

东兴兴利债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-24

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）起至 2017 年 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

东兴兴利债券型证券投资基金

基金简称

东兴兴利债券

场内简称

基金主代码

003545

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2017-04-14

基金管理人

东兴证券股份有限公司

基金托管人

中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

96,914,635.97

基金合同存续期

不定期

基金产品说明

投资目标

本基金在积极投资、严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略

本基金通过对我国宏观经济指标、国家产业政策、货币政策和财政政策及我国资本市场的运行状况等深入研究,判断我国宏观经济发展趋势、中短期利率走势、债券市场预期风险水平和相对收益率。在严格控制风险的基础上，通过对宏观经济形势、国家货币和财政政策、利率变化趋势、市场流动性和估值水平等因素的综合分析，据此评价未来一段时间债券市场和股票市场的相对投资价值，动态调整债券、股票类资产的配置比例。

业绩比较基准

中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人和基金托管人

项目

基金管理人

基金托管人

名称

东兴证券股份有限公司

中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

陈智勇

林葛

联系电话

010-66551816

010-66060069

电子邮箱

chenzy_jj@dxzq.net.cn

tgxxpl@abchina.com

客户服务电话

95309

95599

传真

010-66551452

010-68121816

注册地址

北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址

北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 12 层

北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码

100007

100031

法定代表人

魏庆华

周慕冰

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

证券时报

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

www.fund.dxzq.net

基金年度报告备置地点

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

其他相关资料

项目

名称

办公地址

注册登记机构

东兴证券股份有限公司

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-04-14 至 2017-06-30)

本期已实现收益

1,560,739.89

本期利润

1,655,315.15

加权平均基金份额本期利润

0.0077

本期加权平均净值利润率

0.77 %

本期基金份额净值增长率

0.91 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

738,609.23

期末可供分配基金份额利润

0.0076

期末基金资产净值

97,795,509.8

期末基金份额净值

1.0091

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

0.91 %

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、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3、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。

4、本基金基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效，至报告期末不满 3 个月。

基金净值表现

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

过去一个月

0.48 %

0.02 %

1.31 %

0.09 %

-0.83 %

-0.07 %

过去三个月

0.91 %

0.01 %

-0.28 %

0.11 %

1.19 %

-0.1 %

自基金合同生效日起至今（2017 年 04 月 14 日-2017 年 06 月 30 日）

0.91 %

0.01 %

-0.28 %

0.11 %

1.19 %

-0.1 %

注：本基金基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效，至报告期末不满 3 个月。

自基金合同生效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

注：本基金基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效，截至报告期末，本基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

东兴证券股份有限公司（股票简称“东兴证券”，股票代码“601198”，以下简称“本公司”）是 2008 年经财政部和中国证监会批准，由中国东方资产管理股份有限公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司，2015 年 2 月 26 日在上海证券交易所上市，是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本 27.58 亿元，总部设在北京。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募集证券投资基金管理业务，形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准（证监许可【2015】67 号）于 2015 年 1 月 8 日获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至 2017 年 6 月 30 日，本公司管理东兴

改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金和东兴兴利债券型证券投资基金共 6 只开放式基金。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

吕姝仪女士

本基金基金经理

2017-04-14

-

3年

中国人民大学经济学硕士，3年证券从业经历。曾就职于中山证券有限责任公司资产管理部固收投资助理、民生加银基金管理有限公司固收交易员的职位。2015年9月加入东兴证券股份有限公司基金业务部，现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理。

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；对此后的非首任基金经理，"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。

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》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

每一轮加杠杆都会对应一次剧烈的调整，14 年到 16 年底的债券市场牛市和宽松的货币政策给此轮加杠杆建立了基础，16 年底至今债券市场中枢上移，金融去杠杆仍在路上。去杠杆是金融防风险的手段，经过几番调整，监管的节奏放缓，但趋势未变。对于上半年投资的主线是关注金融监管和美国加息的节奏，那么下半年的主线则是基本面分歧带来的预期差，金融去杠杆难言出清，在目前扰动项很多的震荡市，票息为王仍是上策。

报告期内，本基金采取了较为保守的配置策略，保持短久期的组合期限。在资产类别配置上以短融为主。

报告期内基金的业绩表现

2017年4月14日（基金合同生效日）起至2017年6月30日，本基金份额净值增长率为0.91%，业绩比较基准收益率为-0.28%，高于业绩比较基准1.19%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济平稳甚至超预期之后，下半年政策的态度值得关注，目前来看基建和房地产仍有一定的惯性。债券市场收益大幅上行将逐步影响实体企业，经济可能承受一定的压力。债券市场配置价值显现，下半年需关注发行利率超过贷款基准利率的高等级信用债投资机会，以及基本面预期差带来的利率市场边际变化。

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作

决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日未进行利润分配。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-东兴证券股份有限公司 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,东兴证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东兴证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

资产负债表

会计主体：东兴兴利债券型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

资产：

银行存款

2,841,125.57

结算备付金

25,006.1

存出保证金

2,387.14

交易性金融资产

67,348,400

其中：股票投资

-

基金投资

-

债券投资

67,348,400

资产支持证券投资

-

贵金属投资

-

衍生金融资产

-

买入返售金融资产

30,000,000

应收证券清算款

-

应收利息

777,370.03

应收股利

-

应收申购款

-

递延所得税资产

-

其他资产

-

资产总计

100,994,288.84

负债和所有者权益

本期末

2017-06-30

负债：

短期借款

-

交易性金融负债

-

衍生金融负债

-

卖出回购金融资产款

-

应付证券清算款

-

应付赎回款

3,084,757.16

应付管理人报酬

65,121.41

应付托管费

18,606.13

应付销售服务费

-

应付交易费用

2,607.46

应交税费

-

应付利息

-

应付利润

-

递延所得税负债

-

其他负债

27,686.88

负债合计

3,198,779.04

所有者权益：

-

实收基金

96,914,635.97

未分配利润

880,873.83

所有者权益合计

97,795,509.8

负债和所有者权益总计

100,994,288.84

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0091 元，基金份额总额 96,914,635.97 份。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无上年度末数据。

利润表

会计主体：东兴兴利债券型证券投资基金

本报告期：2017-04-14 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

一、收入

2,131,069.21

1.利息收入

2,038,402.24

其中：存款利息收入

424,689.08

债券利息收入

489,978

资产支持证券利息收入

-

买入返售金融资产收入

1,123,735.16

其他利息收入

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-2,330

其中：股票投资收益

-

基金投资收益

-

债券投资收益

-2,330

资产支持证券投资收益

-

贵金属投资收益

-

衍生工具收益

-

股利收益

-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

94,575.26

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）

-

5.其他收入（损失以“-”号填列）

421.71

减：二、费用

475,754.06

1. 管理人报酬

318,807.58

2. 托管费

91,087.9

3. 销售服务费

-

4. 交易费用

1,572.7

5. 利息支出

32,171.15

其中：卖出回购金融资产支出

32,171.15

6. 其他费用

32,114.73

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

1,655,315.15

减：所得税费用

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

1,655,315.15

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无上年度可比期间数据。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴兴利债券型证券投资基金

本报告期：2017-04-14 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

实收基金

未分配利润

所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）

342,334,360.30

-

342,334,360.30

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

0

1,655,315.15

1,655,315.15

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）

-245,419,724.33

-774,441.32

-246,194,165.65

其中：1.基金申购款

291,710.76

1,494.73

293,205.49

2.基金赎回款

-245,711,435.09

-775,936.05

-246,487,371.14

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）

-

-

-

五、期末所有者权益（基金净值）

96,914,635.97

880,873.83

97,795,509.80

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无上年度可比期间数据。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：魏庆华 主管会计工作负责人：魏庆华 会计机构负责人：

王青

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

东兴兴利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 9 月 9 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴兴利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2073 号）的批复，自 2017 年 3 月 9 日至 2017 年 4 月 10 日公开募集设立。本基金为债券型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 342,299,036.24 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2017]第 01460002 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

342,334,360.30 份，其中认购资金利息折合 35,324.06 份。本基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、证券公司的短期公司债)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资股票，持有可转换公司债券转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，也可直接买入权证等中国证监会、允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人根据法律从法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则--基本准则》(财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订)、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息

披露内容与格式准则第 3 号-半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号-年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号-会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

重要会计政策和会计估计

-

会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

金融资产和金融负债的估值原则

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视

同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；每次基金收益分配比例不低于该次可分配收益的30%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期2017年4月14日（基金合同生效日）至6月30日无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

本基金在本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无需说明的重大会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金在本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无需说明的重大会计估计变更。

差错更正的说明

本基金在本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无需说明的重大会计差错更正。

税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 4 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 9 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

活期存款

2,841,125.57

定期存款

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

其他存款

-

合计

2,841,125.57

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

成本

公允价值

公允价值变动

股票

-

-

-

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

9,927,400

9,927,000

-400

银行间市场

57,326,424.74

57,421,400

94,975.26

合计

67,253,824.74

67,348,400

94,575.26

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

67,253,824.74

67,348,400

94,575.26

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

交易所市场

30,000,000

0

合计

30,000,000

0

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

应收活期存款利息

968.1

应收定期存款利息

-

应收其他存款利息

-

应收结算备付金利息

11.3

应收债券利息

732,745.65

应收买入返售证券利息

43,643.88

应收申购款利息

-

应收黄金合约拆借孳息

-

其他

1.10

合计

777,370.03

注：其他为应收结算保证金利息。

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

其他应收款

-

待摊费用

-

合计

-

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

交易所市场应付交易费用

-

银行间市场应付交易费用

2,607.46

合计

2,607.46

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

应付券商交易单元保证金

-

应付赎回费

-

预提费用

27,686.88

合计

27,686.88

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14(基金合同生效日)至 2017-06-30

基金份额（份）

账面金额

基金合同生效日

342,334,360.30

342,334,360.30

本期申购

291,710.76

291,710.76

本期赎回（以“-”号填列）

-245,711,435.09

-245,711,435.09

本期末

96,914,635.97

96,914,635.97

注：本基金基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 342,334,360.30 份，其中：认购资金本金折算基金份额为：342,299,036.24 份，利息折算基金份额为：35,324.06 份。

未分配利润

单位：人民币元

项目

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

基金合同生效日

-

-

-

本期利润

1,560,739.89

94,575.26

1,655,315.15

本期基金份额交易产生的变动数

-822,130.66

47,689.34

-774,441.32

其中：基金申购款

1,475.44

19.29

1,494.73

基金赎回款

-823,606.1

47,670.05

-775,936.05

本期已分配利润

-

-

-

本期末

738,609.23

142,264.60

880,873.83

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

活期存款利息收入

23,762.09

定期存款利息收入

400,658.5

其他存款利息收入

-

结算备付金利息收入

260.71

其他

7.78

合计

424,689.08

注： 其他为结算保证金利息收入。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

卖出股票成交总额

-

减：卖出股票成本总额

-

买卖股票差价收入

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-2,330

债券投资收益——赎回差价收入

-

债券投资收益——申购差价收入

-

合计

-2,330

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

9,950,142.53

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

9,927,400

减：应收利息总额

25,072.53

买卖债券差价收入

-2,330

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

赎回基金份额对价总额

-

减：现金支付赎回款总额

-

减：赎回债券成本总额

-

减：赎回债券应收利息总额

-

赎回差价收入

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

申购基金份额对价总额

-

减： 现金支付申购款总额

-

减： 申购债券成本总额

-

减： 申购债券应收利息总额

-

申购差价收入

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

减：应收利息总额

-

资产支持证券投资收益

-

注：本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

卖出权证成交总额

-

减：卖出权证成本总额

-

买卖权证差价收入

-

注：本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无衍生工具投资收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-04-14 至 2017-06-30

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

股票投资产生的股利收益

-

基金投资产生的股利收益

-

合计

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

1.交易性金融资产

94,575.26

——股票投资

-

——债券投资

94,575.26

——资产支持证券投资

-

——基金投资

-

——贵金属投资

-

——其他

-

2.衍生工具

-

——权证投资

-

3.其他

-

合计

94,575.26

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

基金赎回费收入

421.71

合计

421.71

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

交易所市场交易费用

530.2

银行间市场交易费用

1,042.5

合计

1,572.7

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

审计费用

2,977.26

信息披露费

24,709.62

汇划手续费

4,337.85

账户维护费

90

合计

32,114.73

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

-

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称

与本基金的关系

东兴证券股份有限公司

基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司

基金托管人、基金销售机构

中国东方资产管理股份有限公司

基金管理人的控股股东

东兴期货有限责任公司

基金管理人的全资子公司

东兴证券投资有限公司

基金管理人的全资子公司

东兴资本投资管理有限公司

基金管理人的全资子公司

东兴证券（香港）金融控股有限公司

基金管理人的全资子公司

大连银行股份有限公司

与基金管理人同一控股股东的关联方、基金销售机构

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

东兴证券股份有限公司

30,099,230.13

100 %

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

东兴证券股份有限公司

622,020,000.00

100 %

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14(基金合同生效日)至 2017-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

318,807.58

其中：支付销售机构的客户维护费

119,755.18

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

91,087.9

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

注：本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

基金合同生效日（2017-04-14）持有的基金份额

-

报告期初持有的基金份额

-

报告期间申购/买入总份额

-

报告期间因拆分变动份额

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

报告期末持有的基金份额

-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

注：本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称

本期末

2017-06-30

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

期末余额

当期利息收入

中国农业银行股份有限公司

2,841,125.57

23,762.09

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-04-14 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：1、本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

注：根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未进行利润分配。

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：本基金本报告期末持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：本基金本报告期末持有暂时停牌等流通受限股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码

债券名称

回购到期日

期末估值单价

数量（张）

期末估值总额

注：本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和合规法律部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级

本期末

2017-06-30

A-1

-

A-1 以下

-

未评级

40,105,000

合计

40,105,000

注： 以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级

本期末

2017-06-30

AAA

7,092,400.00

AAA 以下

10,224,000.00

未评级

-

合计

17,316,400

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所或银行间市场上市交易，因此除附注

6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类

金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1 个月以内

1-3 个月

3 个月-1 年

1-5 年

5 年以上

不计息

合计

资产

银行存款

2,841,125.57

0

0

0

0

0

2,841,125.57

结算备付金

25,006.1

0

0

0

0

0

25,006.1

存出保证金

2,387.14

0

0

0

0

0

2,387.14

交易性金融资产-债券

9,927,000

0

57,421,400

0

0

0

67,348,400

买入返售金融资产

30,000,000

0

0

0

0

0

30,000,000

应收利息

0

0

0

0

0

777,370.03

777,370.03

资产总计

42,795,518.81

-

57,421,400

-

-

777,370.03

100,994,288.84

负债

应付赎回款

0

0

0

0

0

3,084,757.16

3,084,757.16

应付管理人报酬

0

0

0

0

0

65,121.41

65,121.41

应付托管费

0

0

0

0

0

18,606.13

18,606.13

应付交易费用

0

0

0

0

0

2,607.46

2,607.46

其他负债

0

0

0

0

0

27,686.88

27,686.88

负债总计

-

-

-

-

-

3,198,779.04

3,198,779.04

利率敏感度缺口

42,795,518.81

-

57,421,400

-

-

-2,421,409.01

97,795,509.8

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

利率风险的敏感性分析

假设

- 1、该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；
- 2、所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化；
- 3、银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响；
- 4、该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

1、市场利率上升 25 个基点

-7,547.34

2、市场利率下降 25 个基点

7,549.33

外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。
本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

交易性金融资产—基金投资

-

-

交易性金融资产—债券投资

67,348,400

68.87

交易性金融资产—贵金属投资

-

-

衍生金融资产—权证投资

-

-

其他

-

-

合计

67,348,400

68.87

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 4 月 14 日，无可比期间数据。

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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

67,348,400

66.69

其中：债券

67,348,400

66.69

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

30,000,000

29.7

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

2,866,131.67

2.84

7

其他各项资产

779,757.17

0.77

8

合计

100,994,288.84

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股票投资组合

代码

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。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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。

报告期内股票投资组合的重大变动

累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计买入金额

占期末基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未买入股票。

累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计卖出金额

占期末基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未卖出股票。

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额

-

卖出股票收入（成交）总额

-

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未投资股票。

期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号

债券品种

公允价值

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

9,927,000

10.15

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4

企业债券

10,224,000

10.45

5

企业短期融资券

40,105,000

41.01

6

中期票据

7,092,400

7.25

7

可转债（可交换债）

-

-

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

67,348,400

68.87

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：人民币元

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

1180042

11 抚州债

200,000

10,224,000

10.45

2

011771013

17 中材国际 SCP001

100,000

10,049,000

10.28

3

011759033

17 杭经开 SCP001

100,000

10,020,000

10.25

4

011755025

17 南通经开 SCP003

100,000

10,018,000

10.24

5

011756018

17 天富能源 SCP002

100,000

10,018,000

10.24

注： 本基金本报告期末持有的单一债券市值超过基金资产净值的 10%，是基金规模变动因素所致。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金管理人将在十个交易日内进行调整。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注： 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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（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。

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

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

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-

股指期货投资本期公允价值变动

-

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未投资股指期货。

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

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)

-

注：本基金本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

-

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受到调查以及处罚情况的说明

本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额

1

存出保证金

2,387.14

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

777,370.03

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

779,757.17

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)

户均持有的基金份额

持有人结构

机构投资者

个人投资者

持有份额

占总份额比例

持有份额

占总份额比例

1,920

50,476.37

0

0 %

96,914,635.97

100 %

期末上市基金前十名持有人

序号

持有人名称

持有份额（份）

占上市总份额比例

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目

持有份额总数（份）

占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金

174,061.69

0.18 %

期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目

持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金

0

本基金基金经理持有本开放式基金

0

发起式基金发起资金持有份额情况

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

-

-%

-

-%

-

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

-

-%

-

-%

-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

数值

基金合同生效日（2017-04-14）基金份额总额

342,334,360.3

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额

291,710.76

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额

245,711,435.09

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

96,914,635.97

基金份额持有人大会决议

本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日，本基金未召开基金份额持有人大会。

基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人（以下简称"本公司"或"公司"）于 2017 年 3 月 7 日召开第四届董事会第

一次会议，同意选举魏庆华先生担任公司第四届董事会董事长，任期三年；同意选举谭世豪先生担任公司第四届董事会副董事长，并同时履行高级管理人员职责，任期三年；经董事会及董事会各专门委员会选举，第四届董事会各专门委员成员如下：1、发展战略委员会主任委员：魏庆华，副主任委员：秦斌，成员：印建民、江月明、朱武祥、郑振龙、张伟 2、薪酬与提名委员会 主任委员：郑振龙，成员：魏庆华、韩建旻、张伟、邵晓怡 3、审计委员会 主任委员：韩建旻，成员：朱武祥、张伟、邵晓怡、屠旋旋 4、风险控制委员会主任委员：谭世豪，成员：魏庆华、韩建旻、张震；根据《公司法》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任魏庆华先生为公司总经理，任期三年；根据《公司法》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任许学礼先生、银国宏先生、孙小庆先生、刘亮先生、陈海先生为公司副总经理，任期三年；根据《证券公司合规管理试行规定》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任许学礼先生为公司合规总监，任期三年；根据《公司法》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任刘亮先生为公司董事会秘书，任期三年；根据《证券公司全面风险管理规范》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任张军先生为公司首席风险官，任期三年；根据《公司法》和公司《章程》的有关规定，董事会同意聘任徐琳洁女士为公司证券事务代表，任期三年。本公司于2017年3月7日召开第四届监事会第一次会议，会同意选举许向阳先生担任公司第四届监事会主席；同意选举许向阳先生、罗小平先生、杜彬先生为东兴证券股份有限公司第四届监事会履职尽职监督委员会委员，许向阳先生为主任委员；同意选举许向阳先生、叶淑玉女士、吴桥辉先生、郝洁女士为东兴证券股份有限公司第四届监事会财务与内部控制监督委员会委员，许向阳先生为主任委员。公司于2017年4月21日召开第四届董事会第三次会议，同意聘任魏庆华先生为公司财务负责人，任期三年；同意推选黎蜀宁女士为公司第四届董事会非独立董事候选人。

本公司于2017年4月21日发布公告，公司收到公司董事印建民先生递交的书面辞职报告。因个人工作调整，印建民先生申请辞去第四届董事会董事、董事会发展战略委员会委员。根据《公司法》及公司《章程》规定，此次董事印建民先生的辞职不会导致公司董事会成员低于法定最低人数，其辞职自辞职报告送达公司董事会时生效。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

基金投资策略的改变

本报告期内 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日基金投资策略未发生改变。

为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金于 2017 年 8 月 8 日改聘会计师事务所，改聘前为瑞华会计师事务所（特殊普通合伙），改聘后为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2017年4月12日，中国证券监督管理委员会作出《关于对东兴证券股份有限公司采取责令改正、责令增加内部合规检查次数并提交合规检查报告措施的决定》（[2017]43号）。该决定书的主要内容为：经中国证监会检查发现，公司对从业人员买卖股票交易行为的内部管控存在漏洞。要求公司按照相关法律、行政法规和中国证监会的规定落实整改，进一步改进内部管理流程，强化合规管理。针对决定书指出的问题，公司及时进行整改，其中“两两检查”发现两名新入职人员股票账户存在委托记录的情况，其中一人已于2016年11月份销户，另外一人已经离职。公司对该两名人员作出了全辖通报批评、扣罚一个月工资、并在现有职级序列基础上，分别降一职级等处罚决定。同时，公司立即修订了《东兴证券股份有限公司从业人员执业行为管理办法》，进一步完善了管理流程；发布通知要求开立股票账户的公司所有人员限期内注销账户或转托管，并多次通知和排查；另外，通过合规培训、宣传督导、合规监测、合规提示等一系列措施，做好员工执业行为管理工作。公司将按照监管要求，增加合规检查次数并提交合规检查报告。除此之外，本基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内2017年4月14日（基金合同生效日）至6月30日，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称

交易单元数量

股票交易

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

应支付该券商的佣金

备注

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期基金成交总额的比例

成交金额

占当期债券成交总额的比例

成交金额

占当期债券回购成交总额的比例

成交金额

占当期权证成交总额的比例

佣金

占当期佣金总量的比例

东兴证券股份有限公司

2

0

0%

-
-%
30,099,230.13
100 %
622,020,000
100 %
0
0 %
0
0 %
-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务

状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在 C 类或 C 类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元。

4、本基金本报告期内新增租用 2 个交易单元，分别为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。 -

其他重大事件

序号

公告事项

法定披露方式

法定披露日期

东兴兴利债券型证券投资基金招募说明书

公司网站

2017-03-04

2

东兴兴利债券型证券投资基金份额发售公告

指定报刊、公司网站

2017-03-04

3

东兴兴利债券型证券投资基金合同

公司网站

2017-03-04

4

东兴兴利债券型证券投资基金合同摘要

指定报刊、公司网站

2017-03-04

5

东兴兴利债券型证券投资基金托管协议

公司网站

2017-03-04

6

东兴证券股份有限公司关于旗下所有基金参加上海天天基金销售有限公司等十一家公司认购、申购费率优惠的公告

指定报刊、公司网站

2017-03-09

7

关于增加上海基煜基金销售有限公司为东兴证券股份有限公司旗下公开募集证券投资基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告

指定报刊、公司网站

2017-03-29

8

东兴兴利债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告

指定报刊、公司网站

2017-04-15

9

东兴兴利债券型证券投资基金合同生效公告

指定报刊、公司网站

2017-04-15

10

东兴兴利债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告

指定报刊、公司网站

2017-04-22

11

关于增加上海万得投资顾问有限公司和北京肯特瑞财富投资管理有限公司为东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告

指定报刊、公司网站

2017-04-24

12

东兴兴利债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告

指定报刊、公司网站

2017-04-29

13

东兴兴利债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告

指定报刊、公司网站

2017-05-06

14

东兴兴利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告

指定报刊、公司网站

2017-05-11

15

东兴兴利债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告

指定报刊、公司网站

2017-05-13

16

关于东兴证券股份有限公司旗下基金参与金惠家保险代理有限公司基金销售费率优惠的公告

指定报刊、公司网站

2017-05-24

17

东兴证券股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告

指定报刊、公司网站

2017-06-20

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

2017年4月14日至2017年5月16日

0

99,999,000

0

0%

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

本基金存在过单一投资者持有基金份额比例超过 20%及以上的情况，不排除本基金存续期内仍可能出现上述持有人相对集中的情况，本基金可能面临巨额赎回导致的流动性的风险。

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴兴利债券型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴兴利债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴兴利债券型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴兴利债券型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会关于核准东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复、营业执照、公司章程

存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fund.dxzq.net）查阅。