兴业绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月20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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业绿色纯债一年定开债券
基金主代码	009237
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年07月17日
报告期末基金份额总额	1,309,358,260.06份
投资目标	在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。在封闭期内采取的投资策略包括资产配置策略、绿色投资筛选策略、久期策略、信用债券投资策略、类属配置策略、个券选择策略、杠杆投资策略、资产支持证券的投资策略。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债-中国绿色债券全价指数收益率
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	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业绿色纯债一年定开债券A	兴业绿色纯债一年定开债券C
下属分级基金的交易代码	009237	009238
报告期末下属分级基金的份额总额	1,309,182,033.19份	176,226.87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01月01日 - 2022年03月31日)	
	兴业绿色纯债一年定开债券A	兴业绿色纯债一年定开债券C
1.本期已实现收益	10,425,178.97	1,225.08
2.本期利润	4,154,934.69	380.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032	0.0022
4.期末基金资产净值	1,355,081,290.09	182,573.83
5.期末基金份额净值	1.0351	1.0360

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

兴业绿色纯债一年定开债券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	0.31%	0.08%	0.25%	0.06%	0.06%	0.02%

过去六个月	1.50%	0.06%	0.75%	0.05%	0.75%	0.01%
过去一年	4.00%	0.05%	1.99%	0.05%	2.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.86%	0.05%	2.38%	0.05%	3.48%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中债-中国绿色债券全价指数收益率。

兴业绿色纯债一年定开债券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	0.20%	0.08%	0.25%	0.06%	-0.05%	0.02%
过去六个月	1.29%	0.06%	0.75%	0.05%	0.54%	0.01%
过去一年	3.56%	0.05%	1.99%	0.05%	1.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.13%	0.05%	2.38%	0.05%	2.75%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准为：中债-中国绿色债券全价指数收益率。

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

§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	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
冯小波	基金经理	2020-07-17	-	20年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2002年3月至2003年3月在华泰保险股份有限公司投资管理中心担任债券交易员；2003年6月至2003年9月在平安证券股份有限公司资产管理部担任债券投资经理；2003年10月至2012年7月在兴业银行股份有限公司资金营运中心担任高级副理及债券交易员；2012年8月至2016年11月在中海基金股份有限公司投研中心担任基金经理；2016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

一季度3月与1-2月经济增长呈现较大变化。1-2月份各项经济指标全面超预期，工业生产加快，规模以上工业增加值同比增长7.5%，比上年12月份加快3.2个百分点；投资明显回升，1-2月份固定资产投资同比增长12.2%，比上年全年加快7.3个百分点，其中基础设施投资同比增长8.1%，制造业投资增长20.9%，房地产开发投资增长3.7%。；市场销售继续改善，1-2月份社会消费品零售总额同比增长6.7%，比上年12月份加快5个百分点。从国际收支看，1-2月份，货物进出口总额增长13.3%，其中，出口增长13.6%，进口增长12.9%，贸易顺差7388亿元，同比增长16.3%。1-2月份居民消费价格同比上涨0.9%，1-2月份全国城镇调查失业率平均为5.4%。从1-2月份经济数据来看，工业增加值、固定资产投资等数据全面超预期，工业增加值和制造业投资超预期主要受益于外围持续复苏、原材料供应改善；固定资产投资则主要是基建投资和保障房投资拉动，主要是财政或准财政靠前发力。3月份国内多地出现聚集性疫情，加之国际地缘政治不稳定因素显著增加，我国企业生产经营活动受到一定影响。3月份，制造业PMI指数为49.5%,较上月低0.7,PMI指数降至临界点以下，表明我国经济总体景气水平有所回落。

报告期内债券市场总体较为平稳，10年国债收益率窄幅波动，1月份受降息预期推动，国债收益率快速下行至2.68%，春节后，降息预期落空，10年国债收益率持续抬升，最高升至2.85%，季度末收盘于2.79%，与2021年底基本持平。1年国股存单利率在2.41%-2.62%之间波动，1月下旬最低降至2.41%，3月末成交在2.60附近。

本组合报告期内均衡配置了5年以内的金融债，组合久期和杠杆率保持基本稳定。下一阶段，本组合将维持中短久期操作，并根据市场情况灵活调整组合久期和杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业绿色纯债一年定开债券A基金份额净值为1.0351元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为0.25%；截至报告期末兴业绿色纯债一年定开债券C基金份额净值为1.0360元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.20%，同期业绩比较基准收益率为0.25%。

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	1,611,639,633.44	99.74
	其中：债券	1,611,639,633.44	99.74
	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	4,241,618.10	0.26
8	其他资产	9,268.54	0.00
9	合计	1,615,890,520.08	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	9,982,290.41	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,428,512,181.38	105.40
	其中：政策性金融债	1,337,465,104.12	98.69
4	企业债券	173,145,161.65	12.78

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	1,611,639,633.44	118.92

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	210406	21农发06	3,600,000	368,368,471.23	27.18
2	200407	20农发07	2,000,000	205,687,342.47	15.18
3	210403	21农发03	1,500,000	152,765,136.99	11.27
4	200408	20农发08	1,400,000	145,496,246.58	10.74
5	092218001	22农发清发01	1,000,000	99,752,547.95	7.36

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 报告期内基金投资的前十名证券不存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	9,268.54
2	应收证券清算款	-
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	9,268.54

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

	兴业绿色纯债一年定开债券A	兴业绿色纯债一年定开债券C
报告期期初基金份额总额	1,309,182,033.19	176,226.87
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	1,309,182,033.19	176,226.87

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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	20220101-20220331	983,863,636.36	-	-	983,863,636.36	75.14%
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

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绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业绿色纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业绿色纯债一年定期开放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

2022年04月22日