兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年03月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年3月26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。

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及其更新。

本年度报告摘要编自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业多策略混合
基金主代码	000963
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年01月23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
报告期末基金份额总额	527,921,600.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采用"自上而下"的大类资产配置策略和"自下而上"的股票投资策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+1%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,长期预风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王蕾	罗雪蓉
	联系电话	021-22211888	010-58560666
	电子邮箱	zhuoyue@xy-fund.com.cn	ygdxjglzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		40000-95561	95568
传真		021-22211997	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xfr-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-41,083,179.83	-10,504,740.74	62,363,650.02
本期利润	-74,095,755.94	-33,523,948.52	-36,764,816.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1844	-0.0750	-0.0649
本期基金份额净值增长率	-14.44%	-6.16%	-4.56%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0430	0.2192	0.2993
期末基金资产净值	550,637,201.19	466,155,552.69	639,796,008.31
期末基金份额净值	1.043	1.219	1.299

1、所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。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

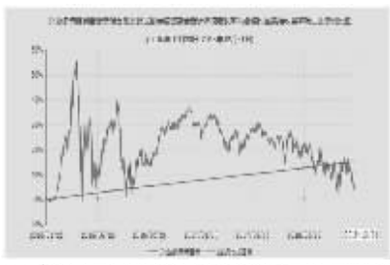
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

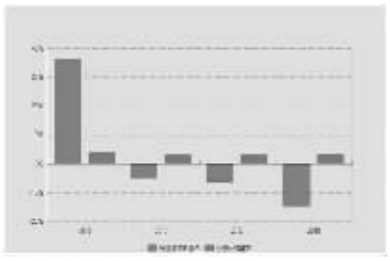
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.15%	1.73%	0.83%	0.01%	-9.98%	1.72%
过去六个月	-9.62%	1.54%	1.67%	0.01%	-11.29%	1.53%
过去一年	-14.44%	1.35%	3.36%	0.02%	-17.80%	1.34%
过去三年	-23.37%	1.24%	10.81%	0.02%	-34.18%	1.23%
自基金合同生效起至今	4.30%	1.57%	15.32%	0.01%	-11.02%	1.56%

注:本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+1%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

2013年3月,兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海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,注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2018年12月31日,兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、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、兴业裕年债券型证券投资基金、兴业裕丰债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金、兴业机遇债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业安润货币市场基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰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、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业安保优选混合型证券投资基金、兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
WEIDONG WU(吴卫东)	基金经理	2015-01-23	2018-01-18	23年	美国籍,物理学博士,具有证券投资基金从业资格,曾在美国证券交易协会(NASD)注册,1994-1996年任德意志银行量化策略研究员(Associate Director),1998-2002年任摩尔(Moore)资产管理公司投资策略研究员,2002-2006任千禧(Millennium)基金投资经理,2007-2010任联邦(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负责人,2013年7月加入兴业基金管理公司,现任基金经理。
冯刚	股票业务总监,基金经理	2017-05-22	-	14年	中国籍,加拿大多伦多大学MBA及中国人民大学经济学硕士,特许金融分析师(CFA),具有证券投资基金从业资格。2002年7月至2003年8月在第一创业证券有限公司证券投资部担任研究员,2003年11月至2013年3月在汇丰晋信基金管理有限公司投资部担任研究员、高级研究员、基金经理,期间2009年7月至2010年12月担任汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理,2010年1月至2011年3月担任汇丰晋信2020生命周期证券投资基金基金经理,2011年3月至2014年6月在中国国际金融有限公司资产管理部担任投资经理(执行总经理级别),管理中金安心回报、中金股票策略、中金股票精选集合资产管理计划。2014年6月至2015年3月在汇丰晋信基金管理有限公司担任QDII投资咨询部总监,负责四只QDII基金的投资顾问工作。2015年2月加入兴业基金管理有限公司,现任股票投资部股票业务总监,基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易;事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内,各项业务操作根据制度和业务流程进行;事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差,编制投资组合公平交易报告,分析事中控制的效果。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年A股内忧外患,市场大幅下跌,主要指数下跌25%-30%。内部的不利因素主要是去杠杆导致表外融资大幅收缩,信用事件阶段性多发,中小企业融资困难。同时还出现了一些国进民退的情况,导致民营企业缺乏中长期信心、投资动力不足。外部的主要不利因素是中美贸易战及美联储持续加息。中美贸易战及科技领域的摩擦给中国的经济增长(特别是出口部门)及技术进步带来很大压力。同时,美联储在2018年持续加息,给中国的货币环境带来较大的外部压力,也导致人民币出现较大的阶段性贬值。以上因素逐步形成共振,四季度之后房地产市场及车市同时明显降温,宏观经济的压力陡然增大。

面对这些问题,政府逐步调整宏观政策,去杠杆转为稳杠杆,财政政策转向积极、基建补短板,减税计划逐步推出,针对中小企业定向货币宽松,针对股权质押风险成立舒困基金,针对中美贸易战务实应对积极谈判。通过多方面努力,宏观形势开始缓和。

本基金在2018年上半年减仓、下半年加仓。配置的主要行业有大金融、医药、新能源汽车、大消费、电子及传媒、光伏等。个股层面相对分散。基金业绩明显好于市场及同类基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业多策略混合基金份额净值为1.043元,本报告期内,基金份额净值增长率为-14.44%,同期业绩比较基准收益率为3.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,市场估值在历史低位,风险因素反映得较充分。中美贸易战短期内缓和,财政政策更加积极,减税政策可期;宽信用正在逐步展开,对民营企业的信贷趋于宽松,市场利率有所下行。市场很可能已经见底,并且展开震荡反弹。中长期来看,宏观经济及市场仍有较大的基本面压力,市场可能仍需磨底,但长期向上空间大于向下风险。

4.6 管理人对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、风险管理总部、研究部、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,以保证其持续适用;评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性,对新投资策略或新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、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对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前提下,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个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配,但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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投资运作方面进行了监督,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损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配 。

5.3 托管人对本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 审计报告

本报告期基金财务报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

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12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	2,585,810.23	13,539,173.40
结算备付金	1,495,310.63	3,138,805.03
存出保证金	233,638.18	232,982.43
交易性金融资产	545,351,915.52	378,892,297.08
其中:股票投资	511,245,915.52	348,910,297.08
基金投资	-	-
债券投资	34,106,000.00	29,982,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	60,000,000.00
应收证券清算款	1,878,159.15	24,322,175.87
应收利息	613,851.67	994,926.73
应收股利	-	-
应收申购款	126,604.38	83,013.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	552,287,269.76	481,203,373.74
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	12,215,238.99
应付赎回款	147,676.37	1,467,410.98
应付管理人报酬	740,228.95	604,523.49
应付托管费	123,371.51	100,753.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	308,772.38	509,539.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,019.36	150,334.11
负债合计	1,650,068.57	15,047,821.05
所有者权益:		
实收基金	527,921,600.29	382,336,000.36
未分配利润	22,715,600.90	83,819,552.33
所有者权益合计	550,637,201.19	466,155,552.69
负债和所有者权益总计	552,287,269.76	481,203,373.74

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.043元,基金份额总额527,921,600.29份。

7.2 利润表

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

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	-62,993,096.26	-20,723,098.18
1.利息收入	1,892,719.22	2,691,477.87
其中:存款利息收入	112,479.17	79,473.83
债券利息收入	1,055,013.70	1,424,195.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	725,226.35	1,187,808.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-31,925,472.35	-571,815.54
其中:股票投资收益	-38,331,184.23	-6,155,367.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,310.00	-702,190.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,382,401.88	6,285,742.24
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-33,012,576.11	-23,019,207.78
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	52,232.98	176,447.27
减:二、费用	11,102,659.68	12,800,850.34
1.管理人报酬	7,014,003.94	8,534,582.42
2.托管费	1,169,000.63	1,422,430.49
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,568,874.52	2,494,359.07
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	350,780.59	349,478.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-74,095,755.94	-33,523,948.52
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-74,095,755.94	-33,523,948.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

卓新安	汪孝强	杨怡斐
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

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

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	382,336,000.36	83,819,552.33	466,155,552.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-74,095,755.94	-74,095,755.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	145,585,599.93	12,991,804.51	158,577,404.44
其中:1.基金申购款	230,096,985.16	30,689,567.05	260,786,552.21
2.基金赎回款	-84,511,385.23	-17,697,762.54	-102,209,147.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	527,921,600.29	22,715,600.90	550,637,201.19
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	492,397,407.95	147,398,600.36	639,796,008.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-33,523,948.52	-33,523,948.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-110,061,407.59	-30,055,099.51	-140,116,507.10
其中:1.基金申购款	47,113,400.89	12,717,221.27	59,830,622.16
2.基金赎回款	-157,174,808.48	-42,772,320.78	-199,947,129.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	382,336,000.36	83,819,552.33	466,155,552.69

注:本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,014,003.94	8,534,582.42
其中:支付销售机构的客户维护费	1,975,105.63	3,000,356.21

注:支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,169,000.63	1,422,430.49

注:支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
民生银行	4,028,200.00	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日(2015年01月23日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	55,867,836.70	55,867,836.70
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	55,867,836.70	55,867,836.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.58%	14.61%

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。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	2,585,810.23	50,885.24	13,539,173.40	43,056.23

本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管,按银行同业或协议利率计息。

7.4.8.6 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在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项	16.01	2019-01-10	17.15	892,784	15,228,680.62	14,293,471.84	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的金额为人民币496,902,297.88元,属于第二层次的金额为人民币48,449,617.64元,无属于第三层次的金额(于2017年12月31日:第一层次为人民币348,761,788.88元,第二层次为人民币30,130,508.20元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii)第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	511,245,915.52	92.57
	其中:股票	511,245,915.52	92.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,106,000.00	6.18
	其中:债券	34,106,000.00	6.18
	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	-	-
	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	4,081,120.86	0.74
8	其他各项资产	2,854,233.38	0.52
9	合计	552,287,269.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,052,675.60	0.92
B	采矿业	-	-
C	制造业	221,897,974.64	40.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,857,412.00	1.25
F	批发和零售业	13,905,574.76	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	33,394,051.00	6.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,597,184.49	7.01
J	金融业	108,990,523.52	19.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,473,417.24	6.62
M	科学研究和技术服务业	7,137,227.26	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	22,021,625.01	4.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,918,250.00	3.07
S	综合	-	-
	合计	511,245,915.52	92.85

8.3 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

金额单位: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	002262	恩华药业	3,731,355	33,656,822.10	6.11
2	002027	分众传媒	6,221,189	32,599,030.36	5.92
3	601336	新华保险	527,491	22,281,219.84	4.05
4	002050	三花智控	1,730,498	21,960,019.62	3.99
5	601111	中国国航	2,658,400	20,330,176.00	3.69
6	601318	中国平安	360,110	20,202,171.00	3.67
7	002456	欧菲科技	2,132,464	19,597,344.16	3.56
8	601601	中国太保	678,128	19,279,179.04	3.50
9	600036	招商银行	746,692	18,816,636.40	3.42
10	601233	桐昆股份	1,875,827	18,308,071.52	3.32

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

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	002027	分众传媒	49,604,908.80	10.64
2	002262	恩华药业	47,767,112.76	10.25
3	601601	中国太保	42,912,444.11	9.21
4	300166	东方国信	42,243,197.22	9.06
5	002456	欧菲科技	40,663,260.44	8.72
6	600887	伊利股份	36,037,535.85	7.73
7	300203	聚光科技	32,141,772.01	6.90
8	601211	国泰君安	31,874,712.00	6.84
9	601233	桐昆股份	31,523,433.08	6.76
10	601336	新华保险	28,933,081.50	6.21
11	600011	华能国际	28,156,498.37	6.04
12	600030	中信证券	27,680,928.00	5.94
13	603708	家家悦	27,147,458.68	5.82
14	600036	招商银行	25,345,962.42	5.44
15	601318	中国平安	25,116,775.00	5.39
16	002271	东方雨虹	25,096,612.21	5.38
17	300136	信维通信	24,238,795.32	5.20
18	002511	中顺洁柔	23,837,913.51	5.11
19	601111	中国国航	23,824,528.00	5.11
20	600885	宏发股份	22,085,695.74	4.74
21	000910	大亚圣象	21,164,883.80	4.54
22	002050	三花智控	21,001,416.00	4.51
23	600741	华域汽车	20,462,372.40	4.39
24	600837	海通证券	20,042,893.88	4.30
25	002475	立讯精密	17,155,311.94	3.68
26	002239	万达电影	16,837,130.90