

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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:中国民生银行股份有限公司

1.1 重要提示
基金管理人的董事、监事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的法律责任。

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2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益一定增长。
本半年度报告正文摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。
2 基金简介

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金产品说明. Includes fund name, codes, and objectives.

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金托管人. Lists management and custodian details.

Table with 2 columns: 主要会计数据和财务指标, 基金净值表现. Shows financial performance and net asset value trends.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

Table with 2 columns: 3.1 主要会计数据和财务指标, 3.2 基金净值表现. Detailed financial and performance metrics.

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
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 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
本基金上半年总体上较高仓位操作,在5月下旬做过一次明显的减仓操作,6月下旬又明显加仓。2月份在市场大幅下跌之后陆续买入较多的金融股,在3月创业板明显反弹后减持了小盘股,当前行业配置主要是金融、消费、电子等。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现
截至报告期末兴业多策略混合基金份额净值为1.154元,本报告期内,基金份额净值增长率为-5.33%,同期业绩比较基准收益率为1.67%。

4.5 管理人对外观经济、证券市场及行业走势的高要展望
表外融资回表过程非常不顺畅,高负债及严环境的调控政策下,房地产市场也在趋淡。总体来看,下半年经济增长承压,但中国经济富有韧性,宏观经济及企业盈利亦有可观的长期增长潜力。

4.6 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
1. 估值政策及重大变化
无。
2. 估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响
无。

3. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述
(1) 公司方面
估值委员会设主任委员一名,由分管运营的公司领导担任;委员若干名,由基金运营部、风险管理部、市场部、投资管理总部(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下:制定合理、公允的估值方法;对估值方法进行讨论并作出评价,在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法,以保持持续适用;评价现有估值方法对新投资股票或新投资品种的适用性,对新投资股票或投资品种采用的估值方法作出决定;讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

(2) 托管银行
托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所
对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。
4. 参与估值流程各方及人员在任何重大利益冲突参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5. 已签约的任何定价程序的性质与程度等信息
无。
4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
根据《基金合同》,在符合有关基金分红条件的情况下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。若《基金合同》生效不满3个月可不对基金进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
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元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守专项声明
本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务和责任。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的的投资运作方面进行了监督,对基金净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有关基金净值计算、基金份额申购赎回价格等方面存在违反基金合同的违规行为。基金净值计算符合基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查的本报告期中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6.1 资产估值表
会计主体:兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2018年06月30日

Table with 2 columns: 资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists assets and values.

Table with 2 columns: 负债, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists liabilities and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

Table with 2 columns: 净资产, 2018年06月30日, 2017年12月31日. Lists net assets and values.

单位:人民币元
表报附注为财务报表的重要组成部分。
本报告 6.1至 6.4 财务报表由下列人员签署:

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上期. Financial statement items and values.

关联方投资本基金采用公允费率,即按照基金法律文件条款执行。
6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元
表报附注为财务报表的重要组成部分。

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上期. Financial statement items and values.

金额单位:人民币元
序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)