

## 兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 第二季度 报告

2019年6月30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  
报告送出日期:2019年7月19日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员在编制报告时,保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
本基金的基金经理在编制报告时,保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本公司承诺以诚实信用、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当仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同自2014年4月17日起至2016年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 兴业国企改革混合

基金代码 000231

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2015年7月19日

报告期末基金总资产 20,043,567,909.00

投资目标 本基金主要投资于成长阶段的国有企业上市企业,精选具有竞争优势的新兴产业、并购重组、产业升级等领域的优质企业,并结合宏观经济形势和政策导向,把握行业景气度变化,通过主动管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金采用“自下而上”的投资分析法,重点对行业基本面进行深入分析以及对公司基本面的研究和评估,并根据

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证国企改革指数收益率×55%+国债指数收益率×45%。

风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券基金,低于股票型基金,属于中等风险收益的产品。

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 4,039,719.57

2.本期利润 3,007,082.62

3.加权平均基金份额利润 0.0114

4.期末基金份额净值 330,691,859.29

5.期末基金资产净值 1,267

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,本期期间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.基金的净值表现

3.1 本报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 4,039,719.57

2.本期利润 3,007,082.62

3.加权平均基金份额利润 0.0114

4.期末基金份额净值 330,691,859.29

5.期末基金资产净值 1,267

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,本期期间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.基金的净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 4,039,719.57

2.本期利润 3,007,082.62

3.加权平均基金份额利润 0.0114

4.期末基金份额净值 330,691,859.29

5.期末基金资产净值 1,267

注:1.本期的基金业绩指标,其“任职日期”为基金合同生效日,“就职日期”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“就职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2.证券从业的含义为《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对行业内的基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,力求基金份额持有人最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.2 基金经理的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.3 相关人员的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.4 不同组合之间证券交易的公平性情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.5 投资决策制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.6 其他相关人员的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.4 报告期内公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日公平交易偏离度绝对值大于0.5%的情形。

5 投资组合持有人数

本基金不存在连续二十个工作日持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 210,797,960.86

2.本期利润 210,797,960.86

3.加权平均基金份额利润 0.0114

4.期末基金份额净值 330,691,859.29

5.期末基金资产净值 1,267

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,本期期间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.基金的净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益的比较

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 210,797,960.86

2.本期利润 210,797,960.86

3.加权平均基金份额利润 0.0114

4.期末基金份额净值 330,691,859.29

5.期末基金资产净值 1,267

注:1.本期的基金业绩指标,其“任职日期”为基金合同生效日,“就职日期”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“就职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2.证券从业的含义为《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对行业内的基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,力求基金份额持有人最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.2 基金经理的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.3 相关人员的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.4 不同组合之间证券交易的公平性情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.5 投资决策制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.4 报告期内公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日公平交易偏离度绝对值大于0.5%的情形。

5 投资组合持有人数

本基金不存在连续二十个工作日持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 1,024,257

2.本期利润 601,001.34

3.加权平均基金份额利润 0.0166

4.期末基金份额净值 1,213,437.21

5.期末基金资产净值 1,213,437.21

注:1.本期的基金业绩指标,其“任职日期”为基金合同生效日,“就职日期”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“就职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2.证券从业的含义为《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对行业内的基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,力求基金份额持有人最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.2 基金经理的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.3 相关人员的公平交易情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同基金经理管理的不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.4 不同组合之间证券交易的公平性情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.3.5 投资决策制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金法》公平交易制度,通过系统和人工等方式对不同组合间的交易行为进行监控和分析。

4.4 报告期内公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日公平交易偏离度绝对值大于0.5%的情形。

5 投资组合持有人数

本基金不存在连续二十个工作日持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日)

1.本期已实现收益 1,024,257