

---

# 兴业致远混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至09月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 兴业致远混合   |
| 基金主代码      | 015911   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022年11月29日  |
| 报告期末基金份额总额 | 69,085,228.90份   |
| 投资目标       | 本基金在控制风险的前提下，通过对企业基本面进行系统及深入的研究，持续挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | <p>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。</p> <p>（1）大类资产配置策略；（2）股票投资策略；（3）债券类资产投资策略；（4）可转换债券投资策略；（5）可交换债券投资策略；（6）资产支持证券投资策略；（7）证券公司短期公司债券投资策略；（8）股指期货投资策略。</p> |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数收益率*75%+中债综合全价指数收益率*25%   |

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
| 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           | 招商银行股份有限公司                                  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 兴业致远混合A                                     | 兴业致远混合C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 015911                                      | 015912         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 40,056,011.72份                              | 29,029,217.18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(2024年07月01日 - 2024年09月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 兴业致远混合A                        | 兴业致远混合C       |
| 1.本期已实现收益      | -2,648,173.60                  | -1,992,015.77 |
| 2.本期利润         | 3,635,315.39                   | 2,536,642.69  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0902                         | 0.0846        |
| 4.期末基金资产净值     | 36,629,567.39                  | 26,297,877.70 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9145                         | 0.9059        |

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

兴业致远混合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 | 11.08% | 1.75%     | 12.07%     | 1.17%         | -0.99% | 0.58% |
| 过去六个月 | 9.76%  | 1.40%     | 10.59%     | 0.93%         | -0.83% | 0.47% |

|            |        |       |       |       |         |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去一年       | -0.15% | 1.22% | 7.84% | 0.82% | -7.99%  | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.55% | 1.04% | 7.34% | 0.75% | -15.89% | 0.29% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*75%+中债综合全价指数收益率\*25%。

### 兴业致远混合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      | 10.94% | 1.75%     | 12.07%     | 1.17%         | -1.13%  | 0.58% |
| 过去六个月      | 9.47%  | 1.40%     | 10.59%     | 0.93%         | -1.12%  | 0.47% |
| 过去一年       | -0.66% | 1.22%     | 7.84%      | 0.82%         | -8.50%  | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.41% | 1.04%     | 7.34%      | 0.75%         | -16.75% | 0.29% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*75%+中债综合全价指数收益率\*25%。

### 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

兴业致远混合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

(2022年11月29日-2024年09月30日)



注：本基金基金合同于 2022 年 11 月 29 日生效，根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

兴业致远混合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：本基金基金合同于 2022 年 11 月 29 日生效，根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## §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 |        |   |
| 邹慧 | 权益投资部总经理、基金经理 | 2022-11-29  | -    | 20年    | 中国籍，邹慧先生，复旦大学金融学专业硕士研究生。2004年9月至2005年10月，在湘财证券股份有限公司研究部担任研究员；2005年10月至2006年7月，在金信证券研究部担任研究员；2006年7月至2007年1月在长江证券股份有限公司研究部担任研究员；2007年1月至2011年6月，在东方证券股份有限公司研究部担任 |

|     |      |            |   |    |   |
|-----|------|------------|---|----|---|
|     |      |            |   |    | 研究员；2011年7月至2012年8月，在浙商证券股份有限公司投资部任投资经理；2012年9月至2017年5月，在东方证券股份有限公司投资部任首席策略分析师；2017年5月至2018年3月，在东方证券股份有限公司股权投资部任投资总监；2018年3月加入兴业基金管理有限公司，现任权益投资部总经理、基金经理。 |
| 陈楷月 | 基金经理 | 2023-12-19 | - | 5年 | 中国籍，硕士学历，具有证券投资基金从业资格。历任上海国际创投股权投资基金管理有限公司投资经理，APAX RECREATION LIMITED.(川力文娱) 投资经理。2018年11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《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

三季度初，国内外偏弱的基本面数据加剧市场对经济增长放缓的担忧，整体偏谨慎，市场活跃度不高，成交额低迷，大盘震荡下跌，上证指数一度跌破2700点，后续在美联储降息50BP，以及9月末央行、金融监管局、证监会出台的关于地产与资本市场等一系列利好政策的催化下，市场情绪扭转，上证指数大幅放量普涨。

政策基调反转，本轮行情可能是由于政策向好预期带来的无风险利率下降和风险偏好上升带来的行情。从流动性来看，在决策层和金融监管部门释放的积极信号下，新设资本市场货币政策工具、被动指数基金、保险增量资金、散户资金、外资回补等各类场外资金密集进场。但如果短期涨幅过大，可能出现阶段性震荡加剧的情况。而且本轮行情很大程度上或与财政发力有关系，后续的财政政策能否如期落地，是后续市场上行高度的关键。

报告期内本基金保持中高仓位，整体配置较为均衡，行业配置以电子，计算机，汽车，军工，机械为主，关注细分行业景气度趋势，估值水平，通过风险收益比动态调整组合，随着市场流动性向好，后续拟增配更受益于风险偏好提升的成长板块。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业致远混合A基金份额净值为0.9145元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.08%，同期业绩比较基准收益率为12.07%；截至报告期末兴业致远混合C基金份额净值为0.9059元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.94%，同期业绩比较基准收益率为12.07%。

### 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  | 53,856,087.95 | 84.95         |
|    | 其中：股票 | 53,856,087.95 | 84.95         |
| 2  | 基金投资  | -             | -             |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 3,369,864.66  | 5.32   |
|   | 其中：债券             | 3,369,864.66  | 5.32   |
|   | 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          | -657.81       | 0.00   |
|   | 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      | 3,210,523.47  | 5.06   |
| 8 | 其他资产              | 2,960,893.78  | 4.67   |
| 9 | 合计                | 63,396,712.05 | 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              | 1,940,960.00  | 3.08         |
| C  | 制造业              | 38,904,520.06 | 61.82        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 571,500.00    | 0.91         |
| E  | 建筑业              | 1,903,563.00  | 3.03         |
| F  | 批发和零售业           | 1,003,428.00  | 1.59         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,062,352.00  | 1.69         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,103,366.89  | 8.11         |
| J  | 金融业              | 2,353,453.00  | 3.74         |
| 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 | 1,012,945.00  | 1.61  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 53,856,087.95 | 85.58 |

### 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  | 688041 | 海光信息 | 24,541 | 2,534,594.48 | 4.03         |
| 2  | 002179 | 中航光电 | 44,500 | 1,937,530.00 | 3.08         |
| 3  | 002050 | 三花智控 | 66,300 | 1,579,929.00 | 2.51         |
| 4  | 002594 | 比亚迪  | 4,700  | 1,444,357.00 | 2.30         |
| 5  | 603193 | 润本股份 | 60,200 | 1,411,088.00 | 2.24         |
| 6  | 300699 | 光威复材 | 42,100 | 1,385,932.00 | 2.20         |
| 7  | 003000 | 劲仔食品 | 96,200 | 1,327,560.00 | 2.11         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 30,500 | 1,325,530.00 | 2.11         |
| 9  | 603508 | 思维列控 | 60,500 | 1,304,380.00 | 2.07         |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 16,600 | 1,262,596.00 | 2.01         |

### 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      | 3,369,864.66 | 5.36         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 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 | 3,369,864.66 | 5.36 |
|----|----|--------------|------|

### 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  | 019727 | 23国债24 | 21,000 | 2,146,384.11 | 3.41         |
| 2  | 019693 | 22国债28 | 12,000 | 1,223,480.55 | 1.94         |

**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

本基金报告期内未投资国债期货。

### 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：光威复材：公司于2024年4月29日收到来自深圳证券交易所关于公司披露的《关于调整公司2022年限制性股票激励计划公司层面业**

绩效考核指标并修订相关文件的公告》的关注函，公司已经对相关问题进行回复。除此之外，报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未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   | 36,654.80    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,917,719.13 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 6,519.85     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 2,960,893.78 |

### 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

|                               | 兴业致远混合A       | 兴业致远混合C       |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 40,509,971.84 | 30,861,771.63 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 150,964.91    | 8,371.59      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 604,925.03    | 1,840,926.04  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 40,056,011.72 | 29,029,217.18 |

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              | 20240701-20240930      | 18,149,806.39 | -    | -    | 18,149,806.39 | 26.27% |

#### 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。

### 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致远混合型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业致远混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业致远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

2024年10月25日