

兴业裕恒债券型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会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。
本基金的管理人和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。
基金过往业绩并不代表基金未来表现。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。

本公司客户服务电话:4000956561
本报告期(2017年1月1日起至3月31日止)

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,052,065,000.00	80.95
其中:债券	1,052,065,000.00	80.95	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	199,064,170.97	9.76
其中:买断式回购到期未偿还的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	170,494,080.03	8.21
8	其他资产	29,619,812.02	1.44
9	合计	2,052,153,862.02	100.00

基金名称	兴业裕恒债券
基金代码	000371
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月14日
报告期末基金份额总额	2,052,153,862.02

投资目标 在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用状况、证券市场走势等方面的研究判断,综合运用货币市场配置策略、久期策略、收益率曲线策略,运用投资策略等,力求实现风险与收益的最佳平衡。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率

风险收益特征 本基金为债券基金,属于债券基金中较低风险的基金品种,其预期风险和预期收益水平低于货币基金,低于债券基金和股票基金。

基金管理人 兴业基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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

主要财务指标	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	17,789,462.38
2.本期利润	12,099,615.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0042
4.期末基金资产净值	2,023,538,123.00
5.期末基金份额净值	1.0091

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将低于所示列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.3 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.4 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.5 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.6 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.7 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.8 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.9 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.10 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.11 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.12 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.13 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.14 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.15 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.16 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.17 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.18 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.19 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.20 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.21 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.22 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.23 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.24 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.25 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.26 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.27 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.28 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.29 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.30 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.31 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.32 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.33 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.34 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.35 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.36 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数

3.2.37 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比

较

注:本基金的业绩比较基准为中国债券综合总指数