

兴业定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017年03月31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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业定开债券	
基金主代码	000546	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年03月13日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,448,903,350.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业定开债券A	兴业定开债券C
下属分级基金的交易代码	000546	002507
报告期末下属分级基金的份 额总额	8,447,894,032.58份	1,009,317.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过对影响市场各类要素的分析以及投资组合的积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	朱玮	陆志俊
	联系电话	021-22211888	95559
	电子邮箱	renjb@cib-fund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40000-95561	95559
传真		021-22211997	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	兴业定开债券A		
	2016年	2015年	2014年03月 13日-2014年 12月31日
本期已实现收益	267,636,114.04	286,520,805.70	181,074,414.46
本期利润	174,227,608.55	233,023,312.49	330,278,092.55
加权平均基金份额本期利润	0.0250	0.1082	0.1020
本期基金份额净值增长率	3.38%	10.45%	10.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0986	0.1208	0.0559
期末基金资产净值	9,360,843,318.73	2,180,818,237.98	3,567,370,098.09
期末基金份额净值	1.108	1.141	1.102

3.1.4 期间数据和指标	兴业定开债券C		
	2016年	2015年	2014年03月 13日-2014年

			12月31日
本期已实现收益	23,663.44	—	—
本期利润	12,194.41	—	—
加权平均基金份额本期利润	0.0123	—	—
本期基金份额净值增长率	1.19%	—	—
3.1.5 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0953	—	—
期末基金资产净值	1,115,094.41	—	—
期末基金份额净值	1.105	—	—

注：1、所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，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、期末可供分配利润采用期末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（为期末余额，不是当期发生数）。

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 (兴业定开债券A)	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
过去三个月	-0.81%	0.08%	-2.32%	0.15%	1.51%	-0.07%
过去六个月	0.82%	0.07%	-1.42%	0.11%	2.24%	-0.04%
过去一年	3.38%	0.06%	-1.63%	0.09%	5.01%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	25.83%	0.10%	7.29%	0.10%	18.54%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

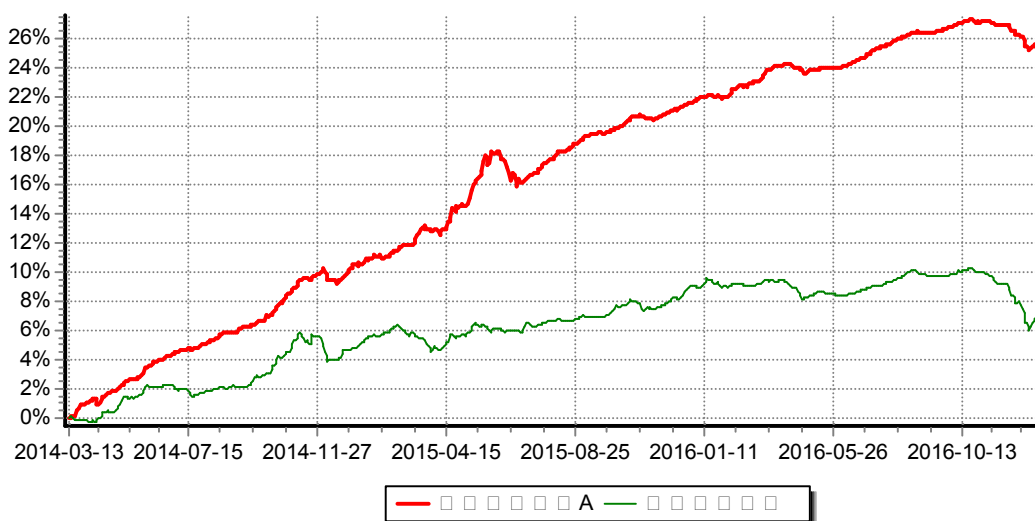
阶段 (兴业定开债券C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
-----------------	----------	-------------	------------	------------	-----	-----

		差②	③	标准差 ④		
过去三个月	-0.90%	0.08%	-2.32%	0.15%	1.42%	-0.07%
过去六个月	0.64%	0.07%	-1.42%	0.11%	2.06%	-0.04%
自基金合同生效日起 至今	1.19%	0.06%	-1.95%	0.10%	3.14%	-0.04%

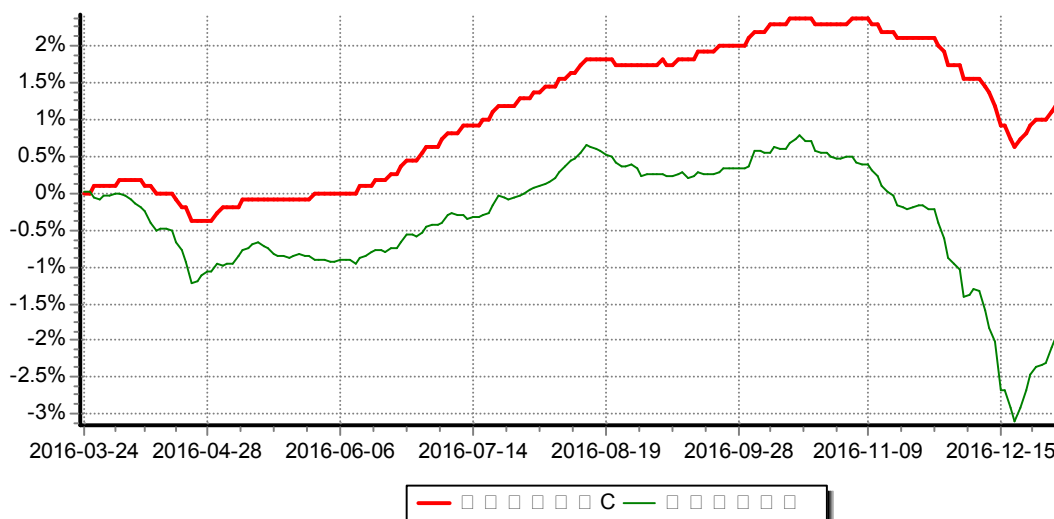
注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

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

兴业定开债券A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



兴业定开债券C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：本基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定自2016年3月23日起增加C类基金份额。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业定开债券A基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

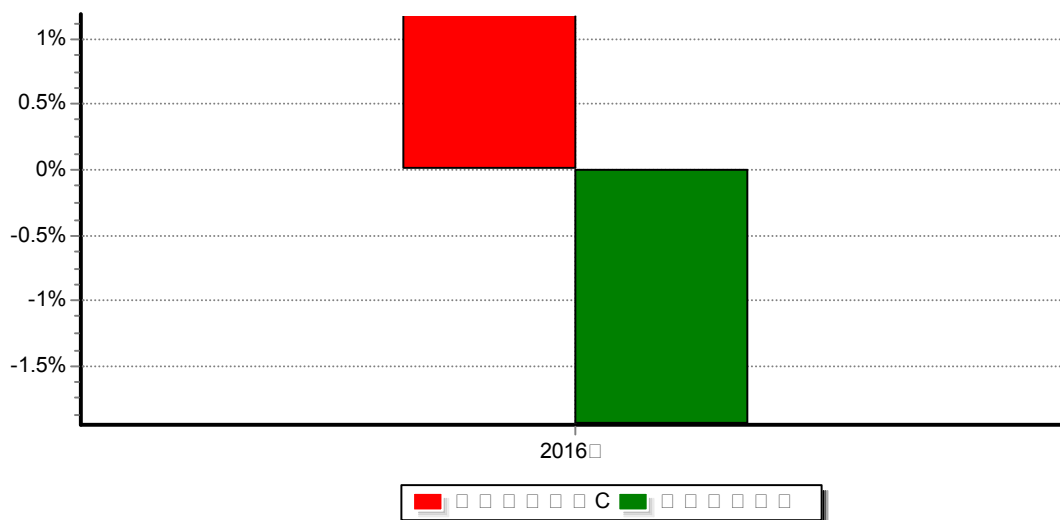
图



注：本基金基金合同于2014年3月13日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

兴业定开债券C基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

图



注：本基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定自2016年3月23日起增加C类基金份额；C类份额增加当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (兴业定 开债券 A)	每10份基金份 额分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分配 合计	备注
2016年	0.700	116,475,997 .90	17,270,941. 61	133,746,939.51	
2015年	0.700	217,794,646 .04	8,801,817.2 3	226,596,463.27	
2014年	—	—	—	—	
合计	1.400	334,270,643 .94	26,072,758. 84	360,343,402.78	
年度 (兴业定 开债券 C)	每10份基金份 额分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分配 合计	备注
2016年	—	—	—	—	
2015年	—	—	—	—	
2014年	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	

§ 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

2013年3月，兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立，公司注册资本7亿元人民币，注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2016年12月31日，兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年

理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金。

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		
周鸣	本基金的基金经理	2014年03月13日	—	15	中国籍，工商管理硕士，具有证券投资基金从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司从事基金投资、企业年金投资等。2009年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信收益宝货币基金基金经理，2009年6月至2013年7月担任申万菱信添益宝债券基金基金经理，2011年12月至2013年7月担任申万菱信可转债债券基金基金经理。2013年8月加入兴业基金

					管理有限公司，现任兴业基金管理有限公司固定收益投资总监、基金经理。
腊博	本基金的基金经理	2015年07月24日	—	12	<p>中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。</p> <p>2003年7月至2006年4月，在新西兰ANYING国际金融有限公司担任货币策略师；2007年1月至2008年5月，在新西兰FORSIGHT金融研究有限公司担任策略分析师；2008年5月至2010年8月，在长城证券有限责任公司担任策略研究员；2010年8月至2014年12月就职于中欧基金管理有限公司，其中2010年8月至2012年1月担任宏观、策略研究员，2012年1月至2013年8月担任中欧新趋势股票型证券投资基金、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金的基金经理助理，2013年8月至2014年12月担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>2014年12月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。</p>

张雪	本基金的基金经理助理	2016年06月01日	2016年11月30日	7	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年7月至2012年4月在瑞银证券有限责任公司担任股票资本市场部副董事；2012年4月至2014年4月，在万家基金管理有限公司担任固定收益部研究员。2014年4月加入兴业基金管理有限公司，2016年6月1日至2016年11月30日担任基金经理助理。
----	------------	-------------	-------------	---	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

4.3.2 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基于对供需基本面、债券绝对收益率水平、信用利差状况等多方面综合考虑，对债券资产进行了减仓和降低久期的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金A类份额净值增长率为3.38%，同期业绩比较基准收益率为-1.63%；本基金C类份额净值增长率为1.19%，同期业绩比较基准收益率为-1.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济受到大宗商品价格上涨的影响有所企稳，未来驱动经济的主要动力可能来自于库存、制造业投资、和基建投资，货币政策整体保持中性，短期看不到宽松的迹象。我们基于对经济和流动性的判断，在10月份对债券持仓进行了减仓和降久期的操作，债券市场经历了前期的调整，各项利差水平已经有所恢复，但整体仍处于偏低的水平。综合对未来经济政策的展望、以及当前的收益率水平，短期债券操作仍较为谨慎，但随着经济回升的动能减弱，将逐渐增加债券的配置。我们也会根据基本面环境和市场环境的变化，主动调整组合的久期和结构，尽量规避不必要的利率风险和信用风险，争取为基金持有人获得稳定的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任；委员若干名，由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨

论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。

本基金本报告期内已实施利润分配1次，共分配利润133,746,939.51元,符合本基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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，本基金不存在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

2016年度，基金托管人在兴业定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016年度，兴业基金管理有限公司在兴业定期开放债券型证券投资基金投资运作、

基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配，分配金额为133,746,939.51元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016年度，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴业定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	576,474,890.46	14,080,505.57
结算备付金	4,209,066.42	22,506,962.33
存出保证金	15,944.77	74,340.49
交易性金融资产	8,129,876,669.00	2,373,105,473.58
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	8,122,876,669.00	2,347,105,473.58
资产支持证券投资	7,000,000.00	26,000,000.00
贵金属投资	—	—

衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	428,000,892.00	—
应收证券清算款	70,047,222.23	570,000,000.00
应收利息	174,609,021.36	62,968,753.60
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	9,383,233,706.24	3,042,736,035.57
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	—	860,000,000.00
应付证券清算款	13,914,975.30	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	5,553,521.70	1,291,169.31
应付托管费	1,586,720.49	368,905.52
应付销售服务费	378.03	—
应付交易费用	20,697.58	2,435.00
应交税费	—	—
应付利息	—	46,287.76
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	199,000.00	209,000.00
负债合计	21,275,293.10	861,917,797.59
所有者权益：		
实收基金	8,448,903,350.08	1,910,670,454.45
未分配利润	913,055,063.06	270,147,783.53

所有者权益合计	9,361,958,413.14	2,180,818,237.98
负债和所有者权益总计	9,383,233,706.24	3,042,736,035.57

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额总额8,448,903,350.08份，其中下属A类基金份额净值1.108元，基金份额总额8,447,894,032.58份；下属C类基金份额净值1.105元，基金份额总额1,009,317.50份。

2、自2016年3月23日起，本基金分设两级基金份额：A级基金份额和C级基金份额。详情参阅相关公告。

7.2 利润表

会计主体：兴业定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间2015年01月01日 至2015年12月31日
一、收入	246,597,204.17	296,994,023.91
1.利息收入	311,580,640.66	227,951,713.21
其中：存款利息收入	4,508,107.88	18,824,395.36
债券利息收入	290,457,996.48	203,760,000.85
资产支持证券利息收入	995,461.37	4,879,743.20
买入返售金融资产收入	15,619,074.93	487,573.80
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	28,336,134.97	122,441,156.05
其中：股票投资收益	—	1,166,236.42
基金投资收益	—	—
债券投资收益	28,336,134.97	118,462,492.16
资产支持证券投资	—	2,812,427.47
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）	-93,419,974.52	-53,497,493.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	100,403.06	98,647.86
减：二、费用	72,357,401.21	63,970,711.42
1. 管理人报酬	53,480,225.22	16,794,520.10
2. 托管费	15,280,064.39	4,798,434.36
3. 销售服务费	3,378.47	—
4. 交易费用	103,652.50	105,645.20
5. 利息支出	3,243,148.13	42,013,056.76
其中：卖出回购金融资产支出	3,243,148.13	42,013,056.76
6. 其他费用	246,932.50	259,055.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	174,239,802.96	233,023,312.49
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	174,239,802.96	233,023,312.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2016年01月01日至2016年12月31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）	1,910,670,454.45	270,147,783.53	2,180,818,237.98
二、本期经营活动产生的基	—	174,239,802	174,239,802.96

金净值变动数（本期利润）		.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）	6,538,232,895.63	602,414,416.08	7,140,647,311.71
其中：1.基金申购款	7,023,145,823.40	646,973,842.98	7,670,119,666.38
2.基金赎回款	-484,912,927.77	-44,559,426.90	-529,472,354.67
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）	—	133,746,939.51	-133,746,939.51
五、期末所有者权益（基金净值）	8,448,903,350.08	913,055,063.06	9,361,958,413.14
项 目	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31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）	3,237,092,005.54	330,278,092.55	3,567,370,098.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	233,023,312.49	233,023,312.49
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）	-1,326,421,551.09	66,557,158.24	-1,392,978,709.33
其中：1.基金申购款	939,842,934.35	53,372,339.72	993,215,274.07
2.基金赎回款	-2,266,264,485.44	-119,929,497.96	-2,386,193,983.40
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）	—	226,596,463.27	-226,596,463.27
五、期末所有者权益（基金	1,910,670,454.45	270,147,783	2,180,818,237.98

净值)		.53	
-----	--	-----	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

卓新章

黄文锋

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴业定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业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[2014]180号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为3,237,092,005.54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(14)第0214号的验资报告。基金合同于2014年3月13日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据2016年3月19日发布的《关于兴业定期开放债券型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,从2016年3月23日起,本基金增设C类基金份额(以下简称"兴业定开债券C"),原有模式份额为A类基金份额(以下简称"兴业定开债券A")。其中,兴业定开债券A是指在投资人申购基金时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;兴业定开债券C是指从本类别基金资产中计提销售服务费,并不再收取申购费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、中小企业私募债券、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)、货币市场工具及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相关规定。因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产,也不参与一级市场新股的申购或增

发。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内，基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本基金本报告期除费用的确认和计量之外，所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提。

兴业定开债券A不收取销售服务费；兴业定开债券C的销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务，按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《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《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
- 3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	基金托管人、基金销售机构
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人的子公司
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	53,480,225.22	16,794,520.10
其中：支付销售机构的客户维护费	17,814,654.90	6,667,569.05

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,280,064.39	4,798,434.36

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当期天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	兴业定开债券A	兴业定开债券C	合计
兴业基金管理有限公司	—	342.65	342.65
合计	-	342.65	342.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	兴业定开债券A	兴业定开债券C	合计
-	—	—	—
合计	-	-	-

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金份额不收取销售服务费，C类基金按前一日基金资产净值的0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给兴业基金。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%÷当期天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年01月01日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	131,787,122.24	—	—	—	—	—
上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

交通银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2016年01月01日至2016年 12月31日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日	
	兴业定开债 券A	兴业定开债 券C	兴业定开债 券A	兴业定开债 券C
期初持有的基金份额	-	-	29,999,000.0 0	-
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	-	-	29,999,000.0 0	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-	-

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

7.4.8.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5 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 2016年01月01日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份 有限公司	76,474,890.46	678,796.84	14,080,505.57	374,666.49

兴业银行股份 有限公司	300,000,000.00	854,466.71	—	15,807,892.31
----------------	----------------	------------	---	---------------

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金本报告期存放于关联方的协议存款按银行约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
112487	16合力 01	2016 -12- 06	2017- 02-22	认购新 发行债 券	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券市场正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 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)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若。

(b)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2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币37,368,000.00元，属于第二层次的余额为人民币8,092,508,669.00元，无属于第三层次的余额(于2015年12月31日：第二层次为人民币2,373,105,473.58元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(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，本基金分别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或第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	固定收益投资	8,129,876,669.00	86.64
	其中：债券	8,122,876,669.00	86.57
	资产支持证券	7,000,000.00	0.07
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—

5	买入返售金融资产	428,000,892.00	4.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	580,683,956.88	6.19
7	其他各项资产	244,672,188.36	2.61
8	合计	9,383,233,706.24	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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买入股票。

8.4.2 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卖出股票。

8.4.3 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买入、卖出股票。

8.5 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	997,698,000.00	10.66
	其中：政策性金融债	997,698,000.00	10.66
4	企业债券	2,908,043,369.00	31.06
5	企业短期融资券	3,243,986,000.00	34.65

6	中期票据	346,103,000.00	3.70
7	可转债	61,377,300.00	0.66
8	同业存单	565,669,000.00	6.04
9	其他	—	—
10	合计	8,122,876,669.00	86.76

8.6 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	111611266	16平安CD266	3,800,000	370,424,000.00	3.96
2	160303	16进出03	3,500,000	336,910,000.00	3.60
3	160408	16农发08	2,100,000	202,398,000.00	2.16
4	150201	15国开01	2,000,000	200,920,000.00	2.15
5	041663004	16首钢CP002	1,900,000	190,323,000.00	2.03

8.7 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投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123580	宁公交02	100,000.00	5,000,000.00	0.05
2	119111	徐新盛03	20,000.00	2,000,000.00	0.02

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

8.12.2

本基金本报告期没有投资股票。

8.12.3 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	15,944.77
2	应收证券清算款	70,047,222.23
3	应收股利	—
4	应收利息	174,609,021.36
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	244,672,188.36
---	----	----------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110035	白云转债	37,368,000.00	0.40
2	132005	15国资EB	24,009,300.00	0.26

8.12.5 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流通受限股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
兴业定开债券A	42,498	198,783.33	1,550,237,562.55	18.35%	6,897,656,470.03	81.65%
兴业定开债券C	18	56,073.19	—	—	1,009,317.50	100.00%
合计	42,516	198,722.91	1,550,237,562.55	18.35%	6,898,665,787.53	81.65%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴业定开债券A	2,590,758.57	0.030000%
	兴业定开债券C	0.00	0.000000%
	合计	2,590,758.57	0.030000%

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）。

9.3 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	份额级别	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	兴业定开债券A	>100
	兴业定开债券C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业定开债券A	0
	兴业定开债券C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业定开债券A	兴业定开债券C
基金合同生效日(2014年03月13日)基金份额总额	3,237,092,005.54	—
本报告期期初基金份额总额	1,910,670,454.45	—
本报告期基金总申购份额	7,022,127,356.77	1,018,466.63
减：本报告期基金总赎回份额	484,903,778.64	9,149.13
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	8,447,894,032.58	1,009,317.50

注：申购含红利再投、转换及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调增份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

2016年12月，张顺国先生担任兴业基金管理有限公司副总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。本报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为9万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为3年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	—	—	—	—	

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

iv 投研交综合实力较强。

v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本期无新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
兴业证券	1,241,195,023.77	—	14,527,600,000.00	—	—	—

兴业基金管理有限公司
二〇一七年三月三十一日