

## 兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金

### 2018年第三季度报告

业绩比较基准收益率为0.07%。  
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
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 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,548,576.02	93.05
2	其中:股票	62,548,576.02	93.05
3	债券投资	168,117,000.00	0.84
4	其中:国债	168,117,000.00	0.84
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
7	应收利息	23,300,000.00	3.34
8	其中:应收股利	--	--
9	其他资产	11,227,302.74	1.63
10	合计	609,700,686.96	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	23,436,401.20	3.50
D	电力、热力、燃气及生产供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	金融业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术业	40,147,474.62	6.00
J	医药生物	--	--
K	房地产业	--	--
L	综合服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	教育	--	--
P	文化艺术业	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	水利、管理和公共事业	--	--
S	其他	62,548,576.02	93.05

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.4 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	国债投资	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	26,441,260.00	11.17
4	企业债券	116,277,000.00	50.21
5	企业短期融资券	9,872,000.00	4.30
6	中期票据	19,214,000.00	8.41
7	可转债(可交换债)	--	--
8	其他	19,214,000.00	8.41
9	合计	170,166,000.00	74.09

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	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
2	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
3	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
4	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
5	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
2	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
3	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
4	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
5	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01

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贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,227,302.74	11,227,302.74	1.63

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权证投资明细

序号	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	无	0	0	0

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	344,550.00
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	10,673,627.90
4	应收股利	--
5	其他应收款	369,288.00
6	其他流动资产	--
7	其他	--
8	合计	11,227,302.74

5.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
2	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
3	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
4	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
5	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
2	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
3	140002	14附息国债(02)	400,000	40,340,000.00	6.01
4	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01
5	160312	16兴业债(01)	400,000	40,340,000.00	6.01

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000006	中航长航	468,500	3,078,048.00	0.45

5.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000001	平安银行	209,811	9,754,465.01	1.48
2	000310	中远海发	204,400	9,596,867.20	1.43
3	000410	广联达	313,300	8,360,174.00	1.26
4	300036	超图软件	364,400	7,864,380.00	1.17
5	002369	卓创信息	262,541	7,769,880.01	1.16
6	002019	深信服	184,000	6,703,140.00	1.00
7	000002	万科A	209,300	6,348,360.00	0.95
8	000221	富春环保	152,130	4,699,480.00	0.70
9	000				