

兴业丰泰债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018年06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:2018年07月19日
§1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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。

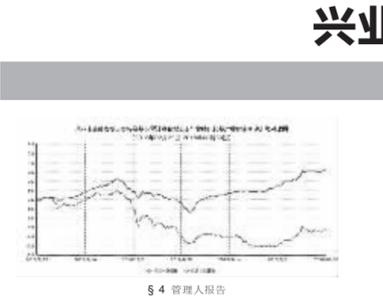


图1:兴业丰泰债券型证券投资基金成立以来净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

下一阶段,本基金将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,长期跟随市场节奏。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金在报告期内债券市场上行情中取得了良好的回报,净值呈现稳健上升态势。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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元的情形。

4.7 报告期内基金的投资组合报告
§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。
5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 单位:份, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额总额

§7 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 4,900,438,812.61

§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额, 持有份额, 份额占比

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
8.2.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.2 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.3 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.5 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.6 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.7 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.8 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.9 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.10 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.11 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.12 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.13 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.14 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.15 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.16 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.17 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.18 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.19 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.20 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.21 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.22 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.23 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.24 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.25 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.26 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.27 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.28 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.29 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.30 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.31 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.32 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.33 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.34 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.35 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.36 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.37 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.38 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.39 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.40 报告期内本基金投资策略和运作分析

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理时间 证券从业资格 说明

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业资格, 说明

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”为根据合同约定确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据合同约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遵规守信情况说明
本报告期内,本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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

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,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金于报告期内严格把握债券的信用风险,执行中长期策略与谨慎杠杆操作,长期维持在2年左右,债券配置维持现有的仓位水平,债券配置以地方政府

债及高流动性利率债为主,地方债仓位在80%以上,利率债配置采用杠杆策略,在部分资产到期后配流动性较好的利率品种,保持组合安全性和流动性的有机结合。本基金在报告期内债券市场上行情中取得了良好的回报,净值呈现稳健上升态势。

下一阶段,本基金将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,长期跟随市场节奏。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金在报告期内债券市场上行情中取得了良好的回报,净值呈现稳健上升态势。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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元的情形。

4.7 报告期内基金的投资组合报告
§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

5.6 报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。
5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

兴业丰利债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

下一阶段,本基金将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,长期跟随市场节奏。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金在报告期内债券市场上行情中取得了良好的回报,净值呈现稳健上升态势。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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元的情形。

4.7 报告期内基金的投资组合报告
§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

5.6 报告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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。

5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。
5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

2.1 基金基本情况
基金名称 兴业丰泰债券型证券投资基金
基金代码 002445
基金运作方式 契约开放式
基金合同生效日 2016年02月25日
报告期末基金份额总额 4,900,438,743.66份

投资目标
本基金通过投资于国债、央行票据、信用债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券等固定收益类金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的投资品种,其预期风险和预期收益低于货币型基金和混合型基金。

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投资品种,其预期风险和预期收益低于货币型基金和混合型基金。

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
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 主要财务指标, 报告期(2018年04月01日-2018年06月30日)

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 本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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率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

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资产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

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:2018年07月19日

§1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺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:2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况
2.1 基金基本情况
基金名称 兴业丰利债券型证券投资基金
基金代码 002880
基金运作方式 契约开放式
基金合同生效日 2017年12月29日
报告期末基金份额总额 2,009,999,000.00份

投资目标
本基金通过投资于国债、央行票据、信用债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券等固定收益类金融工具,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略
本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的投资品种,其预期风险和预期收益低于货币型基金和混合型基金。

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投资品种,其预期风险和预期收益低于货币型基金和混合型基金。

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
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 主要财务指标, 报告期(2018年04月01日-2018年06月30日)

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 本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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率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

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资产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

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:2018年07月19日

兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

下一阶段,本基金将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,长期跟随市场节奏。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
本基金在报告期内债券市场上行情中取得了良好的回报,净值呈现稳健上升态势。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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元的情形。

4.7 报告期内基金的投资组合报告
§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

Table with 2 columns: 单位:份, 报告期末基金份额总额, 报告期末基金份额总额

§7 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 2,009,999,000.00

§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额, 持有份额, 份额占比

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
8.2.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.2 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.3 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.5 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.6 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.7 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.8 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.9 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.10 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.11 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.12 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.13 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.14 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.15 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.16 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.17 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.18 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.19 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.20 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.21 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.22 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.23 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.24 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.25 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.26 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.27 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.28 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.29 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.30 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.31 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.32 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.33 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.34 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.35 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.36 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.37 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.38 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.39 报告期内本基金投资策略和运作分析

8.2.40 报告期内本基金