

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

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:兴业证券股份有限公司

本报告期,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证券投资行为进行了监督,对基金资产净值计算、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资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。在各重要环节的运作均严格按照基金合同的有关规定进行。

附一前一日本基金资产净值×1.2%+当年天数。 6.4.8.2.2 基金托管费用: 单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

2.2 基金产品说明 本基金为股票型基金,长期股权投资比例最高,力争获得高于业绩比较基准的长期资本增值。

2.3 基金管理人和其他托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:兴业证券股份有限公司

6.4.9.3.1 赎回费用 本基金本报告期未从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产品种。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

3.1 主要财务指标和基金净值表现 3.1.1 主要财务指标

3.1.2 基金净值表现 截至2018年06月30日,基金份额净值1.285元,基金份额总额829,559,211份。

7.2 投资组合报告 7.2.1 报告期末按行业分券的股票投资组合

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

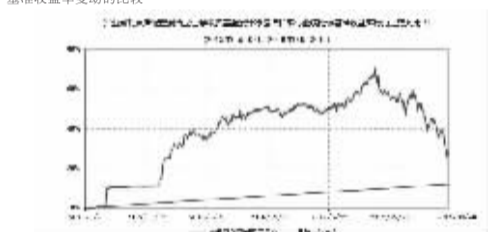


Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

4 管理人报告 4.1 基金管理人及基金情况 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 截至2018年01月01日至2018年06月30日止期间,本基金所有者权益变动如下列项目调整:

7.3 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

2013年3月,兴业基金管理有限公司获中国证监会批准,兴业基金由兴业银行股份有限公司和中集集团投资有限公司共同出资设立,公司注册资本12亿元人民币。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年01月01日至2018年06月30日止期间.

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 stocks.

4.1.2 基金业绩(基金经理小组)及基金经理助理简介

6.4 关联交易 6.4.1 基金基本情况 本报告期,兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 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

1. 对基金的投资管理,其(任职)日期为基金合同生效日,“离职日期”为根据基金合同及确定的解聘日期,除自基金合同生效外,“任职开始”和“离职日期”分别指根据基金合同及确定的解聘日期。

6.4.2 关联交易 6.4.2.1 关联方关系 本报告期,本基金的关联方关系如下: 1. 基金管理人:兴业基金管理有限公司 2. 基金托管人:兴业证券股份有限公司

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 stocks.

4.3 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》,完善相关制度和流程,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品种。

6.4.3 关联方关系 6.4.3.1 关联方关系 本报告期,本基金的关联方关系如下: 1. 基金管理人:兴业基金管理有限公司 2. 基金托管人:兴业证券股份有限公司

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 stocks.

4.4 管理人内部控制制度的建设和完善 4.4.1 报告期内,本基金管理人不断完善内部控制制度,通过制度和流程,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品种。

6.4.4 关联方关系 6.4.4.1 关联方关系 本报告期,本基金的关联方关系如下: 1. 基金管理人:兴业基金管理有限公司 2. 基金托管人:兴业证券股份有限公司

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 stocks.

2018年半年度报告摘要

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

7.6 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 2 columns: 序号 (Serial Number) and 债券名称 (Bond Name) for the top 5 bonds.

7.7 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 资产支持证券名称 (Asset-backed Security Name) for the top 10 securities.

7.8 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 贵金属名称 (Precious Metal Name) for the top 5 investments.

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 权证名称 (Warrant Name) for the top 10 investments.

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金管理人将充分考量股指期货的投机性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,旨在通过投资实现基金的套利保值。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 7.11.1 本期国债期货投资政策 本基金管理人将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 7.11.3 本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未持有国债期货。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.12 投资组合报告附注 7.12.1 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受到公开谴责、处罚的情形。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.12.2 本基金投资的前十名股票中不存在流通受限的情况 7.12.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限的情况说明

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 股指期货名称 (Futures Name) for the top 10 investments.

7.4.2 基金累计卖出金额占期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.3 基金累计买入金额占期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.4 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

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.5 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 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.6 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权证投资明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 7.4.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.7.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金管理人将充分考量股指期货的投机性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,旨在通过投资实现基金的套利保值。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.7.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 7.4.7.3.1 本期国债期货投资政策 本基金管理人将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.7.3.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 7.4.7.3.3 本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未持有国债期货。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 securities.

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.

4.5 基金管理人内部控制制度的建设和完善 4.5.1 报告期内,本基金管理人不断完善内部控制制度,通过制度和流程,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品种。

6.4.5 关联方关系 6.4.5.1 关联方关系 本报告期,本基金的关联方关系如下: 1. 基金管理人:兴业基金管理有限公司 2. 基金托管人:兴业证券股份有限公司

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 基金名称 (Fund Name) for the top 20 stocks.

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 金额 (Amount) for 2018年06月30日 and 2017年12月31日.