

兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018年06月30日 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 报告送出日期:2018年07月19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...

2 基金产品概况 2.1 基金基本情况 基金简称:兴业聚丰灵活配置混合 基金代码:002668

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

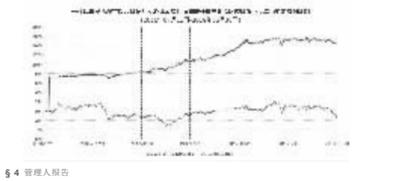
3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期. Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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...

Table with 2 columns: 阶段 and 净值增长率. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

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

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限. Lists the fund manager's details.

1.对基金的聘任基金经理,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...

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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况说明

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 本基金追求绝对收益,依据宏观形势的变化,自上而下动态调整持有的股票和债券比例...

4.5 报告期内基金的业绩表现 报告期内,基金份额净值增长率为-0.52%,同期业绩比较基准收益率为-1.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2018年3月27日起至2018年5月25日止基金份额持有人数量不满二百人,已连续二十个工作日以上。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists the fund's asset composition at the end of the reporting period.

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元). Lists the fund's domestic equity investments by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 5.2.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 10 bonds held by the fund.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists the fund's bond investments by category.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 金额(元). Shows the change in fund assets and liabilities.

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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聚丰灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

本基金自2018年4月1日起至2018年5月28日止基金份额持有人数量不满二百人,已连续二十个工作日以上。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists the fund's asset composition at the end of the reporting period.

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元). Lists the fund's domestic equity investments by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 5.2.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 10 bonds held by the fund.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists the fund's bond investments by category.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 金额(元). Shows the change in fund assets and liabilities.

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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聚优灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

兴业稳天盈货币市场基金

2018年第二季度报告

本基金自2018年9月12日起至2018年9月12日止基金份额持有人数量不满二百人,已连续二十个工作日以上。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists the fund's asset composition at the end of the reporting period.

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元). Lists the fund's domestic equity investments by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 5.2.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 10 bonds held by the fund.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists the fund's bond investments by category.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 金额(元). Shows the change in fund assets and liabilities.

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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稳天盈货币市场基金募集注册的文件

兴业天盈货币市场基金

2018年第二季度报告

本基金自2018年9月12日起至2018年9月12日止基金份额持有人数量不满二百人,已连续二十个工作日以上。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists the fund's asset composition at the end of the reporting period.

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元). Lists the fund's domestic equity investments by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 5.2.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 10 bonds held by the fund.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists the fund's bond investments by category.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 金额(元). Shows the change in fund assets and liabilities.

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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天盈货币市场基金募集注册的文件

兴业天盈货币市场基金

2018年第二季度报告

本基金自2018年9月12日起至2018年9月12日止基金份额持有人数量不满二百人,已连续二十个工作日以上。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元). Lists the fund's asset composition at the end of the reporting period.

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元). Lists the fund's domestic equity investments by industry.

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 5.2.3 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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元). Lists the top 10 stocks held by the fund.

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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 10 bonds held by the fund.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元). Lists the fund's bond investments by category.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists the top 5 bonds held by the fund.

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性及风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 and 金额(元). Shows the change in fund assets and liabilities.

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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天盈货币市场基金募集注册的文件

(二)《兴业天盈货币市场基金募集注册的法律意见书》

(三)《兴业天盈货币市场基金托管协议》

(四)《兴业天盈货币市场基金基金合同》

(五)《兴业天盈货币市场基金招募说明书》

(六)《兴业天盈货币市场基金托管协议》

(七)《兴业天盈货币市场基金基金合同》

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.cb-fund.com.cn 投资者对本报告书如有疑问,可向本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 400095561

兴业基金管理有限公司 二〇一八年七月十九日

兴业天盈货币市场基金 B 兴业天盈货币市场基金 A

Table with 2 columns: 报告期期末基金份额总额, 报告期期末基金资产总额. Shows fund performance metrics.

注:1.申购份额含红利再投、转换入份额,总额扣除转换转出份额。

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基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

Table with 5 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的区间, 期初份额, 期末份额. Lists investors holding over 20% of shares.

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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天盈货币市场基金募集注册的文件

(二)《兴业天盈货币市场基金募集注册的法律意见书》

(三)《兴业天盈货币市场基金托管协议》