
兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金
(原兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金转型)

2020年第1季度报告

2020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:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2020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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月16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。

原兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金报告期自2020年1月1日起至2月18日止，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金报告期自2020年2月19日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

转型后

基金简称	兴业纯债6个月定开债券
基金主代码	005988
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2020年02月19日
报告期末基金份额总额	599,999,949.39份
投资目标	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，通过积极主动的投资管理，在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，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、利率预期策略、信用债券投资策略、收益率利差策略、属类配置策略、个券选择策略、资产支持证券的投资策略、证券公司短期公司债投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。 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	中国债券综合全价指数收益率	
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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业纯债6个月定开债券A	兴业纯债6个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	005988	005989
报告期末下属分级基金的份额总额	599,997,216.30份	2,733.09份

转型前

基金简称	兴业纯债一年定开债券
基金主代码	005988
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年06月27日
报告期末基金份额总额	599,999,949.39份
投资目标	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，通过积极主动的投资管理，在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>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、利率预期策略、信用债券投资策略、收益率利差策略、属类配置策略、个券选择策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券的投资策略、证券公司短期公司债投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率

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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业纯债一年定开债券A	兴业纯债一年定开债券C
下属分级基金的交易代码	005988	005989
报告期末下属分级基金的份额总额	599,997,216.30份	2,733.09份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年02月19日 - 2020年03月31日)	
	兴业纯债6个月定开债券A	兴业纯债6个月定开债券C
1. 本期已实现收益	6,424,315.84	27.81
2. 本期利润	8,960,388.93	39.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0149	0.0144
4. 期末基金资产净值	642,333,759.12	2,906.62
5. 期末基金份额净值	1.0706	1.0635

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、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同于2月19日同时生效。截至本报告期末，本基金转型不满一年。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年01月01日 - 2020年02月18日)	
	兴业纯债一年定开债券A	兴业纯债一年定开债券C

1. 本期已实现收益	5,991,997.31	25.65
2. 本期利润	7,628,231.27	33.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0121
4. 期末基金资产净值	633,373,370.19	2,867.36
5. 期末基金份额净值	1.0556	1.0491

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、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金的报告期自2020年1月1日至2020年2月18日止。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期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

兴业纯债6个月定开债券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
自基金合同生效起至今	1.42%	0.10%	0.70%	0.08%	0.72%	0.02%

兴业纯债6个月定开债券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
自基金合同生效起至今	1.37%	0.10%	0.70%	0.08%	0.67%	0.02%

注：1、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同于2月19日同时生效。

2、“自基金合同生效日起至今”期间为2020年2月19日至2019年3月31日。

3、基金转型前后业绩比较基准均为中国债券综合全价指数收益率。

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

兴业纯债6个月定开债券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



兴业纯债6个月定开债券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、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同于2月19日同时生效。

2、基金转型前后业绩比较基准均为中国债券综合全价指数收益率。

3、本基金合同自2020年2月19日起生效，截止报告期末本基金基金合同生效未满1年。

4、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。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期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	1.22%	0.10%	1.14%	0.11%	0.08%	-0.01%

兴业纯债一年定开债券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	1.17%	0.10%	1.14%	0.11%	0.03%	-0.01%

注：1、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同于2月19日同时生效。

2、“过去三个月”期间为2020年1月1日至2020年2月18日。

3、基金转型前后业绩比较基准均为中国债券综合全价指数收益率。

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

兴业纯债一年定开债券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



兴业纯债一年定开债券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、2020年2月19日起“兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金”转型为“兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金”，兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金的基金合同于2月19日同时生效。

2、本基金于2020年2月19日转型，“过去三个月”期间为2020年1月1日至2020年2月18日。

3、基金转型前后业绩比较基准均为中国债券综合全价指数收益率。

§ 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	2018-08-07	-	9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

报告期内，组合主要配置利率债，灵活调整组合久期和杠杆水平。一季度利率震荡下行，利率债表现优于信用债。新冠疫情在全球蔓延，多国加入降息队伍，中国央行维持银行间流动性合理充裕，通过下调公开市场逆回购利率、MLF利率、下调存款准备金率等降低实体经济融资成本，加强逆周期调控。下一阶段，将关注经济增长和通胀水平，稳中求进，在警惕流动性风险和信用风险的前提下，以利率债作为主要配置品种，灵活调整久期与杠杆水平，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2020年2月18日，兴业纯债一年定开债券A基金份额净值为1.0556元；自2020年1月1日至2020年2月18日本基金份额净值增长率为1.22%，同期业绩比较基准收益率为1.14%。

截至2020年2月18日，兴业纯债一年定开债券C基金份额净值为1.0491元；自2020年1月1日至2020年2月18日本基金份额净值增长率为1.17%，同期业绩比较基准收益率为1.14%。

截至2020年3月31日，兴业纯债6个月定开债券A基金份额净值为1.0706元；自2020年2月19日至2020年3月31日本基金份额净值增长率为1.42%，同期业绩比较基准收益率为0.70%。

截至2020年3月31日，兴业纯债6个月定开债券C基金份额净值为1.0635元；自2020年2月19日至2020年3月31日本基金份额净值增长率为1.37%，同期业绩比较基准收益率为0.70%。

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(转型后)

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	761,449,091.50	92.77
	其中：债券	761,449,091.50	92.77
	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	12,486,981.63	1.52
8	其他资产	46,830,635.28	5.71
9	合计	820,766,708.41	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	712,590,091.50	110.94
	其中：政策性金融债	682,255,091.50	106.21
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	48,859,000.00	7.61
9	其他	-	-
10	合计	761,449,091.50	118.54

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	160418	16农发18	1,400,000	144,480,000.00	22.49
2	150314	15进出14	1,300,000	136,461,000.00	21.24
3	018006	国开1702	1,210,730	125,371,091.50	19.52
4	160210	16国开10	600,000	60,726,000.00	9.45
5	160417	16农发17	300,000	30,969,000.00	4.82

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 2019年9月2日，渤海银行北京分行受到北京银保监局罚款120万元，违法违规事实包括：理财资金违规用于房地产开发企业缴交土地出让价款、违规投向“四证”不全的房地产项目、为保险公司股东违规增资提供融资。2019年10月30日，渤海银行上海分行受到上海监管局责令改正，并处罚款共计250万元，违法违规事实包括：对某同业资金违规投向“四证”不全的房地产项目合规性审查未尽职，违规对外实质承担某同业业务的风险责任，该分行部分贷款分类不准确。2019年12月30日，渤海银行绍兴分行受到中国银保监会绍兴监管分局罚款人民币100万元，违法违规事实包括：虚增存款。2019年12月31日，渤海银行福州分行受到中国银保监会福建监管局罚款人民币180万元，违法违规事实包括：未按进度发放房地产开发贷款或授信、授信不尽职导致产生大额不良、违规办理员工个人消费贷款。

上述证券经信用研究员出具相关意见，并进入债券入库审批流程，基金管理人经过研究判断，并按照相关投资决策流程投资了该债券。除此之外，本基金投资决策程序均

符合相关法律法规要求，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者报告编制日前一年受到公开谴责、处罚以至于影响投资决策流程的情形。

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	28,320.54
2	应收证券清算款	28,641,711.80
3	应收股利	-
4	应收利息	18,160,602.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	46,830,635.28

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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	679,004,161.80	96.10
	其中：债券	679,004,161.80	96.10
	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	13,847,383.36	1.96
8	其他资产	13,704,322.98	1.94
9	合计	706,555,868.14	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	23,889,307.80	3.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	548,240,854.00	86.56
	其中：政策性金融债	477,331,854.00	75.36
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	106,874,000.00	16.87
9	其他	-	-
10	合计	679,004,161.80	107.20

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	018006	国开1702	1,279,260	131,635,854.00	20.78
2	160210	16国开10	700,000	69,678,000.	11.00

				00	
3	111912128	19北京银行C D128	600,000	58,374,000. 00	9.22
4	160418	16农发18	500,000	50,875,000. 00	8.03
5	111914078	19江苏银行C D078	500,000	48,500,000. 00	7.66

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 2019年12月27日，交通银行受到中国银保监会罚款150万元，违法违规事实包括：授信审批不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任。

上述证券经信用研究员出具相关意见，并进入债券入库审批流程，基金管理人经过研究判断，并按照相关投资决策流程投资了该债券。除此之外，本基金投资决策程序均符合相关法律法规要求，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者报告编制日前一年受到公开谴责、处罚以至于影响投资决策流程的情形。

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	25,536.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,678,786.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,704,322.98

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(转型后)

单位：份

	兴业纯债6个月定开债券A	兴业纯债6个月定开债券C
基金合同生效日(2020年02月19日)基金份额总额	599,997,216.30	2,733.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

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	599,997,216.30	2,733.09

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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	兴业纯债一年定开债券 A	兴业纯债一年定开债券 C
报告期期初基金份额总额	599,997,315.70	2,745.09
报告期期间基金总申购份额	0.00	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	99.40	12.00
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	599,997,216.30	2,733.09

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(转型后)

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

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	20200101-20200331	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	33.33%
	2	20200101-20200331	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	33.33%
	3	20200101-20200331	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	33.33%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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

2020年1月14日兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过了《关于兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金转型为兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金有关事项的议案》。自2020年2月19日起，《兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》失效，《兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效，兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金正式转型为兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业纯债6个月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

2020年04月22日