

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31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

送出日期：2017年3月31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2017年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业聚利灵活配置混合
基金主代码	001272
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月7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	326,800,156.94
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金旨在力争获得高于业绩比较基准的投资收益，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。
业绩比较基准	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	朱玮
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	renjb@cib-fund.com.cn
		罗菲菲
		010-58560666
		tgbfxjdzx@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.cib-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	2016年	2015年5月7日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	39,802,974.68	160,684,396.27
本期利润	34,233,203.32	165,305,739.60
加权平均基金份额本期利润	0.1989	0.0604
本期基金份额净值增长率	29.85%	14.90%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.4919	0.1446
期末基金资产净值	487,560,396.33	324,083,932.99
期末基金份额净值	1.492	1.149

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所列数字。

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	1.57%	0.41%	0.89%	0.01%	0.68%	0.40%
过去六个月	6.50%	0.58%	1.80%	0.01%	4.70%	0.57%
过去一年	29.85%	0.65%	3.65%	0.01%	26.20%	0.64%
自基金合同生效日起至今	49.20%	0.60%	6.44%	0.01%	42.76%	0.59%

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%。

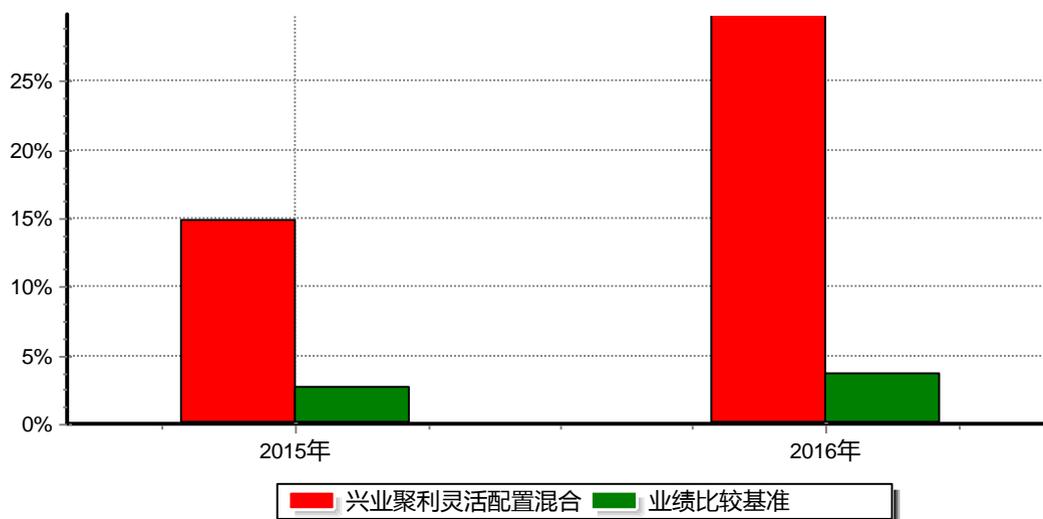
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

兴业聚利灵活配置混合型证券投资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对比图



注：本基金基金合同于2015年5月7日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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7亿元人民币，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2016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、兴业货币市场证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财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、兴业添利债券型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业丰利债券型证券投资基金、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、兴业保本混合型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基

金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、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、兴业聚全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、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金。

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		
腊博	本基金的基金经理	2015年5月14日	—	12	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2003年7月至2006年4月，在新西兰ANYING国际金融有限公司担任货币策略师；2007年1月至2008年5月，在新西兰FORSIGHT金融研究有限公司担任策略分析师；2008年5月至2010年8月，在长城证券有限责任公司担任策略研究员；2010年8月至2014年12月就职于中欧基金管理有限公司，其中2010年8月至2012年1月担任宏观、策略研究员，2012年1月至2013年8月担任中欧新趋势股票型证券投资基金、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型

					证券投资基金、中欧货币市场基金的基金经理助理，2013年8月至2014年12月担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。2014年12月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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合规守信情况的说明

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

在投资操作上，本基金秉持绝对收益的理念，自上而下进行资产配置，根据各细分资产的风险和收益率预期变化进行动态调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为29.85%，同期业绩比较基准收益率为3.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在投资操作上，本基金秉持绝对收益的理念，自上而下进行资产配置，根据各细分资产的风险和收益率预期变化进行动态调整。

展望未来，宏观经济受到大宗商品价格上涨的影响有所企稳，未来驱动经济的主要动力可能来自于库存、制造业投资、和基建投资，货币政策整体保持中性，短期看不到宽松的迹象。股市经历了2016年年末的一轮调整，短期风险已经释放，可视为相对安全，但还需关注2017年二季度可能出现的经济放缓风险。总体来看，2017年股票市场环境相比2016年略好一些，尤其是下半年，货币政策的边际变化值得期待。配置上仍会关注那些有业绩和安全边际支撑的个股，如果下半年政策有改善的迹象，则可以更多的关注成长股。部分成长股经过持续调整，估值渐渐回归正常水平，投资价值正在逐渐显现，随着这一类股票的占比越来越高，相信股市的吸引力将超过债券市场。

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》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

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，本基金托管人在对兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，本托管人对本基金管理人—兴业基金管理有限公司在兴业聚利灵活配置混合型证券投资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关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，兴业聚利灵活配置混合型证券投资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

由兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金管理人—兴业基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、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：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	11,449,285.10	164,503,255.18
结算备付金	13,807,687.29	1,320,627.57
存出保证金	629,079.44	431,491.79
交易性金融资产	259,069,620.52	36,968,857.06
其中：股票投资	239,069,620.52	6,929,857.06
基金投资	—	—
债券投资	20,000,000.00	30,039,000.00
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	199,100,260.00	120,000,700.00
应收证券清算款	14,572,475.37	2,981,479.59
应收利息	607,474.79	610,137.73

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

应收股利	—	—
应收申购款	2,838,622.90	29,821.08
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	502,074,505.41	326,846,370.00
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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	9,963,633.33	—
应付赎回款	2,367,254.99	16,901.23
应付管理人报酬	467,480.36	2,083,632.72
应付托管费	38,956.67	173,636.09
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,306,783.73	168,266.97
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	370,000.00	320,000.00
负债合计	14,514,109.08	2,762,437.01
所有者权益：		
实收基金	326,800,156.94	282,080,220.27
未分配利润	160,760,239.39	42,003,712.72
所有者权益合计	487,560,396.33	324,083,932.99
负债和所有者权益总计	502,074,505.41	326,846,370.00

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.492元，基金份额总额326,800,156.94份。

2、本基金2015年5月7日成立，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

7.2 利润表

会计主体：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年5月7日（基金合 同生效日）至2015年12 月31日
一、收入	44,012,017.44	191,038,874.50
1.利息收入	2,792,803.28	28,485,617.73
其中：存款利息收入	332,992.46	19,479,783.38
债券利息收入	896,754.27	1,356,813.68
资产支持证券利息收 入	—	—
买入返售金融资产收 入	1,563,056.55	7,649,020.67
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填 列）	42,621,021.56	96,142,171.82
其中：股票投资收益	40,761,347.99	92,927,052.45
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,039,232.66	208,322.00
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	820,440.91	3,006,797.37
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	-5,569,771.36	4,621,343.33
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）	—	—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,167,963.96	61,789,741.62
减：二、费用	9,778,814.12	25,733,134.90
1. 管理人报酬	2,921,151.02	21,195,269.16
2. 托管费	243,429.29	1,766,272.47
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	6,199,864.39	2,419,101.21
5. 利息支出	5,666.91	16,911.26
其中：卖出回购金融资产支出	5,666.91	16,911.26
6. 其他费用	408,702.51	335,580.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	34,233,203.32	165,305,739.60
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	34,233,203.32	165,305,739.60

注：本基金2015年5月7日成立，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	282,080,220.27	42,003,712.72	324,083,932.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	34,233,203.32	34,233,203.32
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)	44,719,936.67	84,523,323.35	129,243,260.02
其中：1.基金申购款	621,964,616.93	257,750,055.44	879,714,672.37

2.基金赎回款	-577,244,680.26	-173,226,732.09	-750,471,412.35
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）	326,800,156.94	160,760,239.39	487,560,396.33
项 目	上年度可比期间 2015年5月7日（基金合同生效日）至2015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)	5,005,036,402.75	—	5,005,036,402.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	165,305,739.60	165,305,739.60
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)	-4,722,956,182.48	-123,302,026.88	-4,846,258,209.36
其中：1.基金申购款	7,246,805,449.83	261,063,259.27	7,507,868,709.10
2.基金赎回款	-11,969,761,632.31	-384,365,286.15	-12,354,126,918.46
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）	282,080,220.27	42,003,712.72	324,083,932.99

注：本基金2015年5月7日成立，上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

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：

卓新章

黄文锋

夏鹏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[2015] 680号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为5,005,036,402.75份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(15)第0580号的验资报告。基金合同于2015年5月7日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、银行存款、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、债券回购等)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金参与股指期货、国债期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及

2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
- 3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 4)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

6)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称“兴业基金”)	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称“兴业财富”)	基金管理人的子公司

注:上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的股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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的权证交易。

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内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 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,921,151.02	21,195,269.16
其中:支付销售机构的客户维护费	1,130,713.13	—

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1.2%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×1.2%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	243,429.29	1,766,272.47

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0.1%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×0.1%÷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

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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可比期间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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月7日(基金合同生效日) 至2015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	11,449,285.10	184,471.63	14,503,255.18	9,492,161.00
兴业银行	—	—	—	4,512,499.99

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金本报告期存放于关联方的协议存款按银行约定利率计息。

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（2016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

7.4.12.1.1 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	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	

002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币238,741,067.14元，属于第二层次的余额为人民币20,328,553.38元，无属于第三层次的余额。(于2015年12月31日：第一层次为人民币6,882,257.06元，第二层次为人

人民币30,086,600.00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)第三层次公允价值余额和本期变动金额

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	239,069,620.52	47.62
	其中：股票	239,069,620.52	47.62
2	固定收益投资	20,000,000.00	3.98
	其中：债券	20,000,000.00	3.98
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	199,100,260.00	39.66
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	25,256,972.39	5.03
7	其他各项资产	18,647,652.50	3.71
8	合计	502,074,505.41	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

金额单位：人民币元

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	131,375,259.77	26.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	15,592.23	—
F	批发和零售业	19,485,782.11	4.00
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	241,692.20	0.05
J	金融业	78,358,340.85	16.07
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	9,592,953.36	1.97
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	239,069,620.52	49.03

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	占基金资产净值比例(%)
1	601555	东吴证券	1,793,200	23,795,764.00	4.88
2	601688	华泰证券	1,313,948	23,467,111.28	4.81

3	000963	华东医药	270,373	19,485,782.11	4.00
4	600566	济川药业	622,645	19,463,882.70	3.99
5	300115	长盈精密	394,393	10,277,881.58	2.11
6	002475	立讯精密	485,675	10,077,756.25	2.07
7	600079	人福医药	500,486	9,984,695.70	2.05
8	300203	聚光科技	317,018	9,684,899.90	1.99
9	000728	国元证券	483,400	9,619,660.00	1.97
10	300070	碧水源	547,543	9,592,953.36	1.97

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于本公司网站的年度报告正文

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	601555	东吴证券	56,767,500.64	17.52
2	002236	大华股份	44,159,506.18	13.63
3	300182	捷成股份	41,071,795.18	12.67
4	002241	歌尔股份	38,229,192.09	11.80
5	300207	欣旺达	37,945,622.48	11.71
6	002179	中航光电	37,561,241.12	11.59
7	300115	长盈精密	36,759,765.28	11.34
8	601688	华泰证券	36,284,746.49	11.20
9	600699	均胜电子	29,805,075.28	9.20
10	300070	碧水源	28,808,291.60	8.89
11	000963	华东医药	28,243,893.46	8.72
12	300068	南都电源	27,656,869.20	8.53
13	300144	宋城演艺	26,318,935.57	8.12
14	002475	立讯精密	26,041,232.37	8.04
15	002311	海大集团	25,353,071.83	7.82

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

16	300203	聚光科技	23,637,347.07	7.29
17	600566	济川药业	23,206,730.15	7.16
18	000418	小天鹅 A	23,129,165.23	7.14
19	000333	美的集团	23,082,295.06	7.12
20	300303	聚飞光电	22,428,345.92	6.92
21	300017	网宿科技	22,186,935.40	6.85
22	300073	当升科技	21,857,805.32	6.74
23	002450	康得新	21,431,765.07	6.61
24	600562	国睿科技	21,352,531.91	6.59
25	002185	华天科技	20,817,778.00	6.42
26	002041	登海种业	20,691,022.12	6.38
27	000686	东北证券	20,598,118.40	6.36
28	300287	飞利信	20,081,504.00	6.20
29	002466	天齐锂业	20,021,720.75	6.18
30	600079	人福医药	19,693,176.19	6.08
31	300274	阳光电源	19,563,491.26	6.04
32	002138	顺络电子	18,991,395.12	5.86
33	002074	国轩高科	18,950,069.31	5.85
34	002415	海康威视	18,876,050.44	5.82
35	300014	亿纬锂能	18,868,515.82	5.82
36	000625	长安汽车	18,745,324.80	5.78
37	300136	信维通信	18,733,545.75	5.78
38	600261	阳光照明	18,220,220.58	5.62
39	601318	中国平安	18,210,383.00	5.62
40	002007	华兰生物	18,069,068.34	5.58
41	300133	华策影视	17,530,719.71	5.41
42	600584	长电科技	17,249,481.10	5.32
43	601607	上海医药	16,732,384.96	5.16
44	300271	华宇软件	16,692,460.12	5.15
45	002573	清新环境	16,458,769.00	5.08

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

46	600594	益佰制药	15,242,363.80	4.70
47	300119	瑞普生物	15,043,275.28	4.64
48	002508	老板电器	14,791,081.14	4.56
49	300269	联建光电	14,517,716.44	4.48
50	601788	光大证券	14,402,934.55	4.44
51	600109	国金证券	14,219,991.79	4.39
52	002262	恩华药业	13,620,230.89	4.20
53	300009	安科生物	13,472,789.56	4.16
54	600519	贵州茅台	13,212,073.21	4.08
55	002557	洽洽食品	12,954,641.50	4.00
56	600867	通化东宝	12,675,742.37	3.91
57	300251	光线传媒	12,635,116.00	3.90
58	600036	招商银行	12,496,743.00	3.86
59	300124	汇川技术	12,357,990.00	3.81
60	600422	昆药集团	12,334,944.96	3.81
61	603609	禾丰牧业	12,294,784.16	3.79
62	600030	中信证券	12,281,100.08	3.79
63	300199	翰宇药业	12,008,434.90	3.71
64	600335	国机汽车	11,987,509.00	3.70
65	601668	中国建筑	11,984,601.00	3.70
66	000783	长江证券	11,896,308.00	3.67
67	600048	保利地产	11,799,353.00	3.64
68	300322	硕贝德	11,493,945.00	3.55
69	300284	苏交科	11,211,185.76	3.46
70	002372	伟星新材	11,168,253.18	3.45
71	300267	尔康制药	11,112,727.62	3.43
72	600061	国投安信	11,099,251.31	3.42
73	601009	南京银行	11,046,640.00	3.41
74	300145	中金环境	10,624,979.96	3.28
75	600037	歌华有线	10,612,535.94	3.27

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

76	600000	浦发银行	10,445,524.10	3.22
77	002462	嘉事堂	10,307,274.69	3.18
78	300252	金信诺	9,814,118.46	3.03
79	000728	国元证券	9,617,621.00	2.97
80	600312	平高电气	9,613,544.50	2.97
81	002299	圣农发展	9,538,619.59	2.94
82	601998	中信银行	9,460,561.40	2.92
83	002518	科士达	9,435,873.30	2.91
84	002230	科大讯飞	9,151,544.00	2.82
85	000750	国海证券	8,848,125.00	2.73
86	600585	海螺水泥	8,802,650.28	2.72
87	002304	洋河股份	8,649,565.60	2.67
88	601231	环旭电子	8,639,515.62	2.67
89	600990	四创电子	8,522,296.78	2.63
90	600305	恒顺醋业	8,488,230.00	2.62
91	002446	盛路通信	8,248,948.61	2.55
92	300348	长亮科技	8,242,516.00	2.54
93	600372	中航电子	8,159,752.11	2.52
94	002223	鱼跃医疗	8,075,132.05	2.49
95	002456	欧菲光	7,977,287.03	2.46
96	002550	千红制药	7,961,006.61	2.46
97	600633	浙报传媒	7,945,010.00	2.45
98	600661	新南洋	7,902,272.05	2.44
99	600038	中直股份	7,810,714.20	2.41
100	600518	康美药业	7,785,785.00	2.40
101	601601	中国太保	7,592,940.00	2.34
102	000957	中通客车	7,561,249.77	2.33
103	002281	光迅科技	7,492,782.00	2.31
104	603766	隆鑫通用	7,480,712.00	2.31
105	000402	金融街	7,457,042.83	2.30

106	600748	上实发展	7,455,314.60	2.30
107	300003	乐普医疗	7,376,969.00	2.28
108	002178	延华智能	7,121,720.77	2.20
109	000952	广济药业	7,086,436.00	2.19
110	300383	光环新网	7,016,226.20	2.16
111	002317	众生药业	6,896,023.20	2.13
112	002664	信质电机	6,819,994.71	2.10
113	002701	奥瑞金	6,732,913.00	2.08
114	002271	东方雨虹	6,563,376.09	2.03
115	000031	中粮地产	6,497,294.00	2.00

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002236	大华股份	39,161,339.86	12.08
2	300182	捷成股份	39,083,854.42	12.06
3	300207	欣旺达	37,033,505.23	11.43
4	601555	东吴证券	35,262,699.56	10.88
5	300115	长盈精密	29,384,044.04	9.07
6	002241	歌尔股份	29,022,880.09	8.96
7	600699	均胜电子	28,622,501.61	8.83
8	300068	南都电源	28,109,081.60	8.67
9	002179	中航光电	27,973,429.97	8.63
10	300144	宋城演艺	25,948,116.84	8.01
11	002311	海大集团	24,427,486.87	7.54
12	000418	小天鹅 A	23,493,764.79	7.25
13	002450	康得新	23,006,715.29	7.10
14	000333	美的集团	22,800,290.81	7.04
15	300017	网宿科技	22,006,203.23	6.79

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

16	600562	国睿科技	21,454,279.90	6.62
17	002041	登海种业	21,218,997.09	6.55
18	300274	阳光电源	21,197,037.91	6.54
19	002185	华天科技	21,178,707.94	6.53
20	300136	信维通信	20,964,151.35	6.47
21	002138	顺络电子	20,272,809.70	6.26
22	002074	国轩高科	20,141,508.92	6.21
23	300070	碧水源	19,792,313.94	6.11
24	002466	天齐锂业	19,618,096.83	6.05
25	000686	东北证券	19,535,772.56	6.03
26	300287	飞利信	19,377,606.67	5.98
27	000625	长安汽车	19,146,599.46	5.91
28	601318	中国平安	19,038,662.86	5.87
29	002007	华兰生物	18,634,614.15	5.75
30	600261	阳光照明	17,986,218.00	5.55
31	601607	上海医药	17,141,666.05	5.29
32	300133	华策影视	16,855,190.10	5.20
33	600584	长电科技	16,756,218.85	5.17
34	300271	华宇软件	16,755,728.28	5.17
35	300073	当升科技	16,143,075.15	4.98
36	002573	清新环境	16,024,142.10	4.94
37	002475	立讯精密	15,993,688.35	4.94
38	600594	益佰制药	15,786,933.52	4.87
39	300119	瑞普生物	15,135,900.05	4.67
40	002508	老板电器	15,055,691.76	4.65
41	601788	光大证券	14,513,633.65	4.48
42	300269	联建光电	14,241,998.77	4.39
43	002262	恩华药业	14,220,305.31	4.39
44	300203	聚光科技	13,888,524.41	4.29
45	600867	通化东宝	13,843,003.82	4.27

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

46	601668	中国建筑	13,816,292.23	4.26
47	601688	华泰证券	13,760,188.51	4.25
48	300009	安科生物	13,667,719.93	4.22
49	600519	贵州茅台	13,575,335.00	4.19
50	600048	保利地产	13,423,001.00	4.14
51	300303	聚飞光电	12,995,005.61	4.01
52	600036	招商银行	12,628,725.89	3.90
53	600030	中信证券	12,625,537.92	3.90
54	002415	海康威视	12,569,671.81	3.88
55	600422	昆药集团	12,514,251.00	3.86
56	300124	汇川技术	12,449,576.53	3.84
57	002557	洽洽食品	12,285,822.92	3.79
58	600335	国机汽车	12,251,546.59	3.78
59	300251	光线传媒	12,232,387.56	3.77
60	300199	翰宇药业	11,974,731.01	3.69
61	000783	长江证券	11,617,247.35	3.58
62	603609	禾丰牧业	11,541,863.74	3.56
63	002372	伟星新材	11,480,952.57	3.54
64	300322	硕贝德	11,477,841.63	3.54
65	601009	南京银行	11,147,117.78	3.44
66	300284	苏交科	10,802,526.02	3.33
67	600037	歌华有线	10,655,879.00	3.29
68	300267	尔康制药	10,644,617.40	3.28
69	002462	嘉事堂	10,588,224.88	3.27
70	600000	浦发银行	10,434,404.70	3.22
71	300252	金信诺	9,830,207.80	3.03
72	600079	人福医药	9,568,039.65	2.95
73	000750	国海证券	9,525,566.00	2.94
74	601998	中信银行	9,384,065.80	2.90
75	000963	华东医药	9,367,129.36	2.89

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

76	600585	海螺水泥	9,104,907.94	2.81
77	300014	亿纬锂能	9,091,856.00	2.81
78	002518	科士达	8,996,932.82	2.78
79	002281	光迅科技	8,973,042.62	2.77
80	002299	圣农发展	8,965,072.66	2.77
81	002304	洋河股份	8,902,751.00	2.75
82	002230	科大讯飞	8,883,659.91	2.74
83	601231	环旭电子	8,575,204.04	2.65
84	600372	中航电子	8,566,763.68	2.64
85	600305	恒顺醋业	8,557,556.43	2.64
86	600990	四创电子	8,158,873.29	2.52
87	600038	中直股份	8,135,751.80	2.51
88	300348	长亮科技	8,031,660.90	2.48
89	002446	盛路通信	7,991,959.88	2.47
90	002550	千红制药	7,954,735.85	2.45
91	600518	康美药业	7,938,323.04	2.45
92	000402	金融街	7,870,421.43	2.43
93	002223	鱼跃医疗	7,839,613.47	2.42
94	600633	浙报传媒	7,825,450.00	2.41
95	603766	隆鑫通用	7,793,695.94	2.40
96	002456	欧菲光	7,608,971.04	2.35
97	000957	中通客车	7,488,026.60	2.31
98	600748	上实发展	7,466,168.69	2.30
99	002317	众生药业	7,463,798.96	2.30
100	601601	中国太保	7,285,878.66	2.25
101	300003	乐普医疗	7,276,775.45	2.25
102	002178	延华智能	7,249,562.39	2.24
103	600661	新南洋	7,201,341.82	2.22
104	300266	兴源环境	6,979,089.00	2.15
105	000596	古井贡酒	6,976,652.96	2.15

106	600801	华新水泥	6,942,620.16	2.14
107	300383	光环新网	6,830,061.27	2.11
108	300363	博腾股份	6,683,920.70	2.06
109	002701	奥瑞金	6,643,775.00	2.05
110	600816	安信信托	6,642,163.69	2.05
111	000903	云内动力	6,594,397.70	2.03
112	600068	葛洲坝	6,510,396.29	2.01
113	300219	鸿利智汇	6,488,504.86	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,345,380,549.40
卖出股票的收入（成交）总额	2,148,502,309.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,000,000.00	4.10
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	20,000,000.00	4.10

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019533	16国债05	200,000	20,000,000.00	4.10

注：本基金本报告期末仅持有上述1只债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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，充分考虑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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内基金投资的前十大证券的发行主体中，华泰证券（601688.SH）的主体华泰证券于2016年11月25日收到中国证监会对华泰证券关于未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为惩罚通知：责令华泰证券改正，并给予警告，没收违法所得18,235,275.00元，并处以54,705,825.00元罚款。对华泰证券投资决策程序的说明：该证券经股票研究员推荐，并通过股票入库审批流程后，基金管理人经过研究判断，按照相关投资决策流程投资了该证券。

其他前十大证券的发行主体均未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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	629,079.44
2	应收证券清算款	14,572,475.37
3	应收股利	—
4	应收利息	607,474.79
5	应收申购款	2,838,622.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,647,652.50

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
21,223	15,398.4	677,100.51	0.21%	326,123,056.43	99.79%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	838,077.43	0.26%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月7日)基金份额总额	5,005,036,402.75
本报告期期初基金份额总额	282,080,220.27
本报告期基金总申购份额	621,964,616.93
减：本报告期基金总赎回份额	577,244,680.26
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	326,800,156.94

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016年12月，张顺国先生担任兴业基金管理有限公司副总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。本报告期托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为9万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	0		—	—	—	
东兴证券	0		—	—	—	
方正证券	2	453,198,855.19	10.09%	195,464.79	5.36%	
广发证券	0		—	—	—	
海通证券	2	1,302,298,481.77	29.01%	1,212,831.73	33.23%	
华创证券	2	810,609,178.40	18.05%	592,799.91	16.24%	

华泰证券	0		—	—	—	
民族证券	0		—	—	—	
齐鲁证券	0		—	—	—	
兴业证券	0		—	—	—	
银河证券	0		—	—	—	
招商证券	2	1,208,623,403.85	26.92%	1,125,590.58	30.84%	
中信证券	2	715,132,685.51	15.93%	522,975.96	14.33%	
中银国际证券	0		—	—	—	

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增及剔除券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东方证券		—		—		—

兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

东兴证券		—		—		—
方正证券	—	—	2,385,000,000.00	20.45%	—	—
广发证券		—		—		—
海通证券	4,040,169.45	7.71%	3,266,000,000.00	28.01%	—	—
华创证券	16,442,199.41	31.36%	1,172,000,000.00	10.05%	—	—
华泰证券		—		—		—
民族证券		—		—		—
齐鲁证券		—		—		—
兴业证券		—		—		—
银河证券		—		—		—
招商证券	31,728,874.14	60.52%	3,873,000,000.00	33.21%	—	—
中信证券	215,459.05	0.41%	965,000,000.00	8.28%	—	—
中银国际证券		—		—		—

兴业基金管理有限公司
二〇一七年三月三十一日