

兴业丰泰债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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责任。
基金托管人招行银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
基金过往业绩并不代表未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
基金合同自2016年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴业丰泰债券
基金代码	032445
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月25日
报告期末基金资产总额	203,255,883.16份
投资目标	在严控投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
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、证券市场走势等方面的数据和指标,综合运用资产配置策略、久期策略、收益曲线策略、信用债券策略等,力求规避风险并实现基金的净值增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:中债综合全价指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于债券型基金中的中低风险、低预期收益品种。其预期风险及预期收益水平低于货币基金,高于股票基金。
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元						
主要财务指标	报告期(2016年4月1日-2016年6月30日)					
1.本期已实现收益	920,843.11					
2.本期利润	792,967.64					
3.期初至报告期基金净值利润率	0.0340					
4.期末基金资产净值	203,326,757.91					
5.期末基金份额净值	1.005					

§ 3.1 主要财务指标

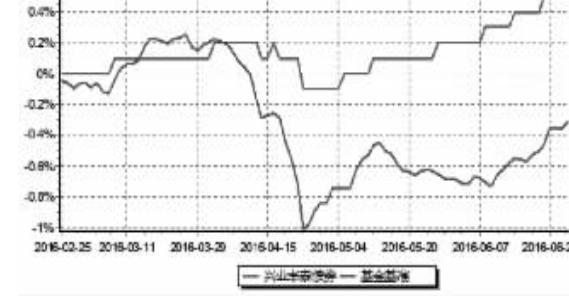
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	—	—
2	其中:活期存款	—	—
3	定期存款	—	—
4	其中:协议存款	197,999,000.00	85.52
5	其中:通知存款	197,999,000.00	85.52
6	买入返售金融资产	—	—
7	其中:质押式回购	—	—
8	其他	—	—
9	合计	231,328,028.89	100.00

§ 3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.00%	-0.52%	0.07%	0.92%	-0.02%

§ 3.2.1 本基金报告期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

兴业丰泰债券型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势图
(2016年2月25日-2016年6月30日)



注:1、本基金基金合同于2016年2月25日生效,截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、根据本基金基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介		
姓名	职务	任本基金基金经理的年限
杨晓君	本基金的基金经理	2016年2月25日
	说明	6

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,“离任日期”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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严控控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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》,完善公平制度和流程,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.4 报告期内本基金的异常交易行为的专项说明

本基金期内,基金管理人未发现有价格操纵、内幕交易、利益输送等异常交易行为。

4.5 报告期内基金的利润分配情况

本基金期内未进行利润分配。

4.6 报告期内基金的收益分配情况

本基金期内未进行收益分配。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年三季度,基数效应或导致通胀回落,去产能下民间投资预计依然疲软,但在政府托底经济保障就业的背景下,下半年基建投资增长维持高位可期,货币方面,流动性周期化、碎片化特征将成常态,预计降息无望,但以对冲外汇占款下滑为主要目

的降准预期仍在。多重因素下,上半年债市的弹簧市格局预计仍将延续,基本面数据扰动或使得利率品种有反弹的动力,但空间依然有限。在内外部环境仍面临不确定性上升的背景下,我们对三季度债市仍持保守谨慎的态度,以稳为纲,在信用事件密集暴露以及后续信用风险仍可能继续发酵的背景下,我们将继续采取较为稳健的操作策略,维持组合在2-3年左右。

4.8 基金合同的业已生效日期

本基金合同于2016年2月25日生效,截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

4.9 报告期内基金的利润分配情况

本基金期内未进行利润分配。

4.10 报告期内基金的未向基金份额持有人分配利润的情况

本基金期内未向基金份额持有人分配利润。

4.11 报告期内基金的未向基金份额持有人支付费用的情况

本基金期内未向基金份额持有人支付费用。

4.12 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.13 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.14 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.15 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.16 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.17 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.18 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.19 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.20 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.21 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.22 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.23 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.24 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.25 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.26 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.27 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.28 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.29 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.30 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.31 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.32 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.33 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.34 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.35 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.36 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.37 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

4.38 报告期内基金的未向基金份额持有人进行分配的情况

本基金期内未向基金份额持有人进行分配。

</