

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
冯刚	股票业务总监、基金经理	2017-05-22	-	15年

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	采矿业	-	-
C	制造业	1,381,739,147.38	20.79
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	15,498,867.00	2.32
F	批发和零售业	7,389,403.22	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	8,154,500.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	11,072,967.30	1.73
J	金融业	13,413,263.00	2.01
K	房地产业	3,275,616.00	0.49
L	租赁和商务服务业	33,140,643.03	4.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,894,667.76	3.13
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	23,106,024.00	3.46
S	综合	-	-
合计		276,156,994.79	41.22

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	000027	华发股份	5,289,589	33,140,643.03	4.96
2	002511	中顺洁柔	217,813	25,795,037.88	3.86
3	002729	万达电影	1,073,700	20,300,024.00	3.06
4	000638	云南白药	252,466	21,584,902.50	3.23
5	600054	黄山旅游	1,758,802	20,894,667.76	3.13
6	601228	烟台港	1,368,323	20,702,797.51	3.10
7	002282	世纪华通	1,628,794	20,415,762.29	3.05
8	600966	神州数码	495,000	17,487,400.00	2.62
9	002061	中广天润	1,029,300	15,498,867.00	2.32
10	002950	三花智控	789,614	12,273,251.38	1.85

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	000027	华发股份	5,289,589	33,140,643.03	4.96
2	002511	中顺洁柔	217,813	25,795,037.88	3.86
3	002729	万达电影	1,073,700	20,300,024.00	3.06
4	000638	云南白药	252,466	21,584,902.50	3.23
5	600054	黄山旅游	1,758,802	20,894,667.76	3.13
6	601228	烟台港	1,368,323	20,702,797.51	3.10
7	002282	世纪华通	1,628,794	20,415,762.29	3.05
8	600966	神州数码	495,000	17,487,400.00	2.62
9	002061	中广天润	1,029,300	15,498,867.00	2.32
10	002950	三花智控	789,614	12,273,251.38	1.85

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,109,000.00	6.01
4	企业债券	40,109,000.00	6.01
5	中期票据	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,109,000.00	6.01

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	40,109,000.00	6.01
4	企业债券	40,109,000.00	6.01
5	中期票据	-	-

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五名股指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1905	-	-

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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证	-	-

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内未进行股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未进行国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

本基金报告期内未进行资产支持证券投资。

5.11 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

本基金报告期内未进行资产支持证券投资。

5.12 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

本基金报告期内未进行贵金属投资。

5.13 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大宗商品投资明细

本基金报告期内未进行大宗商品投资。

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五名衍生品投资明细

本基金报告期内未进行衍生品投资。

5.15 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境外证券投资明细

本基金报告期内未进行境外证券投资。

5.16 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境外衍生品投资明细

本基金报告期内未进行境外衍生品投资。

5.17 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境外资产支持证券投资明细

本基金报告期内未进行境外资产支持证券投资。

5.18 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境外股指期货投资明细

本基金报告期内未进行境外股指期货投资。

5.19 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境外权证投资明细

本基金报告期内未进行境外权证投资。

5.20 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境外国债期货投资明细

本基金报告期内未进行境外国债期货交易。

5.21 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境外资产支持证券投资明细

本基金报告期内未进行境外资产支持证券投资。

5.22 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境外衍生品投资明细

本基金报告期内未进行境外衍生品投资。

5.23 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境外资产支持证券投资明细

本基金报告期内未进行境外资产支持证券投资。

5.24 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境外股指期货投资明细

本基金报告期内未进行境外股指期货投资。

5.25 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境外权证投资明细

本基金报告期内未进行境外权证投资。

5.26 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境外国债期货投资明细

本基金报告期内未进行境外国债期货交易。

5.27 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境外资产支持证券投资明细

本基金报告期内未进行境外资产支持证券投资。

B166

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04月18日												
<p>5.1 重要提示</p> <p>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。</p> <p>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4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。</p> <p>本报告自2019年1月1日起至3月31日止。</p>												
<p>5.2 基金产品概况</p> <p>基金名称: 兴业多策略灵活配置混合</p> <p>基金代码: 000903</p> <p>基金运作方式: 契约型开放式</p> <p>基金合同生效日期: 2018年07月20日</p> <p>报告期末基金份额总额: 489,514,527.21份</p> <p>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。</p> <p>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”的个股投资策略相结合的方式进行资产配置和组合风险管理。</p> <p>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%。</p> <p>风险收益特征: 本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。</p> <p>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</p>												
<p>3.1 主要财务指标</p> <p>单位:人民币元</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>主要财务指标</th> <th>报告期(2019年01月01日至2019年03月31日)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1.本期已实现收益</td> <td>41,878,686.15</td> </tr> <tr> <td>2.本期利润</td> <td>164,319,079.33</td> </tr> <tr> <td>3.本期加权平均基金份额本期利润</td> <td>0.3277</td> </tr> <tr> <td>4.期末基金资产净值</td> <td>667,565,050.20</td> </tr> <tr> <td>5.期末基金份额净值</td> <td>1.330</td> </tr> </tbody> </table>	主要财务指标	报告期(2019年01月01日至2019年03月31日)	1.本期已实现收益	41,878,686.15	2.本期利润	164,319,079.33	3.本期加权平均基金份额本期利润	0.3277	4.期末基金资产净值	667,565,050.20	5.期末基金份额净值	1.330
主要财务指标	报告期(2019年01月01日至2019年03月31日)											
1.本期已实现收益	41,878,686.15											
2.本期利润	164,319,079.33											
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.3277											
4.期末基金资产净值	667,565,050.20											
5.期末基金份额净值	1.330											

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。

注: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可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	28.28%	1.17%	0.80%	0.01%	27.48%	1.16%

注:本基金业绩比较基准为: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率变动的比较



5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
杨晓宇	基金经理	2015-11-09	-	9年

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日至2019年03月31日)
1.本期已实现收益	94,192,515.28
2.本期利润	126,779,019.60
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.0150
4.期末基金资产净值	8,578,586,309.60
5.期末基金份额净值	1.022

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。

注: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可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	1.80%	0.06%	0.47%	0.05%	1.02%	0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数。

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率变动的比较



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04月18日

5.1 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4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	兴业添利债券
基金代码	001290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年06月10日
报告期末基金份额总额	8,369,907,774.95
投资目标	在严格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	本基金通过对宏观经济、利率走势、资产供求、信用风险状况、证券市场走势等方面分析判断,综合运用资产配置策略、久期策略、收益率策略、信用策略等手段,在有效控制风险并实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中国债综合全价指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金,低于混合型证券投资基金和股票型基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日至2019年03月31日)
1.本期已实现收益	1,984,476.22
2.本期利润	5,893,428.21
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.0072
4.期末基金资产净值	112,687,097.60
5.期末基金份额净值	1.224

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。

注: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可能低于所列数字。

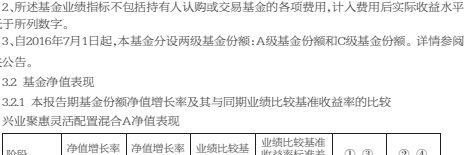
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	1.41%	0.09%	0.92%	0.01%	0.49%	0.08%

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率变动的比较



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04月18日

5.1 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4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	兴业聚惠灵活配置混合
基金代码	001447
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年07月10日
报告期末基金份额总额	91,969,069.05
投资目标	通过稳健的资产配置策略,严格控制下行风险,力争实现基金资产的长期保值增值。
投资策略	本基金通过广泛的大类资产配置策略和个股精选策略,在有效控制风险的前提下,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。
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,其预期收益和风险高于货币型基金和债券型基金,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

3.1 主要财务指标