# 富荣富祥纯债债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2018年08月29日

## §1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富荣富祥纯债 |
| 基金主代码 | 003999 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年03月09日 |
| 基金管理人 | 富荣基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 118,003,913.51份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在一定程度上控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,通过定量分析增强组合策略操作的方法,确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果,利用自主开发的信用分析系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括:期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数(总财富)收益率*90%+1年期定期存款利率(税后)*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低预期风险/预期收益的产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 富荣基金管理有限公司 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 滕大江 | 石立平 |
| | 联系电话 | 0755-84356633 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | service@furamc.com.cn | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-685-5600 | 95595 |
| 传真 | | 0755-83230787 | 010-63639132 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.furamc.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年01月01日-2018年06月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 2,454,325.65 |
| 本期利润 | 5,388,631.96 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0355 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.81% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年06月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0170 |
| 期末基金资产净值 | 120,010,973.90 |
| 期末基金份额净值 | 1.0170 |

注:①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

③期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

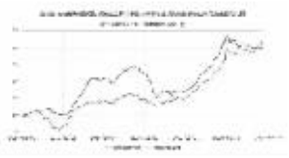
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.09% | 0.03% | 0.57% | 0.05% | -0.66% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.55% | 0.09% | 1.79% | 0.09% | -1.24% | 0.00% |
| 过去六个月 | 2.81% | 0.08% | 3.55% | 0.07% | -0.74% | 0.01% |
| 过去一年 | 2.95% | 0.07% | 3.97% | 0.06% | -1.02% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.04% | 0.07% | 4.44% | 0.06% | -0.40% | 0.01% |

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日,是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区,办公地位于深圳市福田区深圳证券交易所广场,注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于"综合金融服务商",围绕客户需求,贯彻投资人利益优先原则,秉持"规范创造价值,创新推动成长"的经营理念,努力打造企业核心竞争力,整合产业上下游资源,为各类投资者提供充分满足个性需求的产品,并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任,与投资者共同分享中国经济发展的成果,致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吕晓蓉 | 基金经理 | 2017-07-07 | - | 6 | 清华大学工商管理硕士,中国人民大学经济学学士,曾任普华永道中天会计师事务所审计师、嘉实基金管理有限公司组合头寸管理、新股、信用债、转债研究员。2017年7月起担任富荣货币市场基金、富荣富祥纯债债券型证券投资基金、富荣富兴纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年2月起担任富荣富乾债券型证券投资基金基金经理。2018年4月起担任富荣富安债券型证券投资基金基金经理。 |

注:1、此处的"任职日期"为基金经理管理本基金起始日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。公司利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析,报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年上半年,一季度债券市场经历了较为明显的收益率下行过程,且信用债与利率债分化不大,源于主要的几个利多因素互相叠加,包括资金面相对宽松、监管政策空窗期、经济基本面预期走弱等;二季度债市则出现了明显的结构分化,经济预期在内忧外患下继续走弱,央行两次定向降准释放积极信号,而从社融数据、债券违约频次看,因严监管导致的紧信用格局延续,因此二季度利率震荡下行,而信用利差扩大。

报告期内基金净值有所波动,在信用利差走阔过程中收益略有下行但票息的安全垫有所积累,目前基金已进一步优化投资标的资质,信用债仓位以中高等级为主。未来,本基金将继续本着稳健投资的原则,灵活把握交易窗口,争取为投资者争取最大化的长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣富祥纯债基金份额净值为1.0170元;本报告期内,基金份额净值增长率为2.81%,同期业绩比较基准收益率为3.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,整体看债市面临的投资环境尚可:外部贸易战风险,内部信用收缩风险对经济构成的压制持续,虽然经济在房地产投资支撑下仍是慢变量,但下行的风险正逐步加大;通胀方面仍然压力不大,食品价格低位,商品价格有一定支撑,关注原油价格震荡向上风险;央行维护流动性"合理充裕"的表态已明确货币政策稳健偏松,不过流动性在当前基础上进一步宽松的空间预计有限;监管政策对信信用环境的修正程度则存在预期差。利率债年初以来的下行幅度已较大,当前十年国债在3.5%-3.6%的关键点位区间,下行的阻力还包括汇率贬值压力下的中美利差低位,贸易战扰动下的经济预期转向风险,配置力量不足等。因此,预计利率债仍将延续二季度的震荡慢牛,但不排除市场超调时的短期上行风险。信用债,在资管新规实施,投资者整体风险偏好上移的过程中,信用分层不可避免。高等级信用债收益率已随利率下行幅度较为明显,中低资质的收益率当前在历史高分位数水平。建议关注中等资质信用债的性价比和投资时机,一旦信用紧缩出现有利的政策补丁,例如地方隐性债务系统治理措施等,中等资质的信用债性价比将显现,可挖掘的个券机会也将更多。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关法律法规和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金本报告期共进行利润分配一次。2018年3月6日(权益登记日)分配利润4,600,058.79元,每10份基金份额分红0.23元。符合本基金合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司在富荣富祥纯债债券型证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对富荣富祥纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人--富荣基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《富荣富祥纯债债券型证券投资基金2018年半年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富荣富祥纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2018年06月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 232,445.25 | 548,431.45 |
| 结算备付金 | 124,173.73 | - |
| 存出保证金 | 9,711.64 | - |
| 交易性金融资产 | 150,031,963.00 | 268,567,000.00 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 150,031,963.00 | 268,567,000.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 400,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 2,578,497.09 | 7,676,837.74 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 153,376,790.71 | 276,792,269.19 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年06月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 32,999,759.50 | 73,874,510.18 |
| 应付证券清算款 | 99,738.38 | 3,442.19 |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 29,586.12 | 51,614.99 |
| 应付托管费 | 9,862.06 | 17,205.00 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 13,077.52 | 13,726.36 |
| 应交税费 | 12,703.08 | - |
| 应付利息 | 21,579.78 | 79,360.55 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 179,510.37 | 362,000.00 |
| 负债合计 | 33,365,816.81 | 74,401,859.27 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 118,003,913.51 | 200,003,657.99 |
| 未分配利润 | 2,007,060.39 | 2,386,751.93 |
| 所有者权益合计 | 120,010,973.90 | 202,390,409.92 |
| 负债和所有者权益总计 | 153,376,790.71 | 276,792,269.19 |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0170元,基金份额总额118,003,913.51份。

6.2 利润表

会计主体:富荣富祥纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 6,815,715.13 | 2,499,891.79 |
| 1.利息收入 | 5,189,937.38 | 2,207,782.31 |
| 其中:存款利息收入 | 115,050.84 | 112,049.37 |
| 债券利息收入 | 5,036,765.08 | 866,728.96 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 38,121.46 | 1,229,003.98 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -1,316,146.92 | 58,225.54 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -1,316,146.92 | 58,225.54 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 2,934,306.31 | 233,883.50 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 7,618.36 | 0.44 |
| 减:二、费用 | 1,427,083.17 | 393,419.90 |
| 1.管理人报酬 | 231,529.92 | 186,211.58 |
| 2.托管费 | 77,176.64 | 62,070.51 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 7,917.84 | 2,557.59 |
| 5.利息支出 | 968,561.27 | 4,097.58 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 968,561.27 | 4,097.58 |
| 6.税金及附加 | 17,737.13 | - |
| 7.其他费用 | 124,160.37 | 138,482.64 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 5,388,631.96 | 2,106,471.89 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 5,388,631.96 | 2,106,471.89 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富荣富祥纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 200,003,657.99 | 2,386,751.93 | 202,390,409.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 5,388,631.96 | 5,388,631.96 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -81,999,744.48 | -1,168,264.71 | -83,168,009.19 |
| 其中:1.基金申购款 | 147,856,996.56 | 2,703,590.89 | 150,560,587.45 |
| 2.基金赎回款 | -229,856,741.04 | -3,871,855.60 | -233,728,596.64 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | -4,600,058.79 | -4,600,058.79 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 118,003,913.51 | 2,007,060.39 | 120,010,973.90 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 200,019,971.80 | - | 200,019,971.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,106,471.89 | 2,106,471.89 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -1,690.44 | -3.17 | -1,693.61 |
| 其中:1.基金申购款 | 17.86 | 0.03 | 17.89 |
| 2.基金赎回款 | -1,708.30 | -3.20 | -1,711.50 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 200,018,281.36 | 2,106,468.72 | 202,124,750.08 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

| 郭容辰 | 黄文飞 | 黄文飞 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 富荣基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 231,529.92 | 186,211.58 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 38.91 | - |

注:支付基金管理人富荣基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 77,176.64 | 62,070.51 |

注:支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | 上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2017年03月09日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 196,111.28 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 196,111.28 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.17% | - |

注:1、申购含转换入份额、红利再投资份额;赎回含转换出份额。

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年01月01日至2018年06月30日 | | 上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年06月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 光大银行 | 232,445.25 | 16,527.86 | 2,106,787.50 | 86,733.97 |

注:本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额26,999,759.50元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 011800030 | 18厦国贸SCP001 | 2018-07-05 | 100.58 | 72,000 | 7,241,760.00 |
| 101556060 | 15越秀融资MTN001 | 2018-07-05 | 99.83 | 72,000 | 7,187,760.00 |
| 101662028 | 16江东控股MTN001 | 2018-07-05 | 95.70 | 70,000 | 6,699,000.00 |
| 011800237 | 18厦国贸SCP003 | 2018-07-05 | 100.53 | 30,000 | 3,015,900.00 |
| 101800580 | 18南坡MTN001 | 2018-07-05 | 99.22 | 30,000 | 2,976,600.00 |
| 011800747 | 18大同煤矿SCP004 | 2018-07-05 | 100.13 | 4,000 | 400,520.00 |
| 合计 | | | | 278,000 | 27,521,540.00 |

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额6,000,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为150,031,963.00 元,无属于第一层次及第三层次的余额(2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为268,567,000.00 元,无属于第一层次及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外,财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3)除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 150,031,963.00 | 97.82 |
| | 其中:债券 | 150,031,963.00 | 97.82 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 400,000.00 | 0.26 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 356,618.98 | 0.23 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,588,208.73 | 1.69 |
| 9 | 合计 | 153,376,790.71 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 6,896,020.00 | 5.75 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 80,553,183.00 | 67.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | 31,581,540.00 | 26.32 |
| 6 | 中期票据 | 31,001,220.00 | 25.83 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 150,031,963.00 | 125.02 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 041760045 | 17路安CP003 | 80,000 | 8,064,000.00 | 6.72 |
| 2 | 1580063 | 15吐鲁番国投债 | 100,000 | 7,962,000.00 | 6.63 |
| 3 | 1580219 | 15高邮债 | 80,000 | 7,917,600.00 | 6.60 |
| 4 | 1580270 | 15湘江建开债 | 80,000 | 7,870,400.00 | 6.56 |
| 5 | 1680173 | 16宜居债 | 80,000 | 7,684,800.00 | 6.40 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期末投资股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 9,711.64 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,578,497.09 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,588,208.73 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无可转换债券投资。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 285 | 414,048.82 | 117,971,742.81 | 99.9727% | 32,170.70 | 0.0273% |

注:①分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 191.65 | 0.0002% |

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0-10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| |