

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

2016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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017年3月31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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2016年2月3日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
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
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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	过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
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	12
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	13
§5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	14
§7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	20
§8	投资组合报告	43
8.1	期末基金资产组合情况	43
8.2.1	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	43
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	44
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	57
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	57
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴业聚宝灵活配置混合
基金主代码	002330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	566,255,309.56
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过预测资本市场资金环境、宏观经济的发展趋势，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合，谋求超额收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%。
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱玮
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	renjb@cib-fund.com.cn
		陆志俊
		95559
		luzj@bankcomm.com

客户服务电话	40000-95561	95559
传真	021-22211997	021-62701216
注册地址	福建省福州市鼓楼区五四路 137号信和广场25楼	上海市浦东新区银城中路 188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	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	卓新章	牛锡明

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	2016年2月3日（基金合同生效日）-2016年12月31日
本期已实现收益	1,240,925.85
本期利润	-2,546,846.87

加权平均基金份额本期利润	-0.0204
本期加权平均净值利润率	-2.03%
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	311,713.13
期末可供分配基金份额利润	0.0006
期末基金资产净值	566,567,022.69
期末基金份额净值	1.001
3.1.3 累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	0.10%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

4、本基金基金合同于2016年2月3日生效，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	-0.79%	0.06%	-1.09%	0.27%	0.30%	-0.21%
过去六个月	-0.60%	0.05%	0.52%	0.26%	-1.12%	-0.21%
自基金合同生效日起至今	0.10%	0.05%	2.53%	0.33%	-2.43%	-0.28%

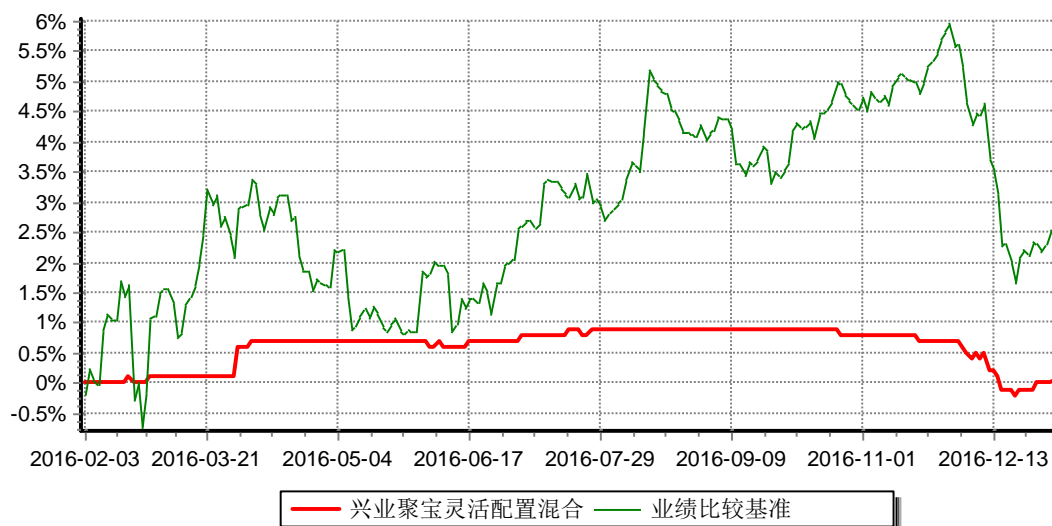
注：1.本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%。

2、本基金于2016年2月3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

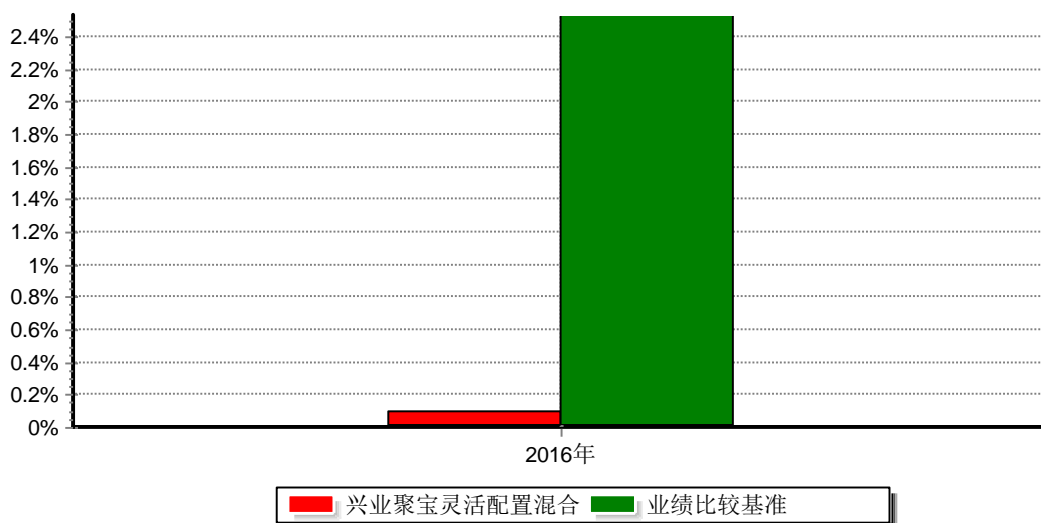
兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、本基金基金合同于2016年2月3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，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资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对比图



注：本基金基金合同于2016年2月3日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

2013年3月，兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立，公司注册资本7亿元人民币，注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2016年12月31日，兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金。

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	2016年2月3日	—	12	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。

	经理				<p>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任策略研究员；2010年8月至2014年12月就职于中欧基金管理有限公司，其中2010年8月至2012年1月担任宏观、策略研究员，2012年1月至2013年8月担任中欧新趋势股票型证券投资基金、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金的基金经理助理，2013年8月至2014年12月担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。2014年12月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。</p>
张雪	本基金的基金经理助理	2016年6月1日	2016年11月30日	7	<p>中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2009年7月至2012年4月在瑞银证券有限责任公司担任股票资本市场部副董事；2012年4月至2014年4</p>

					月，在万家基金管理有限公司担任固定收益部研究员。2014年4月加入兴业基金管理有限公司，2016年6月1日至2016年11月30日任基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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0.10%，同期业绩比较基准收益率为2.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济受到大宗商品价格上涨的影响有所企稳，未来驱动经济的主要动力可能来自于库存、制造业投资、和基建投资，货币政策整体保持中性，短期看不到宽松的迹象。股市经历了2016年年末的一轮调整，短期风险已经释放，可视为相对安全，但还需关注2017年二季度可能出现的经济放缓风险。总体来看，2017年股票市场环境相比2016年略好一些，尤其是下半年，货币政策的边际变化值得期待。配置上仍会关注那些有业绩和安全边际支撑的个股，如果下半年政策有改善的迹象，则可以更多的关注成长股。部分成长股经过持续调整，估值渐渐回归正常水平，投资价值正在逐渐显现，随着这一类股票的占比越来越高，相信股市的吸引力将超过债券市场。

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，2016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、进一步完善公司内控制度及业务流程：报告期内公司进一步对内部制度进行梳理和完善，对公司业务运作和经营管理进行全方位的规范，逐步完善内部控制标准与要求。

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监测：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求,组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、加强员工合规管理：报告期内公司通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规遵从意识；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

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

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

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。

4.9 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

2016年，基金托管人在兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016年，兴业基金管理有限公司在兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2016年，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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(17)第P01221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	兴业聚宝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宝灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"兴业聚宝灵活配置混合")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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宝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	<p>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,兴业聚宝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，公允反映了兴业聚宝灵活配置混合2016年12月31日的财务状况以及2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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	曾浩、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	上海市延安东路222号外滩中心30楼
审计报告日期	2017-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	21,646,233.66
结算备付金		1,701,544.97
存出保证金		1,807.44
交易性金融资产	7.4.7.2	341,361,931.46
其中：股票投资		102,232,931.46
基金投资		—
债券投资		239,129,000.00
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	210,000,665.00
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	2,886,223.21

应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		577,598,405.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负 债:		
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		10,000,000.00
应付赎回款		991.08
应付管理人报酬		298,202.29
应付托管费		106,500.83
应付销售服务费		213,001.65
应付交易费用	7.4.7.7	62,687.20
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	350,000.00
负债合计		11,031,383.05
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	566,255,309.56
未分配利润	7.4.7.10	311,713.13
所有者权益合计		566,567,022.69
负债和所有者权益总计		577,598,405.74

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.001元，基金份额总额566,255,309.56份。

2、本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，无上

年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		-518,428.17
1.利息收入		2,868,652.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	380,054.16
债券利息收入		949,356.13
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		1,539,242.37
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		116,665.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-13,002.27
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	127,753.33
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	1,914.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,787,772.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	284,026.83
减：二、费用		2,028,418.70
1. 管理人报酬		769,122.61
2. 托管费		274,686.56
3. 销售服务费		549,373.27
4. 交易费用	7.4.7.18	75,026.26
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.19	360,210.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,546,846.87
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,546,846.87

注：本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，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：兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	201,709,827.61	—	201,709,827.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-2,546,846.87	-2,546,846.87
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)	364,545,481.95	2,858,560.00	367,404,041.95

其中：1.基金申购款	567,877,153.17	3,384,861.66	571,262,014.83
2.基金赎回款	-203,331,671.22	-526,301.66	-203,857,972.88
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）	566,255,309.56	311,713.13	566,567,022.69

注：本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，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：

卓新章

黄文锋

夏鹏

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

兴业聚宝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》、《兴业聚宝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] 1686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201,709,827.61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0077号的验资报告。基金合同于2016年2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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、银行存款、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、债券回购等)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规

定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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：中债综合全价指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

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2016年12月31日的财务状况以及2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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或基金管理人估值委员会认为必要时，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，基金管理人估值委员会认为必要时，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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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0.70%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0.25%的年费率逐日计提。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.5%的年费率计提。

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》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) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
- 3) 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。

4) 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。

5) 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。

6) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 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 2016年12月31日
活期存款	21,646,233.66
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	21,646,233.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	105,912,394.59	102,232,931.46	-3,679,463.13
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	239,237,309.59	239,129,000.00

	合计	239,237,309.59	239,129,000.00	-108,309.59
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	345,149,704.18	341,361,931.46	-3,787,772.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	60,000,000.00	—
银行间市场	150,000,665.00	—
合计	210,000,665.00	—

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 2016年12月31日
应收活期存款利息	7,202.36
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	842.27
应收债券利息	2,323,293.53
应收买入返售证券利息	552,523.06
应收申购款利息	2,361.11

应收黄金合约拆借孳息	—
其他	0.88
合计	2,886,223.21

7.4.7.6 其他资产

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 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	59,452.20
银行间市场应付交易费用	3,235.00
合计	62,687.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	350,000.00
合计	350,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	201,709,827.61	201,709,827.61
本期申购	567,877,153.17	567,877,153.17
本期赎回（以“-”号填列）	-203,331,671.22	-203,331,671.22

本期末	566,255,309.56	566,255,309.56
-----	----------------	----------------

注：1、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。

2、本基金合同于2016年2月3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201,699,997.88元，折合201,699,997.88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9,829.73元，折合9,829.73份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币201,709,827.61元，折合201,709,827.61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	1,240,925.85	-3,787,772.72	-2,546,846.87
本期基金份额交易产生的变动数	3,606,701.03	-748,141.03	2,858,560.00
其中：基金申购款	4,106,239.21	-721,377.55	3,384,861.66
基金赎回款	-499,538.18	-26,763.48	-526,301.66
本期已分配利润	—	—	—
本期末	4,847,626.88	-4,535,913.75	311,713.13

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	104,549.63
定期存款利息收入	227,700.00
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	20,900.94
其他	26,903.59
合计	380,054.16

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
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	2,986,712.73
减：卖出股票成本总额	2,999,715.00
买卖股票差价收入	-13,002.27

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
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31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	127,753.33
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	127,753.33

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
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,993,961.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,367,020.60
减：应收利息总额	499,187.37
买卖债券差价收入	127,753.33

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,914.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,914.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-3,787,772.72
——股票投资	-3,679,463.13
——债券投资	-108,309.59
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-3,787,772.72

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

基金赎回费收入	284,026.83
合计	284,026.83

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	72,376.26
银行间市场交易费用	2,650.00
合计	75,026.26

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	300,000.00
开户费	400.00
帐户维护费	7,500.00
汇划手续费	2,310.00
合计	360,210.00

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
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	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

基金")	
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	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")	基金管理人的子公司
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
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未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

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 2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	769,122.61
其中：支付销售机构的客户维护费	4,905.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	274,686.56

注：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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
	当期应支付的销售服务费
兴业基金管理有限公司	542,100.99
合计	542,100.99

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.5%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期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

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

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 2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	21,646,233.66	104,549.63

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016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

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的证券。

7.4.12.2 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
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项停牌	16.63		—	7,100	110,192.00	118,073.00	
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60		—	5,800	100,746.00	84,680.00	
600649	城投控股	2016-12-06	重大事项停牌	20.34		—	6,300	116,928.00	128,142.00	
6008	东方	2016-12-	重大事	10.79		—	5,500	56,540.00	59,345.00	

75	电气	09	项停牌							
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事件停牌	6.25	2017-01-26	6.29	26,800	187,332.00	167,500.00	
000750	国海证券	2016-12-15	重大事件停牌	6.97	2017-01-20	6.27	9,500	73,910.00	66,215.00	
002727	一心堂	2016-12-28	重大事件停牌	21.20	2017-01-05	21.66	91,600	2,000,544.00	1,941,920.00	
300104	乐视网	2016-12-07	重大事件停牌	35.80	2017-01-16	36.88	5,600	214,451.00	200,480.00	

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13 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、风险管理总部、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、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率，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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。

本基金报告期末按信用评级列示的债券投资不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日
A-1	59,904,000.00
A-1以下	—
未评级	139,223,000.00
合计	199,127,000.00

7.4.13.2 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 2016年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	10,018,000.00
合计	10,018,000.00

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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。

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

金额单位：人民币元

本期末2016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	21,646,233.66	—	—	—	21,646,233.66
结算备付金	1,701,544.97	—	—	—	1,701,544.97
存出保证金	1,807.44	—	—	—	1,807.44
交易性金融资产	239,129,000.00	—	—	102,232,931.46	341,361,931.46
买入返售金融资产	210,000,665.00	—	—	—	210,000,665.00
应收利息	—	—	—	2,886,223.21	2,886,223.21
资产总计	472,479,251.07	—	—	105,119,154.67	577,598,405.74
负债					
应付证券清算款	—	—	—	10,000,000.00	10,000,000.00
应付赎回款	—	—	—	991.08	991.08
应付管理人报酬	—	—	—	298,202.29	298,202.29
应付托管费	—	—	—	106,500.83	106,500.83
应付销售服务费	—	—	—	213,001.65	213,001.65
应付交易费用	—	—	—	62,687.20	62,687.20
其他负债	—	—	—	350,000.00	350,000.00
负债总计	—	—	—	11,031,383.05	11,031,383.05
利率敏感度缺口	472,479,251.07	—	—	94,087,771.62	566,567,022.69

注：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。

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	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影响金额(单位:人民币元)
		本期末2016年12月31日
	市场利率上升25个基点	-189,769.85
	市场利率下降25个基点	190,452.03

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具公允价值或未来现金流量因外汇变动而发生波动的风险。本基金无涉及外汇风险的资产及负债。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2016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	102,232,931.46	18.04
交易性金融资产-基金投资	—	—
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		102,232,931.46	18.04
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(2016年12月31日)	
	股票价格上升5%	5,111,646.57	
	股票价格下降5%	-5,111,646.57	

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买入应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016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99,466,576.46 元，属于第二层次的余额为人民币241,895,355.00 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	102,232,931.46	17.70
	其中：股票	102,232,931.46	17.70
2	固定收益投资	239,129,000.00	41.40
	其中：债券	239,129,000.00	41.40
	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	210,000,665.00	36.36
	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	23,347,778.63	4.04
7	其他各项资产	2,888,030.65	0.50
8	合计	577,598,405.74	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	52,200.00	0.01
B	采矿业	2,436,977.00	0.43
C	制造业	45,868,315.23	8.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,637,008.00	0.47
E	建筑业	2,504,329.00	0.44
F	批发和零售业	6,794,050.00	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,128,910.00	0.38
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,886,911.00	0.69
J	金融业	24,496,248.30	4.32
K	房地产业	7,163,819.73	1.26
L	租赁和商务服务业	727,134.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	2,138,886.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	101,660.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	953,483.20	0.17
S	综合	343,000.00	0.06
	合计	102,232,931.46	18.04

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	002415	海康威视	345,500	8,226,355.00	1.45
2	000732	泰禾集团	221,917	3,925,711.73	0.69

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

3	000963	华东医药	48,400	3,488,188.00	0.62
4	600036	招商银行	175,900	3,095,840.00	0.55
5	000651	格力电器	125,700	3,094,734.00	0.55
6	002701	奥瑞金	357,400	3,087,936.00	0.55
7	601318	中国平安	83,700	2,965,491.00	0.52
8	600079	人福医药	128,363	2,560,841.85	0.45
9	300115	长盈精密	96,000	2,501,760.00	0.44
10	002727	一心堂	91,600	1,941,920.00	0.34
11	300070	碧水源	104,200	1,825,584.00	0.32
12	601988	中国银行	521,000	1,792,240.00	0.32
13	002236	大华股份	128,206	1,753,858.08	0.31
14	600016	民生银行	187,200	1,699,776.00	0.30
15	002475	立讯精密	80,700	1,674,525.00	0.30
16	300207	欣旺达	118,987	1,653,919.30	0.29
17	600519	贵州茅台	4,000	1,336,600.00	0.24
18	000002	万科A	61,500	1,263,825.00	0.22
19	002304	洋河股份	16,400	1,157,840.00	0.20
20	600000	浦发银行	65,930	1,068,725.30	0.19
21	600837	海通证券	64,000	1,008,000.00	0.18
22	600030	中信证券	60,900	978,054.00	0.17
23	601288	农业银行	302,900	938,990.00	0.17
24	601169	北京银行	89,500	873,520.00	0.15
25	601398	工商银行	191,900	846,279.00	0.15
26	600887	伊利股份	48,000	844,800.00	0.15
27	601688	华泰证券	43,500	776,910.00	0.14
28	601668	中国建筑	84,500	748,670.00	0.13
29	600900	长江电力	54,000	683,640.00	0.12
30	601601	中国太保	24,400	677,588.00	0.12
31	000333	美的集团	23,900	673,263.00	0.12
32	601766	中国中车	65,000	635,050.00	0.11

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

33	600104	上汽集团	26,200	614,390.00	0.11
34	000858	五 粮 液	15,400	530,992.00	0.09
35	600276	恒瑞医药	11,500	523,250.00	0.09
36	601989	中国重工	69,000	489,210.00	0.09
37	600048	保利地产	52,900	482,977.00	0.09
38	000001	平安银行	52,500	477,750.00	0.08
39	000725	京东方 A	166,700	476,762.00	0.08
40	601818	光大银行	120,200	469,982.00	0.08
41	600028	中国石化	82,700	447,407.00	0.08
42	600050	中国联通	58,200	425,442.00	0.08
43	600518	康美药业	23,700	423,045.00	0.07
44	600015	华夏银行	37,700	409,045.00	0.07
45	600835	上海机电	20,400	398,208.00	0.07
46	002450	康得新	19,500	372,645.00	0.07
47	600999	招商证券	22,000	359,260.00	0.06
48	000776	广发证券	21,200	357,432.00	0.06
49	601390	中国中铁	39,500	349,970.00	0.06
50	002024	苏宁云商	29,700	340,065.00	0.06
51	600958	东方证券	20,900	324,577.00	0.06
52	601006	大秦铁路	45,400	321,432.00	0.06
53	601939	建设银行	59,000	320,960.00	0.06
54	002736	国信证券	19,400	301,670.00	0.05
55	601857	中国石油	37,400	297,330.00	0.05
56	601009	南京银行	26,700	289,428.00	0.05
57	600795	国电电力	89,400	283,398.00	0.05
58	601628	中国人寿	11,400	274,626.00	0.05
59	000063	中兴通讯	17,200	274,340.00	0.05
60	300059	东方财富	16,200	274,266.00	0.05
61	001979	招商蛇口	16,700	273,713.00	0.05
62	000625	长安汽车	17,700	264,438.00	0.05

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

63	601377	兴业证券	34,500	263,925.00	0.05
64	601336	新华保险	6,000	262,680.00	0.05
65	601186	中国铁建	21,700	259,532.00	0.05
66	600585	海螺水泥	15,200	257,792.00	0.05
67	601985	中国核电	35,900	253,454.00	0.04
68	601088	中国神华	15,400	249,172.00	0.04
69	601099	太平洋	47,700	245,655.00	0.04
70	000783	长江证券	24,000	245,520.00	0.04
71	600637	东方明珠	10,500	244,650.00	0.04
72	002142	宁波银行	14,500	241,280.00	0.04
73	600547	山东黄金	6,500	237,315.00	0.04
74	002673	西部证券	11,200	232,624.00	0.04
75	600690	青岛海尔	23,400	231,192.00	0.04
76	600011	华能国际	32,500	229,125.00	0.04
77	600535	天士力	5,500	228,195.00	0.04
78	600019	宝钢股份	35,700	226,695.00	0.04
79	000423	东阿阿胶	4,200	226,254.00	0.04
80	601899	紫金矿业	67,400	225,116.00	0.04
81	601555	东吴证券	16,900	224,263.00	0.04
82	002594	比亚迪	4,500	223,560.00	0.04
83	600066	宇通客车	11,400	223,326.00	0.04
84	000839	中信国安	24,000	220,320.00	0.04
85	002456	欧菲光	6,400	219,392.00	0.04
86	300017	网宿科技	4,000	214,440.00	0.04
87	601901	方正证券	28,200	214,320.00	0.04
88	601211	国泰君安	11,500	213,785.00	0.04
89	600705	中航资本	34,900	213,588.00	0.04
90	600115	东方航空	30,200	213,514.00	0.04
91	600196	复星医药	9,200	212,888.00	0.04
92	002241	歌尔股份	8,000	212,160.00	0.04

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

93	002739	万达院线	3,900	210,873.00	0.04
94	000503	海虹控股	5,000	210,250.00	0.04
95	600893	中航动力	6,400	209,536.00	0.04
96	600009	上海机场	7,900	209,508.00	0.04
97	601669	中国电建	28,700	208,362.00	0.04
98	600703	三安光电	15,500	207,545.00	0.04
99	600383	金地集团	16,000	207,360.00	0.04
100	600660	福耀玻璃	11,000	204,930.00	0.04
101	600010	包钢股份	73,400	204,786.00	0.04
102	600111	北方稀土	16,400	201,228.00	0.04
103	300104	乐视网	5,600	200,480.00	0.04
104	002230	科大讯飞	7,400	200,466.00	0.04
105	600804	鹏博士	8,900	195,177.00	0.03
106	000568	泸州老窖	5,900	194,700.00	0.03
107	300024	机器人	9,000	192,420.00	0.03
108	600309	万华化学	8,900	191,617.00	0.03
109	600029	南方航空	27,200	190,944.00	0.03
110	002252	上海莱士	8,200	189,338.00	0.03
111	000768	中航飞机	8,900	189,214.00	0.03
112	600570	恒生电子	4,000	188,560.00	0.03
113	000793	华闻传媒	16,700	188,543.00	0.03
114	600109	国金证券	14,400	187,632.00	0.03
115	002202	金风科技	10,900	186,499.00	0.03
116	000338	潍柴动力	18,700	186,252.00	0.03
117	000009	中国宝安	17,700	183,372.00	0.03
118	600100	同方股份	13,200	182,820.00	0.03
119	000413	东旭光电	16,000	180,160.00	0.03
120	600340	华夏幸福	7,500	179,250.00	0.03
121	000728	国元证券	9,000	179,100.00	0.03
122	601198	东兴证券	8,900	178,534.00	0.03

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

123	600068	葛洲坝	19,400	178,286.00	0.03
124	600886	国投电力	26,700	178,089.00	0.03
125	601607	上海医药	9,000	176,040.00	0.03
126	600867	通化东宝	8,000	175,440.00	0.03
127	600415	小商品城	20,200	174,730.00	0.03
128	601888	中国国旅	4,000	173,600.00	0.03
129	600271	航天信息	8,700	173,565.00	0.03
130	600089	特变电工	19,000	173,470.00	0.03
131	000895	双汇发展	8,200	171,626.00	0.03
132	600023	浙能电力	31,000	168,330.00	0.03
133	000069	华侨城 A	24,200	168,190.00	0.03
134	000166	申万宏源	26,800	167,500.00	0.03
135	600177	雅戈尔	11,900	166,362.00	0.03
136	600031	三一重工	27,200	165,920.00	0.03
137	600352	浙江龙盛	18,000	165,780.00	0.03
138	600816	安信信托	7,000	165,340.00	0.03
139	600489	中金黄金	13,500	163,215.00	0.03
140	600221	海南航空	49,900	162,674.00	0.03
141	600739	辽宁成大	8,900	159,844.00	0.03
142	600741	华域汽车	10,000	159,500.00	0.03
143	002008	大族激光	7,000	158,200.00	0.03
144	601800	中国交建	10,200	154,938.00	0.03
145	601600	中国铝业	36,400	153,608.00	0.03
146	600369	西南证券	21,500	153,295.00	0.03
147	601018	宁波港	30,200	152,812.00	0.03
148	300124	汇川技术	7,500	152,475.00	0.03
149	600718	东软集团	7,700	151,382.00	0.03
150	000157	中联重科	33,000	149,820.00	0.03
151	600674	川投能源	17,000	147,900.00	0.03
152	601788	光大证券	9,200	147,108.00	0.03

153	600118	中国卫星	4,700	146,828.00	0.03
154	601933	永辉超市	29,900	146,809.00	0.03
155	601618	中国中冶	31,400	146,324.00	0.03
156	002465	海格通信	12,500	145,625.00	0.03
157	000826	启迪桑德	4,400	145,112.00	0.03
158	600150	中国船舶	5,200	143,572.00	0.03
159	600153	建发股份	13,400	143,380.00	0.03
160	601919	中远海控	27,200	142,528.00	0.03
161	601111	中国国航	19,700	141,840.00	0.03
162	601998	中信银行	22,000	141,020.00	0.02
163	002007	华兰生物	3,900	139,425.00	0.02
164	601333	广深铁路	27,500	139,425.00	0.02
165	002065	东华软件	5,900	137,470.00	0.02
166	600820	隧道股份	12,400	136,524.00	0.02
167	000686	东北证券	11,000	135,960.00	0.02
168	600061	国投安信	8,700	135,807.00	0.02
169	000917	电广传媒	9,400	135,266.00	0.02
170	000630	铜陵有色	43,700	134,596.00	0.02
171	300315	掌趣科技	14,500	133,980.00	0.02
172	600018	上港集团	26,000	133,120.00	0.02
173	000876	新希望	16,500	132,825.00	0.02
174	600085	同仁堂	4,200	131,796.00	0.02
175	000623	吉林敖东	4,200	130,158.00	0.02
176	600649	城投控股	6,300	128,142.00	0.02
177	002081	金螳螂	13,000	127,270.00	0.02
178	000559	万向钱潮	9,500	125,970.00	0.02
179	300003	乐普医疗	7,000	125,510.00	0.02
180	600398	海澜之家	11,500	124,085.00	0.02
181	600583	海油工程	16,700	123,246.00	0.02
182	600839	四川长虹	29,400	122,892.00	0.02

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

183	002385	大北农	16,900	119,990.00	0.02
184	601718	际华集团	13,000	119,730.00	0.02
185	002183	怡亚通	11,000	119,460.00	0.02
186	600406	国电南瑞	7,100	118,073.00	0.02
187	000046	泛海控股	12,700	117,983.00	0.02
188	600332	白云山	4,900	117,502.00	0.02
189	000402	金融街	11,200	115,360.00	0.02
190	600256	广汇能源	24,400	113,948.00	0.02
191	002422	科伦药业	7,000	112,840.00	0.02
192	600588	用友网络	5,400	112,428.00	0.02
193	600208	新湖中宝	26,900	111,904.00	0.02
194	300058	蓝色光标	11,000	111,870.00	0.02
195	000060	中金岭南	10,000	111,500.00	0.02
196	300168	万达信息	5,500	111,210.00	0.02
197	000709	河钢股份	33,200	110,888.00	0.02
198	600157	永泰能源	27,400	109,874.00	0.02
199	600895	张江高科	6,200	109,864.00	0.02
200	300144	宋城演艺	5,200	108,888.00	0.02
201	600074	保千里	8,200	108,568.00	0.02
202	600688	上海石化	16,700	107,548.00	0.02
203	002500	山西证券	8,900	106,978.00	0.02
204	601106	中国一重	19,700	106,577.00	0.02
205	000977	浪潮信息	5,000	106,000.00	0.02
206	600446	金证股份	4,200	105,546.00	0.02
207	600642	申能股份	17,900	105,073.00	0.02
208	000792	盐湖股份	5,500	104,885.00	0.02
209	601633	长城汽车	9,400	103,964.00	0.02
210	600060	海信电器	6,000	102,720.00	0.02
211	300015	爱尔眼科	3,400	101,660.00	0.02
212	603993	洛阳钼业	27,200	101,184.00	0.02

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

213	002292	奥飞娱乐	4,400	99,880.00	0.02
214	601258	庞大集团	35,900	99,443.00	0.02
215	601216	君正集团	21,000	97,650.00	0.02
216	601117	中国化学	14,400	97,488.00	0.02
217	600170	上海建工	20,500	96,965.00	0.02
218	000738	中航动控	3,900	96,486.00	0.02
219	600252	中恒集团	20,900	95,722.00	0.02
220	002470	金正大	12,000	94,800.00	0.02
221	600737	中粮屯河	7,500	93,450.00	0.02
222	601866	中远海发	22,700	92,616.00	0.02
223	300002	神州泰岳	10,000	92,400.00	0.02
224	600038	中直股份	1,900	91,998.00	0.02
225	600704	物产中大	8,900	91,937.00	0.02
226	601991	大唐发电	24,000	91,680.00	0.02
227	002152	广电运通	6,900	91,632.00	0.02
228	601098	中南传媒	5,500	91,630.00	0.02
229	600027	华电国际	18,500	91,575.00	0.02
230	600373	中文传媒	4,461	90,112.20	0.02
231	600827	百联股份	6,200	89,032.00	0.02
232	600873	梅花生物	13,500	88,020.00	0.02
233	000778	新兴铸管	17,000	87,890.00	0.02
234	600376	首开股份	7,200	85,032.00	0.02
235	600485	信威集团	5,800	84,680.00	0.01
236	600037	歌华有线	5,500	84,260.00	0.01
237	000999	华润三九	3,400	84,082.00	0.01
238	601898	中煤能源	14,400	83,664.00	0.01
239	601992	金隅股份	18,700	83,402.00	0.01
240	603000	人民网	4,700	83,002.00	0.01
241	601872	招商轮船	16,700	82,498.00	0.01
242	601225	陕西煤业	16,900	81,965.00	0.01

243	601179	中国西电	14,500	80,910.00	0.01
244	000061	农产品	6,500	80,405.00	0.01
245	002146	荣盛发展	10,200	80,070.00	0.01
246	000729	燕京啤酒	11,500	79,925.00	0.01
247	002294	信立泰	2,700	78,948.00	0.01
248	600372	中航电子	4,200	77,952.00	0.01
249	600008	首创股份	18,500	76,035.00	0.01
250	000039	中集集团	5,200	76,024.00	0.01
251	600362	江西铜业	4,500	75,285.00	0.01
252	600600	青岛啤酒	2,400	70,656.00	0.01
253	300251	光线传媒	7,200	70,272.00	0.01
254	002195	二三四五	6,200	70,184.00	0.01
255	600959	江苏有线	6,200	70,060.00	0.01
256	601021	春秋航空	1,900	69,806.00	0.01
257	600098	广州发展	6,200	69,564.00	0.01
258	600863	内蒙华电	22,200	68,376.00	0.01
259	601928	凤凰传媒	6,500	68,055.00	0.01
260	000712	锦龙股份	2,900	67,976.00	0.01
261	000800	一汽轿车	6,200	67,394.00	0.01
262	002027	分众传媒	4,700	67,069.00	0.01
263	000825	太钢不锈	16,900	66,586.00	0.01
264	000883	湖北能源	14,500	66,410.00	0.01
265	002424	贵州百灵	3,500	66,290.00	0.01
266	000750	国海证券	9,500	66,215.00	0.01
267	002153	石基信息	2,700	65,799.00	0.01
268	300146	汤臣倍健	5,500	65,670.00	0.01
269	600685	中船防务	2,200	65,340.00	0.01
270	000027	深圳能源	9,200	63,204.00	0.01
271	000898	鞍钢股份	12,500	63,000.00	0.01
272	000156	华数传媒	3,500	62,685.00	0.01

273	300133	华策影视	5,500	62,425.00	0.01
274	600582	天地科技	12,400	61,628.00	0.01
275	600998	九州通	2,900	60,146.00	0.01
276	600875	东方电气	5,500	59,345.00	0.01
277	601608	中信重工	10,400	58,344.00	0.01
278	002399	海普瑞	3,200	58,304.00	0.01
279	600871	石化油服	14,200	58,220.00	0.01
280	601958	金钼股份	7,500	57,375.00	0.01
281	600648	外高桥	2,900	57,246.00	0.01
282	601808	中海油服	4,400	56,452.00	0.01
283	601118	海南橡胶	7,500	52,200.00	0.01
284	600666	奥瑞德	1,900	51,205.00	0.01
285	600783	鲁信创投	2,200	49,764.00	0.01
286	600317	营口港	13,900	48,233.00	0.01
287	600578	京能电力	11,400	47,880.00	0.01
288	300085	银之杰	2,000	41,800.00	0.01
289	600022	山东钢铁	13,900	34,750.00	0.01
290	002568	百润股份	1,700	34,408.00	0.01
291	600188	兖州煤业	2,900	31,494.00	0.01
292	603885	吉祥航空	1,200	27,960.00	—
293	600606	绿地控股	3,000	26,130.00	—
294	601016	节能风电	1,500	13,275.00	—

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	002415	海康威视	8,526,644.93	1.50
2	600036	招商银行	6,197,229.03	1.09
3	000732	泰禾集团	4,215,297.48	0.74

4	000963	华东医药	3,463,351.15	0.61
5	002701	奥瑞金	3,293,025.88	0.58
6	000651	格力电器	3,256,586.00	0.57
7	601318	中国平安	3,010,989.00	0.53
8	300115	长盈精密	2,495,933.00	0.44
9	600079	人福医药	2,494,463.75	0.44
10	002727	一心堂	2,000,544.00	0.35
11	300070	碧水源	1,871,276.00	0.33
12	601988	中国银行	1,815,284.00	0.32
13	002236	大华股份	1,783,449.80	0.31
14	600016	民生银行	1,741,326.00	0.31
15	002475	立讯精密	1,656,005.00	0.29
16	300207	欣旺达	1,638,171.04	0.29
17	000002	万 科 A	1,522,673.00	0.27
18	600519	贵州茅台	1,284,384.00	0.23
19	002304	洋河股份	1,169,425.00	0.21
20	600000	浦发银行	1,103,637.40	0.19

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	600036	招商银行	2,986,712.73	0.53

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	108,912,109.59
卖出股票的收入（成交）总额	2,986,712.73

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	29,984,000.00	5.29
	其中：政策性金融债	29,984,000.00	5.29
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	159,520,000.00	28.16
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	49,625,000.00	8.76
9	其他	—	—
10	合计	239,129,000.00	42.21

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	111612166	16北京银行 CD166	500,000	49,625,000.00	8.76
2	041655011	16瘦西湖 CP001	200,000	20,024,000.00	3.53
3	041659014	16芜湖经开 CP001	200,000	20,024,000.00	3.53
4	160211	16国开11	200,000	19,966,000.00	3.52
5	011698203	16扬州交通 SCP001	200,000	19,950,000.00	3.52

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,807.44
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,886,223.21
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,888,030.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有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

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	002727	一心堂	1,941,920.00	0.34	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
199	2,845,504.07	565,232,825.33	99.82%	1,022,484.23	0.18%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	78,289.45	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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(2016年2月3日)基金份额总额	201,709,827.61
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	567,877,153.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	203,331,671.22
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	566,255,309.56

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

2016年12月，张顺国先生担任兴业基金管理有限公司副总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。本报告期托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为5万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	0		—	—	—	
东兴证券	2	—	—	—	—	
方正证券	0		—	—	—	
广发证券	0		—	—	—	
海通证券	0		—	—	—	
华创证券	0		—	—	—	
华泰证券	0		—	—	—	
民族证券	0		—	—	—	
齐鲁证券	0		—	—	—	
兴业证券	2	111,898,822.32	100.00%	59,452.20	100.00%	
银河证券	0		—	—	—	
招商证券	2	—	—	—	—	
中信证券	0		—	—	—	
中银国际证券	0		—	—	—	

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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东方证券		—		—		—
东兴证券	—	—	29,000,000.00	0.73%	—	—
方正证券		—		—		—
广发证券		—		—		—
海通证券		—		—		—
华创证券		—		—		—
华泰证券		—		—		—
民族证券		—		—		—
齐鲁证券		—		—		—
兴业证券	11,489,503.20	100.00%	3,951,000.00	99.27%	—	—
银河证券		—		—		—
招商证券	—	—	—	—	—	—

中信证券		—		—		—
中银国际证 券		—		—		—

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2016年1月4日指数熔断后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	2016-01-04
2	兴业基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后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	2016-01-07
3	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-09
4	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-09
5	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-09
6	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-09
7	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-09
8	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
9	兴业基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-02-04

10	兴业聚宝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、 www.cib-fund.com.cn	2016-02-04
11	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-03-26
12	兴业基金管理有限公司关于兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告的更正公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-03-30
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并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	2016-04-01
14	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	2016-04-22
15	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	2016-05-10
16	兴业基金管理有限公司关于设立郑州分公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-05-19
17	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	2016-05-28
18	兴业基金2016年06月30日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-06-30
19	兴业基金管理有限公司关于参加代销机构开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-06-30
20	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-07-19

21	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告	www.cib-fund.com.cn	2016-08-24
22	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2016-08-24
23	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2016年第1号)	www.cib-fund.com.cn	2016-09-14
24	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2016年第1号)摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-14
25	兴业基金管理有限公司关于旗下基金代销机构名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-24
26	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金2016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	2016-10-26
27	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	2016-11-08
28	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	2016-11-22
29	兴业基金管理有限公司关于设立石家庄分公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-23
30	兴业基金管理有限公司高级管理人员任职变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-08
31	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	2016-12-08
32	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	中国证券报、上海证券报、 证券时报、	2016-12-23

	机构费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	www.cib-fund.com.cn	
33	关于近日不法分子冒用“兴业基金”微信二维码标识的澄清公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-28
34	兴业基金2016年12月30日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-30
35	兴业基金2016年12月31日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业聚宝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
二〇一七年三月三十一日