

兴业年年利定期开放债券型证券投资基金 2017 年第一季度报告

公告日期：2017-04-21

流水号：FB03201704201111

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[自基金合同生效以来基金累计份额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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[报告期内本基金运作遵规守信情况说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易制度和控制方法](#)

[本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[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](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[本基金投资股指期货的投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)

[本期国债期货投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细](#)

[本期国债期货投资评价](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细](#)

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 18 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 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

兴业年年利定开债券

场内简称

-

基金主代码

001019

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2015-02-12

报告期末基金份额总额

906,200,718.85

投资目标

本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，通过积极主动的投资管理，在有效保持资产流

动性和控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略

本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。

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基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人

兴业基金管理有限公司

基金托管人

中国民生银行股份有限公司

基金保证人

-

主要财务指标

单位：人民币元

项目

2017-01-01 至 2017-03-31(元)

本期已实现收益

-36,932,883.79

本期利润

3,724,541.08

加权平均基金份额本期利润

0.0009

期末基金资产净值

937,422,158.38

期末基金份额净值

1.034

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。

基金净值表现

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

-0.39%

0.09%

-1.24%

0.07%

0.8500%

0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

自基金合同生效以来基金累计份额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

其他指标

单位：元

序号

其他指标

报告期（2017-01-01 至 2017-03-31）

序号

其他指标

报告期（2017-03-31）

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

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

丁进

本基金的基金经理

2015-07-06

-

6

中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2005年7月至2008年2月，在北京顺泽投资咨询有限公司担任研究员；2008年3月至2010年10月，在新华信国际信息咨询（北京）有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问；2010年10月至2012年8月，在光大证券研究所担任信用及转债研究员；2012年8月至2015年2月就职于浦银安盛基金管理有限公司，其中2012年8月至2015年2月担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的基金经理助理，2012年9月至2015年2月担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年5月至2015年2月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年6月至2015年2月担任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2015年2月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

注：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。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-0.39%,同期业绩比较基准收益率为-1.24%。

报告期内基金投资策略和运作分析

总体看,债券方面,一季度利率债收益率曲线震荡走高,信用利差小幅走阔。市场信用风险在资金价格水平快速上行下有所上升。

报告期内,基于组合在本次申赎中规模大幅减少,基于对市场中长端收益率曲线陡峭化可能的谨慎判断,维持短久期配置,在进入封闭期后重新构建组合中短久期配置。

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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的情形。

报告期末基金资产组合情况

金额单位:元

序号

项目

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1

权益类投资

-

-

其中:股票

-

-

2

固定收益投资

	1,201,844,729.55
	82.33
其中：债券	
	1,151,089,750.1
	78.86
资产支持证券	
	50,754,979.45
	3.48
	3
贵金属投资	
-	
-	
	4
金融衍生品投资	
-	
-	
	5
买入返售金融资产	
-	
-	
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	
	128,583,003.95
	8.81
	7
其他资产	
	129,305,093.79
	8.86
	8
合计	
	1,459,732,827.29
	100
报告期末按行业分类的股票投资组合	
报告期末按行业分类的境内股票投资组合	
金额单位：元	
序号	
行业类别	
公允价值（元）	
占基金资产净值比例（%）	
A	
农、林、牧、渔业	

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

-

-

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

-

-

G

交通运输、仓储和邮政业

-

-

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

-

-

J

金融业

-

-

K

房地产业

-

-

L

租赁和商务服务业

-

-

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

-

-

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

-

-

R

文化、体育和娱乐业

-

-

S

综合

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

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

金额单位：元

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（%）

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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

191,271,000

20.4

其中：政策性金融债

191,271,000

20.4

4

企业债券

685,662,968.5

73.14

5

企业短期融资券

90,200,000

9.62

6

中期票据

136,804,000

14.59

7

可转债（可交换债）

47,151,781.6

5.03

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

1,151,089,750.1

122.79

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

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

112253

15 荣盛 01

640,000

64,748,800

6.91

2

041654033

16 国创投资 CP001

500,000

50,320,000

5.37

3

170404

17 农发 04

500,000

48,970,000

5.22

4

160207

16 国开 07

500,000

47,695,000

5.09

5

122204

12 双良节

470,000

47,267,900

5.04

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

金额单位：元

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金投资范围不包含股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金投资范围不包含国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（）

占基金资产净值比例（%）

1

123510

14 吉城 04

500,000

50,754,979.45

5.41

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

其他资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

92,197.36

2

应收证券清算款

101,040,201.25

3

应收股利

-

4

应收利息

26,267,095.18

5

应收申购款

-

6

其他应收款

1,905,600

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

129,305,093.79

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：

序号

债券代码

债券名称

公允价值（）

占基金资产净值比例（%）

1

132005

15 国资 EB

21,156,000.00

2.26

2

132002

15 天集 EB

8,275,200.00

0.88

3

110032

三一转债

5,553,000

0.59

4

113008

电气转债

4,575,200

0.49

5

127003

海印转债

936,387

0.1

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

数值

报告期期初基金份额总额

6,391,347,771.51

报告期期间基金总申购份额

577,350,089.73

报告期期间总赎回份额

6,062,497,142.39

报告期期间基金拆分变动份额

-

报告期期末基金份额总额

906,200,718.85

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目

份额总额(份)

报告期期初管理人持有的本基金份额

0.00

报告期期间买入/申购总份额

0.00

报告期期间卖出/赎回总份额

0.00

报告期期末管理人持有的本基金份额

0.00

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

0.00

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号

交易方式

交易日期

交易份额（份）

交易金额（元）

适用费率

合计

-

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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

20170310~20170331

0

480306436.12

0

480306436.12

0.53

产品特有风险

本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- (一) 中国证监会准予兴业年年利定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 400095561