

兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资 基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 17 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| §7 投资组合报告..... | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 42 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 43 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 44 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 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的情况..... | 44 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 46 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 其他重大事件..... | 47 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 48 |

| | |
|--|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| §12 备查文件目录..... | 49 |
| 12.1 备查文件目录..... | 49 |
| 12.2 存放地点..... | 49 |
| 12.3 查阅方式..... | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|---|
| 基金名称 | 兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 兴全祥泰定开债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 005712 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 3 月 16 日 |
| 基金管理人 | 兴全基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,010,001,950.12 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | - |
| 上市日期 | - |

注：本基金不向个人投资者销售。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值 |
| 投资策略 | <p>由于本基金存在开放期与封闭期，在开放期与封闭期将实行不同的投资策略。</p> <p>（一）开放期投资策略</p> <p>在开放期内本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> <p>（二）封闭期投资策略</p> <p>在封闭期内的投资将依托基金管理人自身信用评级体系和信用风险控制措施。采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，实现风险和收益的最佳配比。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 |
| 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，属于较低风险/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 | 兴全基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |

| | | | |
|---------|------|-----------------------------|-----------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨卫东 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-20398888 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006780099, 021-38824536 | 95561 |
| 传真 | | 021-20398858 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区金陵东路368号 | 福州市湖东路154号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼28-30楼 | 上海市银城路167号兴业大厦4楼 |
| 邮政编码 | | 201204 | 200041 |
| 法定代表人 | | 兰荣 | 高建平 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.xqfunds.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 兴全基金管理有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-30楼 |

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 42,164,945.33 |
| 本期利润 | 33,335,037.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0330 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.02% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.07% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 84,322,048.15 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0835 |
| 期末基金资产净值 | 1,119,243,613.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.1082 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.82% |

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第1号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 0.58% | 0.03% | 0.57% | 0.03% | 0.01% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.06% | 0.04% | 0.63% | 0.06% | 0.43% | -0.02% |
| 过去六个月 | 3.07% | 0.05% | 2.07% | 0.06% | 1.00% | -0.01% |
| 过去一年 | 8.64% | 0.06% | 6.46% | 0.06% | 2.18% | 0.00% |
| 自成立以来 | 10.82% | 0.08% | 9.55% | 0.07% | 1.27% | 0.01% |

注：1、本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率，中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数有限公司编制

并发布的首只债券类指数。样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

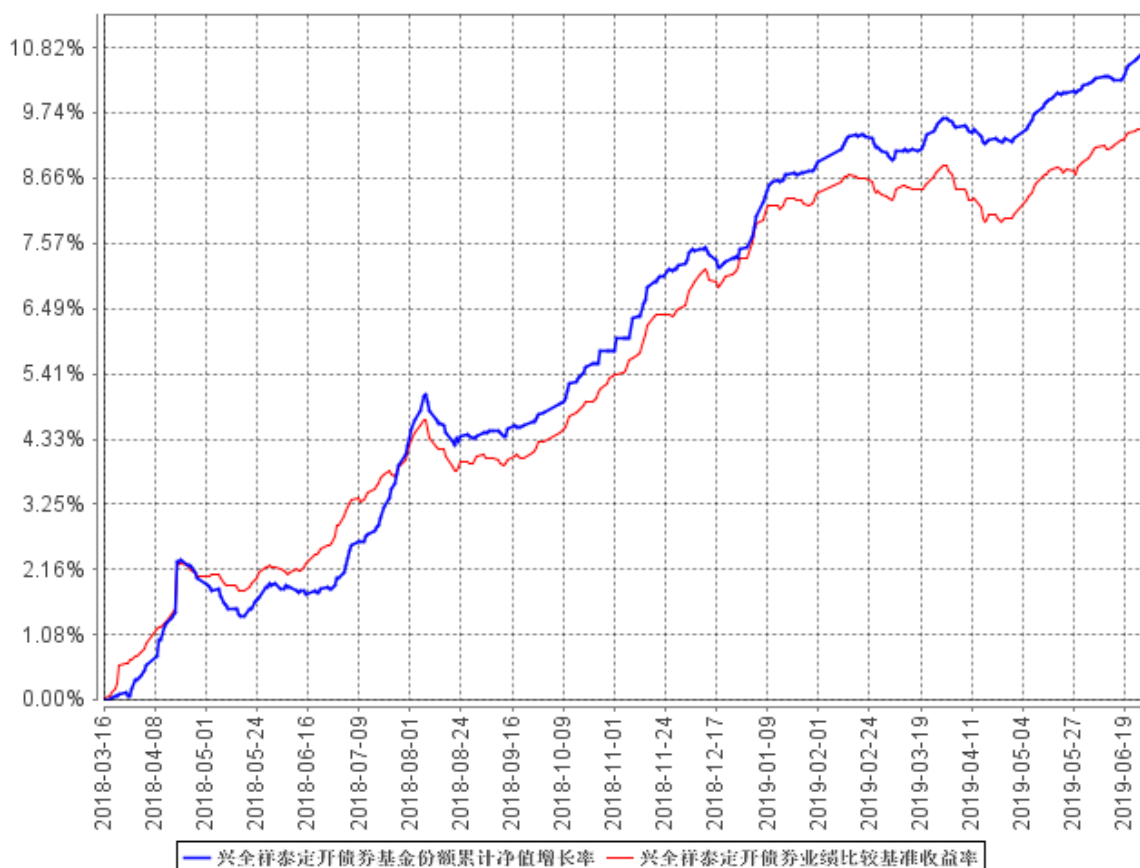
$$\text{Return } t = \text{中证全债指数收益率 } t / \text{中证全债指数收益率 } t-1 - 1$$

$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

兴全祥泰定开债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2019 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 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

兴全基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。

截止2019年6月30日，公司旗下管理着26只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（LOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

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 | | |
| 翟秀华 | 固定收益部总监助理、本基金、 | 2018年3月16日 | - | 9年 | 医学硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴全基金管理 |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|----|--|
| | 兴全添利宝货币基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币基金基金经理 | | | | 有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 王健 | 本基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币基金基金经理 | 2018年8月10日 | - | 5年 | 经济学硕士，历任兴全基金管理有限公司固定收益部研究员、兴全添利宝货币基金基金经理助理、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理、兴全天添益货币基金基金经理助理。 |

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

回顾上半年，全球主要大国经济见顶回调，央行顺势而为，纷纷转向宽松，美联储重启降息预期浓厚。国内方面，在全球经济下行的压力下，叠加中美贸易摩擦，制造业疲弱；基建乏力，地产调控保持定力，整体经济基本面仍然缓慢下行。减税降费成为积极财政政策的抓手，有利于经济向高质量发展转型。在“不大水漫灌”的宏观调控基调下，经济的周期正在钝化，有利于债券投资人获取相对稳定的长期收益。

市场方面，经济弱，政策强，金融数据阶段性反弹主导了利率的变化。一季度宏观政策不断加码信贷投放，多管齐下疏导信用传导机制，平滑了前期严监管的影响。逆周期政策的加码和金融数据的好转使得利率出现了相当幅度的回调。随后出现意外的中美谈判降低了市场的信心，伴随着下滑的全球经济景气和较为宽松的货币环境，利率重新下行，重新回到年内较低位置。在震荡行情下，本组合从进攻性配置结构向平衡型结构转型，着重提升资产的信用资质，控制回撤，为投资人实现了可观的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1082 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.07%，业绩比较基准收益率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在目前的经济状况和宏观调控思路下，经济基本面仍然是缓慢下行的趋势，对债券市场形成

了较强的支撑。央行货币政策保持合理充裕的定力仍然较强。长期看，金融供给侧改革和利率并轨将持续影响整个金融体系。随着同业刚兑的打破，未来流动性分层现象可能会逐渐推升信用利差，使得债券市场向成熟市场更进一步。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

无。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 12,652,984.55 | 3,341,418.80 |
| 结算备付金 | | 5,176,125.50 | 6,062,013.90 |
| 存出保证金 | | 20,493.79 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,635,114,200.00 | 1,519,507,100.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,635,114,200.00 | 1,519,507,100.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 23,705,393.25 | 35,733,589.65 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,676,669,197.09 | 1,564,644,122.35 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 553,999,116.40 | 477,499,472.25 |
| 应付证券清算款 | | 2,500,687.67 | 21,558.09 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 274,958.03 | 276,283.05 |
| 应付托管费 | | 91,652.69 | 92,094.34 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 14,627.33 | 10,737.60 |
| 应交税费 | | 186,059.10 | 163,049.67 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息 | | 280,115.12 | 547,351.02 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 78,367.09 | 125,000.00 |
| 负债合计 | | 557,425,583.43 | 478,735,546.02 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,010,001,950.12 | 1,010,001,950.12 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 109,241,663.54 | 75,906,626.21 |
| 所有者权益合计 | | 1,119,243,613.66 | 1,085,908,576.33 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,676,669,197.09 | 1,564,644,122.35 |

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1082 元，基金份额总额 1,010,001,950.12 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 3 月 16 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 41,073,173.89 | 24,051,846.52 |
| 1.利息收入 | | 36,601,619.44 | 17,684,717.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 134,789.03 | 339,118.17 |
| 债券利息收入 | | 36,367,285.80 | 16,422,749.17 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 99,544.61 | 922,850.61 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 13,301,462.45 | 2,198,269.56 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 13,301,462.45 | 2,198,269.56 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -8,829,908.00 | 4,168,859.01 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 减：二、费用 | | 7,738,136.56 | 3,705,923.35 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,644,019.81 | 892,385.50 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 548,006.63 | 297,461.81 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 12,971.27 | 6,535.43 |
| 5. 利息支出 | | 5,331,072.85 | 2,411,798.52 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 5,331,072.85 | 2,411,798.52 |
| 6. 税金及附加 | | 99,110.59 | 49,765.24 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 102,955.41 | 47,976.85 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 33,335,037.33 | 20,345,923.17 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 33,335,037.33 | 20,345,923.17 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 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） | 1,010,001,950.12 | 75,906,626.21 | 1,085,908,576.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 33,335,037.33 | 33,335,037.33 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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 | 1,010,001,950.12 | 109,241,663.54 | 1,119,243,613.66 |

| 项目 | 上年度可比期间 | | |
|--|---|---------------|------------------|
| | 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 金净值) | | | |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,010,001,950.12 | - | 1,010,001,950.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 20,345,923.17 | 20,345,923.17 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 1,010,001,950.12 | 20,345,923.17 | 1,030,347,873.29 |

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：

_____ 兰荣 _____
_____ 庄园芳 _____
_____ 詹鸿飞 _____
 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 基金基本情况

兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全祥泰定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]231号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 1,010,001,950.12 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00114 号验资报告。基金合同于 2018 年 3 月 16 日正式生效。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 10 个工作日、后 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴

20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | - |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | 12,652,984.55 |
| 合计： | 12,652,984.55 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|------------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 467,519,571.36 | 12,548,628.64 |
| | 银行间市场 | 1,142,675,013.25 | 12,370,986.75 |

| | | | | |
|--------|----|------------------|------------------|---------------|
| | 合计 | 1,610,194,584.61 | 1,635,114,200.00 | 24,919,615.39 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,610,194,584.61 | 1,635,114,200.00 | 24,919,615.39 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,874.23 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 2,096.37 |
| 应收债券利息 | 23,699,414.37 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 8.28 |
| 合计 | 23,705,393.25 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 14,627.33 |
| 合计 | 14,627.33 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 78,367.09 |
| 合计 | 78,367.09 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,010,001,950.12 | 1,010,001,950.12 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,010,001,950.12 | 1,010,001,950.12 |

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 42,157,102.82 | 33,749,523.39 | 75,906,626.21 |
| 本期利润 | 42,164,945.33 | -8,829,908.00 | 33,335,037.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |

| | | | |
|---------|---------------|---------------|----------------|
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 84,322,048.15 | 24,919,615.39 | 109,241,663.54 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 74,422.91 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 60,272.42 |
| 其他 | 93.70 |
| 合计 | 134,789.03 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金不投资于股票。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 13,301,462.45 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 13,301,462.45 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,511,418,978.02 |

| | |
|-------------------------|------------------|
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,466,419,621.31 |
| 减：应收利息总额 | 31,697,894.26 |
| 买卖债券差价收入 | 13,301,462.45 |

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内未获得股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -8,829,908.00 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -8,829,908.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税 | - |
| 合计 | -8,829,908.00 |

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 208.77 |
| 银行间市场交易费用 | 12,762.50 |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 12,971.27 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 53,571.90 |
| 账户维护费用 | 18,600.00 |
| 银行手续费 | 5,988.32 |
| 合计 | 102,955.41 |

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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 |
|------------------------|---------------------|
| 兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”） | 基金管理人，注册登记机构，基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”） | 基金托管人 |
| 兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”） | 基金管理人的股东 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金不投资于股票。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年3月16日(基金合同生效日)至 2018年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 204,014,791.23 | 100.00% | 565,573,437.10 | 100.00% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年3月16日(基金合同生效日)至 2018年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------------|---|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 8,127,500,000.00 | 100.00% | 8,848,500,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金不投资于权证。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月 30日 | 上年度可比期间 2018年3月16日(基金合同生效日) 至2018年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,644,019.81 | 892,385.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.30%/当年天数。

2、本基金基金合同于 2018 年 3 月 16 日生效。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年3月16日(基金合同生效 日)至2018年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 548,006.63 | 297,461.81 |

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数。

2、本基金基金合同于 2018 年 3 月 16 日生效。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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 | 上年度可比期间 |
|-------------------------------------|---------------------------------|---|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日 (2018 年 3 月 16 日) 持有的基金份额 | 1, 002, 450. 12 | 1, 002, 450. 12 |
| 期初持有的基金份额 | 1, 002, 450. 12 | 1, 002, 450. 12 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减: 期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 1, 002, 450. 12 | 1, 002, 450. 12 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0. 9903% | 0. 9903% |

注: 1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定, 符合公允性要求。

3、本基金合同于 2018 年 3 月 16 日生效。

6.4.10.4.2 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

份额单位: 份

| 关联方名称 | 本期末 | | 上年度末 | |
|-------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
| | 2019 年 6 月 30 日 | | 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 兴业银行 | 999, 999, 500. 00 | 99. 0097% | 999, 999, 500. 00 | 99. 0097% |

注: 关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定, 符合公允性要求。

6.4.10.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|-------------|---|--------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 2018 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行 | 12, 652, 984. 55 | 74, 422. 91 | 5, 521, 329. 55 | 296, 986. 39 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金不投资于股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金不投资于股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 170206 | 17 国开 06 | 2019 年 7 月 1 日 | 101.99 | 700,000 | 71,393,000.00 |
| 190401 | 19 农发 01 | 2019 年 7 月 1 日 | 99.29 | 100,000 | 9,929,000.00 |
| 101473006 | 14 渝涪陵 MTN001 | 2019 年 7 月 2 日 | 101.26 | 670,000 | 67,844,200.00 |
| 111909047 | 19 浦发银行 CD047 | 2019 年 7 月 3 日 | 97.25 | 400,000 | 38,900,000.00 |
| 111915032 | 19 民生银行 CD032 | 2019 年 7 月 3 日 | 97.33 | 1,000,000 | 97,330,000.00 |
| 合计 | | | | 2,870,000 | 285,396,200.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，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 285,000,000.00 元，分别于 2019 年 7 月 1 日和 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面，风险管理部和监察稽核部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，为业务部门的风险管理系统的发展提供协助；各业务部门是风险管理的第一线，风险管理时业务部门的最首要责任。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部、相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | 50,345,000.00 | 161,683,000.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 220,932,000.00 | 60,468,000.00 |
| 合计 | 271,277,000.00 | 222,151,000.00 |

注：此处的债券不包括国债、央票与政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 699,424,200.00 | 742,483,100.00 |
| AAA 以下 | 260,089,000.00 | 355,289,000.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 959,513,200.00 | 1,097,772,100.00 |

注：此处的债券不包括国债、央票与政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 243,225,000.00 | 68,397,000.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 243,225,000.00 | 68,397,000.00 |

注：此处为主体信用评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有人的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为发起式定期开放式基金，不向个人投资者销售，符合条件的其他投资者可在合同规定的定期开放日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专

项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 50%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 201 9 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---------------|--------|----------|-------|-------|-----|---------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 银 行 | 12,652,984.55 | - | - | - | - | - | 12,652,984.55 |

| | | | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 存款 | | | | | | | |
| 结算备付金 | 5,176,125.50 | - | - | - | - | - | 5,176,125.50 |
| 存出保证金 | 20,493.79 | - | - | - | - | - | 20,493.79 |
| 交易性金融资产 | 100,305,000.00 | 120,546,000.00 | 561,370,000.00 | 688,521,900.00 | 164,371,300.00 | - | 1,635,114,200.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | -23,705,393.25 | 23,705,393.25 |
| 资产总计 | 118,154,603.84 | 120,546,000.00 | 561,370,000.00 | 688,521,900.00 | 164,371,300.00 | 23,705,393.25 | 1,676,669,197.09 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 553,999,116.40 | - | - | - | - | - | 553,999,116.40 |
| 应付证券清算 | - | - | - | - | - | -2,500,687.67 | 2,500,687.67 |

| | | | | | | | |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 款 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 274,958.03 | 274,958.03 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 91,652.69 | 91,652.69 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 14,627.33 | 14,627.33 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 280,115.12 | 280,115.12 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 186,059.10 | 186,059.10 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 78,367.09 | 78,367.09 |
| 负债总计 | 553,999,116.40 | - | - | - | - | 3,426,467.03 | 557,425,583.43 |
| 利率敏感度缺口 | -435,844,512.56 | 120,546,000.00 | 561,370,000.00 | 688,521,900.00 | 164,371,300.00 | 20,278,926.22 | 1,119,243,613.66 |
| 上年 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | | | |
|---------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 度末 2018年 12月 31日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 3,341,418.80 | - | - | - | - | - | 3,341,418.80 |
| 结算备付金 | 6,062,013.90 | - | - | - | - | - | 6,062,013.90 |
| 交易性金融资产 | | -211,397,000.00 | 381,946,000.00 | 822,481,400.00 | 103,682,700.00 | - | 1,519,507,100.00 |
| 应收利息 | | | | | | -35,733,589.65 | 35,733,589.65 |
| 其他资产 | | | | | | | |
| 资产总计 | 9,403,432.70 | 211,397,000.00 | 381,946,000.00 | 822,481,400.00 | 103,682,700.00 | 35,733,589.65 | 1,564,644,122.35 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购 | 477,499,472.25 | - | - | - | - | - | 477,499,472.25 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|---|---------------|----------------|
| 金融资产款 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 21,558.09 | 21,558.09 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 276,283.05 | 276,283.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 92,094.34 | 92,094.34 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 10,737.60 | 10,737.60 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 547,351.02 | 547,351.02 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 163,049.67 | 163,049.67 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 125,000.00 | 125,000.00 |
| 负债 | 477,499,472.25 | - | - | - | - | -1,236,073.77 | 478,735,546.02 |

| | | | | | | | |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 总计 | | | | | | | |
| 利率敏感度缺口 | -468,096,039.55 | 211,397,000.00 | 381,946,000.00 | 822,481,400.00 | 103,682,700.00 | 34,497,515.88 | 1,085,908,576.33 |

注：本基金合同于 2018 年 3 月 16 日生效。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动； | | |
| | 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2019 年 6 月 30 日） | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| | 利率+1% | -29,784,022.32 | -32,811,434.68 |
| | 利率-1% | 31,135,595.88 | 34,320,298.25 |

6.4.13.4.2 外汇风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
|----|------------------------|-----|--------------------------|------|
| | 公允价值 | 占基金 | 公允价值 | 占基金资 |
| | | | | |

| | | 资产净 值比例 (%) | | 产净值比 例 (%) |
|---------------|------------------|-------------------|------------------|---------------|
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 1,635,114,200.00 | 146.09 | 1,519,507,100.00 | 139.93 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,635,114,200.00 | 146.09 | 1,519,507,100.00 | 139.93 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于本报告期末未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行市场价格风险的敏感性分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§ 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 | 1,635,114,200.00 | 97.52 |
| | 其中：债券 | 1,635,114,200.00 | 97.52 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 17,829,110.05 | 1.06 |
| 8 | 其他各项资产 | 23,725,887.04 | 1.42 |
| 9 | 合计 | 1,676,669,197.09 | 100.00 |

7.2 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

本基金不投资于股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不投资于股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金不投资于股票。

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

本基金不投资于股票。

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

本基金不投资于股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不投资于股票。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 161,099,000.00 | 14.39 |
| | 其中：政策性金融债 | 161,099,000.00 | 14.39 |
| 4 | 企业债券 | 570,131,200.00 | 50.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | 271,277,000.00 | 24.24 |
| 6 | 中期票据 | 389,382,000.00 | 34.79 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 243,225,000.00 | 21.73 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,635,114,200.00 | 146.09 |

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 | 111915032 | 19 民生银行 CD032 | 1,000,000 | 97,330,000.00 | 8.70 |
| 2 | 111907016 | 19 招商银行 CD016 | 1,000,000 | 97,270,000.00 | 8.69 |
| 3 | 101473006 | 14 渝涪陵 MTN001 | 900,000 | 91,134,000.00 | 8.14 |
| 4 | 143530 | 18 陕投 03 | 790,000 | 82,009,900.00 | 7.33 |
| 5 | 1880037 | 18 粤海专项债 01 | 700,000 | 73,759,000.00 | 6.59 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

本基金不投资于权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金不投资于股票。

7.11.3 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 | 20,493.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 23,705,393.25 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,725,887.04 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金不投资于可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

7.11.6 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 |
| 2 | 505,000,975.06 | 1,010,001,950.12 | 100.00% | - | - |

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 | 0.00 | 0.0000% |

本基金不向个人投资者销售。

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的情况

| 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

本基金不向个人投资者销售。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,002,450.12 | 0.99 | 10,002,450.12 | 0.99 | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,002,450.12 | 0.99 | 10,002,450.12 | 0.99 | - |

本基金为发起式基金，在基金募集时，发起资金提供方认购本基金的金额不低于 1000 万元，且持有期限不少于 3 年；发起资金提供方认购的基金份额持有期限满三年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018年3月16日）基金份额总额 | 1,010,001,950.12 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,010,001,950.12 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,010,001,950.12 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

2019 年 4 月 12 日公告，自 2019 年 4 月 12 日起詹鸿飞先生任公司副总经理暨首席信息官，严长胜先生任公司副总经理。

(2) 报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 204,014,791.23 | 100.00% | 8,127,500,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------|-----------------|
| 1 | 旗下各基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 1 月 1 日 |
| 2 | 关于长期停牌股票（长春高新）估值方法调整的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 2 月 27 日 |
| 3 | 关于长期停牌股票（格力电器）估值方法调整的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 3 日 |
| 4 | 关于增聘副总经理的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 12 日 |
| 5 | 关于长期停牌股票（隆基股份）估值方法调整的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 13 日 |
| 6 | 兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金开放期安排的公告（2019 年第 1 次） | 证券时报及公司网站 | 2019 年 4 月 22 日 |
| 7 | 关于调整网上直销部分基金转换/赎回转购优惠费率的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 6 月 27 日 |
| 8 | 关于旗下基金所持证券（中科曙光）调整估值价的公告 | 证券时报及公司网站 | 2019 年 6 月 27 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-----------------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日 | 999,999,500.00 | 0.00 | 0.00 | 999,999,500.00 | 99.01% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 单一机构的集中大额赎回导致的流动性风险。考虑到单一机构占比大，集中赎回可能影响其他投资者的收益，制定投资策略时，管理人考虑到单一客户占比问题，因此组合久期较短，资产流动性较高，同时关注申赎动向，以便及时调整投资策略。 | | | | | | | |

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴全基金管理有限公司

2019年8月24日