

中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金
(原中银丰润定期开放债券型证券投资基金)

2018年第1季度报告

2018年3月31日

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

报告送出日期：二〇一八年四月二十三日

§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，并对其内容的真实性、准确性和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本基金合同规定，于 2018 年 4 月 20 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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

基金简称	中银丰润定期开放债券
基金主代码	003832
交易代码	003832
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年3月16日
报告期末基金份额总额	18,810,348,869.65份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行债券投资时机的选择和久期、类属配置，实施积极的债券投资组合管理，力争获取超越业绩比较基准的稳定投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数

风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证投资中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

2.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

基金简称	中银丰润定期开放债券
基金主代码	003832
交易代码	003832
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016年12月1日
报告期末基金份额总额	20,000,454,669.19份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行债券投资时机的选择和久期、类属配置，实施积极的债券投资组合管理，力争获取超越业绩比较基准的稳定投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证投资中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

注：自原中银丰润债券型证券投资基金的基金份额结转为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金的基金份额的下一工作日（即 2018 年 3 月 16 日）起（含该日），《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，《中银丰润债券型证券投资基金基金合同》同时失效。原中银丰润债券型证券投资基金报告期为2018年1月1日起至2018

年3月15日，中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金报告期为2018年3月16日至2018年3月31日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2018年3月16日-2018年3月31日)
1.本期已实现收益	36,111,186.07
2.本期利润	129,205,586.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	18,933,631,979.00
5.期末基金份额净值	1.0066

注：原中银丰润定期开放债券型证券投资基金于 2018 年 3 月 16 日转型为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金，中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金报告期为 2018 年 3 月 16 日至 2018 年 3 月 31 日，不足一季。

3.1.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2018年1月1日-2018年3月15日)
1.本期已实现收益	157,354,668.82
2.本期利润	241,379,768.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0121
4.期末基金资产净值	20,148,037,734.07
5.期末基金份额净值	1.0074

注：原中银丰润定期开放债券型证券投资基金于2018年3月16日转型为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金，原中银丰润定期开放债券型证券投资基金报告期为2018年1月01日至2018年3月15日，不足一季。

3.2 基金净值表现

3.2.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

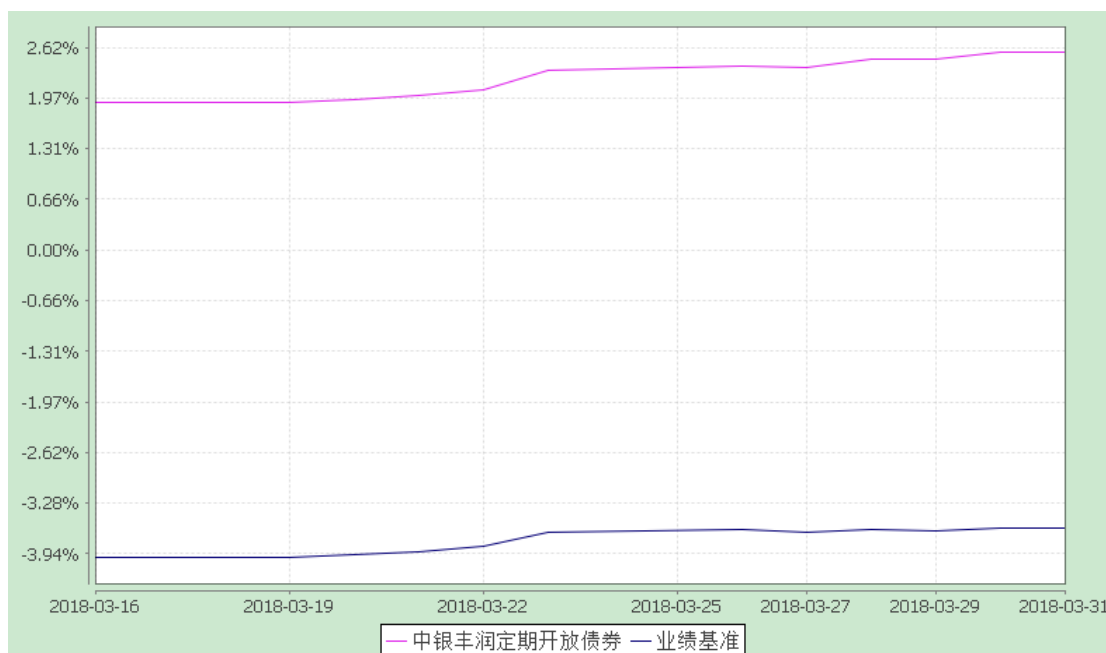
(报告期: 2018年3月16日-2018年3月31日)

3.2.1.1 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

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	②-④
过去三个月	0.66%	0.07%	0.42%	0.06%	0.24%	0.01%

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金
份额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-2018年3月31日)



注: 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金于 2018 年 3 月 16 日由原中银丰润定期开放债券型证券投资基金转型而来, 截至报告期末, 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金转型未满一年。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, 本基金尚在建仓期内。

3.2.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

(报告期: 2018年1月1日-2018年3月15日)

3.2.2.1 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

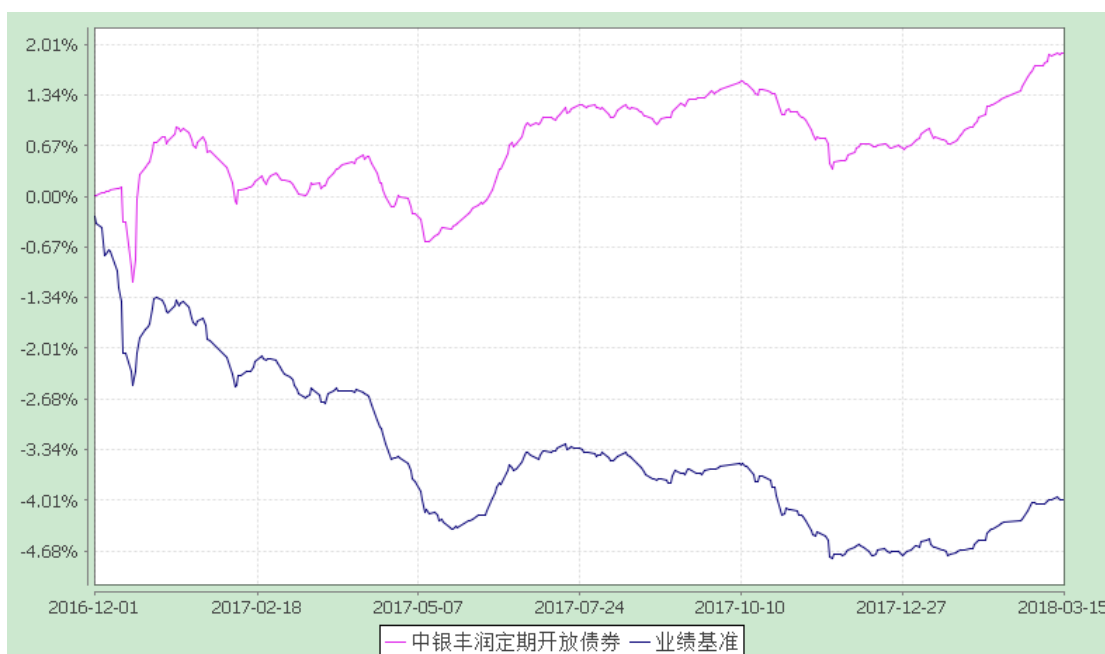
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.22%	0.04%	0.72%	0.04%	0.50%	0.00%

3.2.2.2 自基金合同生效日以来基金份额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

中银丰润定期开放债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2016 年 12 月 1 日-2018 年 3 月 15 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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年	说明
----	----	-------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
易芳菲	本基金的基金经理、中银机构货币基金基金经理、中银如意宝基金基金经理	2016-12-01	-	10	管理学硕士。曾任中信建投证券投资经理、中国农业银行交易员。2015 年加入中银基金管理有限公司，曾任固定收益基金经理助理。2016 年 5 月至今任中银机构货币基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银丰润基金基金经理，2017 年 5 月至今任中银如意宝基金基金经理。具有 10 年证券从业年限。具备基金、证券、银行间本币市场交易员从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；3、2018 年 3 月 16 日，原中银丰润定期开放债券型证券投资基金转型为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金，易芳菲女士继续担任中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95%置信区间，假设

溢价率为 0 的 T 分布检验, 结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明, 本报告期内公司对各投资组合公平对待, 不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未发现异常交易行为。

本报告期内, 基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面, 全球经济继续稳定复苏, 美国表现持续强势, 欧洲势头略有下降。从领先指标来看, 美国经济景气度维持高位, 一季度美国 ISM 制造业 PMI 指数持平于 2017 年底的 59.3, 就业市场整体稳健, 失业率持续 4.1% 低位, 通胀略有回暖。欧元区经济复苏势头略有减慢, 一季度制造业 PMI 指数从 60.6 显著下行至 56.6, 基础通胀依然疲软, 欧元有所走强; 日本经济继续复苏, 一季度制造业 PMI 指数从 54.0 一度冲高至 54.8 后小幅回落至 53.1, 失业率持续低位, 通胀逐步回暖。综合来看, 美国复苏前景仍好, 通胀仍将是美国加息路径的主要影响因素, 而贸易摩擦风险上升后市场情绪回落, 美元指数继续下探至 90 附近; 欧洲复苏速度放缓, 日本经济复苏态势较好。

国内经济方面, 在外需复苏内需稳定背景下, 经济领先指标整体仍是韧性延续, 但下行压力趋于增加。具体来看, 一季度领先指标中采制造业 PMI 震荡下行至 51.5, 同步指标工业增加值 1-2 月同比累计增长 7.2%, 较 2017 年末上行 0.6 个百分点, 但与行业高频数据存在背离, 可能由于统计口径的差异。从经济增长动力来看, 拉动经济的三驾马车中出口短期强势, 消费与投资季节性稳中有升: 2 月美元计价出口增速在春节错位因素作用下较 2017 年末大幅回升至 44.5% 左右, 2 月消费增速较 2017 年末小幅回升至 9.7%, 仍处于较低水平; 制造业和基建投资下降, 房地产投资拉动固定资产投资上升, 1-2 月固定资产投资增速较 2017 年末反弹至 7.9% 的水平。通胀方面, CPI 总体低位徘徊, 2 月受春节因素影响短期同比冲高至 2.9% 的水平, PPI 持续回落, 2 月同比涨幅下降至 3.7%。

2. 市场回顾

整体来看, 一季度债市各类券种出现了不同程度的上涨。其中, 一季度中债总全价指数

上涨 1.21%，中债银行间国债全价指数上涨 1.29%，中债企业债总全价指数上涨 0.41%，在收益率曲线上，一季度收益率曲线经历了由平变陡的变化。其中，一季度 10 年期国债收益率从 3.88%的水平下行 14 个 bp 至 3.74%，10 年期金融债（国开）收益率从 4.82%下行 17 个 BP 至 4.65%。货币市场方面，一季度央行货币政策整体中性，资金面呈现总体宽松的格局。其中一季度银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.68%左右，较上季度均值下降 11bp，银行间 7 天回购利率均值在 3.21%左右，较上季度均值下降 31bp。

3. 运行分析

一季度股票市场出现结构性分化，债券市场整体上涨，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，我们保持合适的久期和杠杆比例，积极参与可转债波段投资机会，优化配置结构，积极增持长久期利率债，适当提高组合杠杆水平，合理分配类属资产比例。

4. 市场展望和投资策略

展望未来，全球经济依然处于复苏阶段，美国经济表现相对较好，欧洲经济势头是否放缓有待观察，中美贸易摩擦仍面临不确定性。国内宏观政策总体保持稳定的同时，更侧重于结构调整，分部门、分债务类型推动“结构性去杠杆”，从而降低地方政府和国有企业杠杆，逐步降低宏观杠杆率水平。财政政策积极的取向不变，但地方融资监管趋严，财政部发文严格规范金融企业对地方政府和国有企业投融资行为，社会融资规模增速稳中有降。

我们对 2018 年二季度债券市场的走势判断保持乐观。经济基本面边际转弱，固定资产投资增速延续下行，其中基建投资可能有较大下行压力。在经济基本面转弱的同时，结构性去杠杆意味着“双支柱”调控框架下政策目标将更侧重“宏观审慎支柱”，货币政策更多的会是回归“松紧适度”的中性操作，把握好稳增长、去杠杆、防风险之间的平衡。二季度，金融监管进入密集落地期，资管新规 3 月获中央全面深化改革委员会通过，最终稿即将正式出台。通胀对债市的压力相对可控，二季度 CPI 从春节高点见顶回落，PPI 同比增速延续回调。中美贸易战背景下，全球市场风险偏好有所降低，美债收益率重新下行。综合上述分析，预计二季度债券收益率中枢可能呈震荡下行走势，我们将积极把握回调后的交易机会。信用债方面，经济下行叠加去杠杆背景下需对违约风险保持关注，操作上在做好组合流动性管理的基础上，保持适度杠杆和久期，合理分配各类资产，审慎精选信用债品种，积极把握投资交易机会。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势，并从自下而上的角度严防信用风险。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年一季度为止, 季度内中银丰润定期开放债券型证券投资基金份额净值增长率为 1.22%, 同期业绩比较基准收益率为 0.72%; 季度内中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金份额净值增长率为 0.66%, 同期业绩比较基准收益率为 0.42%。

4.5 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, 自 2017 年 12 月 18 日至 2018 年 3 月 15 日, 中银丰润定期开放债券型证券投资基金出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自 2018 年 3 月 16 日至本报告期末, 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金无需要说明的相关情况。

§5 投资组合报告

5.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期: 2018年3月16日-2018年3月31日)

5.1.1 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	18,230,183,600.00	96.24
	其中: 债券	18,230,183,600.00	96.24
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	220,050,450.08	1.16
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,112,039.95	0.12
7	其他各项资产	469,429,784.45	2.48
8	合计	18,941,775,874.48	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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。

5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.1.3 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。

5.1.4 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	央行票据	-	-
3	金融债券	12,202,697,000.00	64.45
	其中：政策性金融债	8,923,619,000.00	47.13
4	企业债券	5,491,154,600.00	29.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	536,332,000.00	2.83
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	18,230,183,600.00	96.28

5.1.5 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

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(%)
1	140215	14 国开 15	18,000,000	1,814,220,000.00	9.58
2	1728006	17 中信银行债	13,000,000	1,293,500,000.00	6.83
3	170402	17 农发 02	12,000,000	1,184,640,000.00	6.26
4	140211	14 国开 11	10,500,000	1,100,820,000.00	5.81
5	140423	14 农发 23	10,300,000	1,069,140,000.00	5.65

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.1.11 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.1.11.1

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.2

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	469,429,784.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	469,429,784.45

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年3月15日)

5.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	18,616,200,200.00	92.38
	其中：债券	18,616,200,200.00	92.38
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	300,925,851.39	1.49
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	699,991,548.68	3.47
7	其他各项资产	535,022,939.57	2.65
8	合计	20,152,140,539.64	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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。

5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.2.3 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。

5.2.4 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	央行票据	-	-
3	金融债券	12,134,198,000.00	60.23
	其中：政策性金融债	8,870,168,000.00	44.03
4	企业债券	5,468,734,200.00	27.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	533,968,000.00	2.65
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	479,300,000.00	2.38
8	其他	-	-
9	合计	18,616,200,200.00	92.40

5.2.5 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

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	140215	14 国开 15	18,000,000	1,798,560,000.00	8.93
2	1728006	17 中信银行债	13,000,000	1,288,040,000.00	6.39
3	170402	17 农发 02	12,000,000	1,180,800,000.00	5.86
4	140211	14 国开 11	10,500,000	1,091,370,000.00	5.42
5	140423	14 农发 23	10,300,000	1,061,106,000.00	5.27

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.2.11 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

5.2.11.1

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.2

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	535,022,939.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	535,022,939.57

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

6.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	20,000,454,669.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	9,908,853.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	1,200,014,653.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额	-
本报告期末基金份额总额	18,810,348,869.65

注：中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金自2018年3月16日起生效。

6.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	20,000,454,669.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,000,454,669.19

注：原中银丰润定期开放债券型证券投资基金报告期末为2018年3月15日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.1.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

单位：份

项目	报告期
	(2018年3月16日-2018年3月31日)
基金转型日管理人持有的本基 金份额	-
基金合同生效日起至报告期期 末买入/申购总份额	9,908,838.68
基金合同生效日起至报告期期 末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基 金份额	9,908,838.68
报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例 (%)	0.05

注：中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金自2018年3月16日起生效。

7.1.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

单位：份

项目	报告期
	(2018 年 1 月 1 日-2018 年 3 月 15 日)
报告期期初管理人持有的本基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-

注：本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2018-03-23	9,908,838.68	10,001,000.00	-
合计			9,908,838.68	10,001,000.00	

7.2.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

本报告期内，本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	9,908,838. 68	0.05%	9,908,838 .68	0.05%	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,908,838. 68	0.05%	9,908,838 .68	0.05%	-

9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金

9.1.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-03-16 至 2018-03-31	-	-	1,200,000, 000.00	18,800,399,0 00.00	99.9471%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险;(4)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。							

9.2 中银丰润定期开放债券型证券投资基金

9.2.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-01-01 至 2018-03-15	20,000, 399,00 0.00	-	-	20,000,399,0 00.00	99.9997%

产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险;(4)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。

9.3影响投资者决策的其他重要信息

2018年2月,本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议了《关于中银丰润定期开放债券型证券投资基金转型的议案》,权益登记日为2018年2月5日,投票时间为自2018年2月6日起,至2018年2月28日17:00止。基金管理人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票,上海市通力律师事务所对计票结果进行了见证,上海市东方公证处对计票过程进行了公证。大会出席投票情况达到法定开会条件,表决结果满足法定生效条件,本次会议议案获得通过并生效。根据生效决议,自原中银丰润定期开放债券型证券投资基金的基金份额结转为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金的基金份额的下一工作日起,《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金合同》生效,《中银丰润定期开放债券型证券投资基金合同》同时失效,中银丰润定期开放债券型证券投资基金正式变更为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金,本基金基金合同当事人将按照《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金合同》享有权利并承担义务。具体情况请参考基金管理人于公司网站及指定报刊发布的相关公告。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银丰润定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件;
- 2、《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、《中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》;
- 5、关于申请中银丰润定期开放债券型证券投资基金变更注册为中银丰润定期开放债券型发起式证券投资基金的法律意见书;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

10.2存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

10.3查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇一八年四月二十三日