兴业丰利债券型证券投资基金

2021年第2季度报告

2021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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2021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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业丰利债券
基金主代码	002268
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月28日
报告期末基金份额总额	4,341,220,133.68份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，综合运用类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略等，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。
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，其预期风险及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	招商银行股份有限公司

§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（2021年04月01日 - 2021年06月30日）
1.本期已实现收益	40,203,901.74
2.本期利润	65,605,547.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0151
4.期末基金资产净值	4,405,151,359.80
5.期末基金份额净值	1.0147

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	1.46%	0.04%	0.45%	0.03%	1.01%	0.01%
过去六个月	2.47%	0.05%	0.65%	0.04%	1.82%	0.01%
过去一年	3.09%	0.06%	-0.20%	0.06%	3.29%	0.00%
过去三年	10.46%	0.06%	4.53%	0.07%	5.93%	-0.01%
过去五年	13.33%	0.06%	1.70%	0.07%	11.63%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.67%	0.06%	1.55%	0.07%	12.12%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

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		
伍方方	基金经理	2020-12-23	-	10年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2010年12月至2017年12月，在兴业银行资金营运中心担任交易员，从事人民币资金交易、流动性管理、债券借贷、同业存单发行与投资交易、投资策略研究以及其他资产负债管理相关工作。2017年12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行业协会《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

二季度债券市场窄幅震荡。4-5月资金面维持宽松，利率震荡下行，6月初资金面边际收敛，利率迅速上行，至6月中旬，央行维稳动作明显，利率重回下行。短端资金利率DR007以央行7天OMO利率为中枢波动，1年期国股存单利率以MLF利率为中枢波动，长端10年期国债下行至3.04%附近后反弹至3.20%，然后又回落至3.10%附近。报告期内，本组合严格把握债券的信用风险，配置上以中高等级信用债为主，维持中性久期和杠杆水平。下一阶段将密切关注经济基本面和货币政策节奏，稳中求进，灵活调整组合久期，保证组合安全性和流动性的有机结合，为投资者获取稳定的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业丰利债券基金份额净值为1.0147元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.46%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

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	5,633,682,800.00	98.30
	其中：债券	5,330,832,600.00	93.01
	资产支持证券	302,850,200.00	5.28
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	16,588,542.94	0.29
8	其他资产	81,038,183.60	1.41
9	合计	5,731,309,526.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	816,043,000.00	18.52
	其中：政策性金融债	260,726,000.00	5.92

4	企业债券	916,730,100.00	20.81
5	企业短期融资券	226,077,500.00	5.13
6	中期票据	3,371,982,000.00	76.55
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,330,832,600.00	121.01

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	102001883	20陕延油MTN003	2,000,000	202,420,000.00	4.60
2	102000053	20鲁能源MTN001	2,000,000	200,800,000.00	4.56
3	1928011	19工商银行二级03	1,100,000	112,717,000.00	2.56
4	210206	21国开06	1,100,000	110,011,000.00	2.50
5	190207	19国开07	1,000,000	100,600,000.00	2.28

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	137989	创恒04A	500,000	50,265,000.00	1.14
2	2189291	21工元至诚5优先	500,000	49,985,000.00	1.13
3	137851	21申弘2A	400,000	40,136,000.00	0.91
4	137709	诚意5A1	300,000	30,144,000.00	0.68
5	137758	天铭优01	270,000	27,132,300.00	0.62
6	179913	21信易1A	250,000	25,032,500.00	0.57
7	156443	电投18优	200,000	20,076,000.00	0.46
8	137835	东裕02A	190,000	19,060,800.00	0.43
9	189075	链科33优	180,000	18,014,400.00	0.41
10	189685	21绿城A2	170,000	17,000,000.00	0.39

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 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	34,154.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	81,003,529.24
5	应收申购款	499.70
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	81,038,183.60

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

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

报告期期初基金份额总额	4,341,167,649.41
报告期期间基金总申购份额	78,206.04
减：报告期期间基金总赎回份额	25,721.77
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	4,341,220,133.68

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

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	20210401-20210630	4,341,144,227.86	-	-	4,341,144,227.86	100.00%
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。

注：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

本报告期内，兴业丰利债券型证券投资基金于2021年6月4日公告《关于调整本公司旗下部分基金的基金份额净值计算位数并修改基金合同、托管协议的公告》，为更好地保障基金份额持有人利益，根据有关法律法规及基金合同的规定，兴业基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定提高本公司旗下兴业丰利债券型证券投资基金的基金份额净值的精确位数至小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。同时，对该基金的基金合同和托管协议中涉及基金份额净值计算小数点后保留位数的相关条款进行修改，并据此调整该基金的招募说明书中涉及的相关内容。上述变更事项的调整，自2021年6月4日起生效。

§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丰利债券型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业丰利债券型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业丰利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

除上述第（六）项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处，投资人在办公时间内可免费查阅。

9.3 查阅方式

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

2021年07月21日