兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第1号)

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

重要提示

本基金经2017年 8月11日中国证券监督管理委员会证监许可 [2017]1482号文准予募集注册,基金合同于2017年12月26日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等,详见招募说明书"风险揭示"章节。本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。本基金单一投资者(本公司作为发起式资金提供方除外)持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金可投资中小企业私募债券,中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2018年6月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人情况

名称:兴业基金管理有限公司
住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
法定代表人:卓新章
设立日期:2013年4月17日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2013]288号
组织形式:有限责任公司
注册资本:12亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:021-22211888
联系人:郭玲燕
股权结构:

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中海集团投资有限公司	10%
合计	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

卓新章先生,董事长,本科学历。曾任兴业银行宁德分行副行长、行长,兴业银行总行信贷审查部总经理,兴业银行福州分行副行长,兴业银行济南分行行长,兴业银行基金业务筹建工作小组负责人,兴业银行总行基金金融部总经理,兴业银行总行资产管理部总经理、兴业银行金融市场总部副总裁等职。现任兴业基金管理有限公司董事长,兴业财富资产管理有限公司执行董事。

明东先生,董事,硕士学位。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输(集团)总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作,历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表,中国远洋运输(集团)总公司/中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员,中海集团投资有限公司总经理。

汤夕生先生,董事,硕士学位。曾任建设银行浦东分行办公室负责人,兴业银行上海分行南市支行行长,兴业银行上海分行副行长等职。现任兴业基金管理有限公司总经理,兼任上海市基金同业公会第三届副会长。

朱利民先生,独立董事,硕士学位。曾任国家体改委试点司主任科员、副处长、处长,国家体改委下属中华股份制咨询公司副总经理,中国证监会稽查局副局长、中国证监会派出机构工作协调部主任、兼投资者教育办公室主任,中信建投证券股份有限公司合规总监、监事会主席等职。

黄泽民先生,独立董事,博士学位。曾任华东师范大学商学院院长,第十届、十一届、十二届全国政协委员等职。现任华东师范大学终身教授、博导、国际金融研究所所长,兼任上海世界经济学会副会长,中国金融学会学术委员,中国国际金融学会理事,中国国际经济关系学会常务理事,全国日本经济学会副会长,上海市人民政府参事。

曹和平先生,独立董事,博士学位。曾任中共中央书记处农研室国务院农村发展研究中心农业部研究室副主任,北京大学经济学院副院长,云南大学副校长,北京大学供应链研究中心主任,北京大学中国都市经济研究基地首席专家等职。现任北京大学经济学院教授(博士生导师),北京大学环境、资源与发展经济学创系主任,兼任北京大学数字中国研究院副院长,中国经济规律研究会副会长,中国西部促进会副会长,中国环境科学学会绿色金融分会主任,中央电视台财经频道评论员,北京大学供应链研究中心顾问,互联网普惠金融研究院院长,广州市、西安市、哈尔滨市、厦门市、广安市和青岛市金融咨询决策专家委员,云南省政府经济顾问。

2、监事会成员

顾卫平先生,监事会主席,硕士学位。曾任上海农学院农业经济系金融教研室主任、系副主任,兴业银行上海分行副行长,兴业银行天津分行行长,兴业银行广州分行行长等职。现任兴业银行总行资产管理部总经理。

杜海英女士,监事,硕士学位。曾任中海(海南)海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任(主持工作)、发展部主任,中共中国海运(集团)总公司党校副校长,集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

李骏先生,职工监事,硕士学位。曾任渣打银行全球金融市场部主任,海富通基金管理有限公司机构业务部副总经理,兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理。现任兴业基金管理有限公司产品研发部总经理。

赵正义女士,职工监事,硕士学位。曾任上海上会会计师事务所审计员,生命人寿保险股份有限公司稽核审计部助理总经理,海富通基金管理有限公司监察稽核部稽核经理、财务部高级财务经理,兴业基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任兴业基金管理有限公司财富管理总部副总经理。

3、公司高级管理人员

卓新章先生,董事长,简历同上。

汤夕生先生,总经理,简历同上。

王薏女士,督察长,本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理,兴业银行广州分行副行长,兴业银行信用审查部总经理,兴业银行小企业部总经理,兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生,副总经理,硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长,兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理,兴业银行厦门分行党委委员、行长助理,兴业银行总行投资银行部副总经理,兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生,副总经理,本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理,深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理、商人银行部副总经理,深圳发展银行上海分行宝山支行副行长,兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理,兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理,上海兴晟股权投资管理有限公司总经理,兴投(平潭)资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄孝强先生,总经理助理,本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理,兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长,兴业银行总行资产管理部总经理助理,兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理,兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4、本基金的基金经理

WEIDONG WU(吴卫东)先生,哥伦比亚大学物理学博士。二十三年证券从业经验,曾在美国证券交易协会(NASD)注册。1994-1998年任德意志银行量化策略研究员(Associate Director),1998-2002年任摩尔(Moore)资产管理公司资深策略研究员,2002-2006任千禧(Millennium)基金公司投资经理,2007-2010任梯度(Gradient) 资产管理公司投资经理,2010-2013任兴业银行资产管理部研究总监,2013年7月加入兴业基金管理公司,2015年1月23日起至2018年1月18日担任兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年9月17日至2016年11月29日任兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月26日起担任兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

5、投资策略委员会成员

汤夕生先生,总经理。
黄文锋先生,副总经理。
冯烜先生,股票业务总监。
刘方旭先生,股票公募投资总监。
吴列伟先生,股票专户投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2018年3月31日,本集团总资产62,522.38亿元人民币,高级法下资本充足率15.51%,权重法下资本充足率12.79%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工81人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。2016年6月招商银行荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖",成为国内唯一获奖项国内托管银行;"托管通"获得国内《银行家》2016中国金融创新"十佳金融产品创新奖";7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】"最佳资产托管银行";2017年6月再度荣膺《财资》"中国最佳托管银行奖","全功能网上托管银行2.0"荣获《银行家》2017中国金融创新"十佳金融产品创新奖";8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》"中国年度托管银行奖",2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司"2017年度优秀资产托管机构"奖项,同月招商银行"托管大数据平台风险管理系统"荣获2016-2017年度银监会系统"金点子"方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届"双提升"金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年"最佳基金托管银行"奖。

(二)主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月, 历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。

(四) 托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在招商银行总行层面对风险进行预防和控制;

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制;

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时, 遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全体人员参与。

(2)审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点,体现"内控优先"的要求,以有效防范各种风险作为内部控制的核心。

(3)独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4)有效性原则。内部控制具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

(5)适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要,并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

(6)防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统,包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

(7)重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8)制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

4、内部控制措施

(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务操作流程、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2)经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运作过程中的风险。

(3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行异地实时备份,所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护,对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等,保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源管理。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督,对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定,及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)名称:兴业基金管理有限公司直销中心
住所: 福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
法定代表人:卓新章
地址:上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼
联系人:张聆枫
电话:021-22211885
传真:021-22211997
网址:http://www.cib-fund.com.cn/

(2)名称:网上直销系统
网址:https://trade.cib-fund.com.cn/etrading/

(3)名称:兴业基金微信公众号
微信号:"兴业基金"或者"cibfund"

2、其他销售机构

(1)名称:兴业银行股份有限公司
住所: 福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
办公地址:上海市静安区江宁路168号
邮政编码:200041
联系人:曾鸣
电话:021-95561
网址:http://www.cib.com.cn

(2)名称:招商银行股份有限公司
住所:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人:李建红
办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码:518040
联系人:邓炯鹏
电话:95555
网址:http://www.cmbchina.com/

(3)名称:中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人: 陈四清
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码:100818
联系人:陈洪源
电话:95566
网址:www.boc.cn

(4)名称:平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:刘世安
联系电话:021-38637436
传真:0755-82435367
联系人:周一涵
客服电话:95511-8
公司网址:http://stock.pingan.com

(5)名称:中国国际金融股份有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码:100004
联系人:杨涵宇
电话:400 910 1166
网址:www.cicc.com.cn

(6)名称:国金证券股份有限公司
住所: 四川省成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
办公地址:四川省成都市青羊区东城根上街95号
邮政编码:610015
联系人:刘婧漪、贾鹏
电话:028-86690057、028-86690058
网址: www.gjzq.com.cn
客户服务电话:95310

(7)名称:中国银河证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人: 陈共炎
地址: 北京市西城区金融大街35号2-6层
邮编:100033
联系人:邓颜
客服电话:4008-888-888
公司网址:www.chinastock.com.cn

(8)名称:长城证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号14、16、17楼
邮政编码:518034
法定代表人:丁益
联系人:金夏
电话:0755-83516289
传真:0755-83513882
网址:www.cgws.com

(9)名称:申万宏源证券股份有限公司
住所: 上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人: 储晓明
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
邮政编码:200031
联系人:黄莹
电话:021-33388211
网址:www.swhysc.com

(10)名称:华泰证券股份有限公司
住所: 南京市江东中路228号
法定代表人: 周易
办公地址:南京市江东中路228号
邮政编码:210019
联系人:庞晓芸
电话:95597
网址:http://www.htsc.com.cn/htzq/index/index.jsp

(11)名称:光大证券股份有限公司
住所: 上海市静安区新闸路1508号
法定代表人: 薛峰
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
联系人:何耀
电话:95525
网址:http://www.ebscn.com/

(12)名称:海银基金销售有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
法定代表人: 刘惠
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
邮政编码:200000
联系人:毛林
电话:021-80133597
网址:http://www.fundhaiyin.com/

(13)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人:凌顺平
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
邮政编码:310012
联系人:董一锋
电话:4008-773-772
网址:http://www.5ifund.com

(14)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人:陈柏青
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27F
邮政编码:200135
联系人:韩爱彬
电话:4000-766-123
网址:http://www.fund123.cn/

(15)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26层
邮政编码:200235
联系人:王超
电话:4001818188
网站:http://www.1234567.com.cn

(16)深圳众禄基金销售股份有限公司
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
邮政编码:518028
联系人:童彩平
电话:4006-788-887
网站:http://www.zlfund.cn

(17)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼
邮政编码:510308
联系人:吴煜浩
电话:020-89629066
网站:http://www.yingmi.cn

(18)北京虹点基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
办公地址:北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
邮政编码:100026
联系人:陈铭洲
电话:400-618-0707
网站:https://www.hongdianfund.com/

(19)上海陆金所基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
邮政编码:200120
联系人:程晨
电话:4008219031
网址:http://www.lufunds.com

(20)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
邮政编码:200082
联系人:张裕
电话:400-821-5399
网址:http://www.noah-fund.com

(21)上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
邮政编码:200001
联系人:王哲宇
电话:4006-433-389
网址:www.vstonewealth.com

(22)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:武汉市江汉区泛海国际SOHO7栋23层01、04号
法定代表人:陶捷
办公地址:武汉市江汉区泛海国际SOHO7栋23层01、04号
邮政编码:430000
联系人:陆锋
电话:027-87006003
网址:http://www.buyfunds.cn/

(23)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人:杨文斌
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
邮政编码:200120
联系人:张茹
电话:400-700-9665
网址:http://www.ehowbuy.com

(24)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人:燕斌
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
邮政编码:200335
联系人:兰敏
电话:400-166-6788
网址:http://www.66zichan.com

(25)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
法定代表人:张跃伟
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
邮政编码:200120
联系人:张佳琳
电话:400-820-2899
网站:http://www.erichfund.com

(26)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
法定代表人:王伟刚
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
邮政编码:100190
联系人:熊小满
电话:400-619-9059
网址:http://www.hcjijin.com

(27)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006室
法定代表人:张彦
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦7层
邮政编码:100032
联系人:文雯
电话:400-166-1188
网址:http://www.jrj.com.cn

(28)上海万得基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人:王廷富
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
邮政编码:200120
联系人:徐亚丹
电话:400-821-0203
网址:http://www.520fund.com.cn

(29)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:李兴春
办公地址:上海虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场
邮政编码:200127
联系人:曹怡晨
电话:400-921-7755
网址:http://www.leadfund.com.cn

(30)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人:江卉
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东A座4层
邮政编码:100176
联系人:韩锦星
电话:400-098-8511
网址:http://kenterui.jd.com

(31)上海华信证券有限责任公司
住所:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:陈灿辉
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
邮政编码:200003
联系人: 徐璐
电话:400-820-5999
网址:http://www.shhxzq.com

(32)上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人:李一梅
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
邮政编码:100032
联系人:仲秋玥
电话:400-817-5666
网址:http://www.amcfortune.com

(33)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
法定代表人:王翔
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
邮政编码:200120
联系人:蓝杰
电话:021-65370077
网址:http://www.jiyufund.com.cn

(34)通华财富(上海)基金销售有限公司
住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
法定代表人:兰奇
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
邮政编码:200127
联系人:褚志朋
电话:021-60818249
网址:http://www.tonghuafund.com

(35)上海挖财基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:胡燕亮
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
邮政编码:200127
联系人: 李娟
电话:021-50810687
网址:http://www.wacaijijin.com

(36)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街T3 A座19层
邮政编码:100020
联系人: 袁永姣
电话:4000-618-518
网址:http://www.danjuanapp.com

(37)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
法定代表人:钱昊旻
办公地址:北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层
邮政编码:100052
联系人:徐英
电话: 400-8909998
网址:https://www.jnlc.com

(38)扬州国信嘉利基金销售有限公司
住所:江苏省扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋
法定代表人:刘晓光
办公地址:江苏省扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320室
邮政编码:225100
联系人: 苏曦
电话:400-021-6088
网址:https://www.gxjlcn.com/

(39)名称:上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路500号
法定代表人:高国富
办公地址:上海市中山东一路12号
邮政编码:200002
联系人:唐苑
电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

(40)名称:宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
住所: 北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人: 戎兵
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809
邮政编码:100010
联系人:魏晨
电话:010-52413385
网址:http://www.yixinfund.com/

(41)兴业银行股份有限公司钱大掌柜
住所: 福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
办公地址: 上海市北京西路968号嘉地中心33楼
邮政编码:200041
联系人: 禾青
电话:40018-95561
网址:https:// www.yypt.com /

其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(二)登记机构

名称:兴业基金管理有限公司
住所: 福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼
办公地址:上海市浦东新区浦明路198号财富广场7号楼
法定代表人:卓新章
设立日期:2013年4月17日
联系电话:021-22211899
联系人:金晨

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公场所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
主要经营场所:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法定代表人:曾顺福
电话:021-6141 8888
传真:021-6335 0177/0377
联系人:曾浩
经办注册会计师:曾浩、吴凌志

四、基金的名称

兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金通过计算机算法分析财务、技术因子和互联网大数据,使用多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换债券等)、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为出发,采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略,结合适当的资产配置策略。本基金所指数量化模型是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型的基础上,根据中国资本市场的实际情况,由本基金管理人的金融工程团队开发的更具针对性和实用性的多因子阿尔法选股模型。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争实现基金资产长期稳定增值。为降低资本市场系统性风险对基金的影响,基金管理人在综合分析国内外宏观经济形势以及资本市场环境等因素的基础上,在对证券市场中长期走势判断的基础上,采取适度的资产配置策略。在投资过程中,在保持量化模型选股的前提下,基金管理人可以调整、增加、或减少所使用的量化模型。

1、资产配置策略

本基金的资产配置采取"自上而下"的多因素分析决策支持,结合定性分析和定量分析,对股票资产和固定收益类资产的风险收益特征进行分析预测,确定中长期的股票债券资产配置比例范围。在实施资产配置时,主要考察三方面的因素:宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素。

数量化投资策略是本基金的主要投资策略, 为了有效实施数量化投资策略,本基金将采取相对稳定的股票持仓比例控制措施,降低由于股票持仓比例波动过于频繁影响到数量化投资策略的效果。

2、股票投资策略

本基金以"量化投资"为主要投资策略,通过基金管理人开发的多因子模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。量化模型在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正,优化股票投资组合。

(1)多因子模型

1)筛选有效因子

通过深入研究传统投资理论、总结分析投资团队多年积累的投资经验,基金管理人金融工程团队提炼出适应中国市场的选股逻辑, 再经过全面而细致的实证检验,挑选出相对稳定的逻辑,并具体体现为通过量化因子选股。这些量化因子主要来自三方面信息:一是公司基本面信息;二是公司的二级市场价格数据;三是反映投资者行为的互联网大数据。每一个因子的提炼都经过金融工程团队的反复验证,具备一定的选股能力。

2)因子的权重

每一个因子都代表了一种选股逻辑。在不同的市场环境下,选股逻辑会有不同的侧重点。例如,当市场关注价值投资时,反映公司价值的因子重要性要大一些;当市场更关注企业成长时,反映公司成长速度的因子重要性要大一些。我们会给不同因子配以不同的权重,以反映当时市场的侧重点。

3)因子的更替及权重的调整

金融工程团队将定期回顾所有因子的表现情况,适时剔除失效因子、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子。此外,我们还将采用OLS、信息比率等方法,评价因子的重要程度,定期调整因子权重。

4)个股调仓

本基金使用兴业多因子模型计算每只股票的因子加权得分,并挑选总得分最高的若干只个股构建投资组合。每隔一段时期,我们将重新计算个股加权因子得分,并以新得分值为依据对股票投资组合进行调整,始终保证组合中个股具有相对较高的分值。

(2)股票投资组合的构建

本基金针对沪深两市的全部上市公司,剔除其中不符合投资要求的股票(包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等),筛选得到本基金的股票池后,按照量化模型进行选股和进行换仓交易。所剔除的股票进入股票禁止库,投资组合禁止投资禁止库中的股票。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资,通过主要采取组合久期配置策略,同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

(1)组合久期配置策略是指根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素,确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险。

(2)收益率曲线策略是指在确定组合整体久期以后,根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。

(3)骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券, 也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

(4)息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。

4、权证投资策略

本基金权证投资的原则主要为有利于基金资产增值, 有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价,主要运用的投资策略为:杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta对冲策略等。

5、可转换债券投资策略

本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究,重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债,并选择具有较高投资价值的个券进行投资。

6、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债券相比, 中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险,并寻求足够的收益补偿,增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析,从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用水平的变化趋势,决定投资策略。

7、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

8、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为目的,适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,选择合适的期货合约构建相应的头寸,以调整投资组合的风险暴露,降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金的建仓或变现效率。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%。

中证800指数是由中证指数有限公司编制,中证500和沪深300成份股一起构成中证800指数成份股,中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况,具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制,是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,较全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势,为债券投资者提供更切合的市场基准。

本基金是灵活配置混合型基金,基金在运作过程中股票资产占基金资产的比例为0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、债券回购、权证、资产支持证券等金融工具金融工具。因此,"中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%"是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人招商银行股份有限公司,根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金2018年第1季度报告,所载数据截至2018年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	73,933,485.36	82.85
	其中:股票	73,933,485.36	82.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,169,870.00	5.79
	其中:债券	5,169,870.00	5.79
	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	6,000,000.00	6.72
	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	2,977,961.83	3.34
8	其他资产	1,153,070.84	1.29
9	合计	89,234,388.03	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	740,097.00	0.84
B	采矿业	3,059,695.00	3.45
C	制造业	34,605,642.12	39.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,355,578.88	2.66
E	建筑业	3,031,085.80	3.42
F	批发和零售业	2,591,343.00	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	1,317,564.00	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	720,589.00	0.81
J	金融业	18,744,081.68	21.15
K	房地产业	4,657,473.88	5.26
L	租赁和商务服务业	202,064.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	455,437.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	281,292.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	289,100.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	287,440.00	0.32
S	综合	595,002.00	0.67
	合计	73,933,485.36	83.42

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	601318	中国平安	32,200	2,102,982.00	2.37
2	601288	农业银行	437,600	1,711,016.00	1.93
3	600519	贵州茅台	2,100	1,435,602.00	1.62
4	600079	人福医药	90,500	1,408,180.00	1.59
5	601328	交通银行	208,726	1,289,926.68	1.46
6	600000	浦发银行	99,800	1,162,670.00	1.31
7	601601	中国太保	34,000	1,153,620.00	1.30
8	601668	中国建筑	129,200	1,118,872.00	1.26
9	600094	大名城	146,100	1,057,764.00	1.19
10	600704	物产中大	146,700	977,022.00	1.10

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	5,169,870.00	5.83
	其中:政策性金融债	5,169,870.00	5.83
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	5,169,870.00	5.83

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	140202	14国开02	51,000	5,169,870.00	5.83

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。

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。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-1,320.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为目的,适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,选择合适的期货合约构建相应的头寸,以调整投资组合的风险暴露,降低系统性风险。 基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金的建仓或变现效率。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

11 投资组合报告附注

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。

11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,002.87
2	应收证券清算款	1,059,882.59
3	应收股利	-
4	应收利息	61,091.36
5	应收申购款	3,094.02
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,153,070.84

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

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。

下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。

本基金合同生效日2017年12月26日,基金业绩截止日2018年3月31日。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
自基金合同生效日(2017年12月26日)至2017年12月31日	0.04%	0.01%	0.04%	0.44%	0.00%	-0.43%
2018年01月01日-2018年3月31日	-3.15%	0.91%	-0.66%	0.65%	-2.49%	0.26%
自成立以来2017年12月26日-2018年3月31日	-3.11%	0.87%	-0.62%	0.63%	-2.49%	0.24%

注:基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券/期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的开户费用和账户维护费;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人复核后按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人复核后按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书(更新)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2017年11月22日刊登的《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新,主要补充和更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分,补充了基金合同生效情况、招募说明书内容的截止日期以及相关财务数据的截至日期。
2、在"一、绪言"部分,更新了基金合同的生效日期。
3、在"三、基金管理人"部分,更新了基金管理人及主要人员情况。
4、在"四、基金托管人"部分,更新了托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容。
5、在"五、相关服务机构"部分,更新了直销联系人和其他销售机构的信息。
6、在"六、基金的募集"部分,更新了基金募集的内容。
7、在"七、基金合同的生效"部分,更新了基金合同生效的内容。
8、在"九、基金的投资"部分,更新了基金投资组合报告的内容。
9、在"十、基金的业绩"部分,更新了基金业绩表现的内容。
10、在"二十、基金托管协议的内容摘要"部分,对基金管理人信息进行了更新。
11、在"二十二、其他应披露事项"部分,更新了基金管理人在招募说明书更新期间刊登的与本基金相关的公告。

兴业基金管理有限公司
2018年8月9日

兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年8月9日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	兴业3个月定开债券
基金主代码	005338
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	增聘基金经理
新任基金经理姓名	熊伟
共同管理本基金的其他基金经理姓名	徐青

2. 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	熊伟
任职日期	2018年8月7日
证券从业年限	10年
证券投资管理从业年限	8年
过往从业经历	熊伟,浙江大学经济学硕士。2008年7月至2009年4月,在华泰联合证券担任宏观分析师;2009年5月至2010年10月,在海通证券担任宏观分析师;2010年10月至2011年3月,在浙江敦和投资有限公司担任投资经理助理;2011年3月至2013年3月,在光大证券担任债券分析师;2013年3月至2014年4月,在浦银安盛基金管理有限公司担任专户投资经理,从事债券投资及研究工作。2014年4月加入兴业基金管理有限公司,2016年6月30日起担任兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年7月13日起担任兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年11月17日起担任兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金基金经理。

其中:管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基金名称	任职日期	离任日期
	002659	兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金	2016年6月30日	—
	002660	兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金	2016年6月30日	—
	002668	兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金	2016年7月13日	—
	003309	兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金	2016年11月17日	—
	003671	兴业裕恒债券型证券投资基金	2016年11月17日	—

是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否
是否已取得基金从业资格	是
取得的其他相关从业资格	—
国籍	中国
学历、学位	硕士研究生学历、硕士学位
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是

3. 其他需要说明的事项

本公司已按规定向中国基金业协会办理相应手续,并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2018年8月9日

兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期:2018年8月9日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	兴业纯债一年定开债券
基金主代码	005988
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	增聘基金经理
新任基金经理姓名	伍方方
共同管理本基金的其他基金经理姓名	徐青

2. 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	伍方方
任职日期	2018年8月7日
证券从业年限	8年
证券投资管理从业年限	8 年
过往从业经历	伍方方,北京大学理学硕士。2010年12月至2017年12月主要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,2018年5月28日起担任兴业14天理财债券型证券投资基金基金经理。

其中:管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基金名称	任职日期	离任日期
	003430	兴业14天理财债券型证券投资基金	2018年5月28日	—

是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否
是否已取得基金从业资格	是
取得的其他相关从业资格	—
国籍	中国
学历、学位	硕士研究生学历、硕士学位
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是

3. 其他需要说明的事项

本公司已按规定向中国基金业协会办理相应手续,并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2018年8月9日

兴业基金管理有限公司关于太原分公司营业场所变更的公告

因业务发展需要,兴业基金管理有限公司太原分公司已搬迁至新的营业地址办公,现将相关变更事项公告如下:

营业场所:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦A座18层
邮政编码:030021
联系电话:0351-5615008
传真号码:0351-5222010

感谢您长期以来的支持与关注!

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2018年8月9日