

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)

摘要(2019 年第 1 号)

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

重要提示

本基金经 2014 年 11 月 6 日中国证券监督管理委员会证监许可【2014】1192 号文准予募集注册，基金合同于 2015 年 1 月 23 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，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。本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 1 月 22 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2018 年 12 月 31 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人情况

名称：兴业基金管理有限公司

住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼

办公地址：上海市浦东新区浦明路 198 号财富金融广场 7 号楼

法定代表人：卓新章

设立日期：2013 年 4 月 17 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]288 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-22211888

联系人：郭玲燕

股权结构：

股东名称 出资比例

兴业银行股份有限公司 90%

中海集团投资有限公司 10%

合计 100%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

卓新章先生，董事长，本科学历。曾任兴业银行宁德分行副行长、行长，兴业银行总行信贷审查部总经理，兴业银行福州分行副行长，兴业银行济南分行行长，兴业银行基金业务筹建工作小组负责人，兴业银行总行基金金融部总经理，兴业银行总行资产管理部总经理、兴业银行金融市场总部副总裁等职。现任兴业基金管理有限公司董事长，兴业财富资产管理有限公司执行董事。

明东先生，董事，硕士学位。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输（集团）总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作，历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表，中国远洋运输（集团）总公司/中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远海运发展股份有限公司副总经理、党委委员，中海集团投资有限公司总经理。

汤夕生先生，董事，硕士学位。曾任建设银行浦东分行办公室负责人，兴业银行上海分行南市支行行长，兴业银行上海分行副行长等职。现任兴业基金管理有限公司总经理，兼任上海市基金同业公会第三届副会长。

朱利民先生，独立董事，硕士学位。曾任国家体改委试点司主任科员、副处长、处长，国家体改委下属中华股份制咨询公司副总经理，中国证监会稽查局副局长、中国证监会派出机构工作协调部主任、兼投资者教育办公室主任，中信建投证券股份有限公司合规总监、监事会主席等职。

黄泽民先生，独立董事，博士学位。曾任华东师范大学商学院院长，第十届、十一届、十二届全国政协委员等职。现任华东师范大学终身教授、博导、国际金融研究所所长，兼任上海世界经济学会副会长，中国金融学会学术委员，中国国际金融学会理事，中国国际经济关系学会常务理事，全国日本经济学会副会长，上海市人民政府参事。

曹和平先生，独立董事，博士学位。曾任中共中央书记处农研室国务院农村发展研究中心农业部研究室副主任，北京大学经济学院副院长，云南大学副校长，北京大学供应链研究中心主任，北京大学中国都市经济研究基地首席专家等职。现任北京大学经济学院教授（博士生导师），北京大学环境、资源与发展经济学创系主任，兼任北京大学数字中国研究院副院长，中国经济规律研究会副会长，中国西部促进会副会长，中国环境科学学会绿色金融分会主任，中央电视台财经频道评论员，北京大学供应链研究中心顾问，互联网普惠金融研究院院长，广州市、西安市、哈尔滨市、厦门市、广安市和青岛市金融咨询决策专家委员，云

南省政府经济顾问。

2、监事会成员

顾卫平先生，监事会主席，硕士学位。曾任上海农学院农业经济系金融教研室主任、系副主任，兴业银行上海分行副行长，兴业银行天津分行行长，兴业银行广州分行行长等职。现任兴业银行总行资产管理部总经理。

杜海英女士，监事，硕士学位。曾任中海（海南）海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任（主持工作）、发展部主任，中共中国海运（集团）总公司党校副校长，集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

李骏先生，职工监事，硕士学位。曾任渣打银行全球金融市场部主任，海富通基金管理有限公司机构业务部副总经理，兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理。现任兴业基金管理有限公司产品研发部总经理。

赵正义女士，职工监事，硕士学位。曾任上海上会会计师事务所审计员，生命人寿保险股份有限公司稽核审计部助理总经理，海富通基金管理有限公司监察稽核部稽核经理、财务部高级财务经理，兴业基金管理有限公司监察稽核部副总经理。现任兴业基金管理有限公司财富管理总部总经理。

3、公司高级管理人员

卓新章先生，董事长，简历同上。

汤夕生先生，总经理，简历同上。

王蕙女士，督察长，本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理，兴业银行广州分行副行长，兴业银行信用审查部总经理，兴业银行小企业部总经理，兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生，副总经理，硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长，兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理，兴业银行厦门分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投资银行部副总经理，兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生，副总经理，本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理，深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理、商人银行部副总经理，深圳发展银行上海分行宝山支行副行长，兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理，兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理，上海兴晟股权投资管理有限公司总经理，兴投（平潭）资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄孝强先生，总经理助理，本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理，兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长，兴业银行总行资产管理部总经理助理，兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理，兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4、本基金基金经理

（1）现任基金经理

冯炬，加拿大多伦多大学 MBA 及中国人民大学经济学硕士，特许金融分析师（CFA）。14 年证券从业经历。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 2011 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，现任股票业务总监。2017年5月22日起任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，2017年7月26日起任兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年9月10日起任兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

WEIDONGWU（吴卫东），于2015年1月23日至2018年1月18日期间担任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。

5、投资策略委员会成员

汤夕生先生，总经理。

黄文锋先生，副总经理。

冯烜先生，股票业务总监。

刘方旭先生，股票公募投资总监。

吴列伟先生，股票专户投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1.基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日，中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日，中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范

行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

民生银行荣获第十三届上市公司董事会“金圆桌”优秀董事会奖；

民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017年度小微金融服务银行”；

民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016中国地区最佳财富管理私人银行”奖项；

民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项；

民生银行荣获VISA颁发的“最佳产品设计创新奖”；

民生银行在经济观察报举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”；

民生银行荣获全国银行同业拆借中心授予的“2016年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016年度银行间本币市场优秀衍生品交易商”及“2016年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项；

民生银行荣获中国银行间交易协商会授予的“2016年度优秀综合做市机构”和“2016年度优秀信用债做市商”奖项；

民生银行荣获英国WPP（全球最大的传媒集团之一）颁发的“2017年度最具价值中国品牌100强”；

民生银行在中国资产证券化论坛年会上被授予“2016年度特殊贡献奖”。

2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有25年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经历。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工72人，平均年龄37岁，100%员工拥有大学本科以上学历，62.5%以上员工具有硕士以上文凭。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2018年12月31日，中国民生银行已托管174只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于2018年2月6日发布了“爱托管”品牌，近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心，致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源，对外广泛搭建客户服务平台，向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务，得到各界的充分认可，也在市场上树立了良好品牌形象，成为市场上一家有特色的托管银行。自2010年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

(二)基金托管人的内部控制制度

1.内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念，严格控制合规风险，保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。

(3) 以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障，以完善健全的制度为基础，以落实到位的过程控制为着眼点，以先进的信息技术手段为依托，建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

2.内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会，对高级管理层负责，支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

3.总行各部门紧密配合，共同把控资产托管业务运行中的风险，具体职责与分工如下：总行风险管理与质量监控部作为总行风险管理委员会秘书机构，是全行风险管理的统筹部门，对资产托管部的风险控制工作进行指导；总行法律合规部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等文本的审定，负责该业务与管理的合规性审查、检查与督导整改；总行审计部对全行托管业务进行内部审计。包括定期内部审计、现场和非现场检查等；总行办公室（品牌管理中心）与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。按资产托管部需求对由托管业务引发的声誉风险事件进行定向舆情监测，对由托管业务引起的声誉风险进行应急处置，包括与全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。内部风险控制原则

(1) 合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2) 全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员，并涵盖资产托管业务各环节。

(3) 有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行，任何人都没有超越制度约束的权力。

(4) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，控制资产托管业务中风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5) 及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(6) 独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险监督中心是资产托管部下设的执行机构，不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开，以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7) 相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确，相互牵制，通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8) 防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

4.内部风险控制制度和措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

5.资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一)销售机构（除直销中心）

- (1) 浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室
法定代表人：凌顺平
办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼
邮政编码：310012
联系人：董一锋
电话：4008-773-772
网址：<http://www.5ifund.com>
- (2) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室
法定代表人：陈柏青
办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27F
邮政编码：200135
联系人：韩爱彬
电话：4000-766-123
网址：<http://www.fund123.cn/>
- (3) 上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
法定代表人：其实
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 层
邮政编码：200235
联系人：王超
电话：4001818188
网站：<http://www.1234567.com.cn>
- (4) 深圳众禄基金销售股份有限公司
住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人：薛峰
办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼
邮政编码：518028
联系人：童彩平
电话：4006-788-887
网站：<http://www.zlfund.cn>
- (5) 珠海盈米基金销售有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
法定代表人：肖雯
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼
邮政编码：510308
联系人：吴煜浩
电话：020-89629066
网站：<http://www.yingmi.cn>
- (6) 北京虹点基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元
法定代表人：胡伟
办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

邮政编码：100026
联系人：陈铭洲
电话：400-618-0707
网站：<https://www.hongdianfund.com/>
(7) 上海陆金所基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人：郭坚
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
邮政编码：200120
联系人：程晨

电话：4008219031
网址：<http://www.lufunds.com>
(8) 诺亚正行基金销售有限公司
住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
法定代表人：汪静波
办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼
邮政编码：200082
联系人：余翼飞

电话：400-821-5399
网址：<http://www.noah-fund.com>
(9) 上海凯石财富基金销售有限公司
住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
法定代表人：陈继武
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
邮政编码：200001
联系人：王哲宇

电话：4006-433-389
网址：www.vstonewealth.com
(10) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所：武汉市江汉区泛海国际 SOHO7 栋 23 层 01、04 号
法定代表人：陶捷
办公地址：武汉市江汉区泛海国际 SOHO7 栋 23 层 01、04 号
邮政编码：430000
联系人：陆锋

电话：4000279899
网址：<http://www.buyfunds.cn/>
(11) 上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
法定代表人：杨文斌
办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室
邮政编码：200120
联系人：张茹
电话：400-700-9665
网址：<http://www.ehowbuy.com>

(12) 上海联泰基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
法定代表人：燕斌
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
邮政编码：200335
联系人：兰敏
电话：400-166-6788
网址：<http://www.66zichan.com>

(13) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
法定代表人：张跃伟
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
邮政编码：200120
联系人：张佳琳
电话：400-820-2899
网站：<http://www.erichfund.com>

(14) 北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室
法定代表人：王伟刚
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室
邮政编码：100190
联系人：王骁
电话：400-619-9059
网址：<http://www.hcjijin.com>

(15) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室
法定代表人：张彦
办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 7 层
邮政编码：100032
联系人：文雯
电话：400-166-1188
网址：<http://www.jrj.com.cn>

(16) 上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
法定代表人：王廷富
办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
邮政编码：200120
联系人：徐亚丹
电话：400-821-0203
网址：<http://www.520fund.com.cn>

(17) 上海利得基金销售有限公司
住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
法定代表人：李兴春
办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场

邮政编码：200127
联系人：陈洁
电话：400-921-7755
网址：<http://www.leadfund.com.cn>
(18) 北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人：江卉
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东A座4层
邮政编码：100176
联系人：韩锦星
电话：400-098-8511
网址：<http://kenterui.jd.com>
(19) 上海华信证券有限责任公司
住所：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人：陈灿辉
办公地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
邮政编码：200003
联系人：徐璐
电话：400-820-5999
网址：<http://www.shhxzq.com>
(20) 上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人：李一梅
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
邮政编码：100032
联系人：仲秋玥
电话：400-817-5666
网址：<http://www.amcfortune.com>
(21) 上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室
法定代表人：王翔
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
邮政编码：200120
联系人：蓝杰
电话：021-65370077
网址：<http://www.jiyufund.com.cn>
(22) 通华财富（上海）基金销售有限公司
住所：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
法定代表人：兰奇
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
邮政编码：200127
联系人：褚志朋
电话：95193
网址：<http://www.tonghuafund.com>

(23) 上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

邮政编码：200127

联系人：李娟

电话：021-50810687

网址：<http://www.wacaijijin.com>

(24) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 T3A 座 19 层

邮政编码：100020

联系人：袁永姣

电话：4000-618-518

网址：<http://www.danjuanapp.com>

(25) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：钱昊旻

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

邮政编码：100052

联系人：沈晨

电话：400-8909998

网址：<https://www.jnlc.com>

(26) 扬州国信嘉利基金销售有限公司

住所：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

法定代表人：刘晓光

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320 室

邮政编码：225100

联系人：苏曦

电话：400-021-6088

网址：<https://www.gxjlc.com/>

(27) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

邮政编码：210042

联系人：张慧

电话：95177

网址：<http://www.snjijin.com>

(28) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

邮政编码：100020
联系人：王丽敏
电话：010-85932810
网址：www.datangwealth.com
(29) 南京途牛基金销售有限公司
住所：南京市玄武区玄武大道 699-1 号
法定代表人：宋时琳
办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-32 号
邮政编码：210042
联系人：张士帅
电话：010-85932810
网址：<http://jr.tuniu.com>
(30) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界 A 座 2208
法定代表人：吴雪秀
办公地址：北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层
联系人：董宣
电话：010-88312877-8005
网址：<https://www.yilucaifu.com/>
邮政编码：100000
(31) 兴业银行股份有限公司钱大掌柜
住所：福州市湖东路 154 号
法定代表人：高建平
办公地址：上海市北京西路 968 号嘉地中心 33 楼
邮政编码：200041
联系人：禾青
电话：40018-95561
网址：<https://www.yypt.com/>
(32) 名称：中国民生银行股份有限公司
法定代表人：洪崎
住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码：100032
联系人：赵天杰
电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn
(33) 名称：兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路 154 号
法定代表人：高建平
办公地址：上海市静安区江宁路 168 号
邮政编码：200041
联系人：曾鸣
电话：021-95561
网址：www.cib.com.cn

(34) 名称: 交通银行股份有限公司
住所: 上海市银城中路 188 号
办公地址: 上海市银城中路 188 号
法定代表人: 彭纯
联系电话: 021-58781234
传真: 021-58408483
联系人: 王菁
客服电话: 95559
公司网址: <http://www.bankcomm.com>

(35) 名称: 上海浦东发展银行股份有限公司
住所: 上海市浦东新区浦东南路 500 号
法定代表人: 吉晓辉
办公地址: 上海市中山东一路 12 号
邮政编码: 200002
联系人: 唐苑
电话: 95528
网址: www.spdb.com.cn

(36) 中国国际金融股份有限公司
住所: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人: 丁学东
办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码: 100004
联系人: 杨涵宇
电话: 4009101166
网址: www.cicc.com.cn

(37) 宁波银行股份有限公司
住所: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人: 陆华裕
办公地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号
邮政编码: 315100
联系人: 于波涛
电话: 0574-87050038
网址: www.nbcb.com.cn

(38) 名称: 国金证券股份有限公司
住所: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号
法定代表人: 冉云
办公地址: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号
邮政编码: 610015
联系人: 刘婧漪、贾鹏
电话: 028-86690057、028-86690058
网址: www.gjzq.com.cn

客户服务电话: 95310
(39) 名称: 中国银河证券股份有限公司
住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安
地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
邮编：100033

联系人：邓颜

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

(40)名称：云南红塔银行股份有限公司

住所：云南省玉溪市东风南路 2 号

法定代表人：旃绍平

办公地址：云南省玉溪市东风南路 2 号

邮政编码：653100

联系人：倪源

电话：0877-2791676

网址：www.ynhtbank.com

客服电话：0877-96522

(41)名称：郑州银行股份有限公司

住所：郑州市商务外环路 22 号

办公地址：郑州市商务外环路 22 号

法定代表人：王天宇

联系电话：0371-67009698

传真：0371-67009097

联系人：焦明飞

客服电话：967585（河南地区）4000-967585(全国地区)

公司网址：<http://www.zzbank.cn/>

(42)名称：长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号 14、16、17 楼

邮政编码：518034

法定代表人：丁益

联系人：金夏

电话：0755-83516289

传真：0755-83513882

网址：www.cgws.com

(43)名称：中原银行股份有限公司

办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

邮政编码：450000

法定代表人：窦荣兴

联系人：赵栋一

电话：0371-85519823

传真：0371-85519869

客服电话：95186

网址：www.zybank.com.cn

(44)名称：北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人：于龙

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号
邮政编码：100000

联系人：吴鹏

电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

(45)名称：海银基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

法定代表人：刘惠

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

邮政编码：200000

联系人：毛林

电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

(46)名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：戎兵

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809

邮政编码：100010

联系人：魏晨

电话：010-52413385

网址：<http://www.yixinfund.com/>

(47) 名称：嘉实财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15

单元

法定代表人：赵学军

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

邮政编码：100022

联系人：李雯

电话：400-021-8850

网站：www.harvestwm.cn

(48) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

(49) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

电话：400-818-8000

网址：<https://www.myfund.com/>

(50) 西安银行股份有限公司
住所：西安市高新路 60 号
法定代表人：郭军
办公地址：西安市高新路 60 号
邮政编码：710000
联系人：白智
电话：400-86-96779
网站：www.xacbank.com

(51) 晋商银行股份有限公司
住所：太原市长风西街 1 号丽华大厦
办公地址：山西省太原市小店区长风街 59 号
法定代表人：阎俊生
联系人：卫奕信
电话：95105588
网站：www.jshbank.com

(52) 长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人：李新华
联系人：奚博宇
电话：95579
网站：<https://www.95579.com/>

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

(二) 直销机构

(1) 名称：兴业基金管理有限公司直销中心
住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼
法定代表人：卓新章
办公地址：上海市浦东新区浦明路 198 号财富金融广场 7 号楼
联系人：许野
咨询电话：021-22211885
传真：021-22211997
网址：<http://www.cib-fund.com.cn/>

(2) 名称：兴业基金管理有限公司网上直销系统
网址：<https://trade.cib-fund.com.cn/etrading/>

(3) 名称：兴业基金微信公众号
微信号：“兴业基金”或者“cibfund”

(三) 登记机构

名称：兴业基金管理有限公司
住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼
办公地址：上海市浦东新区浦明路 198 号财富金融广场 7 号楼
法定代表人：卓新章
设立日期：2013 年 4 月 17 日
联系电话：021-22211899
联系人：金晨

(四) 出具法律意见书的律师事务所

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公场所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

经办律师：黎明、孙睿

(五) 审计基金财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

法定代表人：曾顺福

电话：021-61418888

传真：021-63350177/0377

联系人：曾浩

经办注册会计师：曾浩、吴凌志

四、基金的名称

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

八、基金的投资策略

(一) 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。

1、大类资产配置策略

本基金用全球化的视角分析中国经济增长的驱动力和阶段特征，通过宏观基本面进行定性和定量研究，结合政策因素、市场情绪与估值因素等分析大类资产风险收益比，利用大小盘股风格轮动、行业轮动、行业季节效应以及 GARP 行业估值合理分配各资产配置比例，以实现基金资产的稳健增值。

2、股票精选策略

本基金通过定量和定性相结合的方法定期分析和评估上市公司的成长性，以便能够持续分享经济增长转型所带来的发展成果。

定量投资方面，本基金将依托内部自主研发的定量投资模型构建投资组合，利用多个基本面和事件驱动策略构建基础股票池，并根据定期分析和动态调整评估结果；定性投资方面，本基金通过对行业和个股进行深度研究构建核心股票池。

(1) 定量分析

本基金通过内部自主研发的量化模型，如价值成长策略、红利增长股模型、基金重仓股模型和定增破发模型，构建基础股票池。价值成长策略由于选股时兼顾价值和成长，风险相对适中，可以获得较高的风险调整后收益。定增破发策略主要利用股价定增的价格优势进行量化选股。

(2) 定性分析

在基础股票池上，本基金利用基本面研究成果，对基础股票池的股票进行删减，并利用核心价值理论，从垄断壁垒、品牌优势、资源优势、核心竞争力、盈利模式、政策优势、行业优势等角度，对个股进行筛选。

(3) 实地调研

本基金投研团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、公司治理情况、经营状况、重大投资项目情况以及财务数据的真实性等。

3、债券投资策略

本基金在宏观研究的基础上对未来利率变化趋势进行预测，形成债券投资决策的依据，同时结合我国债券市场发展现状及前景，灵活地采取各种债券操作策略建立债券组合。

本基金在运作过程中，将运用利率预测、久期配置、类别配置等积极投资策略，追求低风险下的稳定收益，同时把握无风险套利机会，灵活运用融资杠杆和衍生工具提高收益、控制风险。其主要投资策略有以下几种：

(1) 利率预测/久期配置

本基金将密切关注国内外经济形势的运行，根据市场投资环境的变化趋势，综合考虑宏观经济运行指标、货币市场运行情况、国家财政货币政策动向等因素，由固定收益研究小组定期对各个时间段利率的变化做出合理预期，从而形成利率期限结构的判断。

根据对利率期限结构变化的预判，本基金将对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低可能的利率变化给组合带来的损失，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。例如，当预期市场利率上升时，本基金可缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金可拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。

(2) 类别配置策略

本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券之间的利差和变化趋势，制定债券类别配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结

合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。

（3）无风险套利策略

由于市场的不完全有效性和有关政策对投资者的限制，我国债券市场上存在较多的套利机会。作为多个市场的参与者，在遵守投资规则的前提下，本基金将积极捕捉无风险套利机会，为基金份额持有人创造最大的收益。

（4）融资杠杆策略

本基金可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会（包括期限较长或同期限不同市场的逆回购），以获取额外收益。

（5）债券备选库的标准

本基金选券的基本标准为本金安全、收益较高、流动性良好。

（6）中小企业私募债券的投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。

4、权证投资策略

本基金权证投资的原则主要为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。

5、可转换债券投资策略

本基金着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债，并选择具有较高投资价值的个券进行投资。

6、股指期货投资策略

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。

（二）基金管理人运用基金财产的决策依据、决策程序

1、决策依据

- 1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
- 2)以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；
- 3)国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

1)备选库的形成与维护

对于股票投资，通过定量和定性相结合的方法定期分析和评估上市公司的成长性，依托内部自主研发的定量投资模型构建投资组合，并根据定期分析和动态调整评估结果；对于债券投资，分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差（OAS）对普通债券和含权债券进行分析，在此基础上形成基金债券投资的信用债备选库。

2)资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合以及个股配置，形成资产配置建议。

3)构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，审议并确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投研会议讨论结果，制定基金的投资策略，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

4)交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向交易部发出交易指令。交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

5)投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况，监察稽核部对基金投资进行日常监督，风险管理部负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估，对基金投资组合不断进行调整和优化。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1%。

三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。本基金以实现绝对收益作为投资目标，力争在混合型基金的投资限定之下，追求较高的投资回报。银行定期存款可以近似理解为定息产品，而三年期银行定期存款利率（税后）+1%较符合本基金的预期。因此，本基金采用三年期银行定期存款利率（税后）+1%作为业绩比较基准，与本基金追求的预期收益水平相符。

如果今后法律法规发生变化，或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2018 年第 4 季度报告，所载数据截至 2018 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 511,245,915.52 92.57

其中：股票 511,245,915.52 92.57

2 基金投资 --

3 固定收益投资 34,106,000.00 6.18

其中：债券 34,106,000.00 6.18

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 4,081,120.86 0.74

8 其他资产 2,854,233.38 0.52

9 合计 552,287,269.76 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 5,052,675.60 0.92

B 采矿业 --

C 制造业 221,897,974.64 40.30

D 电力、热力、燃气及水生产和供

应业 --

E 建筑业 6,857,412.00 1.25

F 批发和零售业 13,905,574.76 2.53

G 交通运输、仓储和邮政业 33,394,051.00 6.06

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服

务业 38,597,184.49 7.01

J 金融业 108,990,523.52 19.79

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 36,473,417.24 6.62

M 科学研究和技术服务业 7,137,227.26 1.30

N 水利、环境和公共设施管理业 22,021,625.01 4.00

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 16,918,250.00 3.07

S 综合 --

合计 511,245,915.52 92.85

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值

比例(%)

1 002262 恩华药业 3,731,355 33,656,822.10 6.11

2 002027 分众传媒 6,221,189 32,599,030.36 5.92

3 601336 新华保险 527,491 22,281,219.84 4.05

4 002050 三花智控 1,730,498 21,960,019.62 3.99

5 601111 中国国航 2,658,400 20,310,176.00 3.69

6 601318 中国平安 360,110 20,202,171.00 3.67

7 002456 欧菲科技 2,132,464 19,597,344.16 3.56

8 601601 中国太保 678,128 19,279,179.04 3.50
9 600036 招商银行 746,692 18,816,638.40 3.42
10 601233 桐昆股份 1,875,827 18,308,071.52 3.32

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

- 1 国家债券 --
- 2 央行票据 --
- 3 金融债券 34,106,000.00 6.19
- 其中：政策性金融债 34,106,000.00 6.19
- 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 34,106,000.00 6.19

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

- 1 180209 18 国开 09 300,000 30,096,000.00 5.47
- 2 180404 18 农发 04 40,000 4,010,000.00 0.73

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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投资，也无期间损益。

9.2 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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

10.2 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。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内, 本基金投资前十名证券的发行主体中,新华人寿保险股份有限公司(以

下简称"新华人寿")于 2018 年 2 月 11 日收到中国保监会监管函([2018]31 号),中国保监会对公司境外投资业务违反了《保险资金境外投资管理暂行办法实施细则》(保监发[2012]93 号)关于可投资国家或者地区的相关规定,提出进行整改的要求。2018 年 10 月 18 日,收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》(银保监保罚决字[2018]1 号),银保监会决定对新华人寿欺骗投保人的行为罚款 30 万元,对编制提供虚假资料的行为罚款 50 万元、对未按照规定使用经批准或者备案的保险费率的行罚款 30 万元。同时,对 10 名相关负责人警告并罚款共计 117 万元。

报告期内,本基金投资前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")于 2018 年 5 月 4 日,因为:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款,被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。

上述两只证券经研究员出具相关意见,并进行入库审批流程,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。除此以外,本基金投资决策程序均符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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、处罚以至于影响投资决策流程的情形。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

- 1 存出保证金 233,618.18
- 2 应收证券清算款 1,878,159.15
- 3 应收股利 -
- 4 应收利息 613,851.67
- 5 应收申购款 128,604.38
- 6 其他应收款 -
- 7 其他 -
- 8 合计 2,854,233.38

11.4 报告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。

11.5 报告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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

下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。

基金业绩截止日为 2018 年 12 月 31 日,下述数据未经审计。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段 净值 增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收
益率标准差④ ①—③ ②—④

基金合同生效日（2015.1.23）至 2015.12.31 36.10% 2.32% 4.07% 0.01% 32.03% 2.31%

2016.1.1 至 2016.12.31 -4.56% 1.51% 3.60% 0.01% -8.16% 1.50%

2017.1.1 至 2017.12.31 -6.16% 0.74% 3.48% 0.01% -9.64% 0.73%

2018.1.1 至 2018.12.31 -14.44% 1.35% 3.36% 0.01% -17.80% 1.34%

基金合同生效日（2015.1.23）至 2018.12.31 4.30% 1.57% 15.32% 0.01% -11.02% 1.56%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2018 年 9 月 5 日刊登的《兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2018 年第 2 号)》进行了更新，并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期以及相关财务数据的截至日期。
- 2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的主要人员情况。
- 3、在“四、基金托管人”部分，更新了托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，更新了直销联系人及其他销售机构的信息。
- 5、在“九、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告的内容。
- 6、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金业绩表现的内容。
- 7、在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了基金管理人在招募说明书更新期间刊登的与本基金相关的公告。

兴业基金管理有限公司

2019 年 3 月 8 日