

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
基金管理人的董事及秉承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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 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。

本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

§ 3 基金基本情况

基金简称	兴业聚宝灵活配置混合
基金代码	002330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016-02-03
报告期末基金份额总额	50,314,948.18份

本基金通过精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力求实现持续稳定的投资回报。

本基金通过投资于市场流动性较高的金融工具，使基金在保持总体流动性相对稳定的前提下，优化投资组合，降低风险。

业绩比较基准 *30%*沪深 300 指数收益率

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货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资于股票资产的比例不低于50%。

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

§ 4 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 2018 年 04 月 01 日 - 2018 年 06 月 30 日

1.本期已实现收益 965,759.89

2.本期利润 -2,706,222.44

3.期初平准基金份额本期利润 -0.0533

4.期末基金资产净值 50,609,160.96

5.期末基金份额净值 1.007

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率 *70%*沪深 300 指数收益率 *30%

注:本基金本报告期无财务费用。

3.2 基金净值表现

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

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 -5.09% 102% -2.32% 0.3% -27% 0.68%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率 *70%*沪深 300 指数收益率 *30%

注:本基金本报告期无财务费用。

3.2.2 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变动的比较

报告期内本基金未出现基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动情况。

4.4 报告期内基金的经营业绩

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 报告期内基金的策略调整和运作分析

在投资操作上,本基金秉持绝对收益的理念,自上而下进行资产配置,根据各分资产的风险

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

二季度操作:5月减仓,6月上证 3000 点下方加仓。当前仓位较高,持仓较多的有大金融、电子、消费板块,个股仓位相对分散。

市场看法:短期的融资数据及经济表现总体偏弱,中美贸易冲突,年内杠杠,及较高的市场利率和商品货币经济及市场的短期风险,但中国经济有韧性,宏观经济及企业盈利的增长相对可持续,货币宽松方面,准备金率有较大的降低空间。今年以市场走势调整,当前位置估值水平较低,未来一段时间内,操作策略方面,逢低加仓,波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为 -0.05%,同期业绩比较基准收益率为 -2.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值情况说明

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不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

5. 报告期内基金的费用情况

5.1 报告期内本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	38,926,726.40	66.69
其中:股票		38,926,726.40	66.69
2	固定收益投资	-	-
3	商品及金融衍生品投资	4,012,580.00	6.87
其中:债券		4,012,580.00	6.87
4	货币市场工具	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,200,000.00	12.33
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	8,072,815.69	13.83
8	其他资产	155,931.24	0.27
9	合计	58,371,053.33	100.00

5.2 报告期未按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期内本基金的境内股票投资组合

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	82,900	75,620
2	中央国债	42,435	2,485,842.30
3	中国国开	131,188	2,072,786.20
4	600554	177,600	2,069,040.00
5	601398	294,500	1,568,740.00
6	中国太保	48,500	1,544,725.00
7	600036	56,376	1,490,581.44
8	600622	204,970	1,473,734.30
9	600837	146,500	1,415,765.00
10	601233	81,900	1,410,318.00

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	601336	新华保险	82,900	75,620	70.1
2	601318	中国平安	42,435	2,485,842.30	4.90
3	600406	中国国开	131,188	2,072,786.20	4.09
4	600554	浦发银行	177,600	2,069,040.00	4.08
5	601398	工商银行	294,500	1,568,740.00	3.09
6	601601	中国太保	48,500	1,544,725.00	3.05
7	600036	招商银行	56,376	1,490,581.44	2.94
8	600622	光大银行	204,970	1,473,734.30	2.91
9	600837	兴业银行	146,500	1,415,765.00	2.79
10	601233	民生银行	81,900	1,410,318.00	2.78

5.4 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

5.4.1 报告期内本基金未持有债券投资。

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贵金属投资明细

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五名股票投资明细

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债券投资明细

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贵金属投资明细

5.9 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固定收益投资明细

5.10 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资产支持证券投资明细

5.11 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及权证投资明细

5.12 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股指期货投资明细

5.13 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国债期货投资明细

5.14 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股票期权投资明细

5.15 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外汇期货及权证投资明细

5.16 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其他投资品种投资明细

5.17 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衍生金融工具投资明细

5.18 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其他投资品种投资明细

5.19 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其他投资品种投资明细

5.20 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其他投资品种投资明细

5.21 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其他投资品种投资明细

5.22 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其他投资品种投资明细

5.23 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其他投资品种投资明细

5.24 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其他投资品种投资明细

5.25 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其他投资品种投资明细

5.26 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其他投资品种投资明细

5.27 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其他投资品种投资明细

5.28 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其他投资品种投资明细

5.29 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其他投资品种投资明细

5.30 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其他投资品种投资明细

5.31 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其他投资品种投资明细

5.32 报告期末按公允价值占