

# 兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

## 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。

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05月07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 | 145,272,931.28份 |
| 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         | 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 | 2017年          | 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       | 14,265,133.74  | 39,802,974.68  | 160,684,396.27                 |
| 本期利润          | 15,970,259.53  | 34,233,203.32  | 165,305,739.60                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0700         | 0.1989         | 0.0604                         |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.29%          | 29.85%         | 14.90%                         |
| 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  | 0.5563         | 0.4919         | 0.1446                         |
| 期末基金资产净值      | 226,089,354.58 | 487,560,396.33 | 324,083,932.99                 |
| 期末基金份额净值      | 1.556          | 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 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|----------|----------|----------|-----|-----|
|----|----------|----------|----------|----------|-----|-----|

|                |        | 准差②   | 率③     | 率标准差<br>④ |        |       |
|----------------|--------|-------|--------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月          | -3.71% | 0.83% | 0.87%  | 0.01%     | -4.58% | 0.82% |
| 过去六个月          | 2.77%  | 0.77% | 1.75%  | 0.01%     | 1.02%  | 0.76% |
| 过去一年           | 4.29%  | 0.62% | 3.52%  | 0.01%     | 0.77%  | 0.61% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 55.60% | 0.61% | 10.19% | 0.01%     | 45.41% | 0.60% |

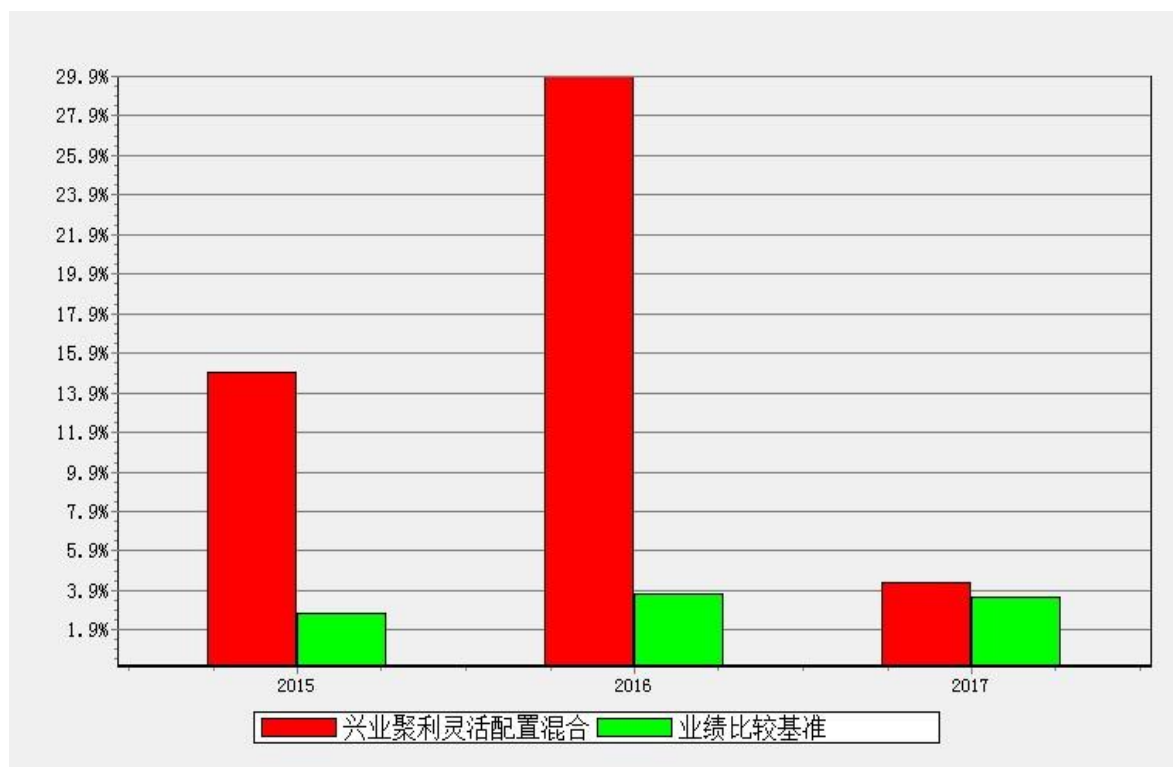
注：本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1%

### 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05月07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 |        |   |
| 腊博 | 固定收益投资一部投资总监、基金经理 | 2015-05-14      | -    | 13年    | 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ANY ING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，现任固定收益投资一部投资总监、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4.29%，同期业绩比较基准收益率为3.52%。

#### 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，2018年驱动股市的因素预计会发生一些变化，一方面债券收益率的持续上行对蓝筹股的估值压力逐渐加大，另一方面预期较高的行业业绩不达预期的风险在逐渐加大，而预期较低的行业估值已经具备较高的吸引力。我们判断2016年以来的通胀环境有可能在2018年明显减弱，经济潜在增速在经历了两年左右的企稳，2018年存在下行的压力，2017年推动经济的库存和投资方面也存在放缓的可能，如果经济层面主导的流动性环境相对改善，股市的驱动结构也会发生一定的变化。我们也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风险可控的超额收益。

#### 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：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| <b>资 产：</b> |                    |                     |
| 银行存款        | 5,597,215.42       | 11,449,285.10       |
| 结算备付金       | 7,870,998.26       | 13,807,687.29       |
| 存出保证金       | 717,919.92         | 629,079.44          |
| 交易性金融资产     | 139,697,042.96     | 259,069,620.52      |
| 其中：股票投资     | 107,048,642.96     | 239,069,620.52      |
| 基金投资        | -                  | -                   |
| 债券投资        | 32,648,400.00      | 20,000,000.00       |
| 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      |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收证券清算款         | 77,463,050.13      | 14,572,475.37      |
| 应收利息            | 908,788.42         | 607,474.79         |
| 应收股利            | -                  | -                  |
| 应收申购款           | 108,174.91         | 2,838,622.90       |
| 递延所得税资产         | -                  | -                  |
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 232,363,190.02     | 502,074,505.41     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2017年12月31日</b> | <b>2016年12月31日</b> |
| <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         | 1,986,327.17       | 9,963,633.33       |
| 应付赎回款           | 2,259,014.92       | 2,367,254.99       |
| 应付管理人报酬         | 242,261.35         | 467,480.36         |
| 应付托管费           | 20,188.46          | 38,956.67          |
| 应付销售服务费         | -                  | -                  |
| 应付交易费用          | 1,616,043.54       | 1,306,783.73       |
| 应交税费            | -                  | -                  |
| 应付利息            | -                  | -                  |
| 应付利润            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 150,000.00         | 370,000.00         |
| 负债合计            | 6,273,835.44       | 14,514,109.08      |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 145,272,931.28     | 326,800,156.94     |
| 未分配利润           | 80,816,423.30      | 160,760,239.39     |
| 所有者权益合计         | 226,089,354.58     | 487,560,396.33     |
| 负债和所有者权益总计      | 232,363,190.02     | 502,074,505.41     |

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.556元，基金份额总额145272931.28份。

## 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：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<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |
|------------------------|---------------------------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            | 31,813,041.91             | 44,012,017.44                      |
| 1. 利息收入                | 5,604,857.73              | 2,792,803.28                       |
| 其中：存款利息收入              | 368,808.14                | 332,992.46                         |
| 债券利息收入                 | 1,737,224.79              | 896,754.27                         |
| 资产支持证券利息收入             | -                         | -                                  |
| 买入返售金融资产收入             | 3,498,824.80              | 1,563,056.55                       |
| 其他利息收入                 | -                         | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 22,440,370.32             | 42,621,021.56                      |
| 其中：股票投资收益              | 22,860,963.99             | 40,761,347.99                      |
| 基金投资收益                 | -                         | -                                  |
| 债券投资收益                 | -2,523,375.87             | 1,039,232.66                       |
| 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                   | 2,102,782.20              | 820,440.91                         |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 1,705,125.79              | -5,569,771.36                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号        | -                         | -                                  |

|                            |               |               |
|----------------------------|---------------|---------------|
| 填列)                        |               |               |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)        | 2,062,688.07  | 4,167,963.96  |
| <b>减: 二、费用</b>             | 15,842,782.38 | 9,778,814.12  |
| 1. 管理人报酬                   | 4,227,093.62  | 2,921,151.02  |
| 2. 托管费                     | 352,257.77    | 243,429.29    |
| 3. 销售服务费                   | -             | -             |
| 4. 交易费用                    | 10,891,275.24 | 6,199,864.39  |
| 5. 利息支出                    | 2,276.83      | 5,666.91      |
| 其中: 卖出回购金融资产支出             | 2,276.83      | 5,666.91      |
| 6. 其他费用                    | 369,878.92    | 408,702.51    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | 15,970,259.53 | 34,233,203.32 |
| 减: 所得税费用                   | -             | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | 15,970,259.53 | 34,233,203.32 |

### 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: 2017年01月01日至2017年12月31日

单位: 人民币元

| 项 目                               | 本期<br>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)                   | 326,800,156.94                | 160,760,239.39 | 487,560,396.33  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -                             | 15,970,259.53  | 15,970,259.53   |
| 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) | -181,527,225.66               | -95,914,075.62 | -277,441,301.28 |
| 其中: 1. 基金申购款                      | 135,034,348.68                | 69,566,811.04  | 204,601,159.72  |

|  |                                    |                 |                 |
|--|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款                               | -316,561,574.34                    | -165,480,886.66 | -482,042,461.00 |
| 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）                        | 145,272,931.28                     | 80,816,423.30   | 226,089,354.58  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>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）                        | 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  |

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”）   | 基金管理人的控股股东、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：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；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的股票交易。

#### 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的权证交易。

#### 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内无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.1.4 债券交易

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债券交易。

#### 7.4.8.1.5 债券回购交易

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回购交易。

### 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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>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  | 4,227,093.62                  | 2,921,151.02                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,624,353.47                  | 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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 352,257.77                    | 243,429.29                         |

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，逐日累计至每月月末，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

本基金本报告期间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

本基金本报告期间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<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016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                          | 5,597,215.42 | 159,234.99                         | 11,449,285.10 |

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（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 | 20,755.25 | -  |
| 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  | 16,274.4  | -  |
| 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       | 复牌开盘单价 | 数量(股)  | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 600332 | 白云山  | 2017-10-31 | 重大事项 | 32.14  | 2018-01-08 | 30.15  | 39,619 | 1,257,952.32 | 1,273,354.66 | -  |
| 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105,626,780.10元，属于第二层次的余额为人民币34,070,262.86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238,741,067.14元，第二层次为人民币20,328,553.38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              | 107,048,642.96 | 46.07         |
|    | 其中：股票             | 107,048,642.96 | 46.07         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 32,648,400.00  | 14.05         |
|    | 其中：债券             | 32,648,400.00  | 14.05         |
|    | 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          | -              | -             |
|    | 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      | 13,468,213.68  | 5.80          |
| 8  | 其他各项资产            | 79,197,933.38  | 34.08         |
| 9  | 合计                | 232,363,190.02 | 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 77,193,760.59 | 34.14         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20     | 0.01          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | 2,322,228.00  | 1.03          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,942.76     | 0.01          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,112.55     | 0.02          |
| J  | 金融业              | 27,432,132.66 | 12.13         |
| 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 | 32,323.20      | 0.01  |
| 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            | 107,048,642.96 | 47.35 |

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 14,211  | 9,912,030.39 | 4.38         |
| 2  | 601336 | 新华保险 | 134,000 | 9,406,800.00 | 4.16         |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 129,187 | 9,040,506.26 | 4.00         |
| 4  | 601601 | 中国太保 | 216,920 | 8,984,826.40 | 3.97         |
| 5  | 601222 | 林洋能源 | 684,468 | 6,940,505.52 | 3.07         |
| 6  | 601877 | 正泰电器 | 263,055 | 6,878,888.25 | 3.04         |
| 7  | 600872 | 中炬高新 | 207,800 | 5,145,128.00 | 2.28         |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 26,600  | 4,867,800.00 | 2.15         |
| 9  | 600809 | 山西汾酒 | 83,596  | 4,764,136.04 | 2.11         |
| 10 | 000725 | 京东方A | 819,100 | 4,742,589.00 | 2.10         |



|  |  |  |  |   |  |
|--|--|--|--|---|--|
|  |  |  |  | 0 |  |
|--|--|--|--|---|--|

## 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  | 601318 | 中国平安 | 67,836,331.74 | 13.91          |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 59,723,871.66 | 12.25          |
| 3  | 002311 | 海大集团 | 56,719,115.81 | 11.63          |
| 4  | 002241 | 歌尔股份 | 54,910,542.15 | 11.26          |
| 5  | 601377 | 兴业证券 | 50,428,961.00 | 10.34          |
| 6  | 002450 | 康得新  | 49,196,726.99 | 10.09          |
| 7  | 600068 | 葛洲坝  | 49,075,614.90 | 10.07          |
| 8  | 002185 | 华天科技 | 47,175,974.97 | 9.68           |
| 9  | 002456 | 欧菲科技 | 46,268,997.96 | 9.49           |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 45,314,241.35 | 9.29           |
| 11 | 300014 | 亿纬锂能 | 44,350,219.64 | 9.10           |
| 12 | 600201 | 生物股份 | 44,301,527.02 | 9.09           |
| 13 | 300182 | 捷成股份 | 43,513,301.54 | 8.92           |
| 14 | 600837 | 海通证券 | 41,109,458.56 | 8.43           |
| 15 | 000776 | 广发证券 | 41,035,547.26 | 8.42           |
| 16 | 002008 | 大族激光 | 40,062,097.21 | 8.22           |
| 17 | 300136 | 信维通信 | 37,671,221.89 | 7.73           |
| 18 | 601555 | 东吴证券 | 37,473,328.34 | 7.69           |
| 19 | 300115 | 长盈精密 | 37,091,016.62 | 7.61           |
| 20 | 601328 | 交通银行 | 36,813,916.00 | 7.55           |
| 21 | 300383 | 光环新网 | 36,573,502.67 | 7.50           |
| 22 | 000686 | 东北证券 | 35,819,886.36 | 7.35           |
| 23 | 000963 | 华东医药 | 35,316,649.67 | 7.24           |
| 24 | 300166 | 东方国信 | 35,271,436.02 | 7.23           |
| 25 | 600594 | 益佰制药 | 34,725,638.57 | 7.12           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 26 | 601668 | 中国建筑 | 34,578,216.00 | 7.09 |
| 27 | 000596 | 古井贡酒 | 33,629,828.60 | 6.90 |
| 28 | 600887 | 伊利股份 | 32,611,033.20 | 6.69 |
| 29 | 002466 | 天齐锂业 | 32,313,738.84 | 6.63 |
| 30 | 300207 | 欣旺达  | 31,983,729.11 | 6.56 |
| 31 | 300113 | 顺网科技 | 31,398,982.49 | 6.44 |
| 32 | 600884 | 杉杉股份 | 30,594,775.52 | 6.28 |
| 33 | 000661 | 长春高新 | 30,534,070.49 | 6.26 |
| 34 | 300033 | 同花顺  | 29,851,437.31 | 6.12 |
| 35 | 600518 | 康美药业 | 28,774,063.10 | 5.90 |
| 36 | 002223 | 鱼跃医疗 | 28,700,275.48 | 5.89 |
| 37 | 601688 | 华泰证券 | 28,648,293.53 | 5.88 |
| 38 | 300144 | 宋城演艺 | 28,590,647.89 | 5.86 |
| 39 | 600809 | 山西汾酒 | 28,383,773.00 | 5.82 |
| 40 | 002555 | 三七互娱 | 28,365,756.00 | 5.82 |
| 41 | 601818 | 光大银行 | 28,113,052.50 | 5.77 |
| 42 | 000998 | 隆平高科 | 27,779,359.12 | 5.70 |
| 43 | 002475 | 立讯精密 | 27,213,475.41 | 5.58 |
| 44 | 300070 | 碧水源  | 26,549,324.88 | 5.45 |
| 45 | 600048 | 保利地产 | 26,068,776.05 | 5.35 |
| 46 | 300073 | 当升科技 | 25,709,834.01 | 5.27 |
| 47 | 600958 | 东方证券 | 25,695,264.00 | 5.27 |
| 48 | 002051 | 中工国际 | 25,468,234.95 | 5.22 |
| 49 | 600298 | 安琪酵母 | 25,062,170.80 | 5.14 |
| 50 | 002262 | 恩华药业 | 24,849,564.08 | 5.10 |
| 51 | 601336 | 新华保险 | 24,752,636.15 | 5.08 |
| 52 | 002317 | 众生药业 | 24,625,719.57 | 5.05 |
| 53 | 601601 | 中国太保 | 24,608,055.82 | 5.05 |
| 54 | 300203 | 聚光科技 | 24,547,650.86 | 5.03 |
| 55 | 000997 | 新大陆  | 24,336,421.29 | 4.99 |
| 56 | 002273 | 水晶光电 | 24,131,173.00 | 4.95 |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 57 | 600999 | 招商证券  | 24,035,547.72 | 4.93 |
| 58 | 601231 | 环旭电子  | 23,823,375.00 | 4.89 |
| 59 | 300274 | 阳光电源  | 23,538,457.92 | 4.83 |
| 60 | 600879 | 航天电子  | 23,517,701.20 | 4.82 |
| 61 | 601009 | 南京银行  | 22,608,550.24 | 4.64 |
| 62 | 002460 | 赣锋锂业  | 22,576,908.72 | 4.63 |
| 63 | 002573 | 清新环境  | 22,412,642.17 | 4.60 |
| 64 | 601628 | 中国人寿  | 22,098,619.37 | 4.53 |
| 65 | 300145 | 中金环境  | 21,661,312.12 | 4.44 |
| 66 | 002050 | 三花智控  | 21,566,243.61 | 4.42 |
| 67 | 600522 | 中天科技  | 21,359,231.00 | 4.38 |
| 68 | 600438 | 通威股份  | 21,119,193.00 | 4.33 |
| 69 | 000050 | 深天马 A | 20,747,581.83 | 4.26 |
| 70 | 300083 | 劲胜智能  | 20,673,705.08 | 4.24 |
| 71 | 601939 | 建设银行  | 20,640,045.75 | 4.23 |
| 72 | 600487 | 亨通光电  | 20,477,227.29 | 4.20 |
| 73 | 600584 | 长电科技  | 20,342,317.90 | 4.17 |
| 74 | 600525 | 长园集团  | 20,293,717.67 | 4.16 |
| 75 | 000860 | 顺鑫农业  | 20,009,999.50 | 4.10 |
| 76 | 600566 | 济川药业  | 19,871,740.30 | 4.08 |
| 77 | 002396 | 星网锐捷  | 19,758,197.39 | 4.05 |
| 78 | 000725 | 京东方 A | 19,308,887.00 | 3.96 |
| 79 | 002045 | 国光电器  | 19,136,000.85 | 3.92 |
| 80 | 002589 | 瑞康医药  | 18,859,789.93 | 3.87 |
| 81 | 002271 | 东方雨虹  | 18,631,287.06 | 3.82 |
| 82 | 300059 | 东方财富  | 18,343,538.42 | 3.76 |
| 83 | 000069 | 华侨城 A | 18,243,801.47 | 3.74 |
| 84 | 601599 | 鹿港文化  | 18,069,501.17 | 3.71 |
| 85 | 000060 | 中金岭南  | 18,061,506.15 | 3.70 |
| 86 | 300450 | 先导智能  | 18,014,976.90 | 3.69 |
| 87 | 603799 | 华友钴业  | 17,817,911.00 | 3.65 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 88  | 002643 | 万润股份 | 17,573,265.66 | 3.60 |
| 89  | 600703 | 三安光电 | 17,572,419.55 | 3.60 |
| 90  | 600519 | 贵州茅台 | 17,514,492.45 | 3.59 |
| 91  | 603589 | 口子窖  | 17,497,095.56 | 3.59 |
| 92  | 601012 | 隆基股份 | 17,468,908.95 | 3.58 |
| 93  | 002507 | 涪陵榨菜 | 16,579,739.41 | 3.40 |
| 94  | 300197 | 铁汉生态 | 16,203,363.50 | 3.32 |
| 95  | 601186 | 中国铁建 | 16,163,892.95 | 3.32 |
| 96  | 600867 | 通化东宝 | 15,805,926.08 | 3.24 |
| 97  | 600362 | 江西铜业 | 15,595,607.49 | 3.20 |
| 98  | 000513 | 丽珠集团 | 15,534,136.80 | 3.19 |
| 99  | 300271 | 华宇软件 | 14,984,275.67 | 3.07 |
| 100 | 000049 | 德赛电池 | 14,865,893.00 | 3.05 |
| 101 | 300003 | 乐普医疗 | 14,764,450.19 | 3.03 |
| 102 | 601998 | 中信银行 | 14,709,850.80 | 3.02 |
| 103 | 002217 | 合力泰  | 14,556,965.43 | 2.99 |
| 104 | 000728 | 国元证券 | 14,532,292.90 | 2.98 |
| 105 | 300232 | 洲明科技 | 14,460,879.32 | 2.97 |
| 106 | 600873 | 梅花生物 | 14,148,604.00 | 2.90 |
| 107 | 002138 | 顺络电子 | 13,992,850.79 | 2.87 |
| 108 | 601222 | 林洋能源 | 13,945,304.50 | 2.86 |
| 109 | 002717 | 岭南园林 | 13,821,660.00 | 2.83 |
| 110 | 300339 | 润和软件 | 13,777,999.80 | 2.83 |
| 111 | 002074 | 国轩高科 | 13,774,078.15 | 2.83 |
| 112 | 600585 | 海螺水泥 | 13,557,708.57 | 2.78 |
| 113 | 600028 | 中国石化 | 13,127,409.00 | 2.69 |
| 114 | 002445 | 中南文化 | 12,872,788.35 | 2.64 |
| 115 | 002043 | 兔宝宝  | 12,718,768.97 | 2.61 |
| 116 | 300296 | 利亚德  | 12,694,279.00 | 2.60 |
| 117 | 300355 | 蒙草生态 | 12,645,986.91 | 2.59 |
| 118 | 002179 | 中航光电 | 12,540,725.44 | 2.57 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 119 | 600801 | 华新水泥  | 12,412,312.68 | 2.55 |
| 120 | 000858 | 五 粮 液 | 12,248,047.50 | 2.51 |
| 121 | 002108 | 沧州明珠  | 12,016,821.41 | 2.46 |
| 122 | 600111 | 北方稀土  | 11,754,889.30 | 2.41 |
| 123 | 600699 | 均胜电子  | 11,726,437.09 | 2.41 |
| 124 | 000070 | 特发信息  | 11,633,395.19 | 2.39 |
| 125 | 300303 | 聚飞光电  | 11,413,226.34 | 2.34 |
| 126 | 002518 | 科士达   | 11,398,856.90 | 2.34 |
| 127 | 600872 | 中炬高新  | 11,192,027.97 | 2.30 |
| 128 | 600373 | 中文传媒  | 11,130,281.52 | 2.28 |
| 129 | 600720 | 祁连山   | 10,821,312.52 | 2.22 |
| 130 | 000002 | 万 科 A | 10,811,150.52 | 2.22 |
| 131 | 601398 | 工商银行  | 10,690,904.00 | 2.19 |
| 132 | 002304 | 洋河股份  | 10,685,711.00 | 2.19 |
| 133 | 000402 | 金 融 街 | 10,655,366.42 | 2.19 |
| 134 | 600383 | 金地集团  | 10,644,508.52 | 2.18 |
| 135 | 000783 | 长江证券  | 10,537,586.00 | 2.16 |
| 136 | 600066 | 宇通客车  | 10,529,723.00 | 2.16 |
| 137 | 300367 | 东方网力  | 10,414,883.92 | 2.14 |
| 138 | 600517 | 置信电气  | 10,382,416.00 | 2.13 |
| 139 | 002121 | 科陆电子  | 10,269,727.72 | 2.11 |
| 140 | 300017 | 网宿科技  | 10,181,537.79 | 2.09 |
| 141 | 300133 | 华策影视  | 10,054,592.80 | 2.06 |
| 142 | 600271 | 航天信息  | 9,991,202.60  | 2.05 |
| 143 | 600199 | 金种子酒  | 9,914,459.56  | 2.03 |
| 144 | 002245 | 澳洋顺昌  | 9,902,357.00  | 2.03 |
| 145 | 000157 | 中联重科  | 9,871,432.92  | 2.02 |
| 146 | 600030 | 中信证券  | 9,812,661.00  | 2.01 |

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  | 002241 | 歌尔股份 | 66,172,710.30 | 13.57           |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 65,398,775.54 | 13.41           |
| 3  | 601555 | 东吴证券 | 60,409,040.90 | 12.39           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 59,038,007.12 | 12.11           |
| 5  | 002311 | 海大集团 | 57,967,286.41 | 11.89           |
| 6  | 300014 | 亿纬锂能 | 54,607,576.04 | 11.20           |
| 7  | 000963 | 华东医药 | 54,546,493.16 | 11.19           |
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 52,802,396.66 | 10.83           |
| 9  | 601377 | 兴业证券 | 50,484,594.69 | 10.35           |
| 10 | 600068 | 葛洲坝  | 50,156,365.42 | 10.29           |
| 11 | 002185 | 华天科技 | 47,960,403.75 | 9.84            |
| 12 | 002456 | 欧菲科技 | 46,997,642.05 | 9.64            |
| 13 | 300115 | 长盈精密 | 46,607,428.50 | 9.56            |
| 14 | 002450 | 康得新  | 45,841,421.68 | 9.40            |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 44,972,225.77 | 9.22            |
| 16 | 600201 | 生物股份 | 44,478,102.97 | 9.12            |
| 17 | 300182 | 捷成股份 | 42,295,182.77 | 8.67            |
| 18 | 600837 | 海通证券 | 40,992,338.62 | 8.41            |
| 19 | 000776 | 广发证券 | 40,692,645.74 | 8.35            |
| 20 | 002008 | 大族激光 | 40,403,206.86 | 8.29            |
| 21 | 300136 | 信维通信 | 39,581,828.03 | 8.12            |
| 22 | 002475 | 立讯精密 | 37,878,515.25 | 7.77            |
| 23 | 000686 | 东北证券 | 37,394,493.71 | 7.67            |
| 24 | 300207 | 欣旺达  | 36,792,806.90 | 7.55            |
| 25 | 601328 | 交通银行 | 36,389,467.77 | 7.46            |
| 26 | 300383 | 光环新网 | 36,199,450.55 | 7.42            |
| 27 | 600594 | 益佰制药 | 35,464,095.28 | 7.27            |
| 28 | 300070 | 碧水源  | 34,711,859.60 | 7.12            |
| 29 | 600566 | 济川药业 | 34,400,258.71 | 7.06            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 34,279,431.66 | 7.03 |
| 31 | 300166 | 东方国信 | 34,221,792.30 | 7.02 |
| 32 | 600884 | 杉杉股份 | 34,160,688.75 | 7.01 |
| 33 | 000596 | 古井贡酒 | 33,690,338.21 | 6.91 |
| 34 | 300203 | 聚光科技 | 32,936,535.07 | 6.76 |
| 35 | 600887 | 伊利股份 | 32,754,968.78 | 6.72 |
| 36 | 002466 | 天齐锂业 | 32,582,409.25 | 6.68 |
| 37 | 300073 | 当升科技 | 32,521,352.92 | 6.67 |
| 38 | 300113 | 顺网科技 | 31,100,999.40 | 6.38 |
| 39 | 300033 | 同花顺  | 29,818,165.42 | 6.12 |
| 40 | 300144 | 宋城演艺 | 28,618,601.38 | 5.87 |
| 41 | 000998 | 隆平高科 | 28,305,818.60 | 5.81 |
| 42 | 601818 | 光大银行 | 27,602,604.00 | 5.66 |
| 43 | 002223 | 鱼跃医疗 | 26,939,737.93 | 5.53 |
| 44 | 300145 | 中金环境 | 26,793,137.30 | 5.50 |
| 45 | 600518 | 康美药业 | 26,769,384.66 | 5.49 |
| 46 | 600809 | 山西汾酒 | 26,672,675.35 | 5.47 |
| 47 | 000661 | 长春高新 | 26,394,156.00 | 5.41 |
| 48 | 600298 | 安琪酵母 | 26,241,509.85 | 5.38 |
| 49 | 002555 | 三七互娱 | 25,796,743.80 | 5.29 |
| 50 | 600958 | 东方证券 | 25,738,078.90 | 5.28 |
| 51 | 600048 | 保利地产 | 25,552,215.83 | 5.24 |
| 52 | 002262 | 恩华药业 | 25,487,313.64 | 5.23 |
| 53 | 000997 | 新大陆  | 25,086,821.44 | 5.15 |
| 54 | 002051 | 中工国际 | 25,080,145.19 | 5.14 |
| 55 | 600999 | 招商证券 | 24,506,229.64 | 5.03 |
| 56 | 600879 | 航天电子 | 24,422,413.86 | 5.01 |
| 57 | 002317 | 众生药业 | 24,298,327.06 | 4.98 |
| 58 | 002273 | 水晶光电 | 23,494,260.64 | 4.82 |
| 59 | 601628 | 中国人寿 | 22,725,713.74 | 4.66 |
| 60 | 601009 | 南京银行 | 22,374,695.22 | 4.59 |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 61 | 002050 | 三花智控  | 22,164,701.17 | 4.55 |
| 62 | 002179 | 中航光电  | 21,923,831.64 | 4.50 |
| 63 | 601231 | 环旭电子  | 21,851,029.50 | 4.48 |
| 64 | 600522 | 中天科技  | 21,574,592.57 | 4.43 |
| 65 | 000728 | 国元证券  | 21,558,069.35 | 4.42 |
| 66 | 600584 | 长电科技  | 21,411,789.59 | 4.39 |
| 67 | 002460 | 赣锋锂业  | 21,408,220.07 | 4.39 |
| 68 | 300083 | 劲胜智能  | 21,203,717.19 | 4.35 |
| 69 | 002573 | 清新环境  | 21,195,443.25 | 4.35 |
| 70 | 300303 | 聚飞光电  | 20,650,170.85 | 4.24 |
| 71 | 600438 | 通威股份  | 20,319,082.20 | 4.17 |
| 72 | 300450 | 先导智能  | 20,294,567.89 | 4.16 |
| 73 | 601939 | 建设银行  | 20,281,037.49 | 4.16 |
| 74 | 600487 | 亨通光电  | 20,268,978.84 | 4.16 |
| 75 | 000050 | 深天马 A | 19,833,425.96 | 4.07 |
| 76 | 000860 | 顺鑫农业  | 19,766,125.04 | 4.05 |
| 77 | 002396 | 星网锐捷  | 19,691,908.79 | 4.04 |
| 78 | 300059 | 东方财富  | 19,562,867.04 | 4.01 |
| 79 | 002271 | 东方雨虹  | 19,275,393.87 | 3.95 |
| 80 | 300274 | 阳光电源  | 18,746,677.54 | 3.84 |
| 81 | 600525 | 长园集团  | 18,663,198.21 | 3.83 |
| 82 | 000069 | 华侨城 A | 18,556,923.53 | 3.81 |
| 83 | 002589 | 瑞康医药  | 18,384,656.64 | 3.77 |
| 84 | 603799 | 华友钴业  | 18,244,656.79 | 3.74 |
| 85 | 002045 | 国光电器  | 18,051,932.81 | 3.70 |
| 86 | 000060 | 中金岭南  | 17,787,822.31 | 3.65 |
| 87 | 603589 | 口子窖   | 17,635,375.86 | 3.62 |
| 88 | 601599 | 鹿港文化  | 17,556,688.90 | 3.60 |
| 89 | 600703 | 三安光电  | 17,462,678.41 | 3.58 |
| 90 | 002507 | 涪陵榨菜  | 17,200,256.21 | 3.53 |
| 91 | 002643 | 万润股份  | 16,893,052.75 | 3.46 |



|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 92  | 600079 | 人福医药  | 16,673,232.33 | 3.42 |
| 93  | 300197 | 铁汉生态  | 16,324,909.57 | 3.35 |
| 94  | 601601 | 中国太保  | 16,175,422.70 | 3.32 |
| 95  | 601336 | 新华保险  | 16,066,537.79 | 3.30 |
| 96  | 000725 | 京东方 A | 15,902,868.35 | 3.26 |
| 97  | 300271 | 华宇软件  | 15,675,987.16 | 3.22 |
| 98  | 601186 | 中国铁建  | 15,656,123.76 | 3.21 |
| 99  | 600867 | 通化东宝  | 15,518,725.13 | 3.18 |
| 100 | 600362 | 江西铜业  | 15,191,101.19 | 3.12 |
| 101 | 300003 | 乐普医疗  | 14,910,117.04 | 3.06 |
| 102 | 000513 | 丽珠集团  | 14,842,881.86 | 3.04 |
| 103 | 002138 | 顺络电子  | 14,611,176.43 | 3.00 |
| 104 | 000049 | 德赛电池  | 14,599,994.70 | 2.99 |
| 105 | 601998 | 中信银行  | 14,460,861.12 | 2.97 |
| 106 | 300232 | 洲明科技  | 14,353,120.72 | 2.94 |
| 107 | 002217 | 合力泰   | 13,826,362.27 | 2.84 |
| 108 | 002074 | 国轩高科  | 13,770,444.58 | 2.82 |
| 109 | 600873 | 梅花生物  | 13,543,526.88 | 2.78 |
| 110 | 601012 | 隆基股份  | 13,334,906.96 | 2.74 |
| 111 | 600585 | 海螺水泥  | 13,318,678.00 | 2.73 |
| 112 | 002717 | 岭南园林  | 13,201,226.81 | 2.71 |
| 113 | 600028 | 中国石化  | 13,014,547.60 | 2.67 |
| 114 | 300339 | 润和软件  | 13,009,478.82 | 2.67 |
| 115 | 002445 | 中南文化  | 12,931,752.32 | 2.65 |
| 116 | 600111 | 北方稀土  | 12,748,331.28 | 2.61 |
| 117 | 300355 | 蒙草生态  | 12,467,589.74 | 2.56 |
| 118 | 002108 | 沧州明珠  | 12,165,816.27 | 2.50 |
| 119 | 600801 | 华新水泥  | 12,160,735.29 | 2.49 |
| 120 | 000858 | 五粮液   | 11,911,743.00 | 2.44 |
| 121 | 600699 | 均胜电子  | 11,830,754.15 | 2.43 |
| 122 | 300296 | 利亚德   | 11,708,527.40 | 2.40 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 123 | 002415 | 海康威视 | 11,704,402.12 | 2.40 |
| 124 | 002043 | 兔宝宝  | 11,703,860.06 | 2.40 |
| 125 | 000070 | 特发信息 | 11,618,036.85 | 2.38 |
| 126 | 600373 | 中文传媒 | 10,944,954.50 | 2.24 |
| 127 | 000402 | 金融街  | 10,940,908.28 | 2.24 |
| 128 | 002518 | 科士达  | 10,932,961.45 | 2.24 |
| 129 | 000783 | 长江证券 | 10,908,742.71 | 2.24 |
| 130 | 000002 | 万科A  | 10,890,548.43 | 2.23 |
| 131 | 600720 | 祁连山  | 10,749,400.90 | 2.20 |
| 132 | 601398 | 工商银行 | 10,540,953.00 | 2.16 |
| 133 | 600066 | 宇通客车 | 10,452,570.00 | 2.14 |
| 134 | 002304 | 洋河股份 | 10,436,897.89 | 2.14 |
| 135 | 600383 | 金地集团 | 10,363,259.00 | 2.13 |
| 136 | 300017 | 网宿科技 | 10,248,679.89 | 2.10 |
| 137 | 002245 | 澳洋顺昌 | 10,131,686.65 | 2.08 |
| 138 | 600199 | 金种子酒 | 10,086,119.24 | 2.07 |
| 139 | 002635 | 安洁科技 | 10,017,533.58 | 2.05 |
| 140 | 002121 | 科陆电子 | 10,006,210.20 | 2.05 |
| 141 | 600517 | 置信电气 | 9,991,746.64  | 2.05 |
| 142 | 600271 | 航天信息 | 9,991,180.25  | 2.05 |
| 143 | 300367 | 东方网力 | 9,913,878.36  | 2.03 |
| 144 | 000157 | 中联重科 | 9,869,554.89  | 2.02 |
| 145 | 300262 | 巴安水务 | 9,788,522.54  | 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 | 4,030,085,461.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,186,791,108.46 |

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      | 13,980,400.00 | 6.18          |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 18,668,000.00 | 8.26          |
|    | 其中：政策性金融债 | 18,668,000.00 | 8.26          |
| 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        | 32,648,400.00 | 14.44         |

#### 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  | 170210 | 17国开10 | 200,000 | 18,668,000.00 | 8.26          |
| 2  | 019557 | 17国债03 | 140,000 | 13,980,400.00 | 6.18          |

注：本基金本报告期末仅持有上述2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   | 717,919.92    |
| 2  | 应收证券清算款 | 77,463,050.13 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 908,788.42    |
| 5  | 应收申购款   | 108,174.91    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 79,197,933.38 |

#### 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<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 9,505        | 15,283.84     | 20,860,521.67 | 14.36%     | 124,412,409.61 | 85.64%     |

#### 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 | 141,059.40 | 0.0971%  |

#### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年05月07日)基金份额总额 | 5,005,036,402.75 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 326,800,156.94   |
| 本报告期基金总申购份额                | 135,034,348.68   |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 316,561,574.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 145,272,931.28 |

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 | 佣金        | 占当期 |    |
|      |        |      |     |           |     |    |

|        |   |                  | 股票成交总额的比例 |              | 佣金总量的比例 |   |
|--------|---|------------------|-----------|--------------|---------|---|
| 广发证券   | 2 | 2,441,701,720.16 | 29.74%    | 1,785,620.04 | 29.91%  | - |
| 中信证券   | 2 | -                | -         | -            | -       | - |
| 中银国际证券 | 2 | -                | -         | -            | -       | - |
| 兴业证券   | 2 | 164,864,273.92   | 2.01%     | 120,565.27   | 2.02%   | - |
| 天风证券   | 2 | 2,225,698,689.57 | 27.11%    | 1,627,655.11 | 27.26%  | - |
| 银河证券   | 2 | -                | -         | -            | -       | - |
| 海通证券   | 2 | 1,607,397,584.26 | 19.58%    | 1,496,970.14 | 25.08%  | - |
| 方正证券   | 2 | 1,307,240,918.02 | 15.92%    | 563,812.00   | 9.44%   | - |
| 华创证券   | 2 | -                | -         | -            | -       | - |
| 光大证券   | 2 | -                | -         | -            | -       | - |
| 招商证券   | 2 | 180,361,496.27   | 2.20%     | 167,970.28   | 2.81%   | - |
| 中信建投   | 2 | 283,534,147.52   | 3.45%     | 207,347.95   | 3.47%   | - |
| 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，本期新增交易单元如下：天风证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司；本期剔除券商交易如下：东方证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、民族证券股份有限公司、齐鲁证券股份有限公司。

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   | 62,190,567.17 | 43.37%       | 4,268,200.00 | 23.62%         | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -             | -            | -            | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中银国际证券 | -             | -            | -            | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | 1,012,197.35  | 0.71%        | -            | -              | -    | -            | -    | -            |
| 天风证券   | 30,080,000.00 | 20.98%       | 4,330,000.00 | 23.97%         | -    | -            | -    | -            |



|      |                       |        |                          |        |   |   |   |   |
|------|-----------------------|--------|--------------------------|--------|---|---|---|---|
|      | 3,36<br>5.88          |        | 700,00<br>0.00           |        |   |   |   |   |
| 银河证券 | -                     | -      | -                        | -      | - | - | - | - |
| 海通证券 | 14,19<br>2,32<br>7.70 | 9.90%  | 4,997,<br>000,00<br>0.00 | 27.66% | - | - | - | - |
| 方正证券 | 19,73<br>1,90<br>0.75 | 13.76% | 4,015,<br>000,00<br>0.00 | 22.22% | - | - | - | - |
| 华创证券 | -                     | -      | -                        | -      | - | - | - | - |
| 光大证券 | -                     | -      | -                        | -      | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1,18<br>4,01<br>6.00  | 0.83%  | 458,00<br>0,000.<br>00   | 2.53%  | - | - | - | - |
| 中信建投 | 14,99<br>1,02<br>9.29 | 10.46% | -                        | -      | - | - | - | - |
| 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