

---

兴业聚福一年持有期混合型证券投资基金

2023年第2季度报告

2023年06月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年07月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年7月19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04月01日起至06月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	兴业聚福一年持有期混合
基金主代码	017060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年02月21日
报告期末基金份额总额	762,799,492.50份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。主要投资策略为资产配置策略、债券类资产投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	兴业聚福一年持有期混合A	兴业聚福一年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	017060	017061
报告期末下属分级基金的份额总额	509,351,900.89份	253,447,591.61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(2023年04月01日 - 2023年06月30日)	
	兴业聚福一年持有期混合A	兴业聚福一年持有期混合C
1.本期已实现收益	3,603,193.33	1,600,994.22
2.本期利润	2,327,775.10	966,663.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0038
4.期末基金资产净值	514,252,239.04	255,614,796.34
5.期末基金份额净值	1.0096	1.0086

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

兴业聚福一年持有期混合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	0.45%	0.16%	-0.28%	0.16%	0.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.96%	0.13%	-0.51%	0.16%	1.47%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

兴业聚福一年持有期混合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	0.39%	0.16%	-0.28%	0.16%	0.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.86%	0.13%	-0.51%	0.16%	1.37%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

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

兴业聚福一年持有期混合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

(2023年02月21日-2023年06月30日)



注：1、本基金基金合同于 2023 年 2 月 21 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、根据本基金基金合同规定，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。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

兴业聚福一年持有期混合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



注：1、本基金基金合同于 2023 年 2 月 21 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未  
 满一年。

2、根据本基金基金合同规定，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。截止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	2023- 02-21	-	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2 010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；20

				<p>12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

报告期内，二季度经济增长在低基数下增长明显，但环比偏弱。疫情影响下，积压需求在一季度释放后二季度恢复力度放缓，1-5月规模以上工业企业利润增速仍为负值，物价水平低位徘徊，居民部门消费修复缓慢；地产领域流动性压力犹存，实体经济融资需求偏弱。政策方面，国内央行超预期降息，以美联储为代表的发达经济体紧缩周期进入尾声，债券收益率下行至去年末低点附近，利率债收益率整体下行25-35BP，信用债收益率总体下行，中高等级跟随利率债普遍下行25BP左右，1年期存单下行30BP左右。权益资产二季度调整，沪深300指数下跌5%左右，消费服务、食品等大消费板块和地产产业链表现较差，中特估主题相对表现较好。可转债大类资产跟随权益资产微跌0.15%。

组合维持中等仓位的权益资产，医药、TMT、新能源、家电、公用事业等板块均衡配置。可转债仓位适当配置，债券资产久期维持中等水平。含权资产调整拖累部分对冲了债券资产的上涨，组合净值小幅上涨。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业聚福一年持有期混合A基金份额净值为1.0096元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.45%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%；截至报告期末兴业聚福一年持有期混合C基金份额净值为1.0086元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.39%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

### 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	126,737,054.01	15.03
	其中：股票	126,737,054.01	15.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	710,034,741.46	84.19
	其中：债券	710,034,741.46	84.19

	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	3,111,706.85	0.37
8	其他资产	3,485,806.42	0.41
9	合计	843,369,308.74	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,339,698.69	8.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,035,000.00	2.47
E	建筑业	287,000.00	0.04
F	批发和零售业	36,528,194.20	4.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,261.12	0.03
J	金融业	2,335,900.00	0.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-



R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,737,054.01	16.46

### 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

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	002727	一心堂	1,380,000	36,432,000.00	4.73
2	000333	美的集团	328,000	19,325,760.00	2.51
3	601985	中国核电	2,700,000	19,035,000.00	2.47
4	600522	中天科技	920,000	14,637,200.00	1.90
5	600745	闻泰科技	166,000	8,117,400.00	1.05
6	002460	赣锋锂业	90,000	5,486,400.00	0.71
7	300003	乐普医疗	240,000	5,426,400.00	0.70
8	002273	水晶光电	320,000	3,820,800.00	0.50
9	002241	歌尔股份	204,000	3,621,000.00	0.47
10	002475	立讯精密	85,000	2,758,250.00	0.36

### 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	45,006,130.41	5.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	363,223,421.73	47.18
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	147,176,629.25	19.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	50,908,625.38	6.61
7	可转债（可交换债）	103,719,934.69	13.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	710,034,741.46	92.23

### 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	019694	23国债01	435,000	43,982,695.07	5.71
2	2028033	20建设银行二级	300,000	31,901,876.71	4.14
3	1928018	19工商银行永续 债	300,000	31,799,145.21	4.13
4	1928031	19广发银行永续 债	300,000	31,671,616.44	4.11
5	1928036	19中信银行永续 债	300,000	31,301,852.05	4.07

**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投资，也无期间损益。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

### 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

本基金本报告期未参与国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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	48,613.49
2	应收证券清算款	3,437,192.93
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	3,485,806.42

### 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	132026	G三峡EB2	29,762,037.87	3.87
2	110081	闻泰转债	25,474,021.48	3.31
3	110059	浦发转债	24,861,223.01	3.23
4	128136	立讯转债	9,271,242.36	1.20
5	113050	南银转债	8,781,594.74	1.14
6	110053	苏银转债	1,907,114.21	0.25
7	113605	大参转债	904,818.63	0.12
8	127075	百川转2	647,626.03	0.08
9	113024	核建转债	605,056.99	0.08
10	110088	淮22转债	579,985.62	0.08
11	113044	大秦转债	231,032.33	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

	兴业聚福一年持有期混 合A	兴业聚福一年持有期混 合C
报告期期初基金份额总额	509,351,900.89	253,447,591.61
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	-	-
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	509,351,900.89	253,447,591.61

## §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聚福一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业聚福一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业聚福一年持有期混合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07月21日