
兴业聚福一年持有期混合型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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07月01日 - 2023年09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	3,434,638.28	1,514,004.16
2.本期利润	-2,182,243.50	-1,277,112.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0043	-0.0050
4.期末基金资产净值	512,069,995.54	254,337,684.28
5.期末基金份额净值	1.0053	1.0035

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	-0.43%	0.16%	-0.76%	0.17%	0.33%	-0.01%
过去六个月	0.02%	0.16%	-1.03%	0.17%	1.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.53%	0.14%	-1.26%	0.16%	1.79%	-0.02%

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	-0.51%	0.16%	-0.76%	0.17%	0.25%	-0.01%
过去六个月	-0.12%	0.16%	-1.03%	0.17%	0.91%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.35%	0.14%	-1.26%	0.16%	1.61%	-0.02%

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



注：1、本基金基金合同于 2023 年 2 月 21 日生效，截至本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，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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，截至本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，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例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		
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合规守信情况的说明

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，国内经济增长初期偏弱，之后出现企稳信号。物价数据、社融、工业企业利润等重要指标有所好转，7-8月出行和社会零售数据也出现向好迹象。出口数据企稳，房地产行业对于经济拖累加大，销售数据低迷。海外美元指数和美债利率均大幅上行，压制风险资产。7月份政治局年中经济工作会议释放出了较强的稳增长政策信号。大类资产上，股票资产冲高回落，多数指数跌破盈亏平衡线，市场情绪低迷；债券资产收益率先下后上，整体小幅上行；中证转债小幅下跌0.5%，估值整体仍处于历史相对高位。

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。可转债仓位维持，操作上增持低价公用事业类转债，减持高价位金融类转债。股票及可转债资产下跌，使得组合净值小幅下跌。

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1.0053元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.43%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%；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1.0035元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.51%，同期业绩比较基准收益率为-0.76%。

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	142,338,937.54	15.64
	其中：股票	142,338,937.54	15.64
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	763,935,996.91	83.96
	其中：债券	763,935,996.91	83.96
	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	2,063,881.23	0.23
8	其他资产	1,533,354.54	0.17
9	合计	909,872,170.22	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	78,536,246.90	10.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,012,750.00	2.35
E	建筑业	276,500.00	0.04
F	批发和零售业	38,346,661.65	5.00
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	1,358,056.74	0.18
J	金融业	5,770,200.00	0.75
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	18,139.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	20,382.77	0.00
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	142,338,937.54	18.57

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	1,643,400	38,110,446.00	4.97
2	000333	美的集团	330,000	18,308,400.00	2.39
3	601985	中国核电	2,467,500	18,012,750.00	2.35
4	600522	中天科技	980,000	14,553,000.00	1.90
5	600745	闻泰科技	325,000	14,186,250.00	1.85
6	688235	百济神州	78,000	11,017,500.00	1.44
7	002241	歌尔股份	390,000	6,154,200.00	0.80
8	601009	南京银行	600,000	4,830,000.00	0.63
9	002273	水晶光电	320,000	3,571,200.00	0.47
10	300003	乐普医疗	155,600	2,556,508.00	0.33

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	44,098,679.18	5.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	425,024,864.30	55.46
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	136,798,536.69	17.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,682,921.07	9.35
7	可转债（可交换债）	86,330,995.67	11.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	763,935,996.91	99.68

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	44,098,679.18	5.75
2	110081	闻泰转债	327,660	35,286,603.10	4.60
3	2220030	22重庆银行二级	340,000	34,783,568.09	4.54
4	1880319	18饶城投债	500,000	31,744,813.70	4.14
5	1928036	19中信银行永续 债	300,000	31,480,923.29	4.11

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 本基金投资前十名证券发行主体中：

1、建设银行：于2022年11月1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200万元；于2022年11月4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260万元；于2023年2月17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没收违法所得并处罚款合计19891.5626万元。其中，总行7342万元，分支机构12550万元。

2、广发银行：于2023年8月3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合计2340万元。其中，总行550万元，分支机构1790万元。

报告期内基金投资的前十名证券除建设银行、广发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 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	57,908.02
2	应收证券清算款	1,475,446.52
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	1,533,354.54

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	110081	闻泰转债	35,286,603.10	4.60
2	132026	G三峡EB2	30,573,217.54	3.99
3	113050	南银转债	9,815,939.11	1.28
4	128136	立讯转债	8,562,269.21	1.12
5	113605	大参转债	901,151.78	0.12

6	110088	淮22转债	618,293.15	0.08
7	113024	核建转债	573,521.78	0.07

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10月25日