

兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏明	基金经理	2015-06-18	-	7年	魏明,硕士学历,具有证券从业资格,曾任招商证券研究所研究员和研究员,2015年6月加入兴业基金,曾任兴业基金基金经理助理,2016年6月正式担任兴业基金基金经理,2018年12月31日任兴业基金基金经理,2019年1月1日起任兴业基金基金经理。
魏明	基金经理	2015-06-18	-	10年	魏明,硕士学历,具有证券从业资格,曾任招商证券研究所研究员和研究员,2015年6月加入兴业基金,曾任兴业基金基金经理助理,2016年6月正式担任兴业基金基金经理,2018年12月31日任兴业基金基金经理,2019年1月1日起任兴业基金基金经理。

1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同确定的解聘日期,除前任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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的说明

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导意见》,完善相应制度流程,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

报告期内,基于对经济基本面、通胀水平、货币政策方向、债券对收益率水平、信用利差等多方面综合考虑,对各类别资产的风险收益特征预期变化进行动态调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金份额净值增长率为2.13%,同期业绩比较基准收益率为1.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,且截至本报告期末,本基金合同生效满3年,暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

基金合同生效三年后继续存续的,自基金合同生效满三年后的基金存续期内,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,在履行适当程序后,本基金合同应当终止并进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	3,136,330,512.85	81.81
3	银行存款	-	-
4	买入返售	-	-
5	其他资产	-	-
6	负债	-	-
7	合计	3,136,330,512.85	81.81

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值(%)
1	医药生物	715,003,000.00	24.54
2	食品饮料	694,486,000.00	23.86
3	金融保险	1,565,382,512.85	51.92
4	农林牧渔	221,158,000.00	7.28
5	交通运输	472,487,000.00	15.11
6	公用事业	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,136,330,512.85	81.81

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	600028	中国石化	3,490,400	291,464,000.00	9.30
2	600033	三一重工	1,200,000	121,360,000.00	3.90
3	600000	浦发银行	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	600036	招商银行	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	600018	华能国际	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.4 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	160019	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	160020	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	160021	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	160022	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24

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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	160019	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	160020	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	160021	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	160022	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24

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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	白银	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	铂金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	钯金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24

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	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	白银	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	铂金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	钯金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24

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

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证A	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	权证B	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	权证C	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	权证D	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	权证E	1,000,000	101,300,000.00	3.24

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

序号	品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	沪深300	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	上证50	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	中证500	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	合计	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

序号	品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	合计	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.11 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	应收利息	27,781.12
2	应收股利	-
3	其他应收款	26,561,567.93
4	其他资产	-
5	合计	26,589,349.05

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	715,003,000.00	24.54
2	食品饮料	694,486,000.00	23.86
3	金融保险	1,565,382,512.85	51.92
4	农林牧渔	221,158,000.00	7.28
5	交通运输	472,487,000.00	15.11
6	公用事业	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,136,330,512.85	81.81

5.13 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	715,003,000.00	24.54
2	食品饮料	694,486,000.00	23.86
3	金融保险	1,565,382,512.85	51.92
4	农林牧渔	221,158,000.00	7.28
5	交通运输	472,487,000.00	15.11
6	公用事业	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,136,330,512.85	81.81

5.14 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	600028	中国石化	3,490,400	291,464,000.00	9.30
2	600033	三一重工	1,200,000	121,360,000.00	3.90
3	600000	浦发银行	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	600036	招商银行	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	600018	华能国际	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.15 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	160019	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	160020	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	160021	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	160022	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.16 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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	160019	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	160020	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	160021	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	160022	16兴业债	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.17 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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	白银	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	铂金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	钯金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.18 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	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	白银	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	铂金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	钯金	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.19.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

序号	品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	沪深300	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	上证50	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	中证500	1,000,000	101,300,000.00	3.24
4	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24
5	合计	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

序号	品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	1,000,000	101,300,000.00	3.24
2	其他	1,000,000	101,300,000.00	3.24
3	合计	1,000,000	101,300,000.00	3.24

5.21 其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	应收利息	27,781.12
2	应收股利	-
3	其他应收款	26,561,567.93
4	其他资产	-
5	合计	26,589,349.05

5.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	715,003,000.00	24.54
2	食品饮料	694,486,000.00	23.86
3	金融保险	1,565,382,512.85	51.92
4	农林牧渔	221,158,000.00	7.28
5	交通运输	472,487,000.00	15.11
6	公用事业	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,136,330,512.85	81.81

5.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	715,003,000.00	24.54
2	食品饮料	694,486,000.00	23.86
3	金融保险	1,565,382,512.85	51.92
4	农林牧渔	221,158,000.00	7.28
5	交通运输	472,487,000.00	15.11
6	公用事业	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,136,330,512.85	81.81

5.24 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

		投资交易、投资组合策略及其他资产管理相关的工作。2017年12月加入兴业基金资产管理有限公司,现任基金经理。			
1.对基金的离任基金经理,且“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”					

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

本基金投资范围不包含股指期货。