

兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 日

§ 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业成长动力混合
基金主代码	002597
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月03日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	49,083,619.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置，基于对企业内在价值的深入研究，重点投资于质地优秀且未来预期成长性良好的上市公司，在充分控制风险和保证流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将结合国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，确定在不同时期和阶段基金在股票、债券等各类资产的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	王永民
	联系电话	010-66594896

人	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40000-95561	95566
传真		021-22211997	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2018年01月01日- 2018年06月30日）
本期已实现收益	2,480,893.20
本期利润	-2,266,405.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0456
本期基金份额净值增长率	-4.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0375
期末基金资产净值	52,637,774.17
期末基金份额净值	1.072

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.07%	0.92%	-4.87%	1.02%	1.80%	-0.10%
过去三个月	-4.37%	0.86%	-7.33%	0.76%	2.96%	0.10%
过去六个月	-4.03%	1.03%	-7.41%	0.79%	3.38%	0.24%
过去一年	5.41%	0.98%	-6.40%	0.67%	11.81%	0.31%
自基金合同生效起至今	7.20%	0.75%	-4.67%	0.61%	11.87%	0.14%

注：本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%。

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

兴业成长动力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

(2016年06月03日-2018年06月30日)



§ 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12亿元人民币，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2018年6月30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、兴业安弘3个月定期开放债券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、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

刘方旭	股票公募 投资总监 、基金经 理	2016-06- 03	-	9年	<p>中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2003年4月至2007年6月，先后就职于上海济国投资管理有限责任公司、上海英代科斯投资管理有限责任公司、上海上东投资管理有限责任公司，担任研究员；2007年7月至2009年6月，在瑞穗投资咨询（上海）有限公司担任分析师；2009年6月至2012年5月，在中欧基金管理有限责任公司担任研究员、基金经理助理，其中2010年担任中欧中小盘股票型证券投资基金基金经理助理，2011年担任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理；2012年5月至2015年5月，在中国人保资产管理股份有限公司股票投资部担任投资经理；2015年5月加入兴业基金管理有限公司，现任股票公募投资总监、基金经理。</p>
高圣	基金经理	2018-03- 02	-	9年	<p>中国籍，硕士学位，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM），具有证券投资基金从业资格。2009年4月至2012年7月在华泰证券股份有限公司研究所担任行业分析师，从事行业及公司研究。2012年7月至2017年8月在海通证券股份有限公司权益投资交易部担任行业公司研究岗位，从事股票投资研究工作。2017年9月加入兴业基金管理有限公司，</p>

					现任基金经理。
--	--	--	--	--	---------

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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2018年上半年来，上证综指与创业板指均出现较为明显的跌幅，本基金通过努力调仓，试图把握市场的结构性机会。本基金因为是定位在新兴成长方面的主题基金，因此在行业配置上主要集中在医药生物、计算机、电子等行业领域。本基金在个股层面的配置相对分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业成长动力混合基金份额净值为1.072元，本报告期内，基金份额净值增长率为-4.03%，同期业绩比较基准收益率为-7.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年下半年中国整体宏观经济增速或将小幅下滑，稳增长将成为下半年经济工作的重点和硬要求。上半年持续推进的去杠杆在下半年仍将是主基调，但下半年的去

杠杆将会以稳为主，力度和节奏有望放轻放缓。货币方面，随着货币政策由稳健中性转为稳健，以及国内流动性目标由“合理稳定”转向“合理充裕”，再叠加资管新规松绑非标，我国货币事实上在松动，下半年国内的货币环境有望较上半年宽松，但指望“大放水”不切实际。财政方面，下半年财政或将发力，旨在扩内需和调结构，着力点是减税和地方专项债提速，下半年基建也有望止跌企稳。2018年下半年房地产调控仍将从严从紧，控房价是主基调。整体看，下半年宏观政策环境对股市的影响有望好于上半年。

国际方面，美国已经进入升息周期，对新兴市场国家带来资本外流的压力。2018年上半年中美贸易摩擦升温，并可能在较长时间内持续，对国内经济发展构成一定不确定性。2018年上半年人民币对美元出现一定贬值，短期内贬值压力得到释放，但下半年资本外流的压力仍然存在。

股票市场在经历了2018年上半年的明显系统性下跌之后，包括主板、中小板和创业板在内的市场整体估值水平继续回落，一些个股及板块已经处于或者接近历史估值底部，已经具备中长期投资价值。2018年上半年A股纳入MSCI后，海外资金配置A股的比例继续上升，其已经成为国内股市重要新增资金来源。国内去杠杆的持续推进、美国等西方国家进入升息周期、以及中美贸易摩擦带来的较大不确定性成为短期压制国内股市估值的主要因素。

综上，预计2018年下半年国内股市可能仍将以弱势宽幅震荡为主基调，但在经历上半年市场整体估值下移后，部分个股和板块的中长期投资机会已经开始显现。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	10,757,227.07	5,253,513.75
结算备付金	2,282,703.71	393,662.93
存出保证金	60,572.42	24,828.41
交易性金融资产	28,797,925.84	41,396,779.80
其中：股票投资	28,797,925.84	41,396,779.80
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	20,500,000.00	-
应收证券清算款	-	10,017,134.25
应收利息	-820.88	-2,450.16
应收股利	-	-
应收申购款	3,190.28	4,571.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	62,400,798.44	57,088,040.52
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2018年06月30日	2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	9,291,876.57	160.00
应付赎回款	3,219.63	21,935.54
应付管理人报酬	65,506.84	71,298.85
应付托管费	10,917.81	11,883.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	302,241.46	49,170.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	89,261.96	100,000.12
负债合计	9,763,024.27	254,448.22
所有者权益:		
实收基金	49,083,619.27	50,894,501.89
未分配利润	3,554,154.90	5,939,090.41
所有者权益合计	52,637,774.17	56,833,592.30
负债和所有者权益总计	62,400,798.44	57,088,040.52

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.072元，基金份额总额49,083,619.27份。

6.2 利润表

会计主体：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年06月30	上年度可比期间
-----	--------------------------	---------

	日	2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	-703,316.63	3,453,567.20
1. 利息收入	267,730.92	207,067.20
其中：存款利息收入	39,679.85	27,186.06
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	228,051.07	179,881.14
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,766,412.69	-1,905,202.34
其中：股票投资收益	3,605,569.97	-2,319,008.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	160,842.72	413,805.67
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,747,299.02	5,149,193.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	9,838.78	2,508.79
减：二、费用	1,563,089.19	847,214.75
1. 管理人报酬	406,003.28	428,317.29
2. 托管费	67,667.22	71,386.24
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	984,045.05	235,924.95

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	105,373.64	111,586.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,266,405.82	2,606,352.45
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,266,405.82	2,606,352.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30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)	50,894,501.89	5,939,090.41	56,833,592.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,266,405.82	-2,266,405.82
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）	-1,810,882.62	-118,529.69	-1,929,412.31
其中：1. 基金申购款	2,397,161.54	256,724.19	2,653,885.73
2. 基金赎回款	-4,208,044.16	-375,253.88	-4,583,298.04
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）	49,083,619.27	3,554,154.90	52,637,774.17
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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）	61,494,224.69	-1,802,225.79	59,691,998.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,606,352.45	2,606,352.45
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）	-8,808,465.49	112,013.59	-8,696,451.90
其中：1. 基金申购款	205,455.91	-4,425.17	201,030.74
2. 基金赎回款	-9,013,921.40	116,438.76	-8,897,482.64
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）	52,685,759.20	916,140.25	53,601,899.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业成长动力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》、《兴业成长动力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]2641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212,527,217.99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(16)第0467号的验资报告。基金合同于2016年6月3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、债券(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、短期融资券等)、债券回购、银行存款、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。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、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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;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:中证500指数收益率 \times 55%+中证全债指数收益率 \times 45%。

6.4.2 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。

6.4.3 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2018年06月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	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: 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	406,003.28	428,317.29
其中：支付销售机构的客户维护费	17,627.25	55,036.07

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1.50%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*1.50%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,667.22	71,386.24

注：支付基金托管人中国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*0.25%÷当年天数。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,757,227.07	27,055.51	3,193,501.58	13,994.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业或协议利率计算。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

6.4.9 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发\增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2 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
603939	益丰药房	2018-04-17	重大资产重组	53.07	2018-07-16	65.69	37,153	1,373,486.36	1,971,709.71	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 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	28,797,925.84	46.15
	其中：股票	28,797,925.84	46.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,500,000.00	32.85
	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	13,039,930.78	20.90
8	其他各项资产	62,941.82	0.10
9	合计	62,400,798.44	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	12,667,820.34	24.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,635,915.36	6.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,997,684.14	17.09
J	金融业	1,114.75	0.00
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	539,580.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	525,519.75	1.00
R	文化、体育和娱乐业	2,430,291.50	4.62
S	综合	-	-
	合计	28,797,925.84	54.71

7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603939	益丰药房	37,153	1,971,709.71	3.75
2	300188	美亚柏科	92,600	1,694,580.00	3.22

3	000977	浪潮信息	70,300	1,676,655.00	3.19
4	603019	中科曙光	35,800	1,642,146.00	3.12
5	000681	视觉中国	57,145	1,640,061.50	3.12
6	600845	宝信软件	60,925	1,605,373.75	3.05
7	300253	卫宁健康	116,000	1,437,240.00	2.73
8	300003	乐普医疗	37,761	1,385,073.48	2.63
9	603605	珀莱雅	32,100	1,366,176.00	2.60
10	600570	恒生电子	25,400	1,344,930.00	2.56

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002727	一心堂	7,992,397.76	14.06
2	002475	立讯精密	7,814,337.20	13.75
3	000681	视觉中国	7,210,105.64	12.69
4	603233	大参林	7,077,709.00	12.45
5	002439	启明星辰	6,742,081.00	11.86
6	002410	广联达	6,238,970.00	10.98
7	300133	华策影视	6,186,451.00	10.89
8	300166	东方国信	5,490,376.00	9.66
9	300003	乐普医疗	5,228,984.00	9.20
10	002142	宁波银行	5,202,975.32	9.15
11	600436	片仔癀	4,927,471.20	8.67
12	002508	老板电器	4,746,182.76	8.35
13	600977	中国电影	4,741,154.46	8.34
14	300357	我武生物	4,575,023.94	8.05
15	603019	中科曙光	4,533,774.16	7.98
16	300251	光线传媒	4,470,633.97	7.87
17	600584	长电科技	4,337,758.66	7.63

18	000858	五 粮 液	4,240,978.00	7.46
19	300188	美亚柏科	4,235,200.76	7.45
20	002343	慈文传媒	4,206,104.00	7.40
21	600196	复星医药	4,183,580.89	7.36
22	002236	大华股份	4,115,213.00	7.24
23	300170	汉得信息	4,112,221.00	7.24
24	603345	安井食品	4,105,291.00	7.22
25	600884	杉杉股份	4,071,040.04	7.16
26	300271	华宇软件	4,045,580.00	7.12
27	600498	烽火通信	3,938,092.70	6.93
28	002405	四维图新	3,842,894.00	6.76
29	603658	安图生物	3,662,316.00	6.44
30	300274	阳光电源	3,643,392.00	6.41
31	002045	国光电器	3,575,283.00	6.29
32	000513	丽珠集团	3,408,563.00	6.00
33	603103	横店影视	3,345,102.00	5.89
34	603799	华友钴业	3,332,787.26	5.86
35	600570	恒生电子	3,324,264.00	5.85
36	300616	尚品宅配	3,312,883.20	5.83
37	603868	飞科电器	3,246,902.14	5.71
38	000977	浪潮信息	3,236,142.00	5.69
39	300418	昆仑万维	3,153,243.00	5.55
40	000063	中兴通讯	3,085,024.00	5.43
41	002027	分众传媒	3,070,035.00	5.40
42	002371	北方华创	3,009,119.00	5.29
43	300595	欧普康视	2,954,589.00	5.20
44	002044	美年健康	2,934,855.72	5.16
45	600115	东方航空	2,932,858.00	5.16
46	600867	通化东宝	2,854,254.00	5.02
47	603883	老百姓	2,766,242.00	4.87
48	600566	济川药业	2,726,100.00	4.80

49	600754	锦江股份	2,544,536.00	4.48
50	603866	桃李面包	2,489,106.00	4.38
51	300633	开立医疗	2,451,626.00	4.31
52	002049	紫光国微	2,450,972.00	4.31
53	300059	东方财富	2,448,909.00	4.31
54	603008	喜临门	2,393,052.00	4.21
55	300113	顺网科技	2,383,794.00	4.19
56	601566	九牧王	2,349,972.31	4.13
57	300015	爱尔眼科	2,349,186.00	4.13
58	603899	晨光文具	2,348,160.00	4.13
59	603839	安正时尚	2,256,761.00	3.97
60	600887	伊利股份	2,211,017.00	3.89
61	002466	天齐锂业	2,194,152.90	3.86
62	300373	扬杰科技	2,180,558.00	3.84
63	002465	海格通信	2,143,855.00	3.77
64	601100	恒立液压	2,137,257.00	3.76
65	600845	宝信软件	2,056,779.49	3.62
66	603986	兆易创新	2,046,511.00	3.60
67	603708	家家悦	1,947,368.40	3.43
68	002293	罗莱生活	1,945,472.00	3.42
69	600779	水井坊	1,912,620.00	3.37
70	002202	金风科技	1,870,225.00	3.29
71	000661	长春高新	1,867,908.00	3.29
72	601601	中国太保	1,856,813.00	3.27
73	601933	永辉超市	1,823,475.00	3.21
74	300098	高新兴	1,808,821.00	3.18
75	000568	泸州老窖	1,729,296.00	3.04
76	600466	蓝光发展	1,728,023.09	3.04
77	300450	先导智能	1,683,162.00	2.96
78	600859	王府井	1,670,218.70	2.94
79	300413	芒果超媒	1,666,407.00	2.93

80	603589	口子窖	1,660,343.10	2.92
81	300136	信维通信	1,657,778.00	2.92
82	002035	华帝股份	1,647,471.48	2.90
83	002833	弘亚数控	1,641,204.00	2.89
84	600038	中直股份	1,634,017.00	2.88
85	603365	水星家纺	1,629,225.00	2.87
86	603885	吉祥航空	1,614,840.00	2.84
87	002511	中顺洁柔	1,596,399.00	2.81
88	601988	中国银行	1,584,139.00	2.79
89	600703	三安光电	1,575,302.00	2.77
90	300253	卫宁健康	1,571,944.00	2.77
91	300036	超图软件	1,536,598.00	2.70
92	002867	周大生	1,487,302.00	2.62
93	002572	索菲亚	1,443,462.00	2.54
94	002281	光迅科技	1,418,452.00	2.50
95	601688	华泰证券	1,395,820.00	2.46
96	002456	欧菲科技	1,392,551.00	2.45
97	300467	迅游科技	1,366,377.00	2.40
98	300628	亿联网络	1,358,196.00	2.39
99	002008	大族激光	1,356,814.00	2.39
100	603127	昭衍新药	1,320,310.00	2.32
101	300571	平治信息	1,303,303.50	2.29
102	601877	正泰电器	1,298,383.00	2.28
103	600487	亨通光电	1,286,803.00	2.26
104	002223	鱼跃医疗	1,207,414.00	2.12
105	603605	珀莱雅	1,184,649.00	2.08
106	300642	透景生命	1,163,515.00	2.05
107	000786	北新建材	1,149,692.00	2.02
108	300367	东方网力	1,148,608.00	2.02
109	600340	华夏幸福	1,146,813.00	2.02
110	601012	隆基股份	1,144,988.00	2.01

111	002555	三七互娱	1,137,970.00	2.00
112	601318	中国平安	1,137,565.00	2.00

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

7.4.2 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	002475	立讯精密	8,937,037.38	15.72
2	002142	宁波银行	7,617,313.60	13.40
3	002727	一心堂	7,359,798.17	12.95
4	002439	启明星辰	7,230,752.00	12.72
5	603233	大参林	6,085,092.75	10.71
6	603658	安图生物	5,882,883.30	10.35
7	002236	大华股份	5,849,081.61	10.29
8	000681	视觉中国	5,768,100.35	10.15
9	300166	东方国信	5,530,276.10	9.73
10	300133	华策影视	5,426,650.91	9.55
11	600436	片仔癀	5,289,231.12	9.31
12	002410	广联达	4,973,096.09	8.75
13	300357	我武生物	4,862,025.46	8.55
14	600977	中国电影	4,637,155.74	8.16
15	300251	光线传媒	4,614,141.72	8.12
16	603345	安井食品	4,591,473.30	8.08
17	002508	老板电器	4,563,317.73	8.03
18	002027	分众传媒	4,458,956.87	7.85
19	000858	五粮液	4,288,498.88	7.55
20	000333	美的集团	4,216,147.58	7.42
21	600867	通化东宝	4,207,127.40	7.40
22	600196	复星医药	4,204,193.67	7.40

23	600884	杉杉股份	4,149,967.72	7.30
24	603883	老百姓	4,146,237.56	7.30
25	300003	乐普医疗	4,103,011.45	7.22
26	002343	慈文传媒	4,077,872.73	7.18
27	300170	汉得信息	4,029,566.12	7.09
28	300271	华宇软件	3,973,837.30	6.99
29	600498	烽火通信	3,924,205.03	6.90
30	603799	华友钴业	3,808,407.28	6.70
31	601233	桐昆股份	3,800,140.15	6.69
32	002405	四维图新	3,754,602.00	6.61
33	600703	三安光电	3,743,316.20	6.59
34	603103	横店影视	3,508,885.77	6.17
35	000513	丽珠集团	3,390,948.03	5.97
36	002045	国光电器	3,367,473.67	5.93
37	600566	济川药业	3,349,037.29	5.89
38	300274	阳光电源	3,304,604.91	5.81
39	600584	长电科技	3,267,019.08	5.75
40	300616	尚品宅配	3,218,222.12	5.66
41	603868	飞科电器	3,168,657.08	5.58
42	000661	长春高新	3,154,651.75	5.55
43	300418	昆仑万维	3,115,750.03	5.48
44	300595	欧普康视	2,937,762.20	5.17
45	600115	东方航空	2,897,080.44	5.10
46	603019	中科曙光	2,862,300.88	5.04
47	002044	美年健康	2,844,998.60	5.01
48	300188	美亚柏科	2,656,788.00	4.67
49	300633	开立医疗	2,641,458.70	4.65
50	000703	恒逸石化	2,606,544.72	4.59
51	600487	亨通光电	2,575,380.99	4.53
52	603866	桃李面包	2,509,845.31	4.42
53	600754	锦江股份	2,497,816.00	4.39

54	002008	大族激光	2,494,990.24	4.39
55	603008	喜临门	2,439,475.55	4.29
56	002049	紫光国微	2,359,047.30	4.15
57	300113	顺网科技	2,346,911.99	4.13
58	002371	北方华创	2,302,516.00	4.05
59	601566	九牧王	2,297,942.41	4.04
60	300059	东方财富	2,296,289.11	4.04
61	603899	晨光文具	2,243,636.22	3.95
62	603839	安正时尚	2,215,753.76	3.90
63	300373	扬杰科技	2,166,970.00	3.81
64	600887	伊利股份	2,141,934.20	3.77
65	000063	中兴通讯	2,041,586.00	3.59
66	601100	恒立液压	2,020,381.00	3.55
67	600570	恒生电子	1,968,456.21	3.46
68	600779	水井坊	1,962,625.58	3.45
69	601877	正泰电器	1,924,672.24	3.39
70	603708	家家悦	1,895,618.00	3.34
71	002293	罗莱生活	1,867,963.00	3.29
72	600031	三一重工	1,867,747.56	3.29
73	002465	海格通信	1,867,129.43	3.29
74	300015	爱尔眼科	1,855,050.28	3.26
75	601601	中国太保	1,796,962.50	3.16
76	002202	金风科技	1,775,705.00	3.12
77	002456	欧菲科技	1,729,905.62	3.04
78	601933	永辉超市	1,725,970.00	3.04
79	300098	高新兴	1,716,973.68	3.02
80	600859	王府井	1,688,604.12	2.97
81	002833	弘亚数控	1,675,870.00	2.95
82	000977	浪潮信息	1,659,770.00	2.92
83	300413	芒果超媒	1,656,432.80	2.91
84	000568	泸州老窖	1,641,000.00	2.89

85	300450	先导智能	1,605,037.00	2.82
86	600038	中直股份	1,601,000.24	2.82
87	603589	口子窖	1,592,505.10	2.80
88	603885	吉祥航空	1,559,301.00	2.74
89	002511	中顺洁柔	1,546,867.00	2.72
90	002035	华帝股份	1,541,099.20	2.71
91	601988	中国银行	1,540,415.00	2.71
92	600104	上汽集团	1,536,449.13	2.70
93	002867	周大生	1,535,660.50	2.70
94	603365	水星家纺	1,518,726.00	2.67
95	300136	信维通信	1,504,945.00	2.65
96	300036	超图软件	1,459,167.00	2.57
97	002572	索菲亚	1,445,649.00	2.54
98	300467	迅游科技	1,407,311.00	2.48
99	600521	华海药业	1,388,950.44	2.44
100	300433	蓝思科技	1,382,173.56	2.43
101	002466	天齐锂业	1,372,691.81	2.42
102	300628	亿联网络	1,329,986.46	2.34
103	002281	光迅科技	1,300,275.86	2.29
104	002304	洋河股份	1,284,017.00	2.26
105	601688	华泰证券	1,270,982.00	2.24
106	600466	蓝光发展	1,231,763.00	2.17
107	603660	苏州科达	1,183,452.90	2.08
108	600340	华夏幸福	1,159,443.00	2.04
109	600745	闻泰科技	1,155,711.65	2.03
110	002223	鱼跃医疗	1,149,130.00	2.02
111	002905	金逸影视	1,139,428.00	2.00

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

7.4.3 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	364,841,264.69
卖出股票收入（成交）总额	376,298,389.60

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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投资，也无期间损益。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的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、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	60,572.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-820.88
5	应收申购款	3,190.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,941.82

7.12.4 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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603939	益丰药房	1,971,709.71	3.75	重大资产重组

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
363	135,216.58	42,001,990.52	85.5723%	7,081,628.75	14.4277%

8.2 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	1,193,437.81	2.4314%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月03日)基金份额总额	212,527,217.99
本报告期期初基金份额总额	50,894,501.89

本报告期基金总申购份额	2,397,161.54
减：本报告期基金总赎回份额	4,208,044.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	49,083,619.27

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总	

	数量		的比例		例	
海通 证券	2	741, 139, 654. 29	100. 00 %	541, 994. 04	100. 00 %	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机构处罚。
- 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，本期未新增及剔除券商交易单元。

10.7.2 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
海通 证券	-	-	1, 592, 600, 000 .00	100. 0 0%	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	42,000,000.00	-	-	42,000,000.00	85.57%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。							

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日