

东兴兴利债券型证券投资基金

2017年第3季度报告

2017年09月30日

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年10月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26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07月01日起至2017年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东兴兴利债券
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年04月14日
报告期末基金份额总额	77,493,903.10份
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	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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年07月01日 - 2017年09月30日）
1. 本期已实现收益	953,605.26
2. 本期利润	1,479,015.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0167
4. 期末基金资产净值	79,492,433.17
5. 期末基金份额净值	1.0258

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	1.65%	0.07%	0.32%	0.06%	1.33%	0.01%

##### 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

东兴兴利债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年04月14日-2017年09月30日)



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。

## § 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。

#### 4.2 管理人对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》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。

#### 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。

##### 4.3.2 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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾7-8月信用债整体处于震荡上行态势，9月和6月行情类似，跟随利率债出现下行行情。金融去杠杆取得初步成效，获得监管当局认可，但金融去杠杆仍然是中期政策目标，货币政策难以全面放松，整体来看债券市场趋势性的行情仍未出现。

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。在资产的类别配置上利率债为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年7月1日起至2017年9月30日，本基金份额净值增长率为1.65%，业绩比较基准收益率为0.32%，高于业绩比较基准1.33%。

#### 4.6 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，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。

## § 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)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,064,580.00	6.35
	其中：股票	5,064,580.00	6.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,863,300.00	88.85
	其中：债券	70,863,300.00	88.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,677,209.50	3.36
8	其他资产	1,149,798.11	1.44
9	合计	79,754,887.61	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
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	4,286,080.00	5.39
K	房地产业	778,500.00	0.98
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	5,064,580.00	6.37

### 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	601688	华泰证券	69,000	1,560,780.00	1.96
2	601939	建设银行	140,000	975,800.00	1.23
3	600030	中信证券	50,000	909,500.00	1.14
4	601398	工商银行	140,000	840,000.00	1.06
5	600266	北京城建	50,000	778,500.00	0.98
6					
7					
8					
9					
10					

### 5.4 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	3,969,600.00	4.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,802,000.00	75.23
	其中：政策性金融债	59,802,000.00	75.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	7,091,700.00	8.92
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,863,300.00	89.14

#### 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	170410	17农发10	600,000	59,802,000.00	75.23
2	1382012	13陕高速MTN1	70,000	7,091,700.00	8.92
3	179936	17贴现国债36	40,000	3,969,600.00	4.99
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。



## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本报告期内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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,935.10
2	应收证券清算款	470,487.21
3	应收股利	-
4	应收利息	664,435.44
5	应收申购款	9,940.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,149,798.11

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	96,914,635.97
报告期期间基金总申购份额	4,564,985.76
减：报告期期间基金总赎回份额	23,985,718.63
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	77,493,903.10

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	4,446,081.04
报告期期间卖出/赎回总份额	1,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,446,081.04
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	4.45

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	申购	2017-07-03	4,446,081.04	4,500,000.00	0.0030
2	赎回	2017-09-27	-1,000,000.00	-1,024,700.00	0.0000
合计			3,446,081.04	3,475,300.00	

注：基金管理人运用固有资金投资本基金适用的申购、赎回费率均按照招募说明书约定收取。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、东兴兴利债券型证券投资基金基金合同
- 2、东兴兴利债券型证券投资基金托管协议
- 3、东兴兴利债券型证券投资基金2017年第3季度报告原文

### 9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

### 9.3 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](http://www.fund.dxzq.net)）查阅。

东兴证券股份有限公司  
二〇一七年十月二十七日