
兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月24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2022年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 兴业沪深300ETF |
| 场内简称 | 兴业沪深300ETF（证券简称：兴业300；扩位证券简称：兴业沪深300ETF） |
| 基金主代码 | 510370 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年09月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 36,258,111.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率 |

| | |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 兴业基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

§ 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 97,189.60 |
| 2. 本期利润 | -2,554,038.14 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1578 |
| 4. 期末基金资产净值 | 29,507,545.75 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8138 |

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 | -14.14% | 0.86% | -15.16% | 0.89% | 1.02% | -0.03% |
| 过去六个月 | -8.25% | 1.15% | -9.89% | 1.19% | 1.64% | -0.04% |
| 过去一年 | -20.77% | 1.15% | -21.81% | 1.18% | 1.04% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -18.62% | 1.14% | -16.96% | 1.19% | -1.66% | -0.05% |

注：本基金的业绩比较基准为标的指数，即沪深300指数收益率。

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



§ 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 | | |
| 那赛男 | 基金经理 | 2020-09-11 | - | 13年 | 中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年8月至2013年3月在博时基金管理有限公司ETF及量化投资部担任投资分析员；2013年4月至2015年6月在长盛基金管理有限公司权益投资部担任ET |

| | | | | | |
|-----|------|------------|------------|-----|--|
| | | | | | F专员；2015年7月至2016年11月在创金合信基金管理有限公司产品开发部从事相关研究工作；2016年11月至2018年4月在创金合信基金管理有限公司指数策略研究投资部历任研究员、基金经理助理，主要从事指数基金投资研究工作。2018年4月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。 |
| 朱小明 | 基金经理 | 2020-10-12 | 2022-09-22 | 10年 | 中国籍，北京大学金融数学专业硕士研究生。2012年7月至2014年6月，在国泰基金管理有限公司担任量化研究员；2014年7月至2016年6月，在德骏达隆资产管理有限公司担任量化投资岗；2016年7月至2019年10月，在万家基金管理有限公司担任量化投资岗，期间2017年4月至2019年10月分别担任万家180指数证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。 |

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

三季度以来，市场回撤显著，上证指数回撤11.01%，深证成指回撤16.42%，创业板指回撤18.56%，其中沪深300指数下跌13.94%，本产品严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本产品较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业沪深300ETF基金份额净值为0.8138元，本报告期内，基金份额净值增长率为-14.14%，同期业绩比较基准收益率为-15.16%。

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2022年07月01日起至2022年09月30日止基金资产净值低于五千万，已连续六十个工作日以上。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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 | 29,049,406.74 | 98.26 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：股票 | 29,049,406.74 | 98.26 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 512,930.66 | 1.74 |
| 8 | 其他资产 | 130.65 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 29,562,468.05 | 100.00 |

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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 418,013.40 | 1.42 |
| B | 采矿业 | 927,106.00 | 3.14 |
| C | 制造业 | 16,844,605.53 | 57.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 825,140.00 | 2.80 |
| E | 建筑业 | 586,703.09 | 1.99 |
| F | 批发和零售业 | 63,485.00 | 0.22 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 856,800.60 | 2.90 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 964,913.22 | 3.27 |
| J | 金融业 | 5,952,950.70 | 20.17 |
| K | 房地产业 | 599,028.00 | 2.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 350,461.00 | 1.19 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 410,668.00 | 1.39 |
| N | 水利、环境和公共设施管 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| | 理业 | | |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 12,960.00 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | 209,149.20 | 0.71 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 27,423.00 | 0.09 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 29,049,406.74 | 98.45 |

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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 | 600519 | 贵州茅台 | 1,100 | 2,059,750.00 | 6.98 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 2,400 | 962,136.00 | 3.26 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 18,000 | 748,440.00 | 2.54 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 20,400 | 686,460.00 | 2.33 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 3,500 | 592,305.00 | 2.01 |
| 6 | 601012 | 隆基绿能 | 9,760 | 467,601.60 | 1.58 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 13,400 | 441,932.00 | 1.50 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 19,100 | 434,334.00 | 1.47 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 8,300 | 409,273.00 | 1.39 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 24,000 | 399,600.00 | 1.35 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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 1. 2021年8月20日，兴业银行股份有限公司因未依法履行其他职责，被中国人民银行罚款5万元。

2. 2022年3月25日，兴业银行股份有限公司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350万元。

3. 2022年3月25日，招商银行股份有限公司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300万元。

4. 2022年1月19日，中国平安湖州中支行公司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101万元。

报告期内基金投资的前十名证券除上述主体外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在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上述主体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 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------|
| 1 | 存出保证金 | 130.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 130.65 |

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五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积极投资股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 12,258,111.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 24,000,000.00 |
| 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 | 36,258,111.00 |
|-------------|---------------|

§ 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

| 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 | 20220915-20220930 | - | 24,010,000.00 | - | 24,010,000.00 | 66.22% |
| 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。 | | | | | | | |

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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业沪深300交易型开放式指数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

2022年10月26日