

银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金

[2013]第四季度报告

基金管理人:银华基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2014年1月21日

§ 1 基本情况

基金管理人和基金托管人报告所披露的事项,误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担法律责任。

基金托管人中建投建设投资有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值表现、持有人信息、投资组合报告、风险揭示、投资策略和投资运作情况等。

基金的过往业绩并不代表未来表现,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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:银华永兴分级债券发起式

交易代码:161828

基金运作方式:契约型,本基金基金合同生效之日起3年内,永兴A自基

金合同生效之日起每满3个月开放一次,永兴B封闭运作;

本基金基金合同生效后3年内届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

基金合同生效日:2013年1月18日

报告期末基金份额总额:1,464,265,958.04份

投资目标:本基金以债券为主要投资对象,在控制信用风险、谨慎投资的前提下,主要获取持有期收益,追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略:本基金通过宏观经济、通货膨胀、利率走势等对货币政策、财政政策、行业分析和预期、流动性变量的变动对不同资产收益的影响,信用趋势风险的分析,通过分析、买入持有期为基本投资策略,获取长期收益;通过杠杆操作、资产配置证券等其他资产的投资为增强投资策略,力争为投资者获取超额收益。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于固定收益类金融工具的比例不高于基金资产的80%,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不高于基金资产净值的5%。

业绩比较基准:三年定期存款利率(税后)+1%。

风险收益特征:本基金为债券型基金,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:银华基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称:永兴A

永兴B

下属两级基金的交易代码:161828

150116

报告期末下属两级基金的份额总额:890,522,382.65份

573,743,575.39份

下属两级基金的风险收益特征:低风险,收益相对稳定。

注:本基金报告期末未持有行业分类的股票投资组合。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金报告期末未持有行业分类的股票投资组合。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金报告期末未持有行业分类的债券投资组合。

5.5 主要财务指标

注:1.本期实现的收益指基金利息收入、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,本期利润为本期实现的收益加上本期公允价值变动收益。

2.本期利润的计算公式不包括持有人认购或申购基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,计入费用后实际收益为本基金的本期利润减去费用后的余额。

3.期末基金资产净值。

4.本期平均基金份额持有人数计算方法为:期末基金资产净值除以期末持有人数。

5.期末基金份额净值。

6.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

7.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

8.过去三个月净值增长率及其计算方法。

9.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

10.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

11.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

12.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

13.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

14.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

15.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

16.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

17.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

18.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

19.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

20.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

21.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

22.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

23.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

24.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

25.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

26.本期基金份额净值增长率及其计算方法。

27.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

28.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

29.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

30.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

31.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

32.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

33.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

34.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

35.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

36.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

37.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

38.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

39.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

40.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

41.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

42.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

43.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

44.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

45.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

46.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

47.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

48.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

49.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

50.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

51.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

52.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

53.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

54.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

55.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

56.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

57.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

58.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

59.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

60.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

61.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

62.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

63.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

64.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

65.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

66.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

67.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

68.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

69.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

70.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

71.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

72.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

73.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

74.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

75.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

76.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

77.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

78.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

79.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

80.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

81.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

82.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

83.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

84.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

85.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

86.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

87.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

88.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

89.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

90.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

91.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

92.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

93.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

94.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

95.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

96.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

97.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

98.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

99.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

100.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

101.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

102.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

103.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

104.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

105.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

106.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

107.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

108.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

109.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

110.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

111.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

112.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

113.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

114.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

115.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

116.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

117.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

118.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

119.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

120.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

121.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

122.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

123.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

124.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

125.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

126.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

127.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

128.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

129.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

130.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

131.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

132.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

133.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

134.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

135.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

136.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

137.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

138.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

139.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

140.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

141.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

142.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。

143.本期基金份额净值增长率标准差及其计算方法。