

# 兴银合盈债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 18 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 17 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

转型后：

基金简称	兴银合盈债券	
场内简称	-	
交易代码	001783	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 2 月 27 日	
报告期末基金份额总额	375,492.72 份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴银合盈债券 A	兴银合盈债券 C

下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001783	001784
报告期末下属分级基金的份额总额	358,164.67 份	17,328.05 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

转型前：

基金简称	兴银双月理财(转型前)	
场内简称	-	
交易代码	001783	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 28 日	
报告期末基金份额总额	349,761.73 份	
投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 180 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金是理财债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴银双月理财 A	兴银双月理财 B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	001783	001784
报告期末下属分级基金的份额总额	349,761.73 份	0.00 份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上。	风险收益特征同上。

### §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（2019 年 2 月 27 日 — 2019 年 3 月 31 日）	
	兴银合盈债券 A	兴银合盈债券 C
1. 本期已实现收益	522.67	81.80

2. 本期利润	522.67	81.80
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0014	0.0016
4. 期末基金资产净值	358,683.00	17,372.43
5. 期末基金份额净值	1.0014	1.0026

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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日—2019年2月26日）	
	兴银双月理财 A	兴银双月理财 B
1. 本期已实现收益	840.20	-
2. 本期利润	840.20	-
3. 期末基金资产净值	349,761.73	-

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（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

##### 兴银合盈债券 A

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	0.14%	0.01%	0.03%	0.03%	0.11%	-0.02%

##### 兴银合盈债券 C

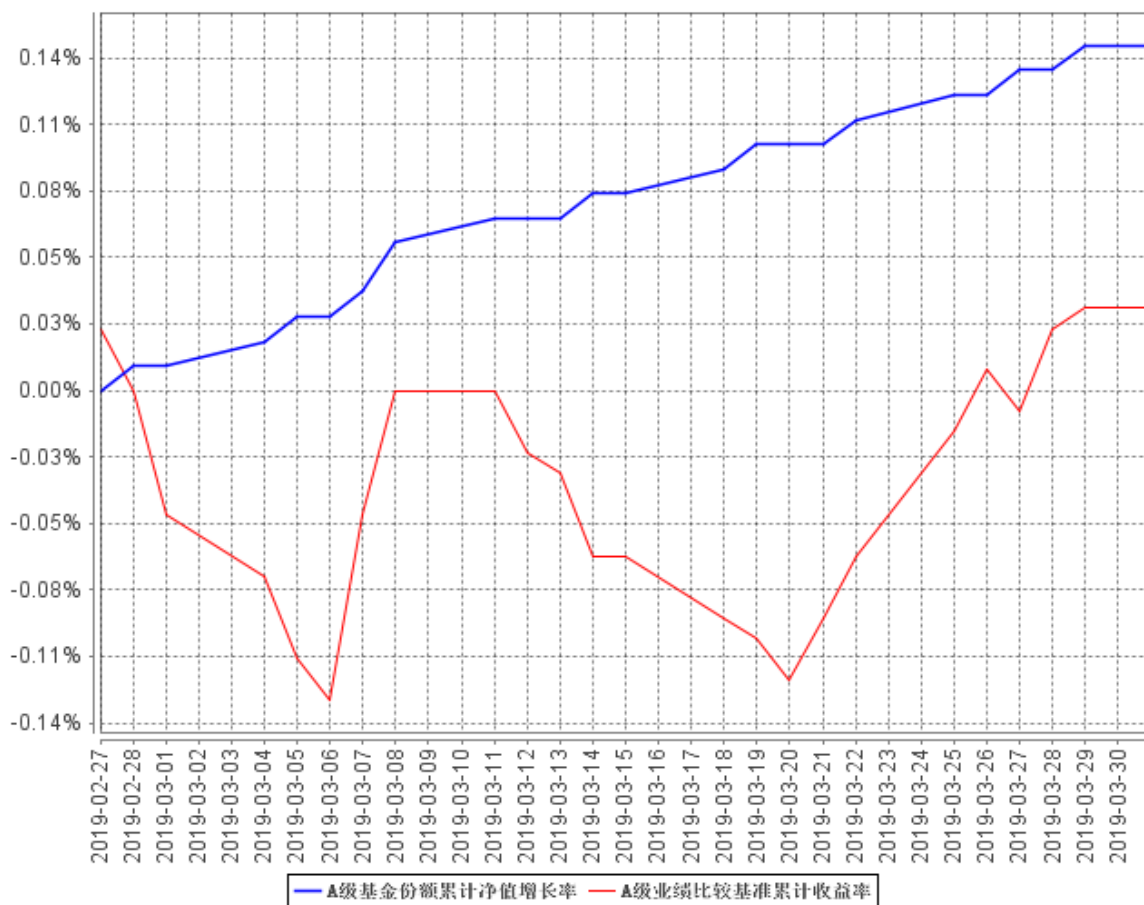
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.26%	0.03%	0.03%	0.03%	0.23%	0.00%

注：1、本基金于 2019 年 2 月 27 日由短期理财型基金转换为债券型基金；

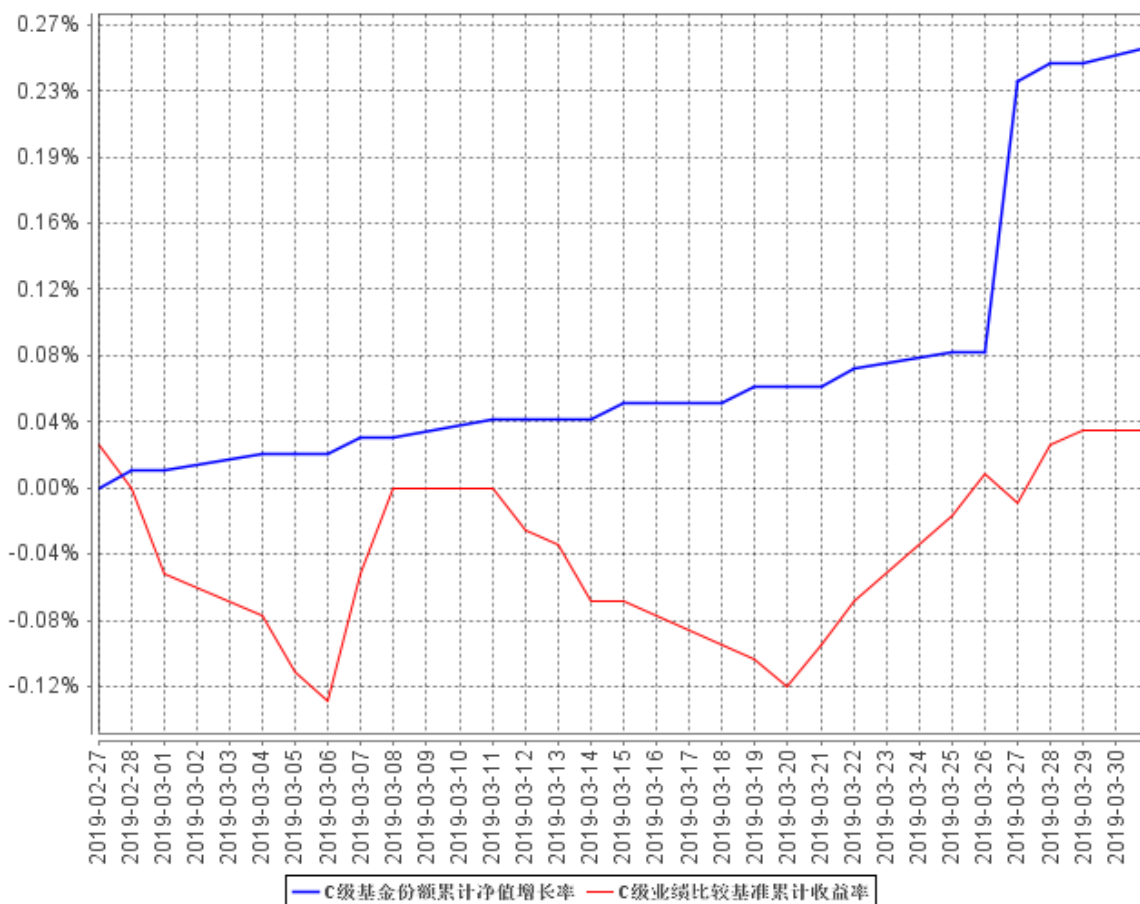
2、转型后的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2019 年 2 月 27 日由短期理财型基金转换为债券型基金；

2、转型后的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴银双月理财 A

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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	0.23%	0.00%	0.21%	0.00%	0.02%	0.00%

注：1、本基金成立于 2017 年 9 月 28 日，于 2019 年 2 月 27 日转型为债券型基金；

2、转型前业绩比较基准=七天通知存款税后利率。

兴银双月理财 B

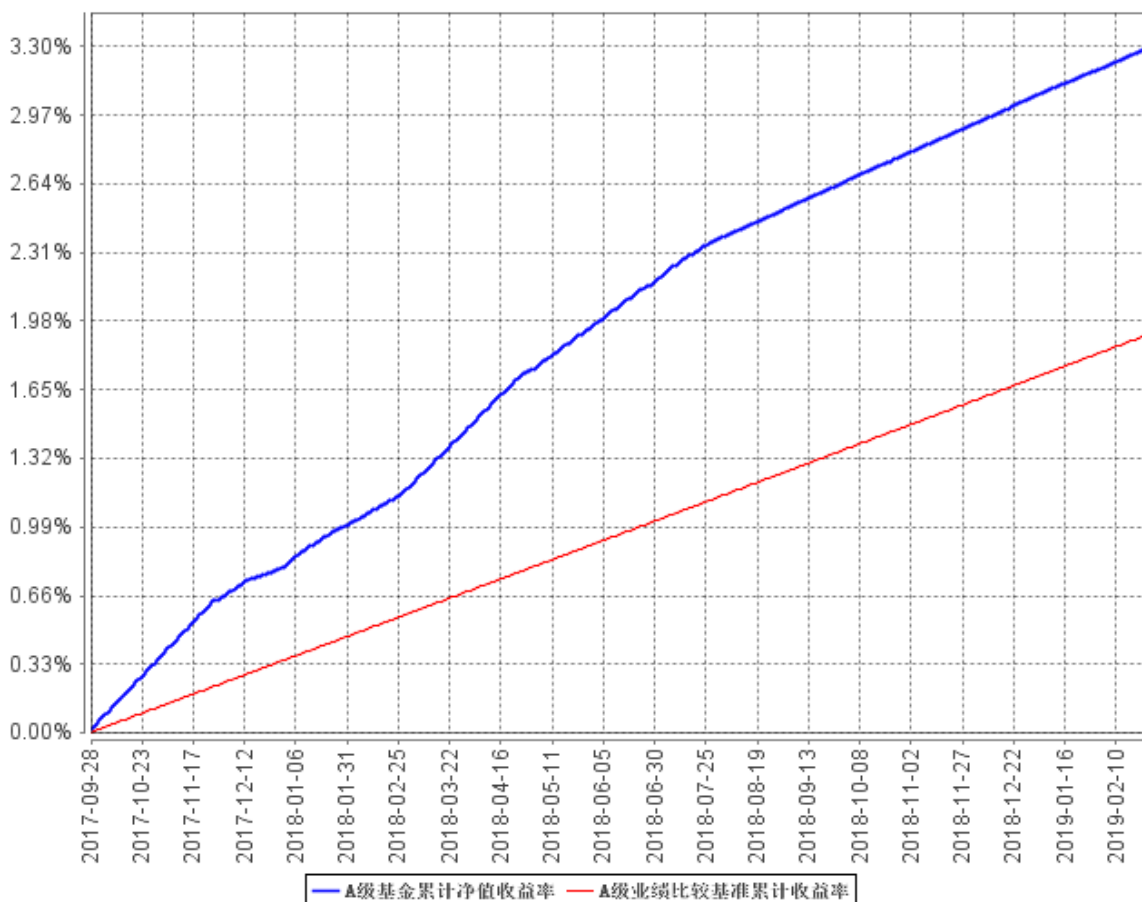
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

注：1、本基金成立于 2017 年 9 月 28 日，于 2019 年 2 月 27 日转型为债券型基金；

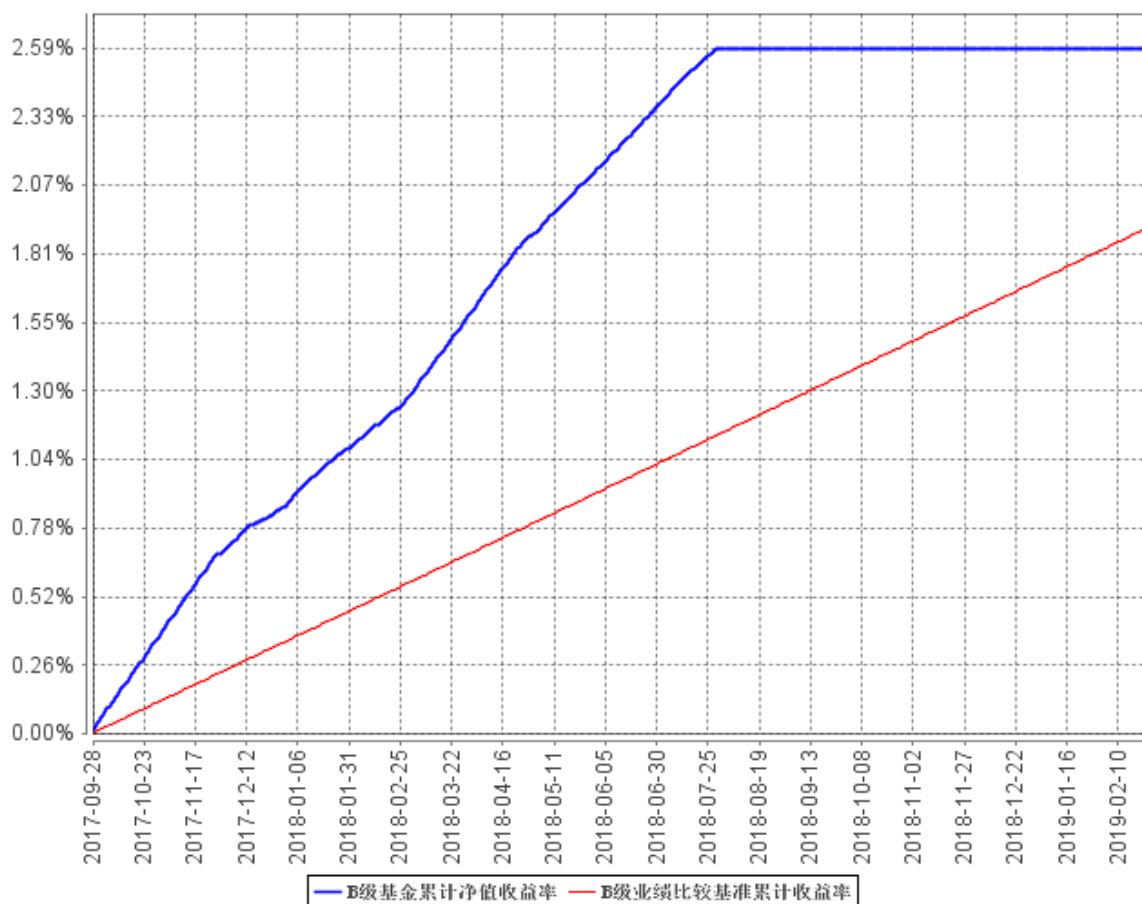
2、转型前业绩比较基准=七天通知存款税后利率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金成立于 2017 年 9 月 28 日，于 2019 年 2 月 27 日转型为债券型基金；

2、转型前业绩比较基准=七天通知存款税后利率。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
洪木妹	本基金的基金经理、公司副总经理兼固定收益部总经理	2017年9月28日	-	11年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），拥有 11 年证券、基金行业工作经验。曾任职于华福证券有限责任公司投资自营部和资产管理总部，从事宏观经济研究和投资工作，现任兴银基金



					管理有限责任公司副总经理兼固定收益部总经理，自 2015 年 11 月起担任兴银瑞益纯债债券型证券投资基金基金经理、自 2017 年 9 月起担任兴银双月理财债券型证券投资基金（兴银合盈债券型证券投资基金）基金经理、自 2019 年 3 月起担任兴银汇福定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
李文程	基金经理	2018 年 4 月 11 日	-	7 年	硕士研究生，拥有 7 年证券、基金行业工作经验。曾任职于中国人保资产管理有限公司、上海海通证券资产管理有限公司。现任兴银基金管理有限责任公司基金经理。自 2018 年 4 月起担任兴银货币市场基金、兴银现金添利货币市场基金、兴银双月理财债券型证券投资基金（兴银合盈债券型证券投资基金）基金经理。自 2018 年 12 月起担任兴银现金收益货币市场基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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。

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
洪木妹	本基金的基金经理、公司副总经理兼固定收益	2017 年 9 月 28 日	-	11 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），拥有 11 年证券、基金行业工作经验。曾任职于华福

	部总经理				证券有限责任公司投资自营部和资产管理总部，从事宏观经济研究和投资工作，现任兴银基金管理有限责任公司副总经理兼固定收益部总经理，自 2015 年 11 月起担任兴银瑞益纯债债券型证券投资基金基金经理、自 2017 年 9 月起担任兴银双月理财债券型证券投资基金（兴银合盈债券型证券投资基金）基金经理、自 2019 年 3 月起担任兴银汇福定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
李文程	基金经理	2018 年 4 月 11 日	-	7 年	硕士研究生，拥有 7 年证券、基金行业工作经验。曾任职于中国人保资产管理有限公司、上海海通证券资产管理有限公司。现任兴银基金管理有限责任公司基金经理。自 2018 年 4 月起担任兴银货币市场基金、兴银现金添利货币市场基金、兴银双月理财债券型证券投资基金（兴银合盈债券型证券投资基金）基金经理。自 2018 年 12 月起担任兴银现金收益货币市场基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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》等有关法律法规的规定，基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运

用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或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

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度流动性整体延续宽松态势。央行于 2019 年 1 月 15 日和 1 月 25 日分别下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点；于 2019 年 1 月 23 日开展定向中期借贷便利（TMLF）操作；于 2019 年 1 月 24 日创设央票互换工具（CBS）；于 2019 年 1 月 25 日开展了普惠金融定向降准动态考核。以上操作使得银行间利率水平中枢比照去年进一步降低，个别时间点向下突破利率走廊下限。进入三月份，为抑制票据套利，央行较长时间暂停公开市场操作，利率中枢有所抬升。存单方面，整体存单发行节奏平缓，发行利率在低水平徘徊。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前（兴银双月理财）：

自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 26 日，兴银双月理财 A 的基金份额净值收益率为 0.23%，兴银双月理财 B 的基金份额净值收益率为 0%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

转型后（兴银合盈债券）：

自 2019 年 2 月 27 日至本报告期末，兴银合盈债券 A 基金份额净值为 1.0014 元，基金份额净值增长率为 0.14%；兴银合盈债券 C 基金份额净值为 1.0026 元，基金份额净值增长率为 0.26%；同期业绩比较基准收益率为 0.03%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前（兴银双月理财）：

本基金本报告期内存在连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，日期范围：2019 年 1 月 1 日-2019 年 2 月 26 日；

存在基金资产净值连续 20 个工作日以上低于五千万元的情形，日期范围：2019 年 1 月 1 日-2019 年 2 月 26 日。

转型后（兴银合盈债券）：

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

存在基金资产净值连续 20 个工作日以上低于五千万元的情形，日期范围：2019 年 2 月 27 日-2019 年 3 月 31 日。

## §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	-	-
	其中：债券	-	-
	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	414,622.76	99.94
8	其他资产	239.97	0.06
9	合计	414,862.73	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.9.2 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。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，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。

**5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金未进行股票投资，不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

**5.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	239.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239.97

**5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

**5.10.5 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。

**5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	387,268.63	99.68
4	其他资产	1,233.78	0.32

5	合计	388,502.41	100.00
---	----	------------	--------

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	0
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	0
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期

本报告期内，本基金投资组合平均剩余存续期未出现超过 120 天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过	-	-

	397 天的浮动利率债		
4	90 天(含)-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	-	-

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期
----	------	---------	----	-----

本报告期内，本基金投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	-	-
	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	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-
10	剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债券	-	-

本基金报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	---------	--------------

本基金报告期末未持有债券。

#### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0



报告期内偏离度的最高值	0.00%
报告期内偏离度的最低值	0.00%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.00%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

本报告期内本基金未存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
----	------	-----	----	-----

本报告期内本基金未存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	期末市值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”计价，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,233.78
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,233.78

#### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	兴银合盈债券 A	兴银合盈债券 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 27 日） 基金份额总额	349,775.28	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	35,404.58	134,483.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	27,015.19	117,155.66
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	358,164.67	17,328.05

### §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	兴银双月理财 A	兴银双月理财 B
报告期期初基金份额总额	361,505.77	-
报告期期间基金总申购份额	888.33	-
报告期期间基金总赎回份额	12,632.37	-
报告期期末基金份额总额	349,761.73	-

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

## 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
合计			-	-	

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（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计			-	-	

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	20190101-20190331	301,928.82	760.02	0.00	302,688.84	80.61%
个人	1	20190314-20190326	0.00	99,960.02	99,960.02	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延缓支付的风险 上述高占比投资者大额赎回时易构成本基金巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 上述高占比投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p>							

### (3) 基金规模过小导致的风险

上述高占比投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2019 年 2 月 27 日起，《兴银合盈债券型证券投资基金基金合同》生效，《兴银双月理财债券型证券投资基金基金合同》同时失效，兴银双月理财债券型证券投资基金正式变更为兴银合盈债券型证券投资基金，本基金基金合同当事人将按照《兴银合盈债券型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

## §9 备查文件目录

### 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴银双月理财债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《兴银双月理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴银双月理财债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《兴银双月理财债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、兴银双月理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议文件；
- 6、《兴银合盈债券型证券投资基金基金合同》
- 7、《兴银合盈债券型证券投资基金招募说明书》
- 8、《兴银合盈债券型证券投资基金托管协议》
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司  
2019 年 4 月 18 日