

## 东兴兴利债券型证券投资基金

### 2017 第三季度 报告

2017年9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、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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。  
基金管理人中期业绩银行股份有限公司根据本基金合同约定,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表示其未来表现,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。  
本报告中所称财务数据未经审计。  
本报告自2017年07月01日起至2017年09月30日止。

#### §2基金产品概况

基金名称	东兴兴利债券
基金代码	001648
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期限	不定期
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值,力争取得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值,力争取得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90%+同期银行活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。
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

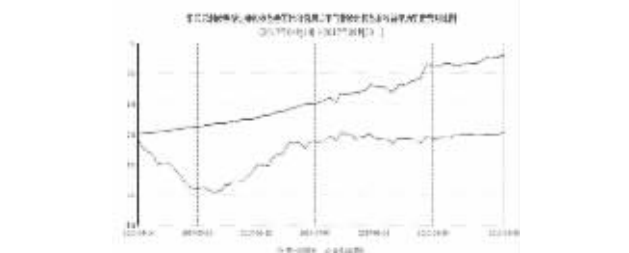
主要财务指标	报告期(2017年7月01日-2017年9月30日)
本期已实现收益	93,668.26
本期利润	1,479,915.17
本期基金份额持有人持有的基金份额净值变动率	9.9687%
本期基金份额持有人持有的基金份额净值增长率	79.464317%
本期基金份额持有人持有的基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	1.026%

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。

#### 3.2.1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

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	一季度	二季度
过去三个月	7.97%	6.94%	1.03%	3.35%	4.62%

#### 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



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。

#### 4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	证券从业年限	简历
陈文	基金经理	2017-04-14	-

注:1.对基金的历任基金经理,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;对此后的非历任基金经理,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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2报告期内本基金基金经理遵守诚信守则的情况

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,本基金无法定、违规行为,本基金投资组合符合有关法律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  
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异常交易专项说明  
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。  
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-8月信用债整体处于震荡上行态势,9月、6月行情类似,跟随利率债下行行情,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,保持较久的组合期限,在资产的类别配置上,利率债为主。

#### 4.5报告期内基金的投资组合报告

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30.32%,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元的情形。

#### §4投资组合报告

##### 5.1报告期末基金资产组合情况

序号	投资组合	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	5,644,200.00	4.24
2	固定收益	5,644,200.00	4.24
3	买入返售金融资产	79,634,200.00	60.52
4	货币资金	79,634,200.00	60.52
5	应收利息	-	-
6	其他资产	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	3,277,200.00	2.52
9	负债	13,277,200.00	10.12
10	合计	79,634,200.00	60.52

##### 5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	金额(元)	占基金总资产比例(%)
农林牧渔	-	-
医药生物	-	-
食品饮料	-	-
纺织服装	-	-
计算机	-	-
通信	-	-
电子	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
地产	-	-
建筑	-	-
国防军工	-	-
交通运输	-	-
石油石化	-	-
有色金属	-	-
钢铁	-	-
化工	-	-
其他	-	-

##### 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	000001	平安银行	1,000,000	10,000,000	12.50
2	000002	万科A	1,000,000	10,000,000	12.50
3	000003	招商银行	1,000,000	10,000,000	12.50
4	000004	浦发银行	1,000,000	10,000,000	12.50
5	000005	民生银行	1,000,000	10,000,000	12.50
6	000006	中信银行	1,000,000	10,000,000	12.50
7	000007	工商银行	1,000,000	10,000,000	12.50
8	000008	中国石化	1,000,000	10,000,000	12.50
9	000009	中信证券	1,000,000	10,000,000	12.50
10	000010	中国平安	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.4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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160000	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	160001	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	160002	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	160003	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	160004	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50
6	160005	16国债06	1,000,000	10,000,000	12.50
7	160006	16国债07	1,000,000	10,000,000	12.50
8	160007	16国债08	1,000,000	10,000,000	12.50
9	160008	16国债09	1,000,000	10,000,000	12.50
10	160009	16国债10	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 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(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160000	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	160001	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	160002	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	160003	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	160004	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 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

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 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

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.11报告期末本基金投资的期权交易情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

##### 5.12报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

##### 5.13报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.14报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.15报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.16报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.17报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.18报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.19报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.20报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.21报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.22报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50
5	16国债05	1,000,000	10,000,000	12.50

##### 5.23报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	16国债01	1,000,000	10,000,000	12.50
2	16国债02	1,000,000	10,000,000	12.50
3	16国债03	1,000,000	10,000,000	12.50
4	16国债04	1,000,000	10,000,000	12.50