

兴银朝阳债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

重要提示 基金管理人的董事会及董事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,基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及本季报。

本报告期内自2017年1月1日起至3月31日止。

82 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Xinyi Chaoyang Bond Fund), 交易代码 (001794), 基金运作方式 (契约型开放式), etc.

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.

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。

3.2 本基金净值表现 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

Table with 5 columns: 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. Row for 过去三个月.

注:1.本基金成立于2015年12月7日; 2.比较基准为中债综合全价(总值)指数(0571.CS).

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

Table with 5 columns: 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. Row for 过去三个月.

注:1.本基金成立于2015年12月7日; 2.比较基准为中债综合全价(总值)指数(0571.CS).

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

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Rows for 杨凡颀, 陈博亮.

1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告的日期。

2.基金经理的离任日期指中国证监会公告的离任日期,即基金合同生效日。

3.2 基金经理的离任日期指中国证监会公告的离任日期,即基金合同生效日。

4.2 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》及其相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对于所管理的不同投资组合间交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明 本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金的业绩表现 本基金期末份额净值为1.012元,每万份份额分红0.0071元。

4.6 报告期内,基金份额收益率为0.31%,业绩比较基准收益率为-1.24%。

4.7 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 本基金本报告期内未出现连续二十个工作日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。

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

兴银基金管理有限责任公司 2017年4月21日

兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司 基金托管人:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

重要提示 基金管理人的董事会及董事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,基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及本季报。

本报告期内自2017年1月1日起至3月31日止。

82 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (Xinyi Changle Bond Fund), 交易代码 (001246), 基金运作方式 (契约型开放式), etc.

83 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.

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。

3.2 本基金净值表现 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

Table with 5 columns: 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. Row for 过去三个月.

注:1.本基金成立于2015年6月9日; 2.本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数(0571.CS).

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

Table with 5 columns: 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. Row for 过去三个月.

注:1.本基金成立于2015年6月9日; 2.本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数(0571.CS).

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

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Rows for 陈博亮, 洪木妹.

1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告的日期。

2.基金经理的离任日期指中国证监会公告的离任日期,即基金合同生效日。

3.2 基金经理的离任日期指中国证监会公告的离任日期,即基金合同生效日。

4.2 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》及其相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对于所管理的不同投资组合间交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明 本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 报告期内基金的业绩表现 本基金期末净值为1.012元,累计分红0.084元/份。

4.6 报告期内,基金份额收益率为0.69%,业绩比较基准收益率为-1.24%。

4.7 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 本基金本报告期内未出现连续二十个工作日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。

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

兴银基金管理有限责任公司 2017年4月21日

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

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注:报告期末按品种分类的债券投资组合中其他项为私募债。

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

Table with 5 columns: 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(%)

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十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

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

5.9 报告期末基金投资的股指期货交易情况说明 5.9.1 本期股指期货投资政策

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.3 本期股指期货投资评价

5.10 投资组合报告附注 5.10.1 报告期内,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金未进行股票投资,不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

86 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

88 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 2 columns: 报告期末持有基金份额变动情况, 报告期末持有基金份额情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 基金管理人于2017年3月30日发布公告,本基金名称自2017年4月5日起,由“华福长乐半年定期开放债券型证券投资基金”变更为“兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金”。

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录 (1)中国证监会准予兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件;

(2)《兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金合同》;

(3)《兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《兴银长乐半年定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点 基金管理人及基金托管人办公场所,并登载于基金管理人网站(www.hffunds.cn)。

9.3 查阅方式 投资者可登录基金管理人网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问,可拨打客服电话(40000-96326)咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司 2017年4月21日