
兴业180天持有期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: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01月20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1月18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12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业180天持有期债券	
基金主代码	016301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年08月17日	
报告期末基金份额总额	331,226,324.60份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争长期实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	主要投资策略为大类资产配置策略、债券投资策略、杠杆策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中国债券综合全价指数	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	兴业180天持有期债券A	兴业180天持有期债券C
下属分级基金的交易代码	016301	016302
报告期末下属分级基金的份额总额	91,112,845.56份	240,113,479.04份

§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)	
	兴业180天持有期债券 A	兴业180天持有期债券 C
1.本期已实现收益	497,675.77	1,220,834.56
2.本期利润	-1,151,564.65	-3,123,818.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0126	-0.0130
4.期末基金资产净值	89,862,746.70	236,686,705.62
5.期末基金份额净值	0.9863	0.9857

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

兴业180天持有期债券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	-1.26%	0.10%	-0.60%	0.08%	-0.66%	0.02%
自基金合同生效起至今	-1.37%	0.08%	-0.83%	0.07%	-0.54%	0.01%

兴业180天持有期债券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	-1.30%	0.10%	-0.60%	0.08%	-0.70%	0.02%

自基金合同生效起至今	-1.43%	0.08%	-0.83%	0.07%	-0.60%	0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）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



- 1、本基金合同自 2022 年 8 月 17 日起生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满 1 年。
- 2、根据本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

兴业180天持有期债券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



- 1、本基金合同自 2022 年 8 月 17 日起生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满 1 年。
- 2、根据本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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	2022-08-17	-	12年	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。
--	--	--	--	--	--

- 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

报告期内，疫情和地产依然对经济增长形成拖累，内需疲弱叠加出口加速下滑，经济下行压力加大。11月初，疫情防控政策出现较大优化调整，地产融资端“三支箭”先后相继推出，央行同期实施降准，并在年末投放充裕流动性跨年。外围方面，以美联储为代表的发达经济体货币政策进入观察期，全球经济在2023年进入衰退的预期上升。债券

收益率大幅上行，对比三季度末，利率债收益率调整5-15BP；信用债普遍上行50-150BP，城投债类别调整最大。市场剧烈调整造成理财产品大量赎回，形成负反馈。可转债资产受信用债调整压缩估值，中证转债单季度下跌2.5%。

报告期内，组合逐步建仓完成，以信用债资产为主，整体久期中等水平。受到债券资产调整影响，净值下跌明显。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业180天持有期债券A基金份额净值为0.9863元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%；截至报告期末兴业180天持有期债券C基金份额净值为0.9857元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.30%，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

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	418,057,686.49	99.34
	其中：债券	418,057,686.49	99.34
	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	2,391,253.05	0.57
8	其他资产	379,576.19	0.09
9	合计	420,828,515.73	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

本基金本报告期末未持有股票。

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	20,258,646.58	6.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,275,300.56	40.51
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	147,095,696.71	45.05
5	企业短期融资券	5,010,632.88	1.53
6	中期票据	61,404,720.28	18.80
7	可转债（可交换债）	52,012,689.48	15.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	418,057,686.49	128.02

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	092280069	22华夏银行二级资本债01	300,000	29,383,947.95	9.00
2	092280080	22光大银行二级资本债01A	300,000	29,372,794.52	8.99
3	122249	13平煤债	259,790	26,789,049.42	8.20
4	019638	20国债09	200,000	20,258,646.58	6.20
5	110059	浦发转债	190,000	19,936,543.84	6.11

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 报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体中：

1、华夏银行：2022年3月25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460万元。

2、浦发银行：2022年3月25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420万元。

3、宁波银行：2022年4月18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宁波监管局罚款220万元；2022年4月23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宁波监管局罚款270万元；2022年5月27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宁波监管局罚款290万元。

4、上海银行：2022年2月23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上海监管局责令改正，并处罚款240万元。

5、光大银行：2022年3月25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490万元；2022年6月2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400万元。

报告期内基金投资的前十名证券除华夏银行、浦发银行、宁波银行、上海银行、光大银行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公司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	11,290.39
2	应收证券清算款	368,285.80
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	379,576.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	19,936,543.84	6.11
2	113042	上银转债	16,710,418.62	5.12
3	110081	闻泰转债	2,477,532.90	0.76
4	127049	希望转2	1,781,321.64	0.55
5	113024	核建转债	1,270,068.63	0.39
6	127040	国泰转债	1,037,394.49	0.32
7	132018	G三峡EB1	398,347.81	0.12
8	128136	立讯转债	226,831.39	0.07
9	110082	宏发转债	109,081.23	0.03

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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业180天持有期债券A	兴业180天持有期债券C
报告期期初基金份额总额	91,109,808.91	240,112,480.84
报告期期间基金总申购份额	3,036.65	998.20
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	91,112,845.56	240,113,479.04

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180天持有期债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业180天持有期债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业180天持有期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01月20日