

中邮睿信增强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:中邮创业基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

81 重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

82 基金产品概况 基金名称:中邮睿信增强债券基金 基金简称:中邮睿信增强债券基金

基金运作方式:契约型开放式 基金合同生效日:2016年8月25日

报告期末基金份额总额:224,421,098.13份

投资目标:本基金将重点关注中国经济转型过程中,符合经济转型升级方向、业绩前景明朗的成长型上市公司股票...

1. 资产配置策略 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济未来发展变动趋势...

2. 股票投资策略 本基金将重点关注在中国经济转型过程中,符合经济转型升级方向、业绩前景明朗的成长型上市公司股票...

3. 债券投资策略 (1) 平均久期配置 本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析...

(2) 期限结构配置 本基金将在注重风险管理的前提下,以套期保值为主要目的,遵循有效管理原则经充分论证后适度运用国债期货...

4. 权益投资 本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益...

5. 中小企业私募债券投资策略 本基金将重点关注风险管理的前提下,以套期保值为主要目的,遵循有效管理原则经充分论证后适度运用国债期货...

6. 资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约风险和提前偿付比例,并采用收益率曲线法和期权定价模型...

7. 国债期货投资策略 本基金将在注重风险管理的前提下,以套期保值为主要目的,遵循有效管理原则经充分论证后适度运用国债期货...

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*15%+中债综合财富指数收益率\*80%+金融债和人民币活期存款基准利率\*5%

风险收益特征:本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种。

基金管理人:中邮创业基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

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

主要财务指标 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

1. 本期已实现收益 2,324,553.88

2. 本期利润 1,919,080.93

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0062

4. 期末基金资产净值 222,622,075.69

5. 期末基金份额净值 0.992

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 基金净值表现 3.2.1 本报告期末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

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 业绩比较基准收益标准差④

过去三个月 0.61% 0.05% 0.39% 0.11% 0.22% -0.06%

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的比较

中交易管理加强交易环节的内部控制,通过工作制度、流程和信息系统控制等手段保证公平交易原则得以实现...

4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内未发现本基金存在异常交易行为

4.3.3 异常交易行为的专项说明 报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 最新的宏观数据来看,官方制造业PMI连续两个月上行,尽管涨幅不大,但数据明显企稳也显示经济处于复苏初期...

4.5 报告期内基金的投资组合报告 截至2017年3月31日,中邮睿信增强债券基金资产净值为0.992元,累计净值0.992元

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 报告期内本基金持有人人数或基金资产净值未触发预警

85 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 14,114,500.00 5.11

其中:股票 14,114,500.00 5.11

2 固定收益投资 237,238,219.30 85.94

其中:债券 237,238,219.30 85.94

3 买入返售金融资产 0.00 0.00

4 银行存款和结算备付金合计 20,863,150.83 7.56

5 其他资产 3,826,931.01 1.39

6 合计 276,042,801.14 100.00

注:1. 由于四舍五入的原因,报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差

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股票投资组合

行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 0.00 0.00

B 采矿业 0.00 0.00

C 制造业 8,362,000.00 3.76

D 电力、热力、燃气及生产和供应业 0.00 0.00

E 建筑业 0.00 0.00

F 批发和零售业 0.00 0.00

G 交通运输、仓储和邮政业 0.00 0.00

H 住宿和餐饮业 0.00 0.00

I 信息技术、软件和信息技术服务业 0.00 0.00

J 金融业 2,751,000.00 1.24

K 房地产业 3,001,500.00 1.35

L 租赁和商务服务业 0.00 0.00

M 科学研究和技术服务业 0.00 0.00

N 水利、环境和公共设施管理业 0.00 0.00

O 房地产业 0.00 0.00

P 教育 0.00 0.00

Q 卫生和社会工作 0.00 0.00

R 文化、体育和娱乐业 0.00 0.00

S 综合 0.00 0.00

合计 14,114,500.00 6.34

注:1. 由于四舍五入的原因,报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 报告期末未有沪港通股票投资

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 000333 美的集团 100,000 3,330,000.00 1.50

2 600007 中国国贸 150,000 3,001,500.00 1.35

3 000001 平安银行 300,000 2,751,000.00 1.24

4 002078 太阳纸业 300,000 2,139,000.00 0.96

5 000063 中兴通讯 100,000 1,696,000.00 0.76

6 000059 华鲁恒升 100,000 1,197,000.00 0.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 18,383,383.30 8.26

2 央行票据 0.00 0.00

3 金融债券 12,179,551.00 5.47

其中:政策性金融债 12,179,551.00 5.47

4 企业债券 53,175,285.00 23.89

5 企业短期融资券 149,922,000.00 67.34

6 中期票据 0.00 0.00

7 可转债(可交换债) 3,578,000.00 1.61

8 同业存单 0.00 0.00

9 其他 0.00 0.00

10 合计 237,238,219.30 106.57

注:1. 由于四舍五入的原因,报告期末基金资产组合公允价值占基金总资产的比例之和与合计可能有尾差

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十名债券投资明细

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(%)

1 016101612 16国债01 200,000 20,074,000.00 9.02

2 122366 14新国开02 200,000 20,056,000.00 9.01

3 011698184 16广发新债 200,000 20,048,000.00 9.01

4 011698326 16广裕新债 200,000 20,022,000.00 8.99

5 011698988 16国债08 200,000 19,996,000.00 8.98

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 报告期末未有资产支持证券投资

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 报告期末未有贵金属投资

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 报告期末未有基金权证

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易

5.9.2 本期国债期货投资的投资品种和损益情况 本基金未进行国债期货交易

5.9.3 本期国债期货投资的投资品种 本基金未进行国债期货交易

5.10 投资组合报告附注 5.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票

5.10.3 基金资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 15,136.88

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 0.00

4 其他应收款 3,810,802.07

5 应收申购款 992.06

6 预付款项 0.00

7 待摊费用 0.00

8 其他 0.00

9 合计 3,826,931.01

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.10.5 报告期末持有的资产支持证券明细 报告期末未有资产支持证券投资

5.10.6 报告期末持有的股指期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有股指期货投资

5.10.7 报告期末持有的国债期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有国债期货交易

5.10.8 报告期末持有的权证明细 报告期末未有基金权证

5.10.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.9.2 本期国债期货投资的投资品种和损益情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.9.3 本期国债期货投资的投资品种 本基金未进行国债期货交易

5.10.10 投资组合报告附注 5.10.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.10.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票

5.10.10.3 基金资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 15,136.88

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 0.00

4 其他应收款 3,810,802.07

5 应收申购款 992.06

6 预付款项 0.00

7 待摊费用 0.00

8 其他 0.00

9 合计 3,826,931.01

5.10.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.10.10.5 报告期末持有的资产支持证券明细 报告期末未有资产支持证券投资

5.10.10.6 报告期末持有的股指期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有股指期货投资

5.10.10.7 报告期末持有的国债期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有国债期货交易

5.10.10.8 报告期末持有的权证明细 报告期末未有基金权证

5.10.10.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.10.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.9.2 本期国债期货投资的投资品种和损益情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.9.3 本期国债期货投资的投资品种 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10 投资组合报告附注 5.10.10.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.10.10.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票

5.10.10.10.3 基金资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 15,136.88

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 0.00

4 其他应收款 3,810,802.07

5 应收申购款 992.06

6 预付款项 0.00

7 待摊费用 0.00

8 其他 0.00

9 合计 3,826,931.01

5.10.10.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.10.10.10.5 报告期末持有的资产支持证券明细 报告期末未有资产支持证券投资

5.10.10.10.6 报告期末持有的股指期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有股指期货投资

5.10.10.10.7 报告期末持有的国债期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有国债期货交易

5.10.10.10.8 报告期末持有的权证明细 报告期末未有基金权证

5.10.10.10.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.10.10.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.9.2 本期国债期货投资的投资品种和损益情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.9.3 本期国债期货投资的投资品种 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.10 投资组合报告附注 5.10.10.10.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.10.10.10.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票

5.10.10.10.10.3 基金资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 15,136.88

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 0.00

4 其他应收款 3,810,802.07

5 应收申购款 992.06

6 预付款项 0.00

7 待摊费用 0.00

8 其他 0.00

9 合计 3,826,931.01

5.10.10.10.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.10.10.10.10.5 报告期末持有的资产支持证券明细 报告期末未有资产支持证券投资

5.10.10.10.10.6 报告期末持有的股指期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有股指期货投资

5.10.10.10.10.7 报告期末持有的国债期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有国债期货交易

5.10.10.10.10.8 报告期末持有的权证明细 报告期末未有基金权证

5.10.10.10.10.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.10.10.10.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.10.9.2 本期国债期货投资的投资品种和损益情况 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.10.9.3 本期国债期货投资的投资品种 本基金未进行国债期货交易

5.10.10.10.10.10 投资组合报告附注 5.10.10.10.10.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.10.10.10.10.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票

5.10.10.10.10.10.3 基金资产构成

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 15,136.88

2 应收证券清算款 0.00

3 应收股利 0.00

4 其他应收款 3,810,802.07

5 应收申购款 992.06

6 预付款项 0.00

7 待摊费用 0.00

8 其他 0.00

9 合计 3,826,931.01

5.10.10.10.10.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 报告期末未有处于转股期的可转换债券

5.10.10.10.10.10.5 报告期末持有的资产支持证券明细 报告期末未有资产支持证券投资

5.10.10.10.10.10.6 报告期末持有的股指期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有股指期货投资

5.10.10.10.10.10.7 报告期末持有的国债期货合约的公允价值及损益情况 报告期末未有国债期货交易

5.10.10.10.10.10.8 报告期末持有的权证明细 报告期末未有基金权证

5.10.10.10.10.10.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.10.10.10.10.9.1 本期国债期货投资情况 本基金未进行国债期货交易</