
兴业优债增利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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	兴业优债增利债券	
基金主代码	002338	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月24日	
报告期末基金份额总额	1,932,339,632.24份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争 获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、杠杆策略、信用衍生品投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业优债增利债券A	兴业优债增利债券C
下属分级基金的交易代码	002338	008392
报告期末下属分级基金的份额总	1,930,886,136.99份	1,453,495.25份

额		
---	--	--

§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)	
	兴业优债增利债券A	兴业优债增利债券C
1.本期已实现收益	2,776,710.23	65,674.71
2.本期利润	2,118,977.65	42,380.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0052	0.0036
4.期末基金资产净值	2,022,164,220.43	1,515,953.64
5.期末基金份额净值	1.0473	1.0430

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于2020年3月23日经持有人大会表决通过"关于兴业奕祥混合型证券投资基金转型为兴业优债增利债券型证券投资基金"的议案，自2020年3月24日起，本基金转型为兴业优债增利债券型证券投资基金，《兴业优债增利债券型证券投资基金基金合同》亦于该日同时生效。

5、自2020年03月24日起，本基金分设两类基金份额：A类基金份额和C类基金份额，2020年03月26日C类基金份额存续，上述业绩表现按实际存续期计算。详情参阅相关公告。

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

兴业优债增利债券A净值表现

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	0.25%	0.06%	0.01%	0.05%	0.24%	0.01%
过去六个月	0.56%	0.04%	0.95%	0.04%	-0.39%	0.00%

过去一年	0.94%	0.06%	0.62%	0.05%	0.32%	0.01%
过去三年	9.13%	0.06%	4.54%	0.05%	4.59%	0.01%
自基金合同生效起至今	10.17%	0.06%	2.22%	0.06%	7.95%	0.00%

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率。

兴业优债增利债券C净值表现

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	0.15%	0.06%	0.01%	0.05%	0.14%	0.01%
过去六个月	0.38%	0.04%	0.95%	0.04%	-0.57%	0.00%
过去一年	0.62%	0.06%	0.62%	0.05%	0.00%	0.01%
过去三年	8.04%	0.06%	4.54%	0.05%	3.50%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.54%	0.06%	2.13%	0.06%	6.41%	0.00%

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率。

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

兴业优债增利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月24日-2023年09月30日)



兴业优债增利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月26日-2023年09月30日)



本基金合同自 2020 年 03 月 24 日起生效并增设 C 类基金份额，自 2020 年 03 月 26 日起 C 类基金份额存续。

§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		
倪侃	固定收益投资部总经理助理、公募债券投资团队总监、基金经理	2022-10-21	-	11年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。曾在银河创新资本、上银基金、九州证券从事投资研究工作；2013年5月加入上银基金管理有限公司，参与公司筹备与创立，先后担任交易员、研究员；2016年9月开始在上银基金先后担任交易总监、基金经理等职务。2021年5月加入兴业基金，现任固定收益投资部总经

					理助理、公募债券投资团队 总监、基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------

- 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《证券投资基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

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

三季度高频数据显示，季度中后期经济景气度指标、同比数据、价格类数据均企稳，叠加地产政策，预期形成正反馈，从具体分项看：1) 地产销售尚未完全企稳，销售端低迷引致投资下行压力较大，地产仍在寻底过程中；2) 工业增加值强于预期，同比、环比改善均较为明显；3) 固定资产投资三项均不同程度传递乐观信号；4) 社零环比折年增速显示回归弱修复路径，总量改善较多，分限上限下看，可能存在一定的消费降级现象；5) 失业率呈现季节性回落，整体与往年8月相当。

进入9月份后资金价格开始波动，除去季节性因素外，与短期汇率波动压力有一定关系，我们预计短期资金面将维持紧平衡状态，直至汇率压力解除。此外，考虑到10月为缴税大月，流动性存在缺口，超储率偏低环境下，税期波动可能加大，预计后市资金中枢将难回8月低点，预计后市R007大概率在2%上下波动。不过，当前短端NCD定价（接近2.5%）已偏高，相对价值和确定性较高，对于追求绝对收益的资金来说，可以重点配置短端品种。

组合三季度维持了在市场震荡中合理调节组合杠杆和久期，如后期收益率下行则考虑适当止盈，以促进产品净值稳步增长。随着资金回流理财子市场，预计四季度流动性将维持稳健，有票息价值资产的配置需求将延续旺盛。后市以信用债基等票息策略产品为主要配置方向，同时择机减持利率债持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业优债增利债券A基金份额净值为1.0473元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.25%，同期业绩比较基准收益率为0.01%；截至报告期末兴业优债增利债券C基金份额净值为1.0430元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.15%，同期业绩比较基准收益率为0.01%。

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的情形。

本报告期内，本基金自2023年7月19日起至2023年9月18日止基金资产净值低于五千万，已连续二十个工作日以上。

§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	1,909,906,739.32	94.35
	其中：债券	1,909,906,739.32	94.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	7,488,930.00	0.37
6	买入返售金融资产	100,086,501.33	4.94
	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	6,702,968.32	0.33
8	其他资产	13,634.34	0.00

9	合计	2,024,198,773.31	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	7,577,423.84	0.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,242,714,864.77	61.41
	其中：政策性金融债	301,981,456.68	14.92
4	企业债券	1,010,169.86	0.05
5	企业短期融资券	215,132,172.24	10.63
6	中期票据	443,472,108.61	21.91
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,909,906,739.32	94.38

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	230411	23农发11	1,100,000	110,114,087.43	5.44
2	102282011	22美的置业MTN002	1,000,000	100,434,754.10	4.96
3	230421	23农发21	1,000,000	99,985,737.70	4.94
4	2028044	20广发银行二级01	900,000	95,984,891.51	4.74
5	102101338	21荣盛MTN001	800,000	81,638,557.38	4.03

1 证券代码 230411 证券名称 23农发11 数量 1,100,000.00 市值 110,114,087.43 占组合净值比例 5.44%

2 证券代码 102282011 证券名称 22美的置业MTN002 数量 1,000,000.00 市值

100,434,754.10 占组合净值比例 4.96%

3 证券代码 230421 证券名称 23农发21 数量 1,000,000.00 市值 99,985,737.70 占组合净值比例 4.94%

4 证券代码 2028044 证券名称 20广发银行二级01 数量 900,000.00 市值 95,984,891.51 占组合净值比例 4.74%

5 证券代码 102101338 证券名称 21荣盛MTN001 数量 800,000.00 市值 81,638,557.38 占组合净值比例 4.03%

6 证券代码 2302001QF 证券名称 23国开绿债01清发 数量 700,000.00 市值 71,445,480.87 占组合净值比例 3.53%

7 证券代码 042380474 证券名称 23恒逸CP005 数量 700,000.00 市值 70,260,453.55 占组合净值比例 3.47%

8 证券代码 212380003 证券名称 23华夏银行债01 数量 600,000.00 市值 60,985,344.26 占组合净值比例 3.01%

9 证券代码 1920059 证券名称 19江苏银行二级 数量 600,000.00 市值 60,867,927.87 占组合净值比例 3.01%

10 证券代码 102001994 证券名称 20东方医药MTN001 数量 500,000.00 市值 53,229,095.89 占组合净值比例 2.63%

11 证券代码 042280509 证券名称 22恒逸CP008 数量 500,000.00 市值 52,915,041.10 占组合净值比例 2.61%

12 证券代码 1920066 证券名称 19上海银行二级 数量 500,000.00 市值 52,624,605.48 占组合净值比例 2.60%

13 证券代码 2128041 证券名称 21广发银行小微债 数量 500,000.00 市值 51,564,254.79 占组合净值比例 2.55%

14 证券代码 2128046 证券名称 21浦发银行02 数量 500,000.00 市值 51,428,183.56 占组合净值比例 2.54%

15 证券代码 102381126 证券名称 23盐城城镇MTN004 数量 500,000.00 市值 51,408,032.79 占组合净值比例 2.54%

16 证券代码 2228050 证券名称 22光大银行 数量 500,000.00 市值 50,966,569.86 占组合净值比例 2.52%

17 证券代码 2228015 证券名称 22浦发银行03 数量 500,000.00 市值 50,905,185.79 占组合净值比例 2.52%

18 证券代码 2328010 证券名称 23平安银行小微债 数量 500,000.00 市值 50,730,699.45 占组合净值比例 2.51%

19 证券代码 2328009 证券名称 23中信银行01 数量 500,000.00 市值 50,727,672.13 占组合净值比例 2.51%

20 证券代码 212380005 证券名称 23光大银行债01 数量 500,000.00 市值 50,463,338.80 占组合净值比例 2.49%

21 证券代码 2328017 证券名称 23农业银行三农债 数量 500,000.00 市值 50,363,852.46 占

组合净值比例 2.49%

22 证券代码 102382349 证券名称 23美的置业MTN004B 数量 500,000.00 市值 49,735,737.70 占组合净值比例 2.46%

23 证券代码 012381453 证券名称 23鲁商SCP005 数量 400,000.00 市值 41,055,672.13 占组合净值比例 2.03%

24 证券代码 1928010 证券名称 19平安银行二级 数量 300,000.00 市值 30,891,459.02 占组合净值比例 1.53%

25 证券代码 2028034 证券名称 20浦发银行二级03 数量 300,000.00 市值 30,855,200.00 占组合净值比例 1.52%

26 证券代码 2028033 证券名称 20建设银行二级 数量 300,000.00 市值 30,838,819.67 占组合净值比例 1.52%

27 证券代码 042380192 证券名称 23包钢集CP002 数量 300,000.00 市值 30,788,049.18 占组合净值比例 1.52%

28 证券代码 1920046 证券名称 19宁波银行二级 数量 300,000.00 市值 30,680,704.92 占组合净值比例 1.52%

29 证券代码 2320025 证券名称 23北京银行01 数量 300,000.00 市值 30,225,918.03 占组合净值比例 1.49%

30 证券代码 102382283 证券名称 23陕西旅游MTN001 数量 250,000.00 市值 25,178,729.51 占组合净值比例 1.24%

31 证券代码 102282761 证券名称 22株洲高科MTN001 数量 200,000.00 市值 21,632,591.78 占组合净值比例 1.07%

32 证券代码 2128036 证券名称 21平安银行二级 数量 200,000.00 市值 20,954,081.10 占组合净值比例 1.04%

33 证券代码 1428011 证券名称 14建行二级01 数量 200,000.00 市值 20,713,025.14 占组合净值比例 1.02%

34 证券代码 2028041 证券名称 20工商银行二级01 数量 200,000.00 市值 20,540,852.46 占组合净值比例 1.02%

35 证券代码 2128028 证券名称 21邮储银行二级01 数量 200,000.00 市值 20,312,649.18 占组合净值比例 1.00%

36 证券代码 102381033 证券名称 23美的置业MTN001B 数量 200,000.00 市值 20,260,786.89 占组合净值比例 1.00%

37 证券代码 102381990 证券名称 23华诚医学MTN001 数量 200,000.00 市值 20,077,431.69 占组合净值比例 0.99%

38 证券代码 102282413 证券名称 22凉山发展MTN002 数量 150,000.00 市值 15,760,253.42 占组合净值比例 0.78%

39 证券代码 2028049 证券名称 20工商银行二级02 数量 100,000.00 市值 10,629,158.90 占组合净值比例 0.53%

40 证券代码 220402 证券名称 22农发02 数量 100,000.00 市值 10,233,150.68 占组合净值

比例 0.51%

41 证券代码 220203 证券名称 22国开03 数量 100,000.00 市值 10,203,000.00 占组合净值比例 0.50%

42 证券代码 2028013 证券名称 20农业银行二级01 数量 100,000.00 市值 10,174,284.15 占组合净值比例 0.50%

43 证券代码 012382846 证券名称 23康缘集SCP001 数量 100,000.00 市值 10,061,098.36 占组合净值比例 0.50%

44 证券代码 012382911 证券名称 23西岸旅游SCP001 数量 100,000.00 市值 10,051,857.92 占组合净值比例 0.50%

45 证券代码 019703 证券名称 23国债10 数量 45,000.00 市值 4,536,135.62 占组合净值比例 0.22%

46 证券代码 019694 证券名称 23国债01 数量 30,000.00 市值 3,041,288.22 占组合净值比例 0.15%

47 证券代码 232280012 证券名称 22广州银行二级资本债01 数量 20,000.00 市值 2,126,643.84 占组合净值比例 0.11%

48 证券代码 232380008 证券名称 23广州农商行二级资本债01 数量 20,000.00 市值 2,086,805.46 占组合净值比例 0.10%

49 证券代码 2126006 证券名称 21南洋银行01 数量 10,000.00 市值 1,033,263.84 占组合净值比例 0.05%

50 证券代码 101900015 证券名称 19中石油MTN001 数量 10,000.00 市值 1,031,296.99 占组合净值比例 0.05%

51 证券代码 101900051 证券名称 19华润MTN001 数量 10,000.00 市值 1,031,070.96 占组合净值比例 0.05%

52 证券代码 102100440 证券名称 21江苏银宝MTN001 数量 10,000.00 市值 1,030,443.28 占组合净值比例 0.05%

53 证券代码 102100622 证券名称 21鲁黄金MTN002 数量 10,000.00 市值 1,023,326.23 占组合净值比例 0.05%

54 证券代码 2228028 证券名称 22中信银行01 数量 10,000.00 市值 1,014,147.54 占组合净值比例 0.05%

55 证券代码 188357 证券名称 21光明01 数量 10,000.00 市值 1,010,169.86 占组合净值比例 0.05%

56 证券代码 137799 证券名称 22海通05 数量 440.00 市值 43,868.88 占组合净值比例 0.00%

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

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

本基金投资国债期货，将以套期保值为目的，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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) 广发银行：2022/12/30中国人民银行对广发银行警告，罚款3484.8万元，违规事由为未依法履行其他职责。

(2) 江苏银行：2023/02/10中国人民银行对江苏银行警告，没收违法所得42元，罚款773.6万元，违规事由为未依法履行其他职责。

报告期内基金投资的前十名证券除广发银行、江苏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	12,565.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,069.14
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,634.34

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告期末本基金持有的金融衍生品投资明细：

1 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23浙商银行CRMW053(23恒逸CP005) 公允价值 1,945,720.00 占组合净值比例 0.10%

2 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 22招行CRMW002(22美的置业MTN002) 公允价值 1,291,800.00 占组合净值比例 0.06%

3 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23中债增CRMW004(23美的置业MTN004B) 公允价值 1,210,250.00 占组合净值比例 0.06%

4 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23浙商银行CRMW056(23陕西旅游MTN001) 公允价值 724,300.00 占组合净值比例 0.04%

5 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 22浙商银行CRMW053(22凉山发展MTN002) 公允价值 588,030.00 占组合净值比例 0.03%

6 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23南京银行CRMW009(23华诚医学MTN001) 公允价值 446,400.00 占组合净值比例 0.02%

7 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23浙商银行CRMW022(23鲁商SCP005) 公允价值 303,120.00 占组合净值比例 0.01%

8 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23交行CMW010(23美的置业MTN001B) 公允价值 297,840.00 占组合净值比例 0.01%

9 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23浙商银行CRMW015(23包钢集CP002) 公允价值 279,120.00 占组合净值比例 0.01%

10 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 22杭州银行CRMW021(22恒逸CP008) 公允价值 259,950.00 占组合净值比例 0.01%

11 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23上海银行CRMW003(23盐城城镇MTN004) 公允价值 234,800.00 占组合净值比例 0.01%

12 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23交行CRMW017(23西岸旅游SCP001) 公允价值 84,670.00 占组合净值比例 0.00%

13 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 22浙商银行CRMW058(22株洲高科MTN001) 公允价值 66,260.00 占组合净值比例 0.00%

14 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 23交行CRMW016(23康缘集SCP001) 公允价值 43,050.00 占组合净值比例 0.00%

15 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 20徽商银行CRMW003 (20东方医药MTN001) 公允价值 10,900.00 占组合净值比例 0.00%

16 衍生品类别 信用风险缓释凭证 衍生品名称 21中债增CRMW018(21荣盛MTN001) 公允价值 -297,280.00 占组合净值比例 -0.01%

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业优债增利债券A	兴业优债增利债券C
报告期期初基金份额总额	29,125,369.34	23,135,029.44
报告期期间基金总申购份额	3,822,384,880.15	28,464.28
减：报告期期间基金总赎回份额	1,920,624,112.50	21,709,998.47
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	1,930,886,136.99	1,453,495.25

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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

单位：份

	兴业优债增利债券A	兴业优债增利债券C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	11,496,455.26	961,261.17
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	11,496,455.26	961,261.17
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.60	66.13

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230701-20230918	12,457,716.43	-	-	12,457,716.43	0.64%
	2	20230725-20230918	7,207,380.36	477,782,130.91	484,989,511.27	-	0.00%
	3	20230919-20230925	-	955,566,163.40	955,566,163.40	-	0.00%
	4	20230919-20230930	-	1,911,130,434.78	-	1,911,130,434.78	98.90%
	5	20230701-20230724	14,414,760.71	-	14,414,760.71	-	0.00%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。							

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

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奕祥混合型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《兴业优债增利债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业优债增利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