

兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不存有虚假记载、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。
基金托管人报告期间内没有对本基金进行审计，但存有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售机构承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行基金销售职责，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期(2017年1月1日起至3月31日)。

§ 2 基金产品概况

| 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 | | 2,510,560.00 | 0.21 |
| B 采矿业 | | - | - |
| C 制造业 | | 41,185,494.44 | 3.41 |
| D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | | - | - |
| E 建筑业 | | 20,561,275.68 | 1.70 |
| F 批发和零售业 | | 4,009,645.43 | 0.33 |
| 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 | | 7,867,827.10 | 0.65 |
| J 金融业 | | 44,624,850.05 | 3.69 |
| K 房地产业 | | - | - |
| L 租赁和商务服务业 | | - | - |
| M 科学研究、技术服务和地质勘查业 | | - | - |
| N 水利、环境和公共设施管理业 | | 9,467,826.00 | 0.78 |
| 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 | | - | - |
| S 综合 | | - | - |
| 合计 | | 130,377,306.03 | 10.70 |

§ 3 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 601377 | 兴业证券 | 1,303,418 | 9,981,181.88 | 0.85 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 417,700 | 8,007,360.00 | 0.66 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 379,599 | 7,179,217.09 | 0.59 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 192,900 | 7,139,228.00 | 0.59 |
| 5 | 601688 | 中国建筑 | 762,000 | 7,010,400.40 | 0.56 |
| 6 | 002666 | 欧亚集团 | 140,700 | 5,339,304.60 | 0.44 |
| 7 | 000170 | 上海建工 | 1,024,000 | 4,997,120.00 | 0.41 |
| 8 | 002460 | 康得新 | 200,300 | 4,976,960.00 | 0.41 |
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 196,973 | 4,966,165.00 | 0.41 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 178,815 | 4,903,307.30 | 0.41 |
| 合计 | | | 1,028,996,500.00 | 85.00 | |

§ 4 报告期末按行业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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 341,252,000.00 | 28.24 |
| 4 | 政策性金融债 | 341,252,000.00 | 28.24 |
| 5 | 企业债券 | - | - |
| 6 | 公司企业债券 | 374,781,500.00 | 31.02 |
| 7 | 中期票据 | - | - |
| 8 | 资产支持券 | 79,000,000.00 | 0.01 |
| 9 | 其他 | 322,796,000.00 | 26.72 |
| 10 | 债券回购 | - | - |
| 合计 | | 1,028,996,500.00 | 85.00 |

§ 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贵金属投资明细

| 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 | 160007 | 国开行CD07 | 210,000 | 211,069,000.00 | 17.47 |
| 2 | 111606706 | 16农商行MTN001(CD124) | 800,000 | 77,192,000.00 | 6.29 |
| 3 | 130301 | 13国开行CD01 | 500,000 | 60,105,000.00 | 4.15 |
| 4 | 111700366 | 17上海农商银行CD017 | 400,000 | 39,164,000.00 | 3.24 |
| 5 | 0116962 | 01浦发银行CD3003 | 300,000 | 30,096,000.00 | 2.40 |
| 合计 | | | 1,028,996,500.00 | 85.00 | |

注:本基金本报告期最后一期定期存款到期收益率为1%。

§ 6.2 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组合

| 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 | 601377 | 兴业证券 | 1,303,418 | 9,981,181.88 | 0.85 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 417,700 | 8,007,360.00 | 0.66 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 379,599 | 7,179,217.09 | 0.59 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 192,900 | 7,139,228.00 | 0.59 |
| 5 | 601688 | 中国建筑 | 762,000 | 7,010,400.40 | 0.56 |
| 6 | 002666 | 欧亚集团 | 140,700 | 5,339,304.60 | 0.44 |
| 7 | 000170 | 上海建工 | 1,024,000 | 4,997,120.00 | 0.41 |
| 8 | 002460 | 康得新 | 200,300 | 4,976,960.00 | 0.41 |
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 196,973 | 4,966,165.00 | 0.41 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 178,815 | 4,903,307.30 | 0.41 |
| 合计 | | | 1,028,996,500.00 | 85.00 | |

注:本基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期同业业比较基准收益率的差额

§ 7.1 本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组合

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------------|------------------|----------------|--------------|
| 1 | 601377 | 兴业证券 | 210,000 | 211,069,000.00 | 17.47 |
| 2 | 111606706 | 16农商行MTN001(CD124) | 800,000 | 77,192,000.00 | 6.29 |
| 3 | 130301 | 13国开行CD01 | 500,000 | 60,105,000.00 | 4.15 |
| 4 | 111700366 | 17上海农商银行CD017 | 400,000 | 39,164,000.00 | 3.24 |
| 5 | 0116962 | 01浦发银行CD3003 | 300,000 | 30,096,000.00 | 2.40 |
| 合计 | | | 1,028,996,500.00 | 85.00 | |

注:本基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期同业业比较基准收益率的差额

§ 7.2 本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

| 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 | 160007 | 16国开行CD07 | 210,000 | 211,069,000.00 | 17.47 |
| 2 | 111606706 | 16农商行MTN001(CD124) | 800,000 | 77,192,000.00 | 6.29 |
| 3 | 130301 | 13国开行CD01 | 500,000 | 60,105,000.00 | 4.15 |
| 4 | 111700366 | 17上海农商银行CD017 | 400,000 | 39,164,000.00 | 3.24 |
| 5 | 0116962 | 01浦发银行CD3003 | 300,000 | 30,096,000.00 | 2.40 |
| 合计 | | | 1,028,996,500.00 | 85.00 | |

注:本基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期同业业比较基准收益率的差额

§ 7.3 本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贵金属投资

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|---------|----------------|--------------|
| 1 | 160007 | 16国开行CD07 | 210,000 | 211,069,000.00 | 17.47 |
| 2 | 111606706 | 16农商行MTN001(CD12 | | | |