

兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	73,874,983.76	16.08
其中:股票		73,874,983.76	16.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	313,293,360.00	68.17
其中:债券		313,293,360.00	68.17
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	51,000,000.00	11.10
其中:买入返售金融资产的买入返售金融资产		-	-
8	银行存款和结算备付金合计	12,034,562.59	2.62
9	其他资产	9,349,210.08	2.03
9	合计	469,561,996.43	100.00

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		-	-
B 医药		-	-
C 制造业		19,569,894.00	4.43
D 电力、热力、燃气及生产		-	-
E 水利、环境和公共设施管		-	-
F 批发和零售业		8,863,276.00	2.01
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		11,604,654.40	2.63
J 金融业		24,376,442.00	5.52
K 房地产业		9,369,762.36	2.03
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学研究和技术服务业		-	-
N 水利、环境和公共设施管		-	-
O 房地产业		-	-
P 教育		-	-
Q 卫生健康业		-	-
R 文化、体育和娱乐业		500,810.00	0.11
S 综合		-	-
9	合计	73,874,983.76	16.73

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	601601	中信证券	248,000	9,054,480.00	2.06
2	601398	工商银行	1,530,000	9,014,640.00	2.04
3	600088	中银证券	762,961	8,960,728.80	2.03
4	601988	中国银河	1,520,700	8,953,376.00	2.01
5	600866	宝钢股份	209,930	9,795,306.40	2.16
6	601318	中国平安	37,700	3,340,597.00	0.76
7	600099	山东路桥	46,400	3,203,520.00	0.73
8	600570	恒生电子	46,900	3,196,235.00	0.72
9	000061	长春高新	9,000	3,043,000.00	0.69
10	600030	中信证券	124,600	2,990,728.00	0.67

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据基金合同决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年上半年权益市场表现好于债券市场，股票市场在经济阶段性企稳、无风险利率低位的情况下，风险偏好有所回升，但估值仍偏高配置有所修复，同时可转债市场的期权价格也随着波动率的加大呈现出修复的特征。受业绩驱动和通胀预期的影响，上半年消费类行业表现较好，我们会根据宏观政策环境，以及各细分资产的风险和收益率预期变化，主动调整持仓的结构和仓位，争取为基金持有人获得稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的投资表现

截至报告期末兴业聚盈灵活配置混合基金份额净值为1.110元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

4.6 报告期内基金持有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。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票		-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,540,300.00	96.69
其中:债券		129,540,300.00	96.69
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买入返售金融资产的买入返售金融资产		-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,836,444.47	1.39
8	其他资产	2,617,628.22	1.96
9	合计	133,974,972.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,196,200.00	5.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,216,500.00	33.80
其中:政策性金融债		38,216,500.00	33.80
4	企业债券	85,329,200.00	75.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,540,300.00	114.58

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	180204	18国债04	1,200,000	128,380,000.00	6.27
2	1119966	18国债03	1,000,000	96,300,000.00	4.94
3	180309	18国债09	700,000	72,348,000.00	3.62
4	180207	18国债07	400,000	38,772,000.00	1.99
5	180204	18国债04	300,000	29,880,000.00	1.49

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125933	20国开03	400,000	40,475,788.20	2.02

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

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

本基金投资范围不包含国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金为债券型基金，不涉及股票相关投资。

5.11.3 其他资产构成

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.52 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.53 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.56 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.57 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.59 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.60 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.61 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.63 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明