

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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月19日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员不保证本基金的财产状况,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。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称 兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金

基金代码 003309

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2016年10月27日

报告期末基金份额总额 90,056,352.97份

本基金在定期开放,定期封闭的运作时点,通过积极主动的投资管理,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。

基金管理人承诺诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。

本基金过往业绩不构成未来表现的保证,投资有风险,投资者在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金在定期开放时点,报告期前一日起至6月30日。

本基金在定期开放时点,报告期前一日起至6月30日。

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2018年07月19日

§ 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

报告期(2018年04月01日-2018年06月30日)

1.本期已实现收益 59,141.00 -3,248.44

2.本期利润 92,797.04 1,338.58

3.加权平均基金份额本期利润 0.0012 0.0001

4.期末基金资产净值 82,528,105.18 10,473,694.97

5.期末基金份额净值 1.0355 1.0266

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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.所列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率将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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

兴业启元一年定期开放A净值表现

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-② ②-④

过去三个月 0.12% 0.15% 10.10% -0.89% 0.05%

兴业启元一年定期开放C净值表现

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-② ②-④

过去三个月 0.02% 0.15% 10.10% -0.90% 0.05%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数收益率。

3.2.2 自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

兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

“特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合规性情况说明

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。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,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指引》,完善公平交易制度和流程,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 报告期内本基金未发现存在异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投研策略和运作分析

报告期内,基于对经济基本面、通胀水平、货币政策方向、债券绝对收益率水平、信用利差状况等多方面综合考虑,对各类细分资产的风险和收益半预算情况进行动态调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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引》,完善公平交易制度和流程,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。

4.6 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份额净值低于五分之一的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 3,011,400.00 32.4

其中:政策性金融债 3,011,400.00 32.4

4 企业债券 73,765,000.00 79.32

5 企业融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债(可交换债) 13,654,250.00 14.68

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 90,430,650.00 97.24

5.2 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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000309 三一转债 4,900,300.00 5.28

2 123206 东财转债 2,405,400.00 2.59

3 128204 亨通转债 2,092,200.00 2.25

4 131011 光大转债 1,522,200.00 1.64

5 110038 清洁转债 1,222,500.00 1.31

6 110424 联合转债 525,750.00 0.57

7 126200 乐歌转债 275,350.00 0.30

8 合计 90,430,650.00 97.24

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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110032 三一转债 200,000.00 0.78

2 123213 12晶蓝 80,000.00 0.86

3 136276 16晶蓝01 80,000.00 0.81

4 124718 16光大01 80,000.00 0.82

5 120396 12乐歌转债 150,000.00 0.17

6 126200 乐歌转债 0.00 0.00

7 126200 乐歌转债 0.00 0.00

8 合计 79,853,550.31 97.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 行政债券 - -

3 金融债券 3,011,400.00 32.4

其中:政策性金融债 3,011,400.00 32.4

4 企业债券 73,765,000.00 79.32

5 企业融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债(可交换债) 13,654,250.00 14.68

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 90,430,650.00 97.24

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贵金属投资明细

序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110032 三一转债 0.00 0.00

2 123206 东财转债 0.00 0.00

3 128204 亨通转债 0.00 0.00

4 131011 光大转债 0.00 0.00

5 110038 清洁转债 0.00 0.00

6 110424 联合转债 0.00 0.00

7 126200 乐歌转债 0.00 0.00

8 合计 0.00 0.00

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

序号 资产支持证券代码 资产支持证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120203 12晶蓝 200,000.00 0.78

2 123213 12晶蓝01 80,000.00 0.86

3 136276 16晶蓝01 80,000.00 0.81

4 124718 16光大01 80,000.00 0.82

5 120396 12乐歌转债 150,000.00 0.17

6 126200 乐歌转债 0.00 0.00

7 126200 乐歌转债 0.00 0.00

8 合计 90,430,650.00 97.24

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

序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

2 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

3 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

4 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

5 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

6 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

7 100000 100000.00 0.40 10,000,000.00 0.40

8 1