

浙商惠裕纯债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告



注:1.本基金基金合同生效日为2016年11月7日,基金合同生效日至本报告期末,本基金生效时间已满一年。
2.本基金建仓期为6个月,从2016年11月7日至2017年5月6日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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 | 任本基金基金经理期间 | 说明 | |
|-----|----------|--------------|----|---|
| 胡晓斌 | 本基金的基金经理 | 2017年9月18日至今 | 7 | 胡晓斌先生,复旦大学经济学院金融学硕士,曾任招商证券资产管理部研究员,债券研究员,债券交易员。 |
| 胡晓斌 | 本基金的基金经理 | 2016年1月15日至今 | 6 | 胡晓斌先生,复旦大学经济学院金融学硕士,曾任招商证券资产管理部研究员,债券研究员,债券交易员。 |

4.2 管理人对本报告期内本基金运作合规守信情况的说明
本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的行为。本基金无重大违法违规、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
为了规范公平交易行为,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定,本公司制定了相应的公平交易制度,在不同投资决策层面,本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,对不同类别的投资组合分别管理,独立决策,在交易层面,实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,严禁在不同投资组合之间进行利益输送;在监控和评估层面,本公司金融工程小组将每日审查当天的交易交易,对不同投资组合在交易所公开竞价交易时间同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现异常交易行为。
公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内本基金主要投资品种为利率债和信用债,信用债以中高等级的金融债、企业债等为主,利率债以短期国债、政策性银行债为主。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.0326元;本报告期基金份额净值增长率为92.15%,业绩比较基准收益率为0.17%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内不存在对本基金持有人人数或基金资产净值预警的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| 2 | 固定收益 | 1,421,727,000.00 | 90.04 |
| 3 | 银行存款 | 1,421,727,000.00 | 90.04 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 13,000,120.00 | 0.82 |
| 7 | 银行承兑票据及银行承兑汇票 | 109,146,896.38 | 6.69 |
| 8 | 其他资产 | 36,151,603.66 | 2.23 |
| 9 | 合计 | 1,679,051,027.04 | 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
本基金本报告期末未持有股票。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有港股投资股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。

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五名债券投资明细

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国债债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 109,146,896.38 | 6.69 |
| 4 | 中期票据 | 109,146,896.38 | 6.69 |
| 5 | 企业债券 | 312,042,000.00 | 19.21 |
| 6 | 可转债(可交换债) | 608,199,000.00 | 36.88 |
| 7 | 待偿资产 | - | - |
| 8 | 资产支持 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,421,727,000.00 | 90.00 |

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 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| 2 | 固定收益 | 1,421,727,000.00 | 90.04 |
| 3 | 银行存款 | 1,421,727,000.00 | 90.04 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 13,000,120.00 | 0.82 |
| 7 | 银行承兑票据及银行承兑汇票 | 109,146,896.38 | 6.69 |
| 8 | 其他资产 | 36,151,603.66 | 2.23 |
| 9 | 合计 | 1,679,051,027.04 | 100.00 |

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权证投资明细

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.1 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可转换债券。
5.10.2 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.4 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可转换债券。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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可转换债券。
5.10.7 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.8 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.9 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可转换债券。
5.10.10 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.11 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.12 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可转换债券。
5.10.13 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.14 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.15 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可转换债券。
5.10.16 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.17 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.18 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可转换债券。
5.10.19 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.20 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.21 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可转换债券。
5.10.22 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.23 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.24 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可转换债券。
5.10.25 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.26 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.27 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可转换债券。
5.10.28 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.29 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.30 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可转换债券。
5.10.31 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.32 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.33 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可转换债券。
5.10.34 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.35 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.36 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可转换债券。
5.10.37 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.38 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.39 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可转换债券。
5.10.40 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.41 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.42 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可转换债券。
5.10.43 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.44 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.45 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可转换债券。
5.10.46 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.47 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.48 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可转换债券。
5.10.49 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.50 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.51 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可转换债券。
5.10.52 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.53 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.54 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可转换债券。
5.10.55 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.56 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收股利 | - |
| 5 | 其他应收款 | 36,151,603.66 |
| 6 | 其他流动资产 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,151,603.66 |

5.10.57 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可转换债券。
5.10.58 报告期末未上市交易的债券明细
本基金本报告期末未持有上市交易的债券。
5.10.59 其他资产构成

| 序号 | 名称</ |
|----|------|
|----|------|