

## 兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

### 2019年第三季度报告

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人数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

##### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	422,967,219.69	63.67
1.1	其中:股票	422,967,219.69	63.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,026,000.00	6.01
3.1	其中:债券	40,026,000.00	6.01
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
6.1	买入返售金融资产	176,000,000.00	26.71
6.1.1	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	23,470,266.20	3.52
8	其他资产	1,565,736.97	0.23
9	合计	666,418,310.86	100.00

##### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	363,431.26	0.05
C	制造业	234,516,253.31	36.30
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	12,161,480.00	1.83
F	批发和零售业	6,262,520.26	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	1,226,564.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,176,300.10	8.00
J	金融业	29,372,743.28	4.42
K	房地产业	11,500,360.00	1.73
L	租赁和商务服务业	10,066,660.01	1.51
M	科学研究和技术服务业	6,378,720.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	19,931,713.58	3.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,061,600.00	3.17
R	文化、体育和娱乐业	17,980,200.00	2.71
S	合计	422,967,219.69	63.67

##### 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	000588	云南白药	472,056	39,483,006.10	5.94
2	000468	华邦制药	1,060,853	36,403,154.28	5.53
3	002292	圣达生物	2,576,664	27,902,059.66	4.19
4	001077	正海生物	1,104,674	25,111,540.66	3.79
5	600566	济川药业	626,065	24,872,817.15	3.74
6	601233	信创股份	1,577,727	24,470,546.77	3.68
7	002650	三花智控	2,114,338	22,306,268.00	3.38
8	002044	美年健康	1,692,260	21,061,000.00	3.17
9	000054	广汇能源	2,146,162	19,931,713.58	2.99
10	601336	新华保险	367,100	19,061,213.00	2.86

## 信息披露

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  
报告送出日期:2019年07月19日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及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2019年7月17日复核了本报告内容真实、准确和完整,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责任。  
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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	兴业多策略混合
基金代码	000635
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
报告期末基金资产总额	666,418,310.86
报告期末基金份额总额	248,001,485.20份
投资目标	本基金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,力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的个股选择策略相结合的方式进行资产配置和风险控制。
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,其预期风险和预期收益高于纯货币基金和债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。
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

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

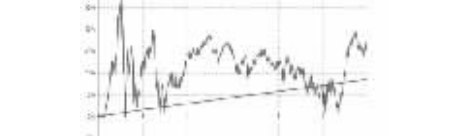
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2019年04月01日~2019年06月30日)
1.本期已实现收益	24,090,031.61
2.本期利润	1,362,004.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	664,219,430.63
5.期末基金份额净值	1.341

注:1、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。  
2、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下列数字。

#### 3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	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	0.116%	0.709%	0.026%	0.011%	-0.763%	0.768%

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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



#### § 4 管理人报告

##### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
徐晋	基金经理	2017-01-19	-	06

##### 4.2 基金经理(或基金经理小组)简介

中国籍,硕士学位,具有证券从业资格,2017年7月加入本公司,在零售银行部担任产品经理工作,主要负责零售银行部理财产品销售工作,2018年6月加入兴业基金管理有限公司,担任零售银行部产品经理工作,2019年6月加入兴业基金管理有限公司,担任零售银行部产品经理工作。

##### 4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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。

##### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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。

##### 4.5 报告期内基金的投资表现

截至报告期末兴业多策略混合基金份额净值为1.341元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.116%,同期业绩比较基准收益率为0.036%。

##### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.7 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.8 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.9 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.10 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.11 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.12 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.13 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.14 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.15 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.16 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.17 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.18 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.19 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.20 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.21 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.22 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.23 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.24 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.25 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.26 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

##### 4.27 基金资产净值预警说明

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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

### 2019年第三季度报告

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人数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

##### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	73,636,416.23	20.83
1.1	其中:股票	73,636,416.23	20.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	263,442,800.00	74.14
3.1	其中:债券	263,442,800.00	74.14
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
6.1	买入返售金融资产	-	-
6.1.1	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	5,540,112.01	1.57
8	其他资产	10,624,682.74	3.02
9	合计	363,448,379.88	100.00

##### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	10,130,200.10	6.16
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业	-	-
E	建筑业	9,067,970.00	2.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,588,800.60	3.73
J	金融业	24,303,340.53	7.84
K	房地产业	8,965,176.00	2.88
L	租赁和商务服务业	8,965,176.00	2.88
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	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	500,810.00	0.16
S	合计	73,636,416.23	20.83

##### 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	601668	中国铁建	1,675,300	9,067,970.00	2.91
2	601001	中国太保	247,200	9,025,272.00	2.88
3	601088	工商银行	1,530,177	9,012,762.00	2.88
4	600048	保利地产	762,400	8,965,176.00	2.88
5	600066	宏发股份	230,570	5,907,032.00	1.93
6	601318	中国平安	38,400	3,367,100.00	1.02
7	600570	恒生电子	46,400	3,162,160.00	1.08
8	000061	长春高新	9,000	3,046,000.00	0.98
9	600000	中信证券	126,500	2,980,165.00	0.96
10	600009	山西路桥	38,400	2,661,520.00	0.85

##### 5.4 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债券投资明细

序号	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	230,436,464.38	6.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,026,000.00	6.02
3.1	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	36,176,500.00	11.31
5	中期票据	67,989,500.00	21.86
6	资产支持证券	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	363,442,800.00	84.71

##### 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	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	央行票据	29,856,000.00	9.60
2	金融债券	121,420,000.00	36.04
3	企业债券	36,176,500.00	11.31
4	中期票据	67,989,500.00	21.86
5	资产支持证券	-	-

##### 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

本报告期内,本基金未持有资产支持证券。

##### 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

本报告期内,本基金未持有贵金属投资。

##### 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

本报告期内,本基金未持有权证投资。

##### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本报告期内,本基金未持有股指期货持仓,也无损益。

##### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策  
本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考量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。

##### 5.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未持有国债期货持仓,也无损益。

##### 5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内,本基金未持有国债期货持仓,也无损益。

##### 5.13 其他资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金	-	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	-
5	其他应收款	-	-
6	其他	-	-
7	合计	-	-

##### 5.14 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

本报告期内,本基金未持有股票投资。

##### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,026,000.00	6.02
4	企业债券	40,026,000.00	6.02
5	中期票据	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,026,000.00	6.02

##### 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

2	180312	18进出12	100,000	10,016,000.00	1.51
---	--------	--------	---------	---------------	------

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

##### 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

本报告期内,本基金未持有资产支持证券。

##### 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

本报告期内,本基金未持有贵金属。

##### 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

本报告期内,本基金未持有