

# 兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 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:2018 年 03 月 30 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 2018 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2017年01月01日起至2017年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	兴业多策略混合
基金主代码	000963
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
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	382,336,000.36份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。
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	zhaoyue@cib-fund.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	www.cib-fund.com.cn
-----------	---------------------

文的管理人互联网网 址	
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	2017年	2016年	2015年1月23日（基金合同生效日）-2015年12月31日
本期已实现收益	-10,504,740.74	62,363,650.02	625,681,968.55
本期利润	-33,523,948.52	-36,764,816.57	674,935,191.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0750	-0.0649	0.5278
本期基金份额净值增长率	-6.16%	-4.56%	36.10%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.2192	0.2993	0.3610
期末基金资产净值	466,155,552.69	639,796,008.31	806,861,435.79
期末基金份额净值	1.219	1.299	1.361

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	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-4.84%	0.67%	0.85%	0.01%	-5.69%	0.66%
过去六个月	-4.24%	0.74%	1.72%	0.01%	-5.96%	0.73%
过去一年	-6.16%	0.74%	3.48%	0.01%	-9.64%	0.73%
自基金合同生效起至今	21.90%	1.64%	11.57%	0.01%	10.33%	1.63%

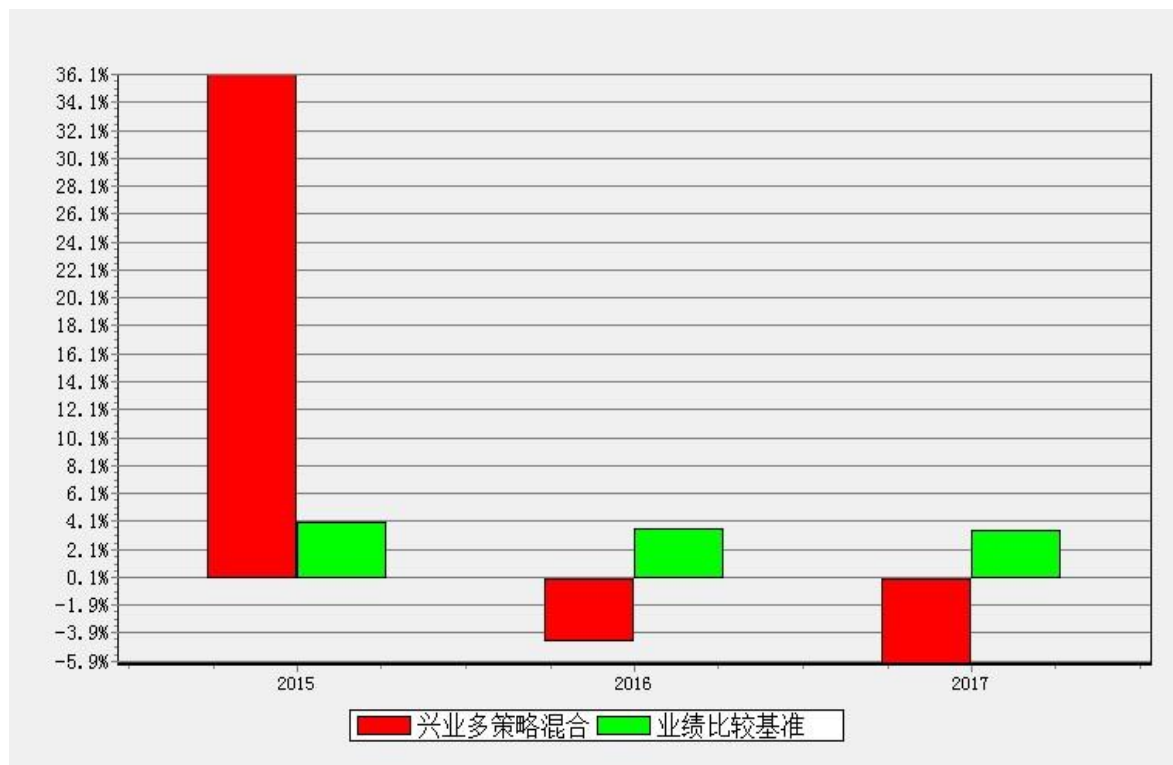
注：本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1%。

### 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

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年01月23日-2017年12月31日)



### 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



注：本基金基金合同于2015年1月23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2017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、兴业裕丰债券型证券投资基金、兴业安润货币市场基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金。（注：截至报告送出日，兴业基金注册资本为12亿元，详情请见本基金管理人于3月6日发布的《兴业基金管理有限公司关于增加注册资本的公告》）。

#### 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		
WEIDONG WU（吴卫东）	基金经理	2015-01-23	-	22年	美国籍，物理学博士，具有证券投资基金从业资格。曾在美国证券交易协会（NASD）注册。1994-1998年任德意志银行量化策略研究员（Associate Director），1998-2002年任摩尔（Moore）资产管理公司资深策略研究员，2002-2006任千禧（Millennium）基金投资经理，2007-2010任梯度（Gradient）资产管理公司投资经理，2010-2013任兴业银行资产管理部研究负责人，2013年7月加入兴业基金管理公司，现任基金经理。
冯烜	股票投资	2017-05-	-	13年	中国籍，加拿大多伦多大学MB

	部总监、 基金经理	22		A及中国人民大学经济学硕士， 特许金融分析师（CFA），具有 证券投资基金从业资格。2002 年7月至2003年8月在第一创业 证券有限公司证券投资部担任 研究员。2005年11月至2011年3 月在汇丰晋信基金管理有限公司 投资部担任研究员、高级研 究员、基金经理，期间2009年7 月至2010年12月担任汇丰晋信 2016生命周期开放式证券投资 基金基金经理，2010年1月至2 011年3月担任汇丰晋信2026生 命周期证券投资基金基金经 理。2011年3月至2014年6月在 中国国际金融有限公司资产管 理部担任投资经理（执行总经 理级别），管理中金安心回报、 中金股票策略、中金股票精选 集合资产管理计划。2014年6 月至2015年1月在汇丰晋信基 金管理有限公司担任QFII投资 咨询部总监，负责四只QFII基 金的A股投顾工作。2015年2月 加入兴业基金管理有限公司， 现任股票投资部总监、基金经 理。
--	--------------	----	--	---

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。

3、吴卫东先生于2018年1月18日离任本基金基金经理，详情请见2018年1月20日本基金管理人发布的《兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告》。

#### 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

2017年国内经济全年都比较强劲,并且超出此前的市场预期,宏观数据及周期品的价格都有表现。同时,全球经济增长也表现亮眼,美国经济继续向好,其它主要经济体也陆续复苏。国内通胀(CPI)维持在较低水平。总体看,强增长与低通胀的组合非常有利于股票市场。货币政策稳中趋紧,金融系统开始去杠杆、金融监管不断加强,市场利率从二季度开始攀升,这些方面给股票市场带来了一定压力。年内的一件大事是A股获准加入MSCI新兴市场指数,这将在长期内为A股市场带来可观的海外资金流入,同时有助于国内股票市场的不断成熟。全年来看,A股市场出现巨大分化,二八现象突出,结构性机会集中在少量公司,大市值价值型股票大幅上涨,龙头效应凸显;与此同时,大部分的中小市值股票大幅下跌。表现突出的板块是食品饮料、白电、银行保险、新能源汽车、电子等,表现较差的板块是传媒、计算机等。全年来看,本基金的股票仓位高

位波动，主要配置的行业是传媒、科技、消费、医药、建筑、金融等，基金在个股层面相对分散。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金的份额净值增长率为-6.16%，同期业绩比较基准收益率为3.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济方面，增速可能温和走低、但国内经济仍将展现足够韧性，同时新兴行业保持持续的快速增长，消费升级及制造业升级不断推进。通胀中枢可能缓慢走高、但仍将在温和状态。上市公司盈利有望实现稳健增长。资管新规有利于股票市场。今年6月A股加入MSCI新兴市场指数后将迎来海外资金的流入。A股市场中长期基本面较好，估值在合理区间。货币政策稳中偏紧，去杠杆仍在推进，市场利率可能在高位运行一段时间，这些构成市场的压制因素，但影响可控。总体来看，A股市场有望提供稳健的长期投资价值，系统性风险可控，慢牛或可期，结构性机会仍有望大量出现。市场的潜在风险点是增长低于预期、通胀超预期、及美股大幅调整的溢出效应等。

#### 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

1、根据《基金合同》，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

2、本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

3、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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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，本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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、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：兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	13,539,173.40	894,492.05
结算备付金	3,138,805.03	1,430,399.56
存出保证金	232,982.43	249,209.61
交易性金融资产	378,892,297.08	636,848,683.62
其中：股票投资	348,910,297.08	596,683,683.62
基金投资	-	-
债券投资	29,982,000.00	40,165,000.00
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	60,000,000.00	-
应收证券清算款	24,322,175.87	5,342,055.22
应收利息	994,926.73	1,337,706.63
应收股利	-	-
应收申购款	83,013.20	71,517.75
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
资产总计	481,203,373.74	646,174,064.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	2017年12月31日	2016年12月31日
<b>负 债:</b>		
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	12,215,238.99	3,203,223.30
应付赎回款	1,467,410.98	1,392,798.87
应付管理人报酬	604,523.49	833,562.75
应付托管费	100,753.93	138,927.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	509,559.55	467,992.04
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,334.11	341,552.05
负债合计	15,047,821.05	6,378,056.13
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	382,336,000.36	492,397,407.95
未分配利润	83,819,552.33	147,398,600.36
所有者权益合计	466,155,552.69	639,796,008.31
负债和所有者权益总计	481,203,373.74	646,174,064.44

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.219元，基金份额总额382,336,000.36份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
<b>一、收入</b>	-20,723,098.18	-21,999,733.98
1. 利息收入	2,691,477.87	2,186,055.53
其中：存款利息收入	79,473.83	100,232.38
债券利息收入	1,424,195.67	1,235,102.12
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,187,808.37	850,721.03
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-571,815.54	74,521,443.79
其中：股票投资收益	-6,155,367.78	66,378,517.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-702,190.00	-149,270.00
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	6,285,742.24	8,292,196.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-23,019,207.78	-99,128,466.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	176,447.27	421,233.29
<b>减：二、费用</b>	12,800,850.34	14,765,082.59
1. 管理人报酬	8,534,582.42	10,388,043.42

2. 托管费	1,422,430.49	1,731,340.50
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,494,359.07	2,282,154.15
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	349,478.36	363,544.52
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-33,523,948.52</b>	<b>-36,764,816.57</b>
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-33,523,948.52</b>	<b>-36,764,816.57</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2017年01月01日至2017年12月31日

单位: 人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017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)	492,397,407.9 5	147,398,600.3 6	639,796,008.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-33,523,948.5 2	-33,523,948.52
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)	-110,061,407. 59	-30,055,099.5 1	-140,116,507.10
其中: 1. 基金申购款	47,113,400.89	12,717,221.27	59,830,622.16
2. 基金赎回款	-157,174,808. 48	-42,772,320.7 8	-199,947,129.26
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)	382,336,000.3	83,819,552.33	466,155,552.69

值)	6		
项 目	上年度可比期间 2016年01月01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)	592,863,614.49	213,997,821.30	806,861,435.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-36,764,816.57	-36,764,816.57
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)	-100,466,206.54	-29,834,404.37	-130,300,610.91
其中：1. 基金申购款	142,209,019.69	29,238,029.52	171,447,049.21
2. 基金赎回款	-242,675,226.23	-59,072,433.89	-301,747,660.12
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)	492,397,407.95	147,398,600.36	639,796,008.31

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

庄孝强

楼怡斐

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

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金(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》、《兴业多策略灵活配置混合型发起式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[2014]1192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2,361,484,922.83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0047号的验资报告。基金合同于2015年1月23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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产,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相关规定)。固定收益类资产包括通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等。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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为: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2017年12月31日的财务状况以及2017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

本基金本报告期除 7.4.5 描述情形外,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 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)相关规定，本基金对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整，新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。本基金本期未持有上述相关流通受限股票，相关会计估计调整对本基金资产净值无影响。

#### 7.4.5.3 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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 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。

3) 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。

4) 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。

5) 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”)	基金管理人控股股东、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”)	基金管理人控制的公司

注：下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股票交易。

#### 7.4.8.1.2 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权证交易。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,534,582.42	10,388,043.42
其中：支付销售机构的客户维护费	3,000,356.21	3,749,837.05

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1.5%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×1.5%÷当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,422,430.49	1,731,340.50

注：支付基金托管民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%÷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

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01 日至2017年12 月31日	上年度可比期 间 2016年01月01 日至2016年12 月31日
基金合同生效日（2015年01月23日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	55,867,836.70	55,867,836.70
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	55,867,836.70	55,867,836.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.61%	11.35%

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

##### 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 2017年01月01日至2017年 12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年1 2月31日	
	期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息收 入
中国民生银行股份有限公司	13,539,17 3.40	43,056.23	894,492.0 5	55,096.76

注：本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业或协议利率计息。

##### 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（2017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

7.4.9.1.1 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,755.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,274.4	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300730	科创信息	2017-12-25	股价异动	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	股价异动	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

### 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。

#### 7.4.9.3.2 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2017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348,761,788.88元，属于第二层次的余额为人民币30,130,508.20元，无属于第三层次的余额(于2016年12月31日：第一层次为人民币564,656,822.16元，第二层次为人民币72,191,861.46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) 第三层次公允价值计量的金融工具

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	348,910,297.08	72.51
	其中：股票	348,910,297.08	72.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,982,000.00	6.23
	其中：债券	29,982,000.00	6.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	60,000,000.00	12.47
	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	16,677,978.43	3.47
8	其他各项资产	25,633,098.23	5.33
9	合计	481,203,373.74	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

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	9,069,206.36	1.95
B	采矿业	-	-
C	制造业	131,016,932.58	28.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	26,526,256.00	5.69
F	批发和零售业	21,985,135.92	4.72



G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,575,498.71	8.70
J	金融业	34,353,992.90	7.37
K	房地产业	12,324,321.84	2.64
L	租赁和商务服务业	36,948,184.06	7.93
M	科学研究和技术服务业	10,511,522.00	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	25,565,160.75	5.48
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	348,910,297.08	74.85

### 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	600054	黄山旅游	1,421,729	20,288,072.83	4.35
2	300058	蓝色光标	3,437,656	18,975,861.12	4.07
3	002385	大北农	2,995,020	18,149,821.20	3.89
4	002400	省广股份	3,371,918	17,972,322.94	3.86
5	601688	华泰证券	965,700	16,667,982.00	3.58
6	600261	阳光照明	2,540,613	14,024,183.76	3.01
7	002262	恩华药业	863,937	12,319,741.62	2.64

8	600406	国电南瑞	669,400	12,236,632.00	2.63
9	002050	三花智控	662,281	12,146,233.54	2.61
10	002051	中工国际	618,900	11,406,327.00	2.45

#### 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	601688	华泰证券	23,899,905.24	3.74
2	002262	恩华药业	23,122,995.33	3.61
3	600054	黄山旅游	22,752,226.88	3.56
4	600340	华夏幸福	18,815,222.00	2.94
5	600406	国电南瑞	18,317,128.44	2.86
6	002041	登海种业	17,508,222.26	2.74
7	002831	裕同科技	15,965,174.20	2.50
8	000028	国药一致	15,858,031.00	2.48
9	002385	大北农	14,954,037.36	2.34
10	600887	伊利股份	14,436,886.00	2.26
11	300284	苏交科	14,089,600.00	2.20
12	300271	华宇软件	14,088,142.15	2.20
13	000796	凯撒旅游	13,992,614.18	2.19
14	600820	隧道股份	13,200,429.78	2.06
15	600138	中青旅	13,112,853.06	2.05
16	601689	拓普集团	12,932,127.22	2.02
17	002051	中工国际	12,719,270.24	1.99
18	601799	星宇股份	12,563,540.00	1.96
19	002202	金风科技	12,043,123.00	1.88
20	002206	海利得	11,962,243.14	1.87

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	000963	华东医药	32,019,043.37	5.00
2	603816	顾家家居	27,898,299.19	4.36
3	300166	东方国信	25,695,925.71	4.02
4	300408	三环集团	23,321,732.85	3.65
5	603899	晨光文具	23,303,505.77	3.64
6	000860	顺鑫农业	22,958,201.11	3.59
7	600153	建发股份	22,290,649.87	3.48
8	002563	森马服饰	21,366,411.56	3.34
9	600741	华域汽车	20,071,383.04	3.14
10	002241	歌尔股份	19,951,047.07	3.12
11	600887	伊利股份	19,649,726.28	3.07
12	600271	航天信息	19,477,294.66	3.04
13	000848	承德露露	19,190,082.37	3.00
14	600340	华夏幸福	19,053,085.23	2.98
15	000796	凯撒旅游	18,654,992.23	2.92
16	600612	老凤祥	18,130,101.78	2.83
17	002041	登海种业	16,624,339.67	2.60
18	600315	上海家化	15,292,827.97	2.39
19	002707	众信旅游	13,871,135.35	2.17
20	600138	中青旅	13,484,302.17	2.11
21	300017	网宿科技	13,102,297.77	2.05
22	600820	隧道股份	12,997,674.36	2.03
23	600406	国电南瑞	12,867,601.85	2.01

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	796,643,085.67
卖出股票收入（成交）总额	1,014,957,336.65

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,982,000.00	6.43
	其中：政策性金融债	29,982,000.00	6.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,982,000.00	6.43

### 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	150207	15国开07	300,000	29,982,000.00	6.43

### 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

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

## 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

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内本基金投资的前十大证券的发行主体中，2017年9月29日蓝色光标（300058）的主体北京蓝色光标品牌管理顾问股份有限公司（以下简称“蓝色光标”）发布公告，蓝色光标于2017年9月27日收到中国证券监督管理委员会北京监管局《关于对北京蓝色光标品牌管理顾问股份有限公司采取出具警示函行政监管措施的决定》（文号[2017]119号）。蓝色光标于2015年12月18日公开发行了14亿元可转换公司债券。经查，该债券募集资金使用中涉及的“蓝色天幕全球机场联播媒体网络模块”项目及“电商综合服务平台”项目已超过1年未使用募集资金，募集资金投资项目实际投资进度与投资计划存在差异，蓝色光标未解释具体原因并进行披露，违反了《上市公司信息披露管理办法》（中国证券监督管理委员会令第40号）第二条“信息披露义务人应当真实、准确、完整、及时地披露信息，不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”的规定。中国证券监督管理委员会北京监管局根据《上市公司信息披露管理办法》（中国证券监督管理委员会令第40号）第五十九条的规定，对蓝色光标采取出具警示函的监管措施。蓝色光标应及时解释并披露募集资金投资项目实际投资进度与投资计划存在差异的具体原因及后续应采取的措施。

对蓝色光标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。

其它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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	232,982.43
2	应收证券清算款	24,322,175.87
3	应收股利	-
4	应收利息	994,926.73
5	应收申购款	83,013.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,633,098.23

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
14,189	26,945.94	55,933,351.93	14.63%	326,402,648.43	85.37%

### 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	2,332,852.24	0.61%

### 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	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额占基 金总份 额比例 (%)	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例 (%)	发 起 份 额 承 诺 持 有 期 限
基金管理人固有资金	55,867,836.70	14.61	10,000,000.00	2.62	3年
基金管理人高级管理人员	780,160.33	0.20	-	-	-
基金经理等人员	345,815.91	0.09	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	56,993,812.94	14.90	10,000,000.00	2.62	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年01月23日)基金份额总额	2,361,484,922.83
本报告期期初基金份额总额	492,397,407.95
本报告期基金总申购份额	47,113,400.89
减：本报告期基金总赎回份额	157,174,808.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	382,336,000.36

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

2017年8月9日，王慧女士担任兴业基金管理有限公司督察长，详见本公司于2017年8月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。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5万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为3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

中国证券监督管理委员会上海监管局在对我司进行常规全面现场检查后，于2017年3月13日作出了《关于对兴业基金管理有限公司采取责令改正监管措施的决定》。公司对此高度重视，立即制定整改计划和整改方案，认真进行整改，逐一落实各项整改要求。公司已按照《关于对兴业基金管理有限公司采取责令改正监管措施的决定》的要求于2017年4月5日前完成整改工作，并通过了中国证券监督管理委员会上海监管局的整改验收。

除上述情况外，本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。



## 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	687,711,298.66	38.13%	502,922.31	38.13%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	338,028,623.30	18.74%	247,200.20	18.74%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	441,804,700.85	24.50%	323,092.50	24.50%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	336,035,941.87	18.63%	245,742.15	18.63%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

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构处罚。
- 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，光大证券、天风证券、广发证券、中信建投的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,071,300.00	26.10%	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	1,840,200.00	44.84%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	304,900.00	7.43%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	887,70	21.63%	-	-	-	-

			0,000. 00					
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

兴业基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十日