
兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

§1 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年07月01日起至09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳康三年定开债券
基金主代码	004242
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年01月10日
报告期末基金份额总额	7,678,338,573.52份
投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内，主要投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、杠杆策略、信用衍生品投资策略、持有到期投资策略、再投资策略。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定存利率（税后）+1%

风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	48,555,321.13
2.本期利润	48,555,321.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0063
4.期末基金资产净值	7,850,241,920.26
5.期末基金份额净值	1.0224

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.62%	0.01%	0.95%	0.01%	-0.33%	0.00%
过去六个月	1.23%	0.01%	1.88%	0.01%	-0.65%	0.00%
过去一年	2.35%	0.01%	3.75%	0.01%	-1.40%	0.00%
过去三年	7.30%	0.01%	11.25%	0.01%	-3.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.13%	0.01%	13.96%	0.01%	-4.83%	0.00%

注：1.2019年12月12日本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金转型为兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金有关事项

的议案》。本基金自2020年1月10日起转型为兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金。《兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自2020年1月10日起失效，《兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于同日生效。

2、本基金的业绩比较基准自2020年1月10日起变更为：每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定存利率（税后）+1%。

3.2.2 自基金转型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



注：1.自2020年1月10日起兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金转型为兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金；

2.根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.本基金的业绩比较基准自2020年1月10日起变更为：每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定存利率（税后）+1%。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

丁进	固定收益投资部混合资产投资团队副总监，基金经理	2017-01-20	-	12年	<p>中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2005年7月至2008年2月，在北京顺泽锋投资咨询有限公司担任研究员；2008年3月至2010年10月，在新华信国际信息咨询（北京）有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问；2010年10月至2012年8月，在光大证券研究所担任信用及转债研究员；2012年8月至2015年2月就职于浦银安盛基金管理有限公司，其中2012年8月至2015年2月担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的基金经理助理，2012年9月至2015年2月担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年5月至2015年2月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年6月至2015年2月担任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2015年2月加入兴业基金管理有限公司，现任固定收益投资部混合资产投资团队副总监，基金经理。</p>
----	-------------------------	------------	---	-----	---

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》及其配套法律法规、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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内经济增长初期偏弱，之后出现企稳信号。物价数据、社融、工业企业利润等重要指标有所好转，7-8月出行和社会零售数据也出现向好迹象。出口数据企稳，房地产行业对于经济拖累加大，销售数据低迷。海外美元指数和美债利率均大幅上行，压制风险资产。7月份政治局年中经济工作会议释放出了较强的稳增长政策信号。大类资产上，股票资产冲高回落，多数指数跌破盈亏平衡线，市场情绪低迷；债券资产收益率先下后上，整体小幅上行；中证转债小幅下跌0.5%，估值整体仍处于历史相对高位。

报告期内，组合日常以维持杠杆运作，获取票息收益为主；收益率反弹高点增持少量金融债资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业稳康三年定开债券基金份额净值为1.0224元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.62%，同期业绩比较基准收益率为0.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在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的情形。

§5 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	11,193,521,534.44	99.77
	其中：债券	11,193,521,534.44	99.77
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,144,853.13	0.18
8	其他资产	5,280,000.00	0.05
9	合计	11,218,946,387.57	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,308,856,323.62	131.32
	其中：政策性金融债	5,404,511,283.38	68.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	884,665,210.82	11.27
10	合计	11,193,521,534.44	142.59

注：其他为地方政府债。

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

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	160405	16农发05	51,500,000	5,352,563,703.95	68.18
2	2220073	22上海银行	7,000,000	707,809,427.34	9.02
3	2228058	22中国银行绿色金融债02	6,700,000	683,021,895.64	8.70
4	222200001	22浙商银行绿债01	5,800,000	592,715,340.95	7.55
5	2228050	22光大银行	5,400,000	546,060,171.29	6.96

1 证券代码 160405 证券名称 16农发05 数量 51,500,000.00 市值（元） 5,352,563,703.95 占组合净值比例（%） 68.18

2 证券代码 2220073 证券名称 22上海银行 数量 7,000,000.00 市值（元） 707,809,427.34 占组合净值比例（%） 9.02

3 证券代码 2228058 证券名称 22中国银行绿色金融债02 数量 6,700,000.00 市值（元） 683,021,895.64 占组合净值比例（%） 8.70

4 证券代码 222200001 证券名称 22浙商银行绿债01 数量 5,800,000.00 市值（元） 592,715,340.95 占组合净值比例（%） 7.55

5 证券代码 2228050 证券名称 22光大银行 数量 5,400,000.00 市值（元） 546,060,171.29 占组合净值比例（%） 6.96

6 证券代码 2228057 证券名称 22浦发银行04 数量 4,500,000.00 市值（元） 454,032,488.53 占组合净值比例（%） 5.78

7 证券代码 2220079 证券名称 22江苏银行 数量 4,100,000.00 市值（元） 417,098,346.66 占组合净值比例（%） 5.31

8 证券代码 2220085 证券名称 22南京银行绿色债 数量 3,800,000.00 市值（元） 387,610,916.31 占组合净值比例（%） 4.94

9 证券代码 2228060 证券名称 22建设银行三农债 数量 3,700,000.00 市值（元） 377,145,289.86 占组合净值比例（%） 4.80

10 证券代码 2220086 证券名称 22南京银行03 数量 3,200,000.00 市值（元） 326,325,653.54 占组合净值比例（%） 4.16

11 证券代码 198001 证券名称 22重庆43 数量 2,200,000.00 市值（元） 219,137,882.11 占组合净值比例（%） 2.79

- 12 证券代码 092200011 证券名称 22江苏银行三农债01A 数量 1,700,000.00 市值（元）168,895,467.90 占组合净值比例（%） 2.15
- 13 证券代码 109231 证券名称 22重庆14 数量 1,500,000.00 市值（元） 150,942,267.85 占组合净值比例（%） 1.92
- 14 证券代码 2220076 证券名称 22北京银行小微债03 数量 1,200,000.00 市值（元）121,198,029.11 占组合净值比例（%） 1.54
- 15 证券代码 2220089 证券名称 22浙商银行三农债 数量 1,000,000.00 市值（元）102,125,997.30 占组合净值比例（%） 1.30
- 16 证券代码 198392 证券名称 22浙江61 数量 1,000,000.00 市值（元） 101,958,461.25 占组合净值比例（%） 1.30
- 17 证券代码 109879 证券名称 22重庆35 数量 1,000,000.00 市值（元） 100,189,424.83 占组合净值比例（%） 1.28
- 18 证券代码 109785 证券名称 22鄂137 数量 600,000.00 市值（元） 60,285,909.49 占组合净值比例（%） 0.77
- 19 证券代码 198340 证券名称 22广东59 数量 500,000.00 市值（元） 50,941,042.61 占组合净值比例（%） 0.65
- 20 证券代码 220412 证券名称 22农发12 数量 500,000.00 市值（元） 50,920,593.69 占组合净值比例（%） 0.65
- 21 证券代码 109337 证券名称 22福建40 数量 500,000.00 市值（元） 50,332,616.53 占组合净值比例（%） 0.64
- 22 证券代码 171074 证券名称 20江苏06 数量 500,000.00 市值（元） 50,267,145.13 占组合净值比例（%） 0.64
- 23 证券代码 109833 证券名称 22上海11 数量 400,000.00 市值（元） 40,127,950.59 占组合净值比例（%） 0.51
- 24 证券代码 109463 证券名称 22北京38 数量 300,000.00 市值（元） 30,133,495.50 占组合净值比例（%） 0.38
- 25 证券代码 2220074 证券名称 22宁波银行04 数量 200,000.00 市值（元）20,306,015.81 占组合净值比例（%） 0.26
- 26 证券代码 109681 证券名称 22四川82 数量 200,000.00 市值（元） 20,099,339.14 占组合净值比例（%） 0.26
- 27 证券代码 198397 证券名称 22广西48 数量 100,000.00 市值（元） 10,249,675.79 占组合净值比例（%） 0.13
- 28 证券代码 018011 证券名称 国开2002 数量 10,000.00 市值（元） 1,026,985.74 占组合净值比例（%） 0.01

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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资前十名证券发行主体中：

1、中国银行：于2023年2月17日因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会对总行罚款1600万元，对分支机构罚款1680万元,合计罚款3280万元；于2023年6月21日因未依法履行其他职责，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对总行责令改正，并处罚没款共计696.9076万元。

2、江苏银行：于2023年2月10日因未依法履行其他职责被中国人民银行予以警告，没收违法所得42元，罚款773.6万元；于2023年8月18日因未依法履行其他职责被国家金融监督管理总局江苏监管局予以警告，处16万元罚款。

3、建设银行：于2022年11月1日因未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会罚款200万元；于2022年11月4日因未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会罚款260万元；于2023年2月17日因未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得并处罚款合计19891.5626万元。其中，总行7342万元，分支机构12550万元。

报告期内基金投资的前十名证券除中国银行、江苏银行、建设银行外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金管理人的研究部门对其保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

5.11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

5.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	5,280,000.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,280,000.00

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	7,678,338,572.53
报告期期间基金总申购份额	0.99
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	7,678,338,573.52

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件
- (二) 《兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

2023年10月25日