

# 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 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：2016 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2016 年 3 月 23 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。

本报告期自 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |            |
|--|------------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                        | <b>2</b>   |
| 1.1 重要提示.....                                  | 2          |
| 1.2 目录.....                                    | 3          |
| <b>§2 基金简介</b> .....                           | <b>5</b>   |
| 2.1 基金基本情况.....                                | 5          |
| 2.2 基金产品说明.....                                | 5          |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                           | 5          |
| 2.4 信息披露方式.....                                | 6          |
| 2.5 其他相关资料.....                                | 6          |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....           | <b>6</b>   |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                           | 6          |
| 3.2 基金净值表现.....                                | 7          |
| 3.3 其他指标.....                                  | 错误! 未定义书签。 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                         | 8          |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                          | <b>8</b>   |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                          | 8          |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....                | 12         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                   | 12         |
| 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.....               | 12         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....               | 12         |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                   | 13         |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                  | 13         |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                   | 14         |
| <b>4.9 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</b> ..... | <b>14</b>  |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                          | <b>14</b>  |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                    | 错误! 未定义书签。 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....   | 错误! 未定义书签。 |
| 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.....        | 错误! 未定义书签。 |
| <b>§6 审计报告</b> .....                           | <b>15</b>  |
| 6.1 审计报告基本信息.....                              | 15         |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                             | 15         |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                         | <b>16</b>  |
| 7.1 资产负债表.....                                 | 16         |
| 7.2 利润表.....                                   | 17         |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                        | 18         |
| 7.4 报表附注.....                                  | 19         |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                         | <b>39</b>  |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                            | 39         |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                        | 39         |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....         | 40         |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                       | 41         |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                      | 42         |

|   |                  |
|---|------------------|
| 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 .....    | 43               |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 43               |
| 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 ..... | 43               |
| 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 .....    | 43               |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 43               |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44               |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 44               |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                    | <b>45</b>        |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45               |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45               |
| 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的情况 .....     | 45               |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>45</b>        |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                      | <b>46</b>        |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46               |
| 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 .....      | 46               |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46               |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46               |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46               |
| 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 .....         | 46               |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 46               |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 48               |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>              | <b>错误！未定义书签。</b> |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                      | <b>51</b>        |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 51               |
| 13.2 存放地点 .....                             | 52               |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 52               |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 兴业聚惠灵活配置混合         |
| 基金主代码      | 001547             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 7 月 8 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 | 1,681,323,632.04 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过稳健的资产配置策略，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。                        |
| 投资策略   | 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略充分控制下行风险。因势利导运用多样化的投资策略实现基金份额净值的长期平稳增长。 |
| 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                          | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 021-22211888                | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | renjb@cib-fund.com.cn       | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 40000-95561                 | 95568                 |
| 传真      |      | 021-22211997                | 010-58560798          |
| 注册地址    |      | 福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 邮政编码    |      | 200120                      | 100031                |
| 法定代表人   |      | 卓新章                         | 洪崎                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、上海证券报、证券时报    |
| 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    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                        |
|--------|--------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼      |
| 注册登记机构 | 兴业基金管理有限公司         | 上海市浦东新区浦明路 198 号财富金融广场 7 号楼 |

## § 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 | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | 16,171,887.92                            |
| 本期利润          | 20,809,491.25                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0260                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.55%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.80%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末                                  |
| 期末可供分配利润      | 42,726,243.94                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0254                                   |
| 期末基金资产净值      | 1,727,635,345.52                         |
| 期末基金份额净值      | 1.028                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末                                  |
| 基金份额累计净值增长率   | 2.80%                                    |

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）。

4、本基金于 2015 年 7 月 8 日成立，本报告期不是完整报告期。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

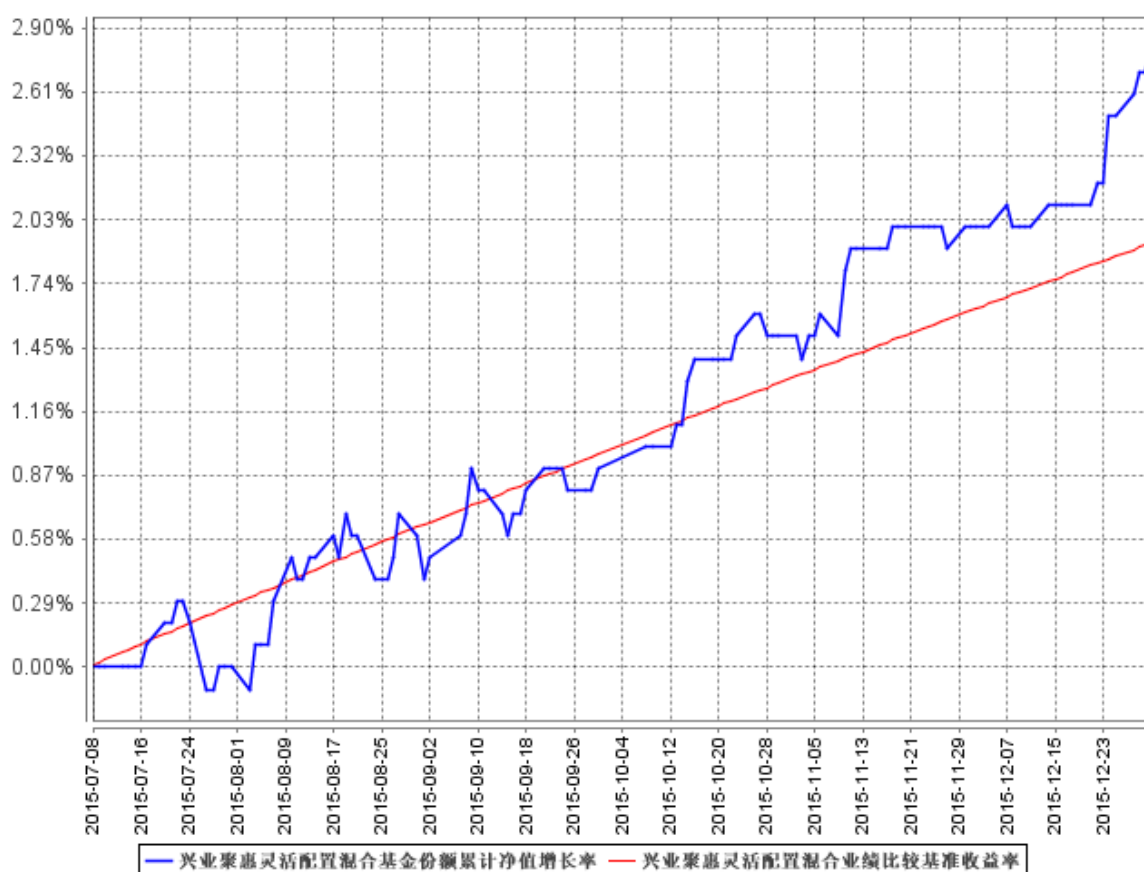
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 1.88%    | 0.08%       | 0.95%      | 0.01%         | 0.93% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.80%    | 0.09%       | 1.93%      | 0.01%         | 0.87% | 0.08% |

注：1、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%。

2、本基金于 2015 年 7 月 8 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

#### 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

兴业聚惠灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

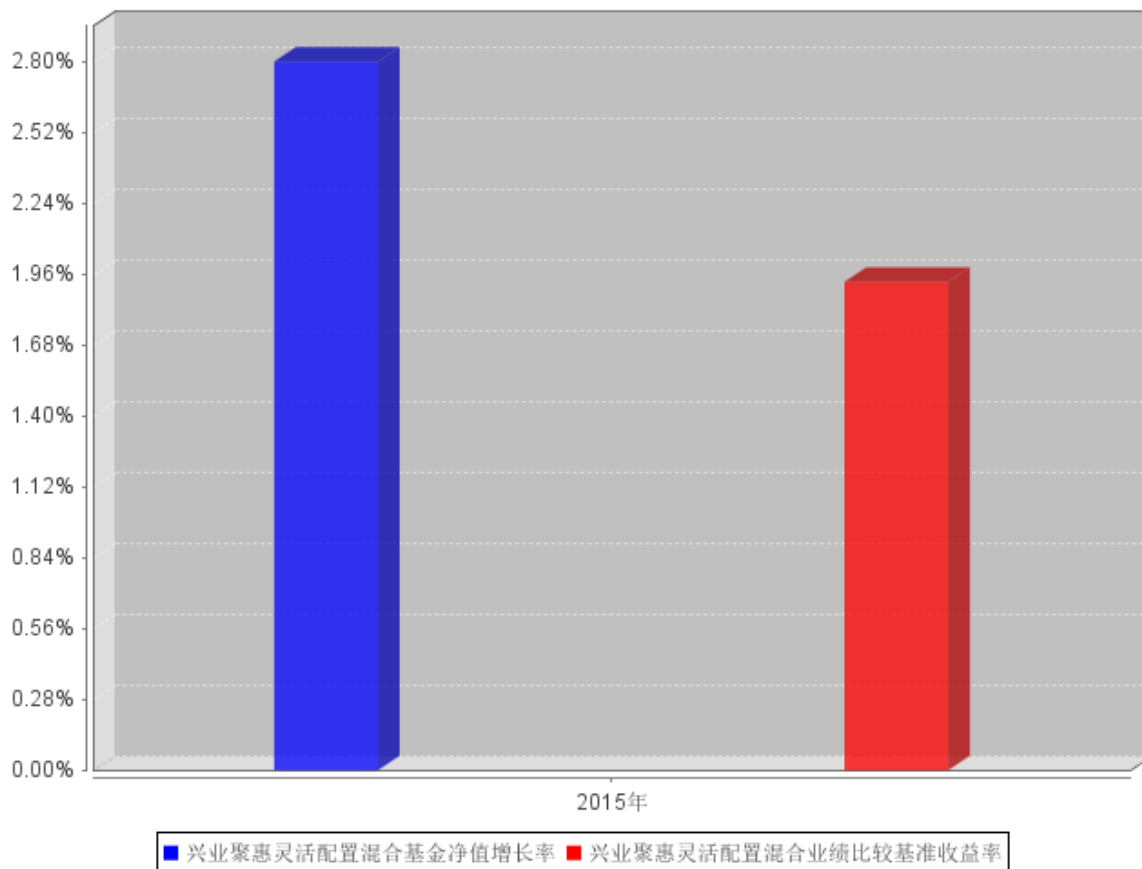


注：1、本基金基金合同于 2015 年 7 月 8 日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业聚惠灵活配置混合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对比图



注：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

注：无。

## § 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5亿元人民币，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2015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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|----------|-----------------|------|--------|--|
|    |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 腊博 | 本基金的基金经理 | 2015年7月8日       | -    | 11     | 中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格，新西兰梅西大学金融硕士。2003年7月至2006年4月，在新西兰 ANYING 国际金融有限公司担任货币策略师；2007年1月至2008年5月，在新西兰 FORSIGHT 金融研究有限公司担任策略分析师；2008年5月至2010年8月，在长城证券有限责任公司担 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 投资基金<br>基金经<br>理。2014<br>年12月加<br>入兴业基<br>金管理有<br>限公司，<br>2015年5<br>月14日起<br>担任兴业<br>聚利灵活<br>配置混合<br>型证券投<br>资基金基<br>金经理、<br>2015年5<br>月21日起<br>担任兴业<br>聚优灵活<br>配置混合<br>型证券投<br>资基金基<br>金经理，<br>2015年7<br>月8日起<br>担任兴业<br>聚惠灵活<br>配置混合<br>型证券投<br>资基金基<br>金经理。<br>2015年7<br>月24日担<br>任兴业定<br>期开放债<br>券型证券<br>投资基金<br>基金经<br>理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，自成立以来，本基金份额净值增长率为 2.8%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前期需求增速放缓的局面在边际上可能会出现一定的改善，但放缓的趋势很难通过政策扭转，受供给侧改革和部分商品价格上涨的约束，货币政策宽松的幅度也会有所下降，供给侧改革和经济结构转型仍然会是政策实施的落脚点。我们将在有效控制回撤的基础上，根据自上而下的资产

配置和细分资产的风险收益预期变化对组合进行动态调整。争取为基金持有人获得风险调整后的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2015 年度主要从如下几个方面落实风险控制、强化监察稽核职能：

1、梳理完善公司内控制度及业务流程：报告期内组织各部门对公司制度体系进行全面梳理、整合，规范公司业务运作和经营管理，全面建立内部控制标准与要求。

2、加强业务合规审核控制：通过对各类新产品的实现方案、相关协议、法律文件、流程、投资限制等进行审核评估并提供合规咨询等业务支持，确保业务创新的合规实施。

3、全面实施投资监督和风险监测：通过事前、事中、事后三个阶段进行投资风险监控，事前通过编制投资合规风控卡、设置恒生系统合规阈值等方式明确法规、合同及内控要求；事中结合系统与人工控制方式，每日监控投资交易过程并及时提示投资异常情况；事后定期对公募产品的合规运作、投资业绩等进行评估、分析，确保公司各产品合规运作、风险可控。

4、开展各项稽核审计工作：除应监管要求开展定期稽核、特定人员离任审计并及时向监管报送工作报告外，还就重点业务领域组织开展常规、专项审计，对产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查及整改跟踪，促进公司内控制度执行有效，内控水平不断提升。

5、加强员工行为合规管理：公司按照法规要求组织全体员工开展投资申报、定期检查信息管制要求落实情况，并通过组织合规培训和学习以及发送法规解读、违规案例、合规宣传手册等多种形式开展合规教育。在加强员工培训教育的同时加强违规问责力度，惩防并举，促进合规文化建设。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

#### 4.7 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。

**4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

**4.9 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惠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惠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，兴业聚惠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

由兴业聚惠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

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                    |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见              |
| 审计报告编号     | 德师报(审)字(16)第 P0813 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |
|--------------|--|
| 审计报告收件人      | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：  |
| 引言段          | 我们审计了后附的兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。        |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是兴业聚惠灵活配置混合的基金管理人兴业基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道   |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段     | 我们认为，兴业聚惠灵活配置混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴业聚惠灵活配置混合 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。  |
| 注册会计师的姓名  | 陶坚 吴凌志   |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海  |
| 审计报告日期    | 2016 年 3 月 25 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 975,205,502.09          |
| 结算备付金      |         | 1,610,263.01            |
| 存出保证金      |         | 121,507.00              |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 87,269,357.06           |
| 其中：股票投资    |         | 7,055,357.06            |
| 基金投资       |         | -                       |
| 债券投资       |         | 80,214,000.00           |
| 资产支持证券投资   |         | -                       |
| 贵金属投资      |         | -                       |



|                 |            |                            |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 660,002,150.00             |
| 应收证券清算款         |            | 2,982,680.06               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 2,609,741.10               |
| 应收股利            |            | -                          |
| 应收申购款           |            | 9,940.36                   |
| 递延所得税资产         |            | -                          |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          |
| 资产总计            |            | 1,729,811,140.68           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015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          | 7.4.7.3    | -                          |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          |
| 应付证券清算款         |            | -                          |
| 应付赎回款           |            | 101.57                     |
| 应付管理人报酬         |            | 1,595,629.83               |
| 应付托管费           |            | 199,453.74                 |
| 应付销售服务费         |            | -                          |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 180,610.02                 |
| 应交税费            |            | -                          |
| 应付利息            |            | -                          |
| 应付利润            |            | -                          |
| 递延所得税负债         |            | -                          |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 200,000.00                 |
| 负债合计            |            | 2,175,795.16               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 1,681,323,632.04           |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 46,311,713.48              |
| 所有者权益合计         |            | 1,727,635,345.52           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,729,811,140.68           |

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.028 元，基金份额总额 1,681,323,632.04 份。

2、本基金 2015 年 7 月 8 日成立，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015<br>年12月31日 |
|----------------------------|------------|--|
| <b>一、收入</b>                |            | 24,802,171.08                            |
| 1. 利息收入                    |            | 8,315,055.56                             |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 3,442,436.66                             |
| 债券利息收入                     |            | 2,720,534.46                             |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 2,152,084.44                             |
| 其他利息收入                     |            | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 7,594,962.32                             |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 5,385,486.10                             |
| 基金投资收益                     |            | -  |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 2,209,476.22                             |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.5 | -  |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -  |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15   | -  |
| 股利收益                       | 7.4.7.16   | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 4,637,603.33                             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.18   | 4,254,549.87                             |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 3,992,679.83                             |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 2,982,914.39                             |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 372,864.37                               |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -  |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 427,526.24                               |
| 5. 利息支出                    |            | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -  |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 209,374.83                               |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 20,809,491.25                            |
| 减：所得税费用                    |            | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 20,809,491.25                            |

注：本基金 2015 年 7 月 8 日成立，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |                |                  |
|--|---|----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 207,655,310.13                                  | -              | 207,655,310.13   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 20,809,491.25  | 20,809,491.25    |
| 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）      | 1,473,668,321.91                                | 25,502,222.23  | 1,499,170,544.14 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,306,191,524.82                                | 43,817,713.74  | 2,350,009,238.56 |
| 2. 基金赎回款                               | -832,523,202.91                                 | -18,315,491.51 | -850,838,694.42  |
| 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）                        | 1,681,323,632.04                                | 46,311,713.48  | 1,727,635,345.52 |

注：本基金 2015 年 7 月 8 日成立，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>卓新章</u> | <u>黄文锋</u> | <u>莫艳鸿</u> |
| 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

兴业聚惠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》、《兴业聚惠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]1274 号文批准公开募集。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 207,655,310.13 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 1160 号验资报告。基金合同于 2015 年 7 月 8 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》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业聚惠灵

活配置混合型证券投资基金招募说明书》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。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%，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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

#### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净

值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### - 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### - 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.8%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，若《基金合

同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 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[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 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；个人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，自 2008 年 9 月 19 日起，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) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 55,205,502.09           |
| 定期存款           | 920,000,000.00          |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       |
| 存款期限 1 个月以内    | 920,000,000.00          |
| 其他存款           | -                       |
| 合计：            | 975,205,502.09          |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |              |              |
|----|-------------------------|--------------|--------------|
|    | 成本                      | 公允价值         | 公允价值变动       |
| 股票 | 2,501,763.73            | 7,055,357.06 | 4,553,593.33 |

|               |               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -             | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场         | -             | -             |
|               | 银行间市场         | 80,129,990.00 | 80,214,000.00 |
|               | 合计            | 80,129,990.00 | 80,214,000.00 |
| 资产支持证券        | -             | -             | -             |
| 基金            | -             | -             | -             |
| 其他            | -             | -             | -             |
| 合计            | 82,631,753.73 | 87,269,357.06 | 4,637,603.33  |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年12月31日 |           |
|------------|--------------------|-----------|
|            | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 660,002,150.00     | -         |
| 合计         | 660,002,150.00     | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 88,100.28          |
| 应收定期存款利息   | 495,000.00         |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 797.06             |
| 应收债券利息     | 1,567,240.44       |
| 应收买入返售证券利息 | 458,542.79         |
| 应收申购款利息    | 0.47               |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 其他         | 60.06              |
| 合计         | 2,609,741.10       |

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 166,344.62              |
| 银行间市场应付交易费用 | 14,265.40               |
| 合计          | 180,610.02              |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | -                       |
| 预提审计费       | 50,000.00               |
| 预提信息披露费     | 150,000.00              |
| 合计          | 200,000.00              |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|---|------------------|
|               | 基金份额(份)   | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 207,655,310.13                                  | 207,655,310.13   |
| 本期申购          | 2,306,191,524.82                                | 2,306,191,524.82 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -832,523,202.91                                 | -832,523,202.91  |
| 本期末           | 1,681,323,632.04                                | 1,681,323,632.04 |

注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

2、本基金合同于 2015 年 7 月 8 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 207,655,292.95 元，折合 207,655,292.95 份基金份额。募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 17.18 元，折合 17.18 份基金份额。以上收到的实收基金(本息)共计人民币 207,655,310.13 元，折合 207,655,310.13 份基金份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -              | -             | -              |
| 本期利润           | 16,171,887.92  | 4,637,603.33  | 20,809,491.25  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 26,554,356.02  | -1,052,133.79 | 25,502,222.23  |
| 其中：基金申购款       | 43,968,900.22  | -151,186.48   | 43,817,713.74  |
| 基金赎回款          | -17,414,544.20 | -900,947.31   | -18,315,491.51 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 42,726,243.94  | 3,585,469.54  | 46,311,713.48  |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                             |
|-----------|--------------------------------|
|           | 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 527,384.63                     |
| 定期存款利息收入  | 2,752,959.72                   |
| 其他存款利息收入  | -                              |
| 结算备付金利息收入 | 11,632.13                      |
| 其他        | 150,460.18                     |
| 合计        | 3,442,436.66                   |

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                             |
|------------|--------------------------------|
|            | 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 卖出股票成交总额   | 192,069,941.47                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 186,684,455.37                 |
| 买卖股票差价收入   | 5,385,486.10                   |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期                             |
|----|--------------------------------|
|    | 2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |

|                               | 日            |
|-------------------------------|--------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,209,476.22 |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -            |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -            |
| 合计                            | 2,209,476.22 |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|-------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 255,649,110.95                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 247,798,838.78                       |
| 减：应收利息总额                | 5,640,795.95                         |
| 买卖债券差价收入                | 2,209,476.22                         |

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015 |
|------|-------------------------------|
|------|-------------------------------|

|            | 年 12 月 31 日  |
|------------|--------------|
| 1. 交易性金融资产 | 4,637,603.33 |
| ——股票投资     | 4,553,593.33 |
| ——债券投资     | 84,010.00    |
| ——资产支持证券投资 | -            |
| ——贵金属投资    | -            |
| ——其他       | -            |
| 2. 衍生工具    | -            |
| ——权证投资     | -            |
| 3. 其他      | -            |
| 合计         | 4,637,603.33 |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 4,254,177.99                                    |
| 其他      | 371.88  |
| 合计      | 4,254,549.87                                    |

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 424,088.74                                      |
| 银行间市场交易费用 | 3,437.50  |
| 合计        | 427,526.24                                      |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|--------|---|
| 审计费用   | 50,000.00                                       |
| 信息披露费  | 150,000.00                                      |
| 账户维护费  | 4,600.00  |
| 银行汇划费用 | 4,374.83  |
| 开户费    | 400.00  |
| 合计     | 209,374.83                                      |

### 7.4.7.20 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 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、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          |
| 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   |
| 兴晟股权投资管理有限公司             | 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期  |
|-----------------|---|
|                 | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,982,914.39                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -   |

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 0.8%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 0.8%÷当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期  |
|----------------|---|
|                | 2015 年 7 月 8 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 372,864.37                                |

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告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。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。



### 7.4.10.5 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>2015年7月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |            |
|-------|--------------------------------------|------------|
|       | 期末余额                                 | 当期利息收入     |
| 民生银行  | 55,205,502.09                        | 772,384.63 |
| 兴业银行  | 500,000,000.00                       | 868,459.72 |

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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间未发生其他关联方交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |             |           |        |      |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|-------------|-----------|--------|------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日      | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 002778               | 高科石化 | 2015年12月28日 | 2016年1月6日 | 新股流通受限 | 8.50 | 8.50   | 5,600        | 47,600.00 | 47,600.00 | -  |

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|-------|------------|------------|----|
| 600990 | 四创   | 2015年8月31日 | 重大事  | 62.75  | -    | -      | 2,000 | 120,980.00 | 125,500.00 | -  |

|    |  |   |  |  |  |  |  |  |  |
|----|--|---|--|--|--|--|--|--|--|
| 电子 |  | 项 |  |  |  |  |  |  |  |
|----|--|---|--|--|--|--|--|--|--|

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“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”的风险收益目标。

本基金的基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金管理人建立的风险管理体系由三个风险防范等级构成：

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；负责对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指在公司风险控制委员会，投资决策委员会和风险管理总部层次对公司风险进行的预防和控制。经理层下设风险控制委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、研究、评估，制定相应的风险控制制度并监督制度的执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量分析方法去估算各种风险产生的可能损失。从定性分析判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度，从定量分析建立风险量化指标、模型，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险又称违约风险，是指借款人、证券发行人或交易对方因各种原因，不愿或无力履行合同条件而构成违约，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了较完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。最后，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：截至报告期末，本基金无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | -                       |
| AAA 以下 | -                       |
| 未评级    | 80,214,000.00           |
| 合计     | 80,214,000.00           |

注：上表中未评级债券均为政策性金融债。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本报告期内基金的资产均能及时变现。此外，本基金管理人采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析和监测持有个券的市场交易状况、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015年12月31日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息          | 合计             |
|--------------------|----------------|------|------|--------------|----------------|
| 资产                 |                |      |      |              |                |
| 银行存款               | 975,205,502.09 | -    | -    | -            | 975,205,502.09 |
| 结算备付金              | 1,610,263.01   | -    | -    | -            | 1,610,263.01   |
| 存出保证金              | 121,507.00     | -    | -    | -            | 121,507.00     |
| 交易性金融资产            | 80,214,000.00  | -    | -    | 7,055,357.06 | 87,269,357.06  |
| 买入返售金融资产           | 660,002,150.00 | -    | -    | -            | 660,002,150.00 |

|         |                  |   |   |                |                  |
|---------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 应收证券清算款 | -                | - | - | 2,982,680.06   | 2,982,680.06     |
| 应收利息    | -                | - | - | 2,609,741.10   | 2,609,741.10     |
| 应收申购款   | -                | - | - | 9,940.36       | 9,940.36         |
| 其他资产    | -                | - | - | -              | -                |
| 资产总计    | 1,717,153,422.10 | - | - | 12,657,718.58  | 1,729,811,140.68 |
| 负债      | -                | - | - | -              | -                |
| 应付赎回款   | -                | - | - | 101.57         | 101.57           |
| 应付管理人报酬 | -                | - | - | 1,595,629.83   | 1,595,629.83     |
| 应付托管费   | -                | - | - | 199,453.74     | 199,453.74       |
| 应付交易费用  | -                | - | - | 180,610.02     | 180,610.02       |
| 其他负债    | -                | - | - | 200,000.00     | 200,000.00       |
| 负债总计    | -                | - | - | 2,175,795.16   | 2,175,795.16     |
| 利率敏感度缺口 | 1,717,153,422.10 | - | - | -10,481,923.42 | 1,727,635,345.52 |

注：1. 表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2. 基金成立于 2015 年 7 月 8 日，无上年度数据。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                 |   |
|----|---------------------------------|---|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变              |   |
|    | 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。 |   |
| 分析 | 相关风险变量的变动                       | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额(单位:人民币元)<br>本期末(2015年12月31日) |
|    | 市场利率下降 25 个基点                   | 77,537.98<br>-                                      |
|    | 市场利率上升 25 个基点                   | -77,382.36  |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础

上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 7,055,357.06            | 0.41          |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | 80,214,000.00           | 4.64          |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -             |
| 其他            | -                       | -             |
| 合计            | 87,269,357.06           | 5.05          |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除股票价格以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末（2015 年 12 月 31 日）       |
|    | 股票价格上升 5%          | 352,767.85                  |
|    | 股票价格下降 5%          | -352,767.85                 |

#### 7.4.14 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差很小。

##### (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 2015 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 6,882,257.06 元，属于第二层次的余额为人民币 80,387,100.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 7,055,357.06     | 0.41          |
|    | 其中：股票             | 7,055,357.06     | 0.41          |
| 2  | 固定收益投资            | 80,214,000.00    | 4.64          |
|    | 其中：债券             | 80,214,000.00    | 4.64          |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 660,002,150.00   | 38.15         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 976,815,765.10   | 56.47         |
| 7  | 其他各项资产            | 5,723,868.52     | 0.33          |
| 8  | 合计                | 1,729,811,140.68 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别     | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -            | -             |
| B  | 采矿业      | -            | -             |
| C  | 制造业      | 3,133,124.03 | 0.18          |

|   |                  |              |      |
|---|------------------|--------------|------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -    |
| E | 建筑业              | 1,002,328.20 | 0.06 |
| F | 批发和零售业           | 222,304.44   | 0.01 |
| 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  | 2,588,208.18 | 0.15 |
| J | 金融业              | -            | -    |
| 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       | 109,392.21   | 0.01 |
| 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          | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -            | -    |
| S | 综合               | -            | -    |
|   | 合计               | 7,055,357.06 | 0.41 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 603508 | 思维列控 | 14,605 | 1,136,853.20 | 0.07         |
| 2  | 300496 | 中科创达 | 6,560  | 918,465.60   | 0.05         |
| 3  | 002781 | 奇信股份 | 21,600 | 807,192.00   | 0.05         |
| 4  | 603398 | 邦宝益智 | 6,343  | 586,220.06   | 0.03         |
| 5  | 603996 | 中新科技 | 16,729 | 494,174.66   | 0.03         |
| 6  | 603936 | 博敏电子 | 7,448  | 381,933.44   | 0.02         |
| 7  | 300493 | 润欣科技 | 7,248  | 299,632.32   | 0.02         |
| 8  | 002782 | 可立克  | 13,312 | 283,146.24   | 0.02         |
| 9  | 002786 | 银宝山新 | 9,630  | 263,476.80   | 0.02         |
| 10 | 002779 | 中坚科技 | 3,078  | 240,699.60   | 0.01         |
| 11 | 300497 | 富祥股份 | 5,523  | 237,654.69   | 0.01         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 12 | 002780 | 三夫户外 | 3,566  | 222,304.44 | 0.01 |
| 13 | 603778 | 乾景园林 | 7,140  | 195,136.20 | 0.01 |
| 14 | 002787 | 华源包装 | 10,011 | 163,880.07 | 0.01 |
| 15 | 300494 | 盛天网络 | 6,251  | 162,901.06 | 0.01 |
| 16 | 600990 | 四创电子 | 2,000  | 125,500.00 | 0.01 |
| 17 | 603299 | 井神股份 | 23,499 | 124,779.69 | 0.01 |
| 18 | 300492 | 山鼎设计 | 6,219  | 109,392.21 | 0.01 |
| 19 | 300490 | 华自科技 | 7,127  | 93,292.43  | 0.01 |
| 20 | 300491 | 通合科技 | 6,015  | 90,766.35  | 0.01 |
| 21 | 002777 | 久远银海 | 4,264  | 70,356.00  | 0.00 |
| 22 | 002778 | 高科石化 | 5,600  | 47,600.00  | 0.00 |

## 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601288 | 农业银行 | 19,410,000.00 | 1.12            |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 16,360,361.10 | 0.95            |
| 3  | 000002 | 万科A  | 13,364,269.00 | 0.77            |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 13,037,175.00 | 0.75            |
| 5  | 600104 | 上汽集团 | 10,115,000.00 | 0.59            |
| 6  | 600598 | 北大荒  | 5,943,633.48  | 0.34            |
| 7  | 002142 | 宁波银行 | 5,335,509.00  | 0.31            |
| 8  | 300274 | 阳光电源 | 4,642,374.15  | 0.27            |
| 9  | 000625 | 长安汽车 | 4,638,722.55  | 0.27            |
| 10 | 600422 | 昆药集团 | 3,599,598.00  | 0.21            |
| 11 | 300251 | 光线传媒 | 3,442,000.00  | 0.20            |
| 12 | 300098 | 高新兴  | 3,348,306.20  | 0.19            |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 3,200,137.12  | 0.19            |
| 14 | 002236 | 大华股份 | 3,087,117.00  | 0.18            |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 2,901,462.00  | 0.17            |
| 16 | 601992 | 金隅股份 | 2,895,387.00  | 0.17            |
| 17 | 002146 | 荣盛发展 | 2,824,521.80  | 0.16            |
| 18 | 600511 | 国药股份 | 2,566,837.36  | 0.15            |
| 19 | 002051 | 中工国际 | 2,447,638.00  | 0.14            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 20 | 601555 | 东吴证券 | 2,264,633.00 | 0.13 |
|----|--------|------|--------------|------|

注：本项“买入金额”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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601288 | 农业银行 | 19,380,000.00 | 1.12            |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 16,250,988.04 | 0.94            |
| 3  | 600048 | 保利地产 | 14,672,337.23 | 0.85            |
| 4  | 000002 | 万科A  | 13,829,432.98 | 0.80            |
| 5  | 600104 | 上汽集团 | 10,028,289.24 | 0.58            |
| 6  | 600598 | 北大荒  | 5,600,616.53  | 0.32            |
| 7  | 002142 | 宁波银行 | 5,310,264.00  | 0.31            |
| 8  | 000625 | 长安汽车 | 4,876,516.00  | 0.28            |
| 9  | 300274 | 阳光电源 | 4,328,070.33  | 0.25            |
| 10 | 300251 | 光线传媒 | 4,137,156.36  | 0.24            |
| 11 | 600422 | 昆药集团 | 3,655,945.00  | 0.21            |
| 12 | 300098 | 高新兴  | 3,446,709.64  | 0.20            |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 3,205,150.44  | 0.19            |
| 14 | 002236 | 大华股份 | 3,027,425.00  | 0.18            |
| 15 | 601992 | 金隅股份 | 2,868,100.00  | 0.17            |
| 16 | 002051 | 中工国际 | 2,831,664.00  | 0.16            |
| 17 | 002415 | 海康威视 | 2,724,001.00  | 0.16            |
| 18 | 002146 | 荣盛发展 | 2,697,114.00  | 0.16            |
| 19 | 600511 | 国药股份 | 2,594,427.70  | 0.15            |
| 20 | 601555 | 东吴证券 | 2,280,901.60  | 0.13            |

注：本项“卖出金额”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。

### 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 | 189,186,219.10 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 192,069,941.47 |

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -             |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 80,214,000.00 | 4.64          |
|    | 其中：政策性金融债 | 80,214,000.00 | 4.64          |
| 4  | 企业债券      | -             | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -             |
| 6  | 中期票据      | -             | -             |
| 7  | 可转债       | -             | -             |
| 8  | 其他        | -             | -             |
| 9  | 合计        | 80,214,000.00 | 4.64          |

### 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  | 150211 | 15 国开 11 | 500,000 | 50,145,000.00 | 2.90          |
| 2  | 150215 | 15 国开 15 | 200,000 | 20,026,000.00 | 1.16          |
| 3  | 150206 | 15 国开 06 | 100,000 | 10,043,000.00 | 0.58          |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末投资股指期货。

#### 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

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：报告期内，本基金未参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 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   | 121,507.00   |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,982,680.06 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,609,741.10 |
| 5  | 应收申购款   | 9,940.36     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 5,723,868.52 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 |
| 214          | 7,856,652.49  | 1,681,263,410.48 | 100.00%    | 60,221.56 | 0.00%      |

### 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<br>持有本基金 | 6,263.93  | 0.00%    |

### 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的情况

| 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7月8日）基金份额总额               | 207,655,310.13   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                  | 2,306,191,524.82 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额                | 832,523,202.91   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                |

|             |                  |
|-------------|------------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 1,681,323,632.04 |
|-------------|------------------|

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

本报告期内本基金管理人兴业基金管理有限公司于 2015 年 1 月 31 日公布了《兴业基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，2015 年 1 月 28 日起霍建生不再担任兴业基金管理有限公司督察长职务，张银华担任兴业基金管理有限公司督察长职务。2015 年 12 月 26 日公布了《兴业基金管理有限公司关于聘任总经理助理的公告》，2015 年 12 月 25 日起，张顺国担任总经理助理。

基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

德勤华永会计师事务所自本基金合同生效日（2015 年 7 月 8 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期末，应付未付的审计费用为人民币伍万元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|              | 数量 | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |   |
|--------------|----|----------------|--------------|------------|------------|---|
| 方正证券股份有限公司   | 2  | 311,622,113.79 | 82.40%       | 134,012.98 | 68.38%     | - |
| 招商证券股份有限公司   | 2  | 66,540,261.60  | 17.60%       | 61,968.38  | 31.62%     | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 兴业证券股份有限公司   | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 中信证券股份有限公司   | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 华创证券有限责任公司   | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 海通证券股份有限公司   | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 华泰证券股份有限公司   | 2  | -              | -            | -          | -          | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2  | -              | -            | -          | -          | - |

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 财力雄厚，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)。
- vi 评估方法:由投资总监、研究总监根据以上因素评分。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增及剔除券商交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易           |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|--------------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|              | 成交金额           | 占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 |
| 方正证券股份有限公司   | 253,430,920.31 | 99.10%       | 864,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司   | 2,306,011.72   | 0.90%        | -              | -              | -    | -            |
| 中银国际证券有限责任公司 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券股份有限公司   | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华创证券有限责任公司   | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 海通证券股份有限公司   | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券股份有限公司   | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中国银河证券股份有限公司 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                          | 法定披露方式                                   | 法定披露日期    |
|----|-------------------------------|--|-----------|
| 1  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月8日 |
| 2  | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月9日 |
| 3  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、                        | 2015年7月9日 |



|    |  |  |            |
|----|--|--|------------|
|    | 的公告  | www.cib-fund.com.cn                      |            |
| 4  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月11日 |
| 5  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月13日 |
| 6  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月22日 |
| 7  | 关于兴业基金管理有限公司微信交易系统上线及参与费率优惠活动的公告                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月24日 |
| 8  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月25日 |
| 9  | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年7月31日 |
| 10 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年8月11日 |
| 11 | 兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中国国际金融股份有限公司为销售机构及旗下基金参加中金公司申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、<br>www.cib-fund.com.cn | 2015年8月21日 |
| 12 | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回业务公                                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、                        | 2015年9月25日 |

|    |   |                                      |             |
|----|---|--------------------------------------|-------------|
|    | 告   | www.cib-fund.com.cn                  |             |
| 13 | 兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年10月13日 |
| 14 | 兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年10月16日 |
| 15 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年10月17日 |
| 16 | 兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年10月23日 |
| 17 | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年10月27日 |
| 18 | 兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过直销机构申购、赎回数量限制的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年11月11日 |
| 19 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年11月16日 |
| 20 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015年11月16日 |
| 21 | 兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行股份                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、                    | 2015年11月23日 |

|    |   |                                      |                  |
|----|---|--------------------------------------|------------------|
|    | 有限公司费率优惠活动的公告   | www.cib-fund.com.cn                  |                  |
| 22 | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金提高赎回费计入基金财产比例的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 11 月 27 日 |
| 23 | 兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在代销渠道认（申）购金额下限的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 9 日  |
| 24 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动并开通定期定额投资及转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 12 日 |
| 25 | 兴业基金管理有限公司关于聘任总经理助理的公告                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 26 日 |
| 26 | 兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金提高赎回费计入基金财产比例的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 27 日 |
| 27 | 兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整开放时间的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 31 日 |
| 28 | 兴业基金 2015 年 12 月 31 日净值（收益）                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、www.cib-fund.com.cn | 2015 年 12 月 31 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予聚惠灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金合同》

- (三)《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

除上述第（六）项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处，投资人在办公时间内可供免费查阅。

## 12.3 查阅方式

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司  
2016年3月25日