

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:2019年04月18日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及监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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金的基金经理已阅读并理解了报告书中与本基金相关的财务数据、净值表现、收益风险特征、投资策略和投资组合报告内容，保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金的财务资料未经审计。

《本基金的财务资料见第1部分》。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金代码 | 000441 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年03月21日 |
| 报告期末基金资产总额 | 2,000,000,000.00 |
| 投资目标 | 在严控风险的前提下，通过资产配置，力争在中长期获得超越业绩基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金在综合分析宏观经济、行业景气度、利率水平、信用利差、流动性、资金面、政策面等多方面因素的基础上，通过资产配置，力争在中长期获得超越业绩基准的稳定收益。在严控风险的前提下，通过资产配置，力争在中长期获得超越业绩基准的稳定收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期风险和预期收益低于货币市场基金，低于股票型基金。 |
| 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基金品种，其预期风险和预期收益低于货币市场基金，低于股票型基金。 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | 报告期(2019年01月01日 - 2019年03月31日) |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 36,914,286.40 |
| 2.本期利润 | 37,305,156.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0126 |
| 4.期末净资产净值 | 3,171,442,320.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0671 |

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，计算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 本报告期内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

| 阶段 | 净值增长率 ^① | 净值增长率标准差 ^② | 业绩比较基准收益率 ^③ | 业绩比较基准收益率标准差 ^④ | ①-③ ^⑤ | ②-④ ^⑥ |
|-------|--------------------|-----------------------|------------------------|---------------------------|------------------|------------------|
| 过去三个月 | 1.21% | 0.00% | 0.47% | 0.05% | 0.74% | 0.01% |

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

单位:人民币元

兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

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 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--------------------------|--------------------------|----------|--|
| 徐莹 | 固定收益投资 第二投资总监 基金经理 | 2017-04-02 2017-04-02 | 8 11年 | 中国籍，硕士生，具有证券投资基金从业资格，2008年7月至2012年1月在兴业银行总行资金营运中心工作，2012年1月至今在兴业银行总行资金营运中心工作，期间历任资金营运中心资金部经理、资金营运中心资金部经理兼资金部投资经理、资金营运中心资金部经理兼资金部投资经理，现任基金经理。 |

1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 报告期内基金的利润分配情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金利润分配原则及实施细

则》，完善相关制度和流程，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。

4.5 报告期内基金的税收情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金税收政策》。

4.6 报告期内基金持有人大额赎回的情况

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不足二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

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) | 占基金资产的比例(%) |
|----|--------------|------------------|-------------|
| 1 | 权证投资 | — | — |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 国债现券投资 | 4,384,032,000.00 | 96.71% |
| 4 | 其他债券投资 | 4,384,032,000.00 | 96.71% |
| 5 | 货币市场基金 | — | — |
| 6 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,096,000.00 | 0.20% |
| 8 | 其他资产 | 140,000,702.54 | 3.09% |
| 9 | 合计 | 4,534,018,702.54 | 100.00% |

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

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组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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十名保险及组合类金融投资

本基金本报告期末未持有股票。

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十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.9 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.11 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.12 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保险及组合类金融投资

本基金本报告期末未持有股票。

5.13 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

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债券投资

本基金本报告期末未持有股票。

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资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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贵金属投资

本基金本报告期末未持有股票。

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保险及组合类金融投资

本基金本报告期末未持有股票。

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十名股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.19 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.20 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.21 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.22 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保险及组合类金融投资

本基金本报告期末未持有股票。

5.23 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

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债券投资

本基金本报告期末未持有股票。

5.25 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.26 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.27 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保险及组合类金融投资

本基金本报告期末未持有股票。

5.28 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.29 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.30 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组合