

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一八年七月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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,并对其真实性、准确性或完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码	000408
交易代码	000408
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月10日
报告期末基金资产总额	10,000,969,000.00元

本基金在每个开放周期内开放申购和赎回的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金在长期利率趋势的基础上,结合经济周期、宏观政策方向及资金面分析,进行债券投资的择时操作,选择久期、信用品种、资产利差等进行配置,并根据对利率的判断,适时调整组合的久期和资产配置。

业绩比较基准 中银货币基金的收益率。

本基金属于债券型基金,属于沪深证券交易所上市基金,净值型基金,高货币市场基金。

风险收益特征 本基金的预期风险水平低于股票型基金,净值型基金,高货币市场基金。

基金管理人 中银基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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	2018年4月1日-2018年6月30日
1.本期已实现收益		130,600,714.00
2.本期利润		310,372.03
3.期初至报告期基金利润		0.0169
4.期末基金净值		10,099,066,907.00
5.期末基金份额净值		1.0009

注:1.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。

2.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,计价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 本基金基金净值增长率净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期期间 2018年4月1日至2018年6月30日

份额(净值) 期初净值 期末净值 净值增长百分比(%) 收益类型(%) 收益率(%)

过去6个月 1.00% 0.07% 1.01% 0.10% 0.05% -0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年1月10日至2018年6月30日)

注:截至报告期末,本基金成立未满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金在建仓期内。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金管理人的董事会及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,并对其真实性、准确性或完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期	2018年4月1日-2018年6月30日
1.本期已实现收益		300,675,407.00
2.本期利润		420,264,062.02
3.期初至报告期基金利润		0.0169
4.期末基金净值		10,360,969,140.06
5.期末基金份额净值		1.0104

注:1.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。

2.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,计价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 本基金基金净值增长率净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期期间 2018年4月1日至2018年6月30日

份额(净值) 期初净值 期末净值 净值增长百分比(%) 收益类型(%) 收益率(%)

过去6个月 2.27% 0.10% 1.01% 0.10% 1.20% 0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年3月16日至2018年6月30日)

注:截至报告期末,中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金基金未满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金在建仓期内。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金管理人的董事会及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,并对其真实性、准确性或完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期	2018年4月1日-2018年6月30日
1.本期已实现收益		300,675,407.00
2.本期利润		420,264,062.02
3.期初至报告期基金利润		0.0169
4.期末基金净值		10,360,969,140.06
5.期末基金份额净值		1.0104

注:1.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。

2.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,计价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 本基金基金净值增长率净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期期间 2018年4月1日至2018年6月30日

份额(净值) 期初净值 期末净值 净值增长百分比(%) 收益类型(%) 收益率(%)

过去6个月 2.27% 0.10% 1.01% 0.10% 1.20% 0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年6月21日至2018年6月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金管理人的董事会及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,并对其真实性、准确性或完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,于2018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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标	报告期	2018年4月1日-2018年6月30日
1.本期已实现收益		110,324,717.73
2.本期利润		130,467,774.44
3.期初至报告期基金利润		0.0169
4.期末基金净值		10,126,773,006.44
5.期末基金份额净值		1.0104

注:1.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。

2.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,计价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 本基金基金净值增长率净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期期间 2017年6月21日至2018年6月30日

份额(净值) 期初净值 期末净值 净值增长百分比(%) 收益类型(%) 收益率(%)

过去6个月 2.27% 0.10% 1.01% 0.10% 1.20% -0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

中银丰荣定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年6月21日至2018年6月30日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告