

兴业聚宝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:交通银行股份有限公司

1. 估值政策及重大变化 2. 估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响 3. 有关参与估值流程各方人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作情况的描述

2.1 基金基本情况 2.2 基金产品说明 2.3 基金管理人及基金托管人

2.4 信息披露方式 2.5 其他相关资料

3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要会计数据和财务指标

3.2 基金业绩指标及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 基金管理人报告 3.4 基金管理人及其管理基金的经验

3.5 基金投资组合报告 3.6 风险管理

3.7 基金估值 3.8 基金费用

3.9 基金收益分配 3.10 基金资产净值的核算

3.11 基金合同 3.12 基金托管人

3.13 基金销售 3.14 基金转换

3.15 基金申购赎回 3.16 基金赎回

3.17 基金定投 3.18 基金转换

3.19 基金收益分配 3.20 基金资产净值的核算

3.21 基金估值 3.22 基金费用

3.23 基金收益分配 3.24 基金资产净值的核算

3.25 基金申购赎回 3.26 基金赎回

3.27 基金定投 3.28 基金转换

3.29 基金收益分配 3.30 基金资产净值的核算

3.31 基金估值 3.32 基金费用

3.33 基金收益分配 3.34 基金资产净值的核算

3.35 基金申购赎回 3.36 基金赎回

3.37 基金定投 3.38 基金转换

3.39 基金收益分配 3.40 基金资产净值的核算

3.41 基金估值 3.42 基金费用

3.43 基金收益分配 3.44 基金资产净值的核算

3.45 基金申购赎回 3.46 基金赎回

3.47 基金定投 3.48 基金转换

3.49 基金收益分配 3.50 基金资产净值的核算

3.51 基金估值 3.52 基金费用

3.53 基金收益分配 3.54 基金资产净值的核算

3.55 基金申购赎回 3.56 基金赎回

3.57 基金定投 3.58 基金转换

3.59 基金收益分配 3.60 基金资产净值的核算

3.61 基金估值 3.62 基金费用

3.63 基金收益分配 3.64 基金资产净值的核算

3.65 基金申购赎回 3.66 基金赎回

3.67 基金定投 3.68 基金转换

3.69 基金收益分配 3.70 基金资产净值的核算

3.71 基金估值 3.72 基金费用

3.73 基金收益分配 3.74 基金资产净值的核算

3.75 基金申购赎回 3.76 基金赎回

3.77 基金定投 3.78 基金转换

为2017,709,827.61元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第0077号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围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(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票)。

托管人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。

4. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 5. 已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

6. 4.2 托管人对报告期内基金净值情况的说明 根据《基金合同》在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每个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个月可不再进行收益分配。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致的说明 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 6.4.5.1 差错更正的说明 本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]148号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发辅助服务增值税问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券、期货、期权等金融工具和金融衍生品,持有其他证券投资基金,按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金在证券交易所中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣缴税款日的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳,从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 关联方关系 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况 本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各项关联方 本基金本报告期与基金发生关联交易的各项关联方未发生变化。

注:下述关联方交易均在正常业务范围內按一般商业条款进行。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 6.4.8.1.1 股票交易 6.4.8.1.2 债券交易 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬 6.4.8.2.1 基金管理费 6.4.8.2.2 基金托管费

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.7%÷当年天数, H为每日应计提的基金管理费, E为前一日基金资产净值, 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费 注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.25%÷当年天数, H为每日应计提的基金托管费, E为前一日基金资产净值, 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.3 销售服务费 注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H=E×0.5%÷当年天数, H为每日应计提的基金销售服务费, E为前一日基金资产净值, 基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 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 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

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

关联方名称 2018年01月01日至2018年06月30日 2017年01月01日至2017年06月30日

交通银行股份有限公司 7,562,911.89 6,377.96 5,106,902.92 74,864.03

注:本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期间及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明 本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 6.4.9.3.3 交易所市场债券正回购 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 7 投资组合报告 7.1 期末投资组合资产组合情况 7.2 1 报告期末按行业分类的股票投资组合 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 单位:人民币元

代码 行业名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 38,929,726.40 66.69

B 采矿业 38,929,726.40 66.69

C 制造业 4,012,980.00 6.87

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 4,012,980.00 6.87

E 建筑业 0.00 0.00

F 批发和零售业 0.00 0.00

G 交通运输、仓储和邮政业 7,200,000.00 12.33

H 住宿和餐饮业 15,931.24 0.27

I 信息传输、软件和信息技术服务业 8,072,815.69 13.83

J 金融业 58,371,063.31 100.00

K 房地产业 0.00 0.00

L 租赁和商务服务业 0.00 0.00

M 科学研究和技术服务业 0.00 0.00

N 水利、环境和公共设施管理业 0.00 0.00

O 卫生、社会保障和社会福利业 0.00 0.00

P 教育 0.00 0.00

Q 综合 894,822.00 1.57

R 其他 0.00 0.00

合计 38,929,726.40 7681

7.2.2 报告期末按公允价值占基金资产净值大小排名的前十名股票投资组合 单位:人民币元

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 中信建投 82,900 3,554,752.00 7.01

2 601918 中国平安 42,438 2,485,842.30 4.90

3 600046 绝味食品 131,189 2,072,786.20 4.09

4 600554 泰山石油 177,600 2,056,040.00 4.08

5 601398 工商银行 294,500 1,566,740.00 3.09

6 601061 中信银行 48,900 1,544,720.00 3.05

7 600036 招商银行 56,376 1,405,561.44 2.74

8 600622 光大证券 204,970 1,474,734.30 2.91

9 600837 华海药业 148,500 1,414,756.00 2.79

10 601253 山东路桥 81,900 1,410,318.00 2.78

7.4 报告期末股票投资组合的重大变化 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 7.4.1.1 买入金额

7.4.1.1 买入金额 单位:人民币元

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)

1 600036 中信建投 4,514,457.00 9.14

2 601336 中信建投 4,476,954.00 9.06

3 600887 伊利股份 3,388,080.00 6.89

4 600741 华鲁恒升 1,442,233.00 2.93

5 601211 华邦制药 2,804,670.00 5.68

6 601918 中国平安 2,796,240.00 5.66

7 600026 山东钢铁 2,656,710.00 5.42

8 600622 光大证券 2,115,000.00 4.28

9 601398 工商银行 2,098,430.00 4.25

10 600837 华海药业 1,631,580.00 3.32

11 600622 光大证券 2,076,910.00 4.20

12 300166 华测检测 2,098,430.00 4.25

13 601253 山东路桥 1,998,160.00 4.04

14 600036 中信建投 1,842,233.00 3.73

15 600837 华海药业 1,807,130.00 3.66

16 600837 华海药业 1,790,750.00 3.63

17 002262 卓尔智联 1,680,000.00 3.42

18 601688 华泰证券 1,680,000.00 3.42

19 002263 景林集团 1,680,000.00 3.42

20 600899 招商局港口 1,614,794.00 3.28

21 600899 招商局港口 1,584,000.00 3.19

22 002511 爱尔眼科 1,553,016.00 3.15

23 600703 三安光电 1,546,260.00 3.13

24 600885 运盛颐养 1,536,610.00 3.11

25 002227 永达股份 1,525,911.00 3.09

26 002271 东方时尚 1,484,638.00 3.01

27 600741 华鲁恒升 1,442,233.00 2.93

28 600021 东信国际 1,442,380.00 2.92

29 600466 华菱钢铁 1,424,073.67 2.88

30 002032 亚邦股份 1,260,870.00 2.57

31 002812 际华集团 1,197,340.00 2.40

32 600466 华菱钢铁 1,197,450.00 2.40

33 002263 景林集团 1,148,000.00 2.33

34 601111 华邦制药 1,134,947.00 2.30

35 300017 华信新材 1,116,340.00 2.25

36 002311 联众股份 1,097,590.00 2.22

37 300251 联众股份 1,086,620.00 2.21

38 000919 华邦制药 1,045,233.00 2.13

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 7.4.2.1 卖出金额

7.4.2.1 卖出金额 单位:人民币元

序号 股票代码 股票名称 本期累计卖出金额 占期初基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 4,424,930.00 9.02

2 600887 伊利股份 3,320,262.00 6.74

3 300033 乐视网 3,227,702.00 6.51

4 601211 华邦制药 2,952,240.00 5.98

5 300136 华信新材 2,726,623.00 5.52

6 601688 华泰证券 2,217,950.30 4.49

7 300166 华测检测 2,025,008.00 4.16

8 000919 华邦制药 2,000,967.00 4.05

9 004666 华菱钢铁 1,936,523.31 3.92

10 002032 亚邦股份 1,747,267.95 3.54

11 600036 中信建投 1,711,516.66 3.47

12 002263 景林集团 1,706,772.52 3.46

14 601111 华邦制药 1,617,710.00 3.29

13 002263 景林集团 1,617,710.00 3.29

15 000895 华海药业 1,617,096.91 3.28

16 002027 卓尔智联 1,614,233.40 3.27

17 002262 卓尔智联 1,579,727.19 3.20

18 600466 华菱钢铁 1,488,532.51 3.01

19 600741 华鲁恒升 1,481,482.33 2.98

20 002475 东方时尚 1,444,848.00 2.93

21 600068 华菱钢铁 1,434,846.00 2.90

22 600021 东信国际 1,360,410.00 2.77

23 601681 华信新材 1,251,480.00 2.56

24 000998 招商局港口 1,196,133.00 2.43

25 002031 华信新材 1,181,727.00 2.39

26 002812 际华集团 1,148,000.00 2.33

27 601799 华信新材 1,122,402.24 2.27

28 002439 华信新材 1,090,430.38 2.21

29 000826 华菱钢铁 1,082,616.00 2.19

30 000826 华菱钢铁 1,024,734.14 2.10

31 000826 华菱钢铁 1,024,734.14 2.10

32 300271 华信新材 1,024,502.2