

银华永利债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月25日

1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月23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运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	银华永利债券
交易代码	000807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月22日
报告期末基金份额总额	595,984,265.80份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于国内经济、利率、债券、货币市场和证券市场等有价证券和衍生品,通过自上而下的资产配置和自下而上的个股精选,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。同时,本基金适当参与一级债与二级债的灵活配置。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险等级	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险均高于货币市场基金,低于混合类基金和股票型基金。
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属证券投资基金名称	银华永利债券A 银华永利债券C
下属证券投资基金代码	000807 000828
报告期末下属证券投资基金总额	562,276,172.93份 33,708,092.87份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	银华永利债券	银华永利债券C
1.本期已实现收益		7,319,272.99	541,594.19
2.本期利润		11,297,296.64	795,366.79
3.加权平均基金份额本期利润		0.0256	0.0230
4.期末基金份额净值		605,991,731.41	36,685,222.51
5.期末基金资产净值		1,086	1,082

3.2 基金净值表现

注:1.本基金业绩比较基准为中证综合债指数收益率。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。

注:2.上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费,计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

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	2.86%	0.07%	1.69%	0.07%	0.71%	0.00%

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

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
过去六个月	2.77%	0.07%	1.64%	0.07%	0.62%	0.00%

3.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	银华永利债券	银华永利债券C
1.本期已实现收益		7,319,272.99	541,594.19
2.本期利润		11,297,296.64	795,366.79
3.加权平均基金份额本期利润		0.0256	0.0230
4.期末基金份额净值		605,991,731.41	36,685,222.51
5.期末基金资产净值		1,086	1,082

3.4 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	上证指数	11,068,540.00	2.03
2	000002	万科A	400.00	0.07
3	000003	招商银行	74,074,000.00	11.45
4	000004	浦发银行	74,074,000.00	11.45
5	000005	民生银行	866,807,401.49	133.91
6	000006	中信证券	215,117,000.00	33.25
7	000007	中国神华	49,000.00	0.07
8	000008	五粮液	1,169,221,941.49	180.70

3.5 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	00440015	14国债01	40,000	40,570,000.00	6.32
2	121859	12国债27	790,000	790,000.00	0.12
3	122848	12国债30	790,000	790,000.00	0.12
4	140205	14国债05	300,000	302,900.00	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	33,708,000.00	5.16

3.6 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

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	121859	12国债27	790,000.00	0.12
2	122848	12国债30	790,000.00	0.12
3	140205	14国债05	300,000.00	0.47
4	10160025	10国债附息17M001	300,000.00	0.47

3.7 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

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.8 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权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00440015	14国债01	40,000	0.07
2	121859	12国债27	790,000	1.14
3	122848	12国债30	790,000	1.14
4	140205	14国债05	300,000	0.47
5	10160025	10国债附息17M001	300,000	0.47

3.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码
----	----