

---

# 百嘉百兴纯债债券型证券投资基金

## 2022年第4季度报告

### 2022年12月31日

基金管理人:百嘉基金管理有限公司

基金托管人:恒丰银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月18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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1月17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10月1日起至2022年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	百嘉百兴纯债债券
基金主代码	014259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月08日
报告期末基金份额总额	199,964,213.60份
投资目标	本基金为纯债债券型基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)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低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	百嘉基金管理有限公司

基金托管人	恒丰银行股份有限公司
-------	------------

### § 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10月01日 - 2022年12月31日）
1. 本期已实现收益	1,078,422.48
2. 本期利润	1,018,422.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0051
4. 期末基金资产净值	203,460,707.53
5. 期末基金份额净值	1.0175

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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 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	0.50%	0.09%	-0.60%	0.08%	1.10%	0.01%
过去六个月	0.94%	0.08%	0.12%	0.06%	0.82%	0.02%
过去一年	1.64%	0.07%	0.51%	0.06%	1.13%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.75%	0.07%	0.83%	0.06%	0.92%	0.01%

##### 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

百嘉百兴纯债债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于2021年12月8日生效。

2、本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金按规定在合同生效后六个月内应达到上述规定的投资组合比例，本基金各项资产配置比例现符合基金合同的有关约定。

## § 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		
李泉	本基金的基金经理、百嘉百利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理、百嘉百顺纯债债券型证券投资基金的基金经理、百嘉百益债券	2021-12-08	-	15	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任金鹰基金市场部渠道经理，深圳前海聚能投资市场部总经理，中科沃土基金集中交易部交易主管，现任公司固收

	型证券投资基金的基金经 理、固收投资部负责人。				投资部负责人。
--	----------------------------	--	--	--	---------

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“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《证券业从业人员资格管理办法》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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人已制定公平交易管理、投资权限管理、投资备选库管理和集中交易等制度，以公平交易贯穿始终、相互独立、公平对待作为公平交易的原则，通过恒生交易系统内的公平交易模块进行风险控制。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度受疫情防控措施优化、地产政策“三支箭”、理财赎回导致的抛压等因素影响，利率债收益率总体以上行为主，12月下旬受资金宽松、回购利率处于低位影响，收益有所下行，其中中短债收益率回落幅度较大。

全季度来看，10年国债活跃券收益率上行约10BP，5年国开收益率上行10BP，3年国开收益率上行约13BP，各期限债券收益率全线上行。

报告期内，货币政策呈现稳健偏宽松状态，资金价格处于低位，银行间隔夜、7天质押式回购加权利率均值分别为1.41%和2.04%，与上季度相比有所提高，但杠杆收益仍明显。

报告期内，本基金主要围绕着“宽货币”市场环境下收益相对确定的3年内利率债和高等级信用债进行投资，在市场调整前及时降低了组合杠杆，同时市场稳定后及时提高了杠杆，使组合在本季度内取得不错的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末百嘉百兴纯债债券基金份额净值为1.0175元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.50%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 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	263,070,985.75	99.76
	其中：债券	245,055,693.15	92.93
	资产支持证券	18,015,292.60	6.83
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	634,274.72	0.24
8	其他资产	-	-
9	合计	263,705,260.47	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金报告期末未持有境内股票。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

### 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	245,055,693.15	120.44
	其中：政策性金融债	124,262,865.75	61.07
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	-	-
10	合计	245,055,693.15	120.44

### 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	170201	17国开01	300,000	31,612,684.93	15.54
2	210218	21国开18	300,000	30,285,435.62	14.89
3	180403	18农发03	200,000	20,977,112.33	10.31
4	200203	20国开03	200,000	20,930,071.23	10.29
5	220202	22国开02	200,000	20,457,561.64	10.05

### 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

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(%)
1	135043	惠毓7A	180,000	18,015,292.60	8.85

## 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。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 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

本基金未参与投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局、中国银行保险监督管理委员会的处罚，浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚，中山农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会中山监管分局的处罚、广东顺德农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会佛山监管分局的处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库



本基金本报告期末未投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

### 5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末无持有其他资产。

### 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

本基金本报告期末无股票投资。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	199,965,947.25
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,733.65
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	199,964,213.60

## § 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

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## § 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

别		间区间					
机 构	1	20221001-20221231	199,938,036.58	-	-	199,938,036.58	99.99%
产品特有风险							
<p>报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形;持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予百嘉百兴纯债债券型证券投资基金注册的文件
- 2、《百嘉百兴纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《百嘉百兴纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《百嘉百兴纯债债券型证券投资基金的法律意见书》

### 9.2 存放地点

广州市天河区花城大道769号广州嘉昱中心10楼。

### 9.3 查阅方式

投资人可在办公时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

百嘉基金管理有限公司

2023年01月18日