
兴业中短债债券型证券投资基金
（原兴业14天理财债券型证券投资基金转型）

2020年第4季度报告

2020年12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：2021年01月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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1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。

原兴业14天理财债券型证券投资基金报告期自2020年10月1日起至12月14日止，兴业中短债债券型证券投资基金报告期自2020年12月15日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

转型后

基金简称	兴业中短债债券
基金主代码	003430
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2020年12月15日
报告期末基金份额总额	50,097,879.82份
投资目标	本基金主要投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，融合规范化的基本面研究和严谨的信用分析，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定类属资产配置和债券组合久期、期限结构；在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上精选投资标的。本基金采用的主要策略包括：1、久期配置策略；2、期限结构配置策略；3、类属配置策略；4、个券精选策略；5、息差策略；6、

	信用债投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、资产支持证券投资策略；9、信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，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	兴业中短债债券A	兴业中短债债券C
下属分级基金的交易代码	003431	003430
报告期末下属分级基金的份额总额	44,900,314.72份	5,197,565.10份

转型前

基金简称	兴业14天理财	
基金主代码	003430	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月24日	
报告期末基金份额总额	205,551,977.86份	
投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资组合管理。	
业绩比较基准	中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率（税后）。	
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金，高于货币市场基金。	
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14天理财A	兴业14天理财B
下属分级基金的交易代码	003430	003431

报告期末下属分级基金的份额总额	5,302,212.67份	200,249,765.19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12月15日 - 2020年12月31日)	
	兴业中短债债券A	兴业中短债债券C
1. 本期已实现收益	457,566.28	6,043.87
2. 本期利润	463,759.84	16,291.45
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0030	0.0031
4. 期末基金资产净值	45,039,832.93	5,213,742.70
5. 期末基金份额净值	1.0031	1.0031

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、自2020年12月15日起，原兴业14天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。本基金基金合同于2020年12月15日生效，本报告期不是完整报告期。

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10月01日 - 2020年12月14日)	
	兴业14天理财A	兴业14天理财B
1. 本期已实现收益	38,687.43	14,391,402.29
2. 本期利润	38,687.43	14,391,402.29
3. 期末基金资产净值	5,302,212.67	200,249,765.19

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

2、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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、自2020年12月15日起，原兴业14天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现(转型后)

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

兴业中短债债券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	0.31%	0.03%	0.45%	0.02%	-0.14%	0.01%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

2、自 2020 年 12 月 15 日起，原兴业 14 天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。本基金基金合同于 2020 年 12 月 15 日生效，本报告期不是完整报告期。“自基金合同生效起至今”期间为 2020 年 12 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日。

兴业中短债债券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	0.31%	0.02%	0.45%	0.02%	-0.14%	0.00%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

2、自 2020 年 12 月 15 日起，原兴业 14 天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。本基金基金合同于 2020 年 12 月 15 日生效，本报告期不是完整报告期。“自基金合同生效起至今”期间为 2020 年 12 月 15 日至 2020 年 12 月 31 日。

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



注：1、自 2020 年 12 月 15 日起，原兴业 14 天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。本基金基金合同于 2020 年 12 月 15 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、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。



注：1、自 2020 年 12 月 15 日起，原兴业 14 天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金。本基金基金合同于 2020 年 12 月 15 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、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 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

兴业14天理财A净值表现

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	0.6847%	0.0153%	0.2766%	0.0000%	0.4081%	0.0153%
过去六个月	1.1780%	0.0107%	0.6160%	0.0000%	0.5620%	0.0107%
过去一年	2.5662%	0.0085%	1.2873%	0.0000%	1.2789%	0.0085%
过去三年	9.3569%	0.0053%	3.9873%	0.0000%	5.3696%	0.0053%
自基金合同生效起至今	14.2259%	0.0047%	5.5918%	0.0000%	8.6341%	0.0047%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率（税后）。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

3、本基金于 2020 年 12 月 15 日转型，“过去三个月”期间为 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去六个月”期间为 2020 年 7 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去一年”期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去三年”期间为 2018 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“自基金合同生效起至今”期间为原兴业 14 天理财债券型证券投资基金生效日起至 2020 年 12 月 14 日。

兴业14天理财B净值表现

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	0.6928%	0.0153%	0.2766%	0.0000%	0.4162%	0.0153%
过去六个月	1.1963%	0.0107%	0.6160%	0.0000%	0.5803%	0.0107%
过去一年	2.6052%	0.0085%	1.2873%	0.0000%	1.3179%	0.0085%
过去三年	9.4859%	0.0053%	3.9873%	0.0000%	5.4986%	0.0053%

					6%	3%
自基金合同生效起至今	14.3737%	0.0046%	5.5918%	0.0000%	8.7819%	0.0046%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率（税后）。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

3、本基金于 2020 年 12 月 15 日转型，“过去三个月”期间为 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去六个月”期间为 2020 年 7 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去一年”期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“过去三年”期间为 2018 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 14 日，“自基金合同生效起至今”期间为原兴业 14 天理财债券型证券投资基金生效日起至 2020 年 12 月 14 日。

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





§ 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	2018-05-28	—	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合规守信情况的说明

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

四季度利率先上后下。11月中旬永煤事件对债券市场带来冲击，后续先是有神秘资金投放交易所回购，后是有11月底央行超预期进行MLF操作，12月份央行通过逆回购操作投放大量资金，中短端利率下行明显。短端资金利率DR007以央行7天OMO利率为中枢在[1.5%, 2.6%]区间震荡，1年期国股存单利率一度上行高出MLF利率40bp左右，随后又回落至接近MLF利率，长端10年期国债上行至3.30%附近后回落至3.15%附近。组合在本季度维持较低平均剩余期限和杠杆水平，控制偏离度，并严控信用风险和流动性风险，做好资产负债管理，获取骑乘收益和套息收益。本季度末产品顺利转型成兴业中短债债券型基金。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2020年12月14日，兴业14天理财A基金份额净值为1.0000元；自2020年10月1日至2020年12月14日本基金份额净值收益率为0.6847%，同期业绩比较基准收益率为0.2766%。

截至2020年12月14日，兴业14天理财B基金份额净值为1.0000元；自2020年10月1日至2020年12月14日本基金份额净值收益率为0.6928%，同期业绩比较基准收益率为0.2766%。

截至2020年12月31日，兴业中短债债券A基金份额净值为1.0031元；自2020年12月15日至2020年12月31日本基金份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

截至2020年12月31日，兴业中短债债券C基金份额净值为1.0031元；自2020年12月15日至2020年12月31日本基金份额净值增长率为0.31%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

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(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	29,758,000.00	58.74
	其中：债券	29,758,000.00	58.74
	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	20,448,877.38	40.36
8	其他资产	455,705.99	0.90
9	合计	50,662,583.37	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	9,934,000.00	19.77
2	央行票据	—	—
3	金融债券	19,824,000.00	39.45
	其中：政策性金融债	19,824,000.00	39.45
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	29,758,000.00	59.22

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	190207	19国开07	100,000	10,059,000.00	20.02
2	209955	20贴现国债55	100,000	9,934,000.00	19.77
3	200202	20国开02	100,000	9,765,000.00	19.43

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股指期货。

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股指期货。

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	73,391.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	380,707.30
5	应收申购款	1,607.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	455,705.99

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	固定收益投资	170,644,090.91	82.86
	其中：债券	159,830,090.91	77.61
	资产支持证券	10,814,000.00	5.25
2	买入返售金融资产	10,000,135.00	4.86
	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	22,744,271.69	11.04
4	其他资产	2,542,813.94	1.23
5	合计	205,931,311.54	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.10
	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个交易日融资余额占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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	50

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本基金基金合同，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天。在本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过134天。

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	16.36	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	19.46	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	58.26	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	4.90	—
	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		98.98	—

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

根据本基金基金合同，本基金投资组合的平均剩余存续期不得超过254天。在本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过254天。

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	49,751,794.33	24.20

2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,006,568.55	43.79
	其中：政策性金融债	70,007,572.91	34.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,996,583.73	4.86
6	中期票据	10,075,144.30	4.90
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	159,830,090.91	77.76
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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 (%)
1	160206	16国开06	700,000	70,007,572.91	34.06
2	209955	20贴现国债55	500,000	49,751,794.33	24.20
3	072000245	20海通证券CP008	200,000	19,998,995.64	9.73
4	101800329	18首农MTN001	100,000	10,075,144.30	4.90
5	012001493	20宁波港SCP002	100,000	9,996,583.73	4.86

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	0.1361%
报告期内偏离度的最低值	-0.0015%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0370%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	138473	南链优05	100,000	10,000,000.00	4.86
2	138307	万科12优	100,000	814,000.00	0.40

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	73,391.09
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	2,469,422.85
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	2,542,813.94

§ 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	兴业中短债债券A	兴业中短债债券C
基金合同生效日(2020年12月15日)基金份额总额	200,249,765.19	5,302,212.67

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,900,314.72	63,291.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	200,249,765.19	167,939.31
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	44,900,314.72	5,197,565.10

注：1、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。

2、本基金A类基金份额由原兴业14天理财债券型证券投资基金B类基金份额转型而来，C类基金份额由原兴业14天理财债券型证券投资基金A类基金份额转型而来，基金合同于2020年12月15日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	兴业14天理财A	兴业14天理财B
报告期期初基金份额总额	6,258,909.65	3,398,464,179.84
报告期期间基金总申购份额	38,687.43	214,391,402.29
报告期期间基金总赎回份额	995,384.41	3,412,605,816.94
报告期期末基金份额总额	5,302,212.67	200,249,765.19

注：1、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。

2、自2020年12月15日起，原兴业14天理财债券型证券投资基金转型为兴业中短债债券型证券投资基金，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 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交易明细(转型前)

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	20201207-20201224	0.00	200,249,765.19	200,249,765.19	0.00	0.00%
	2	20201001-20201209	3,186,609,475.23	13,388,913.27	3,199,998,388.50	0.00	0.00%
	3	20201225-20201231	0.00	19,959,081.84	0.00	19,959,081.84	39.84%
	4	20201225-20201230	0.00	9,978,046.10	0.00	9,978,046.10	19.92%
	5	20201225-20201230	0.00	9,978,046.10	0.00	9,978,046.10	19.92%
	6	20201215-20201224	0.00	401,340,579.40	401,340,579.40	0.00	0.00%
	7	20201215-20201209	6,372,917,078.28	27,079,698.72	6,399,996,777.00	0.00	0.00%
	8	20201225-20201231	0.00	19,959,081.84	0.00	19,959,081.84	39.84%
	9	20201225-20201230	0.00	9,978,046.10	0.00	9,978,046.10	19.92%
	10	20201225-20201230	0.00	9,978,046.10	0.00	9,978,046.10	19.92%
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14天理财债券型证券投资基金自2020年10月22日起至2020年11月15日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2020年11月16日表决通过了《关于兴业14天理财债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会决议，本基金修订后的《兴业中短债债券型证券投资基金基金合同》、《兴业中短债债券型证券投资基金托管协议》以及《兴业中短债债券型证券投资基金招募说明书》于2020年12月15日生效。

§ 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14天理财债券型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《兴业中短债债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业中短债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

2021年01月22日