

**兴业聚惠混合型证券投资基金**  
**(原兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型)**

**2022 年年度报告**

2022 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:2023 年 03 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。基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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。

原兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金报告期自2022年1月1日至3月15日，兴业聚惠混合型证券投资基金报告期自2022年3月16日起至2022年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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）	13
3.1 主要会计数据和财务指标	13
3.2 基金净值表现	14
3.3 过去三年基金的利润分配情况	19
§4 管理人报告	19
4.1 基金管理人及基金经理情况	19
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	21
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
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	24
§5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	24
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	24
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	24
§6 审计报告(转型后)	24
6.1 审计报告基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	25
§6 审计报告(转型前)	27
6.1 审计报告基本信息	27
6.2 审计报告的基本内容	28
§7 年度财务报表(转型后)	30
7.1 资产负债表	30
7.2 利润表	32
7.3 净资产（基金净值）变动表	34
7.4 报表附注	36
§7 年度财务报表(转型前)	63
7.1 资产负债表	63
7.2 利润表	65
7.3 净资产（基金净值）变动表	67

7.4 报表附注 .....	70
§8 投资组合报告(转型后) .....	109
8.1 期末基金资产组合情况 .....	109
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	110
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 .....	110
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	111
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	113
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 .....	114
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 .....	114
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 .....	114
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 .....	114
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	114
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	114
8.12 投资组合报告附注 .....	115
§8 投资组合报告（转型前） .....	115
8.1 期末基金资产组合情况 .....	115
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	116
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 .....	117
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	121
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	122
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 .....	123
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 .....	123
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 .....	123
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 .....	123
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	124
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	124
8.12 投资组合报告附注 .....	124
§9 基金份额持有人信息(转型后) .....	125
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	125
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	125
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 .....	126
§9 基金份额持有人信息(转型前) .....	126
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	126
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	127
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 .....	127
§10 开放式基金份额变动(转型后) .....	128
§10 开放式基金份额变动(转型前) .....	128
§11 重大事件揭示 .....	128
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	129
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 .....	129
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	129
11.4 基金投资策略的改变 .....	129
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	129
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 .....	129
转型后 .....	130
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	130
转型前 .....	132
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	132

---

11.8 其他重大事件 .....	134
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	136
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	136
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	137
§13 备查文件目录 .....	137
13.1 备查文件目录 .....	137
13.2 存放地点 .....	137
13.3 查阅方式 .....	137

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 转型后

基金名称	兴业聚惠混合型证券投资基金	
基金简称	兴业聚惠混合	
基金主代码	001547	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2022年03月16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	152,945,701.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
下属分级基金的交易代码	001547	002923
报告期末下属分级基金的份额总额	13,359,861.06份	139,585,840.04份

#### 转型前

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07月08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	529,962,377.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001547	002923
报告期末下属分级基金的份额总额	130,135,838.34份	399,826,539.62份

## 2.2 基金产品说明

### 转型后

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。</p> <p>主要投资策略为资产配置策略、债券类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%。
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。

### 转型前

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	中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%。
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。

## 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	张玲菡
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn
客户服务电话	40000-95561	95568

传真	021-22211997	010-57093382
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	上海市浦东新区银城路167号13、14层	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	官恒秋	高迎欣

## 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
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	上海市浦东新区银城路167号13、14层

## 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	上海市浦东新区银城路167号13、14层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)

### 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	2022年03月16日（基金合同生效日） - 2022年12月31日	
	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
本期已实现收益	-3,489,755.59	-24,605,893.52
本期利润	438,673.05	3,804,496.70



加权平均基金份额本期利润	0.0108	0.0153
本期加权平均净值利润率	0.64%	0.91%
本期基金份额净值增长率	-0.24%	-0.36%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2022年末	
期末可供分配利润	8,099,860.72	82,260,381.86
期末可供分配基金份额利润	0.6063	0.5893
期末基金资产净值	22,027,520.45	228,853,238.89
期末基金份额净值	1.649	1.640
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-0.24%	-0.36%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

## 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

兴业聚惠混合A

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	-1.85%	0.23%	-0.05%	0.25%	-1.80%	-0.02%
过去六个月	-4.29%	0.21%	-2.68%	0.21%	-1.61%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.24%	0.28%	0.03%	0.25%	-0.27%	0.03%

兴业聚惠混合C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-1.86%	0.21%	-0.05%	0.25%	-1.81%	-0.04%
过去六个月	-4.26%	0.20%	-2.68%	0.21%	-1.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-0.36%	0.27%	0.03%	0.25%	-0.39%	0.02%

注：1、本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由"三年期银行定期存款利率（税后）+1%。"变更为"中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%"。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 3.2.2 自基金转型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

兴业聚惠混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年03月16日-2022年12月31日)



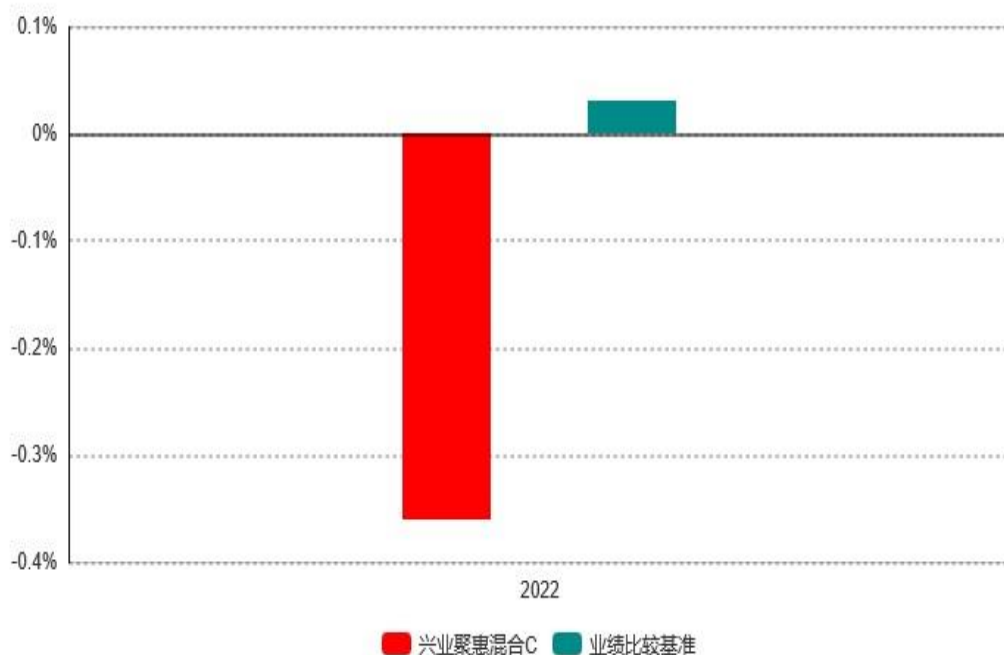
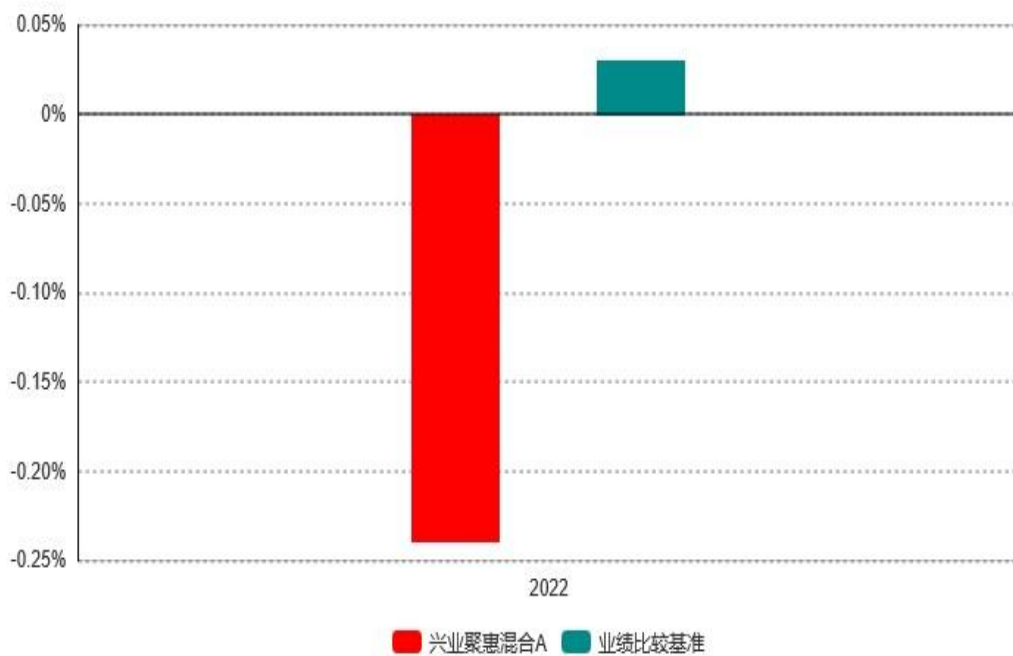
兴业聚惠混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由"三年期银行定期存款利率（税后）+1%。"变更为"中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%"。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 3.2.3 自基金转型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



注：1、本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由"三年期银行定期存款利率（税后）+1%。"变更为"中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%"。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本年未进行利润分配。

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年03月15日)		2021年		2020年	
	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C
本期已实现收益	-405,254.71	-1,467,913.38	17,043,509.11	34,591,259.84	46,305,138.68	26,235,573.88
本期利润	-15,347,843.15	-49,811,413.75	19,293,772.22	38,999,998.20	52,734,521.36	29,448,884.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1045	-0.1062	0.1247	0.1025	0.2867	0.2805
本期加权平均净值利润率	-6.07%	-6.20%	7.35%	6.05%	18.97%	18.22%
本期基金份额净值增长率	-6.24%	-6.21%	6.65%	6.49%	20.92%	20.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年03月15日)		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	85,042,790.00	258,278,022.44	105,597,246.57	324,142,834.75	146,538,621.75	144,918,183.66
期末可供分配基金份额利润	0.6535	0.6460	0.6977	0.6825	0.5985	0.5854
期末基金资产净值	215,178,628.34	658,104,562.06	266,765,469.66	833,513,644.34	404,806,543.50	407,944,207.93
期末基金份额净值	1.6530	1.6460	1.763	1.755	1.653	1.648

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年03月15日)		2021年末		2020年末	
	基金份额累计净值增长率	65.30%	42.88%	76.30%	52.34%	65.30%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 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

兴业聚惠灵活配置混合A

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(2022年01月01日-2022年03月15日)	-6.24%	0.33%	-4.09%	0.28%	-2.15%	0.05%
过去六个月(2021年10月01日-2022年03月15日)	-3.67%	0.27%	-3.31%	0.22%	-0.36%	0.05%
过去一年(2021年04月01日-2022年03月15日)	-0.72%	0.29%	-2.91%	0.22%	2.19%	0.07%
过去三年(201	34.94%	0.32%	4.69%	0.16%	30.25%	0.16%

9年04月01日-2022年03月15日)						
过去五年(2017年04月01日-2022年03月15日)	42.13%	0.28%	12.10%	0.13%	30.03%	0.15%
自基金合同生效起至今(2015年07月08日-2022年03月15日)	65.30%	0.30%	18.62%	0.11%	46.68%	0.19%

兴业聚惠灵活配置混合C

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(2022年01月01日-2022年03月15日)	-6.21%	0.32%	-4.09%	0.28%	-2.12%	0.04%
过去六个月(2021年10月01日-2022年03月15日)	-3.69%	0.27%	-3.31%	0.22%	-0.38%	0.05%
过去一年(2021年04月01日-2022年03月15日)	-0.78%	0.28%	-2.91%	0.22%	2.13%	0.06%
过去三年(2019年04月01日-2022年03月15日)	34.48%	0.32%	4.69%	0.16%	29.79%	0.16%
过去五年(201	41.41%	0.28%	12.10%	0.13%	29.31%	0.15%

7年04月01日-2022年03月15日)						
自基金合同生效起至今(2016年07月01日-2022年03月15日)	42.88%	0.26%	14.87%	0.12%	28.01%	0.14%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 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A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



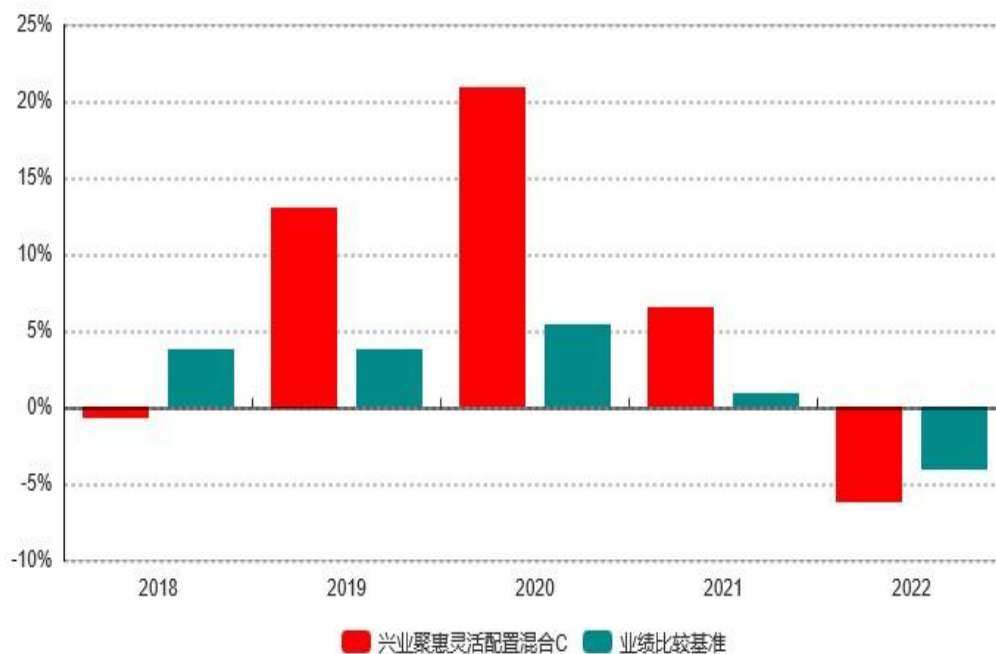
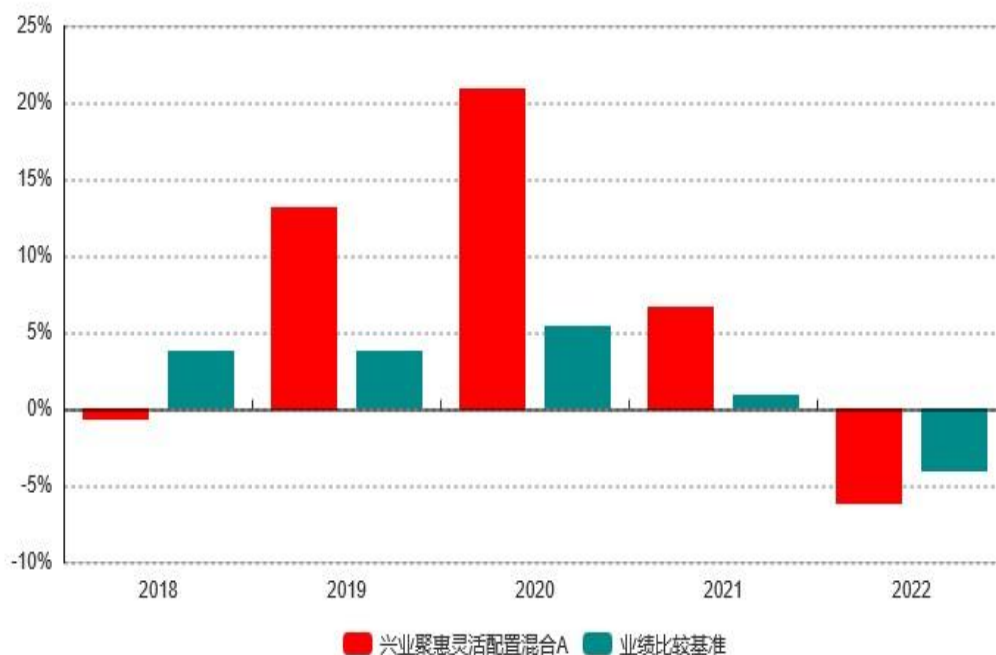
兴业聚惠灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由"三年期银行定期存款利率（税后）+1%。"变更为"中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%"。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 3.2.3 过去五年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



注：1、本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由"三年期银行定期存款利率（税后）+1%。"变更为"中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%"。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

### 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

兴业基金管理有限公司（以下简称"兴业基金"或"公司"）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司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。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2022年12月31日，兴业基金共管理84只公募基金。

#### 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		
徐青	基金经理	2017-01-19	2022-09-15	11年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2011年7月至2014年1月，在华泰证券股份有限公司研究所担任债券研究员，从事债券研究工作；2014年2

					月至2016年8月，在国联安基金管理有限公司债券组合管理部从事债券投资研究工作，期间担任债券研究员和基金经理助理，其中2015年5月至2016年8月担任国联安德盛增利证券投资基金的基金经理助理，2015年5月至2015年12月担任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理，2016年3月至2016年8月担任国联安安稳保本混合型证券投资基金的基金经理助理。2016年9月加入兴业基金管理有限公司。
蔡艳菲	基金经理	2022-09-15	-	14年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2008年7月至2013年8月在兴业证券固定收益部先后从事债券承销和债券研究、投资工作；2013年9月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

2022年，国内疫情反复和地产领域流动性压力对经济形成显著拖累，俄乌战争、发达经济体货币政策收紧对国内经济也造成扰动。全年债券收益率总体呈现V型走势，信用利差也呈现V型走势，走阔至近3年的高位。2022年权益资产整体下跌，但需求结构变化及机会成本不高，转债估值中枢仍有所提升，全年中证转债指数下跌10%。股票市场受到多重黑天鹅事件和外围加息的影响风险偏好下降，跌幅较大，11月份之后股票市场底部回升。板块来看，受益于疫情后的经济恢复预期回升，消费类板块、地产、家电等行业表现较好。

报告期内，组合适度调整了债券持仓结构，整体以降低久期和杠杆操作为主。权益仓位方面，保持较为均衡的配置，兼顾行业景气度与估值的合理性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年3月15日，兴业聚惠灵活配置混合A基金份额净值为1.6530元；自2022年1月1日至2022年3月15日本基金份额净值增长率为-6.24%，同期业绩比较基准收益率为-4.09%。

截至2022年3月15日，兴业聚惠灵活配置混合C基金份额净值为1.6460元；自2022年1月1日至2022年3月15日本基金份额净值增长率为-6.21%，同期业绩比较基准收益率为-4.09%。

截至2022年12月31日，兴业聚惠混合A基金份额净值为1.649元；自2022年3月16日至2022年12月31日本基金份额净值增长率为-0.24%，同期业绩比较基准收益率为0.03%。

截至2022年12月31日，兴业聚惠混合C基金份额净值为1.640元；自2022年3月16日至2022年12月31日本基金份额净值增长率为-0.36%，同期业绩比较基准收益率为0.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情管控的解除、地产尾部风险的下降，奠定了今年国内经济复苏的基础，但是出口下降的相对确定，私人部门信心的恢复需要时间，内生性信用扩张整体处于偏弱状态，复苏的力度仍依赖于积极的广义财政和中性偏松的货币政策的配合。在这样的宏观背景下，股票市场受益于风险因素的消退，稳经济政策的陆续出台，风险偏好上升，上半年估值修复贡献高于业绩增长的贡献，后期关注业绩增长的恢复力度；利率债则受制于复苏的强预期与弱现实的博弈，将呈现区间震荡的格局。

当前阶段中高等级信用债的投资价值凸现，操作策略上，组合拟以信用债为底仓，根据市场走势的预判，积极参与利率债的交易机会，未来我们将继续根据各细分资产的风险和收益率预期变化，主动调整持仓的结构和仓位，持续优化组合的资产配置，力争实现较为稳健的净值增长。

#### 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，2022年度主要从如下几个方面落实风险控制与合规管理、强化监察稽核职能：

1、建立健全公司治理结构、完善制度流程：报告期内公司持续优化公司治理和内部控制环境，紧跟监管导向深入落实行业高质量发展意见要求，完成监管新规内化落地工作，持续完善制度体系和授权管理机制，结合业务发展情况持续健全内部控制体系；

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，对公司治理、

投资研究、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、落实全员合规理念、加强员工合规管理：报告期内公司持续开展外规宣贯和培训，密切关注外部监管要求，重视外规要求传达与内化，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，提升员工合规内控意识；严格规范工作人员执业行为，开展警示案防教育，督促员工勤勉尽责，防范利用职务便利从事违法违规、超越权限或者其他损害客户合法权益的行为；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。

6、持续完善内控合规体系建设、强化合规内控管理：报告期内，持续推进合规内控文化建设，完善法治管理体系，优化合规内控评价机制，强化合规引导，推进重点法规内化落地，有序开展各项合规内控工作，不断提升公司审慎规范经营和全面风险管理水平。

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；副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任；专业委员若干名，由研究部门、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险管理部门、监察稽核部门、基金运营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》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

#### 4.9 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，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，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、基金费用开支及利润分配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。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告(转型后)

### 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(23)第P00926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	兴业聚惠混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了兴业聚惠混合型证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年3月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表、净资产(资产净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附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混合型证券投资基金2022年12月31日的财务状况、2022年3月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和资产净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业聚惠混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴业基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业聚惠混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们

	<p>对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责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，使其实现公允反映，并设计、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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业聚惠混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业聚惠混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业聚惠混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串</p>

	<p>通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，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。(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业聚惠混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业聚惠混合型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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）
注册会计师的姓名	汪芳   王硕
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	2023-03-28

## §6 审计报告(转型前)

### 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(23)第P00855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：
审计意见	我们审计了兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2022年3月15日(基金合同失效前日)的资产负债表，2022年1月1日至2022年3月15日(基金合同失效前日)的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附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型证券投资基金2022年3月15日(基金合同失效前日)的财务状况以及2022年1月1日至2022年3月15日(基金合同失效前日)的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	兴业基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结

	<p>论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责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，使其实现公允反映，并设计、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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串</p>

	<p>通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，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。(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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)	
注册会计师的姓名	汪芳	王硕
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号外滩中心21楼	
审计报告日期	2023-03-28	

## §7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	965,039.63
结算备付金		1,530,810.95
存出保证金		48,919.17
交易性金融资产	7.4.7.2	284,319,233.77
其中：股票投资		37,910,003.19
基金投资		-
债券投资		246,409,230.58
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		4,070,839.57
应收股利		-
应收申购款		7,292.03
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		290,942,135.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022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		38,266,467.99
应付清算款		-
应付赎回款		1,381,146.97
应付管理人报酬		131,262.48
应付托管费		21,877.09
应付销售服务费		19,965.98
应付投资顾问费		-
应交税费		8,428.36
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	232,226.91
负债合计		40,061,375.78
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	152,945,701.10
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	97,935,058.24
净资产合计		250,880,759.34
负债和净资产总计		290,942,135.12

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额总额152,945,701.10份，其中下属A类基金份额净值1.649元，基金份额13,359,861.06份，下属C类基金份额净值1.640元，基金份额139,585,840.04份。

2、2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。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：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月16日至2022年12月31日

单位：人民币元



项目	附注号	本期 2022年03月16日至2022年1 2月31日
<b>一、营业总收入</b>		8,944,492.13
1.利息收入		113,144.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	108,891.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,252.61
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,218,579.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-37,901,154.12
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	11,987,889.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	1,694,684.65
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	32,338,818.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	711,108.88
<b>减：二、营业总支出</b>		4,701,322.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,344,873.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	390,812.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	335,761.26
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,383,338.11

其中：卖出回购金融资产支出		1,383,338.11
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		21,131.13
8. 其他费用	7.4.7.18	225,406.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,243,169.75
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,243,169.75
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,243,169.75

注：2022年3月16日起"兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业聚惠混合型证券投资基金"，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。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 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月16日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	529,962,377.96	-	343,320,812.44	873,283,190.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	529,962,377.96	-	343,320,812.44	873,283,190.40
三、本期增减变	-377,016,676.86	-	-245,385,754.20	-622,402,431.06

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	4,243,169.75	4,243,169.75
(二)、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)	-377,016,676.86	-	-249,628,923.95	-626,645,600.81
其中：1.基金申购款	55,643,907.26	-	38,226,696.15	93,870,603.41
2.基金赎回款	-432,660,584.12	-	-287,855,620.10	-720,516,204.22
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	152,945,701.10	-	97,935,058.24	250,880,759.34

注：2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。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：

-

-

-

-----

-----

-----

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

兴业聚惠混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由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”)转型而来。兴业聚惠灵活配置混合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》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,并出具了编号为德报(验)字(15)第1160号的验资报告。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。

2022年3月16日兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。会议审议了《关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚惠混合型证券投资基金有关事项的议案》,内容包括,将兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金的基金名称变更为兴业聚惠混合型证券投资基金,调整基金的投资、基金资产估值等相关内容并修订基金合同。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,自2022年3月16日起,《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)生效,兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚惠混合型证券投资基金。

根据基金合同相关规定,本基金分设A类基金份额(以下简称“兴业聚惠混合A”)和C类基金份额(以下简称“兴业聚惠混合C”)两类份额。其中,兴业聚惠混合A是指在投资人申购时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;兴业聚惠混合C是指在投资人申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

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(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、银行存款、同业存单、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、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。本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%-40%,本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的20%,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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由“三年期银行定期存款利率(税后)+1%”变更为：中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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2022年12月31日的财务状况以及2022年3月16日(基金合同生效日)至2022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。本期财务报表的实际编制期间为2022年3月16日(基金合同生效日)至2022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

根据本基金的业务模式和现金流量特征，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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量

为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”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计入“交易性金融资产”。

## (2)金融负债的分类

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用

损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，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。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。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原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，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。

(3)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，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

##### (1)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。

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。

##### (2)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与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。



债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。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。买卖债券价差收入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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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、相关交易费用与税费后的差额确认。

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确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

### (3)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。

### (4)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 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相应类别的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)A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
  - (2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
  - (3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。
- 本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金自2022年7月1日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

### 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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续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的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，受让方不再缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2022年12月31日
活期存款	965,039.63
等于：本金	964,470.45
加：应计利息	569.18
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	965,039.63

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		40,136,659.72	-	37,910,003.19	-2,226,656.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	69,930,405.05	1,039,898.70	70,257,922.70	-712,381.05
	银行间市场	175,095,441.58	2,876,807.88	176,151,307.88	-1,820,941.58
	合计	245,025,846.63	3,916,706.58	246,409,230.58	-2,533,322.63
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		285,162,506.35	3,916,706.58	284,319,233.77	-4,759,979.16

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	53,226.91
其中：交易所市场	44,052.25
银行间市场	9,174.66

应付利息	-
预提费用	179,000.00
合计	232,226.91

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 兴业聚惠混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合A)	本期 2022年03月16日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	130,135,838.34	130,135,838.34
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整 (若有)	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	130,135,838.34	130,135,838.34
本期申购	757,033.69	757,033.69
本期赎回（以“-”号填列）	-117,533,010.97	-117,533,010.97
本期末	13,359,861.06	13,359,861.06

##### 7.4.7.7.2 兴业聚惠混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合C)	本期 2022年03月16日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	399,826,539.62	399,826,539.62
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整 (若有)	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-

-基金拆分和集中申购完成后	399,826,539.62	399,826,539.62
本期申购	54,886,873.57	54,886,873.57
本期赎回（以“-”号填列）	-315,127,573.15	-315,127,573.15
本期末	139,585,840.04	139,585,840.04

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 兴业聚惠混合A

单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	90,316,287.28	-5,273,497.28	85,042,790.00
本期利润	-3,489,755.59	3,928,428.64	438,673.05
本期基金份额交易产生的变动数	-78,726,670.97	1,912,867.31	-76,813,803.66
其中：基金申购款	487,822.98	42,536.27	530,359.25
基金赎回款	-79,214,493.95	1,870,331.04	-77,344,162.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,099,860.72	567,798.67	8,667,659.39

##### 7.4.7.8.2 兴业聚惠混合C

单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	271,247,554.25	-12,969,531.81	258,278,022.44
本期利润	-24,605,893.52	28,410,390.22	3,804,496.70
本期基金份额交易产生的变动数	-164,381,278.87	-8,433,841.42	-172,815,120.29
其中：基金申购款	34,510,829.62	3,185,507.28	37,696,336.90
基金赎回款	-198,892,108.49	-11,619,348.70	-210,511,457.19
本期已分配利润	-	-	-

本期末	82,260,381.86	7,007,016.99	89,267,398.85
-----	---------------	--------------	---------------

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日
活期存款利息收入	37,370.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	70,347.17
其他	1,173.73
合计	108,891.43

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	292,142,694.62
减：卖出股票成本总额	329,349,274.09
减：交易费用	694,574.65
买卖股票差价收入	-37,901,154.12

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	13,247,402.34
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,259,512.52
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	11,987,889.82

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,016,216,393.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,004,438,815.00
减：应计利息总额	13,023,935.01
减：交易费用	13,155.57
买卖债券差价收入	-1,259,512.52

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,694,684.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,694,684.65

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年03月16日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	32,338,818.86
——股票投资	33,913,072.02
——债券投资	-1,574,253.16
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	32,338,818.86

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年12月31日
基金赎回费收入	711,108.88
合计	711,108.88

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年12月31日
审计费用	39,862.74
信息披露费	95,671.02
汇划手续费	10,372.81
帐户维护费	29,500.00
律师费	40,000.00
公证费	10,000.00
合计	225,406.57

#### 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

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。

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）	基金托管人
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称“中海集团”)	基金管理人的股东

兴业财富资产管理有限公司（以下简称“兴业财富”）	基金管理人控制的公司
--------------------------	------------

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的回购交易。

###### 7.4.10.1.5 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 2022年03月16日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,344,873.10
其中：支付销售机构的客户维护费	418,524.58

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0.60%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×0.60%÷当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	390,812.21

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0.10%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×0.10%÷当年天数。

#### 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		
	2022年03月16日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C	合计
兴业基金	0.00	169,620.45	169,620.45
兴业银行	0.00	1,974.80	1,974.80
合计	0.00	171,595.25	171,595.25

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金不收取销售服务费，C类基金按前一日C类份额基金资产净值的0.10%的年费率计提，逐日累计，按月支付。其计算公式为：C类基金日销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.10%÷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

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 2022年03月16日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	965,039.63	37,370.53

注：本基金的活期银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

#### 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

本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022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

金额单位：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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688035	德邦科技	2022-09-09	1-6个月（含）	科创板打新限售	46.12	48.82	4,981	229,723.72	243,172.42	-
688275	万润新能	2022-09-21	1-6个月（含）	科创板打新限售	299.88	168.85	1,083	324,770.04	182,864.55	-
6883	丛麟	2022	1-6个月	科创	59.76	34.87	3,254	194,4	113,4	-

70	科技	-08-17	(含)	板打 新限售				59.04	66.98	
688455	科捷 智能	2022-09-07	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末2022年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额38,266,467.99元，于2023年1月3日、1月5日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资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。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，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。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指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；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。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，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。本基金通过对银行间同业市场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基金管理人旗下其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中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**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。



#### 7.4.13.2.4 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 2022年12月31日
AAA	158,070,275.12
AAA以下	37,658,618.47
未评级	10,056,098.63
合计	205,784,992.22

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证

监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

#### 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。本基金基金管理人主要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 2022年1 2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	965,039.63	-	-	-	965,039.63
结算备付金	1,530,810.95	-	-	-	1,530,810.95
存出保证金	48,919.17	-	-	-	48,919.17
交易性金融资产	38,772,853.15	207,636,377.43	-	37,910,003.19	284,319,233.77
应收清算款	-	-	-	4,070,839.57	4,070,839.57
应收申购款	-	-	-	7,292.03	7,292.03
资产总计	41,317,622.90	207,636,377.43	-	41,988,134.79	290,942,135.12
负债					
卖出回购金融资产款	38,266,467.99	-	-	-	38,266,467.99
应付赎回	-	-	-	1,381,146.97	1,381,146.97

回					
应付管理人报酬	-	-	-	131,262.48	131,262.48
应付托管费	-	-	-	21,877.09	21,877.09
应付销售服务费	-	-	-	19,965.98	19,965.98
应交税费	-	-	-	8,428.36	8,428.36
其他负债	-	-	-	232,226.91	232,226.91
负债总计	38,266,467.99	-	-	1,794,907.79	40,061,375.78
利率敏感度缺口	3,051,154.91	207,636,377.43	-	40,193,227.00	250,880,759.34

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	利率曲线平行移动	
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 2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,648,003.72
	市场利率下降25个基点	1,672,651.12

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，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。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以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，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所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 2022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	37,910,003.19	15.11
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	37,910,003.19	15.11

#### 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 2022年12月31日

	股票价格上升5%	1,895,500.16
	股票价格下降5%	-1,895,500.16

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日
第一层次	38,060,626.71
第二层次	245,649,868.87
第三层次	608,738.19
合计	284,319,233.77

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年12月31日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,814,826.94	1,814,826.94
当期购买	-	2,808,156.89	2,808,156.89
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,196,574.06	4,196,574.06
当期利得或损失总额	-	182,328.42	182,328.42
其中：计入损益的利得或损失	-	182,328.42	182,328.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	608,738.19	608,738.19
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-255,675.37	-255,675.37

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	608,738.19	平均价格亚式期权模型	股票在剩余期限内的股价的预期年化波动率	0.1444-0.5109	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### §7 年度财务报表(转型前)

#### 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：2022年03月15日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	12,191,637.39	12,205,999.15
结算备付金		7,601,321.87	5,233,300.99
存出保证金		132,727.04	116,320.27
交易性金融资产	7.4.7.2	920,582,722.50	1,116,344,081.56
其中：股票投资		167,999,972.56	231,783,590.66
基金投资		-	-
债券投资		752,582,749.94	884,560,490.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	70,000,222.50
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		59,871,190.87	659,379.51
应收股利		-	-
应收申购款		343,746.88	744,859.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	11,207,717.28
资产总计		1,000,723,346.55	1,216,511,880.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年03月15日</b>	<b>上年度末 2021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		118,513,613.42	109,944,710.08
应付清算款		4,523,298.37	988,133.55
应付赎回款		3,729,079.45	4,253,584.02
应付管理人报酬		231,082.03	488,758.50
应付托管费		38,513.67	81,459.77
应付销售服务费		29,271.62	57,839.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,868.46	26,799.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	361,429.13	391,482.59
负债合计		127,440,156.15	116,232,766.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	529,962,377.96	626,293,354.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	343,320,812.44	473,985,759.71



净资产合计		873,283,190.40	1,100,279,114.00
负债和净资产总计		1,000,723,346.55	1,216,511,880.63

注：1、报告截止日2022年3月15日，基金份额总额529,962,377.96份，其中下属A类基金份额净值1.653元，基金份额130,135,838.34份，下属C类基金份额净值1.646元，基金份额399,826,539.62份。

2、2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

3、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022年01月01日至2022年03月15日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-63,032,069.30	67,869,379.18
1.利息收入		90,950.40	27,703,536.73
其中：存款利息收入	7.4.7.9	32,071.90	168,976.44
债券利息收入		-	27,223,964.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,878.50	310,595.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		131,946.82	33,153,662.40
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-5,147,981.94	28,564,794.84
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.11	5,291,241.52	2,221,015.29
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	-11,312.76	2,367,852.27
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-63,286,088.81	6,659,001.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	31,122.29	353,178.58
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,127,187.60</b>	<b>9,575,608.76</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,295,032.37	5,421,560.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	215,838.72	903,593.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	164,378.11	641,763.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		394,603.53	769,056.82
其中：卖出回购金融资产支出		394,603.53	769,056.82
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		9,676.00	66,578.80
8. 其他费用	7.4.7.18	47,658.87	1,773,054.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-65,159,256.90</b>	<b>58,293,770.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-65,159,256.90</b>	<b>58,293,770.42</b>
<b>五、其他综合收益的税后净</b>		<b>-</b>	<b>-</b>

额			
六、综合收益总额		-65,159,256.90	58,293,770.42

注：1、2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

2、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（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：2022年01月01日至2022年03月15日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	626,293,354.29	-	473,985,759.71	1,100,279,114.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	626,293,354.29	-	473,985,759.71	1,100,279,114.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,330,976.33	-	-130,664,947.27	-226,995,923.60
（一）、综合收益总额	-	-	-65,159,256.90	-65,159,256.90

（二）、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）	-96,330,976.33	-	-65,505,690.37	-161,836,666.70
其中：1.基金申购款	80,605,665.62	-	58,538,185.83	139,143,851.45
2.基金赎回款	-176,936,641.95	-	-124,043,876.20	-300,980,518.15
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	529,962,377.96	-	343,320,812.44	873,283,190.40
项目	上年度可比期间			
	2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	492,424,778.41	-	320,325,973.02	812,750,751.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	492,424,778.41	-	320,325,973.02	812,750,751.43

资产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	133,868,575.88	-	153,659,786.69	287,528,362.57
（一）、综合收益总额	-	-	58,293,770.42	58,293,770.42
（二）、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）	133,868,575.88	-	95,366,016.27	229,234,592.15
其中：1.基金申购款	729,444,032.77	-	513,429,733.22	1,242,873,765.99
2.基金赎回款	-595,575,456.89	-	-418,063,716.95	-1,013,639,173.84
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	626,293,354.29	-	473,985,759.71	1,100,279,114.00

注：2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

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：

官恒秋

张顺国

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号的验资报告。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。

2022年3月16日兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。会议审议了《关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚惠混合型证券投资基金有关事项的议案》,内容包括,将兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金的基金名称变更为兴业聚惠混合型证券投资基金,调整基金的投资、基金资产估值等相关内容并修订基金合同。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,自2022年3月16日起,原《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同》生效,兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚惠混合型证券投资基金。

根据基金合同相关规定,本基金分设A类基金份额(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合A”)和C类基金份额(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合C”)两类份额。其中,兴业聚惠灵活配置混合A是指在投资人申购时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;兴业聚惠灵活配置混合C是指在投资人申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

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(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、银行存款、同业存单、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、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。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金参与股指期货、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×80%+沪深300指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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2022年3月15日(基金合同失效前日)的财务状况以及2022年1月1日至2022年3月15日(基金合同失效前日)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2022年1月1日至2022年3月15日(基金合同失效前日)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

根据本基金的业务模式和现金流量特征，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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”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计入“交易性金融资产”。

#### (2)金融负债的分类

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用



风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，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。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。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原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，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

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。

(3) 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，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

##### (1) 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。

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。

##### (2) 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与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。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。买卖债券价差收入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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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、相关交易费用与税费后的差额确认。

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确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

### (3) 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。

### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 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相应类别的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) A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

根据《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0.00元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息，金额分别为人民币12,205,999.15元、人民币5,233,300.99元、人民币116,320.27元、人民币70,000,222.50元、人民币11,207,717.28元、人民币109,944,710.08元、人民币-16,782.11元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款、其他负债-应付利息，金额分别为人民币12,212,571.55元、人民币5,235,891.49元、人民币116,377.91元、人民币70,023,061.66元、人民币0.00元、人民币109,927,927.97元、人民币0.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币1,116,344,081.56元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币11,175,657.58元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币1,127,519,739.14元。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续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的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;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,受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	12,191,637.39	12,205,999.15
等于：本金	12,173,173.53	12,205,999.15
加：应计利息	18,463.86	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	12,191,637.39	12,205,999.15

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	204,139,701.11	-	167,999,972.56	-36,139,728.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	181,244,040.09	2,966,732.95	183,812,152.95	-398,620.09
	银行间市场	561,001,949.38	8,329,096.99	568,770,596.99	-560,449.38

	合计	742,245,989.47	11,295,829.94	752,582,749.94	-959,069.47
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	946,385,690.58	11,295,829.94	920,582,722.50	-37,098,798.02
	项目	上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
	股票	208,002,584.17	-	231,783,590.66	23,781,006.49
	贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	115,979,623.89	-	115,692,490.90	-287,132.99
	银行间市场	766,174,582.71	-	768,868,000.00	2,693,417.29
	合计	882,154,206.60	-	884,560,490.90	2,406,284.30
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,090,156,790.77	-	1,116,344,081.56	26,187,290.79

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期及上年度末均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 2022年03月15日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-



项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	55,000,000.00	-
银行间市场	15,000,222.50	-
合计	70,000,222.50	-

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	11,207,717.28
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	11,207,717.28

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付交易费用	174,562.89	229,264.70
其中：交易所市场	167,387.76	218,514.75
银行间市场	7,175.13	10,749.95
应付利息	-	-16,782.11

预提费用	186,866.24	179,000.00
合计	361,429.13	391,482.59

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 兴业聚惠灵活配置混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠灵活配置混合A)	本期 2022年01月01日至2022年03月15日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,350,166.22	151,350,166.22
本期申购	1,067,630.17	1,067,630.17
本期赎回（以“-”号填列）	-22,281,958.05	-22,281,958.05
本期末	130,135,838.34	130,135,838.34

##### 7.4.7.7.2 兴业聚惠灵活配置混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠灵活配置混合C)	本期 2022年01月01日至2022年03月15日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	474,943,188.07	474,943,188.07
本期申购	79,538,035.45	79,538,035.45
本期赎回（以“-”号填列）	-154,654,683.90	-154,654,683.90
本期末	399,826,539.62	399,826,539.62

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 兴业聚惠灵活配置混合A

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
本期期初	105,597,246.57	9,818,056.87	115,415,303.44
本期利润	-405,254.71	-14,942,588.44	-15,347,843.15

本期基金份额交易产生的变动数	-14,875,704.58	-148,965.71	-15,024,670.29
其中：基金申购款	749,251.91	37,772.95	787,024.86
基金赎回款	-15,624,956.49	-186,738.66	-15,811,695.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,316,287.28	-5,273,497.28	85,042,790.00

#### 7.4.7.8.2 兴业聚惠灵活配置混合C

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
本期期初	324,142,834.75	34,427,621.52	358,570,456.27
本期利润	-1,467,913.38	-48,343,500.37	-49,811,413.75
本期基金份额交易产生的变动数	-51,427,367.12	946,347.04	-50,481,020.08
其中：基金申购款	54,674,318.23	3,076,842.74	57,751,160.97
基金赎回款	-106,101,685.35	-2,130,495.70	-108,232,181.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	271,247,554.25	-12,969,531.81	258,278,022.44

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	11,891.46	121,000.33
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	19,760.82	46,249.07
其他	419.62	1,727.04
合计	32,071.90	168,976.44

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	111,129,354.10	540,607,025.94
减：卖出股票成本总额	115,960,913.56	512,042,231.10
减：交易费用	316,422.48	-
买卖股票差价收入	-5,147,981.94	28,564,794.84

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	5,806,369.78	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-515,128.26	2,221,015.29
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	5,291,241.52	2,221,015.29

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月 15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	658,368,281.24	1,643,867,834.03

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	651,613,374.37	1,613,777,294.89
减：应计利息总额	7,263,037.64	27,869,523.85
减：交易费用	6,997.49	-
买卖债券差价收入	-515,128.26	2,221,015.29

#### 7.4.7.12 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。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
股票投资产生的股利收益	-11,312.76	2,367,852.27
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-11,312.76	2,367,852.27

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年03 月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-63,286,088.81	6,659,001.47
——股票投资	-59,920,735.04	4,655,107.23

——债券投资	-3,365,353.77	2,003,894.24
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-63,286,088.81	6,659,001.47

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	31,122.29	351,739.05
转换费收入	-	1,439.53
合计	31,122.29	353,178.58

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	10,137.26	50,000.00
信息披露费	24,328.98	120,000.00
汇划手续费	5,492.63	17,769.69

帐户维护费	7,700.00	46,200.00
交易费用	-	1,539,084.91
合计	47,658.87	1,773,054.60

## 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

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。

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司（以下简称"兴业基金"）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司（以下简称"民生银行"）	基金托管人
兴业银行股份有限公司（以下简称"兴业银行"）	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司（以下简称"兴业财富"）	基金管理人控制的公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的回购交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2022年01月01日至2022年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,295,032.37	5,421,560.93
其中：支付销售机构的客户维护费	172,107.15	1,096,303.81

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0.60%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×0.60%÷当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	215,838.72	903,593.62

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0.10%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×0.10%÷当年天数。

### 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 2022年01月01日至2022年03月15日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	合计
兴业基金	0.00	74,632.66	74,632.66
兴业银行	0.00	928.07	928.07
合计	0.00	75,560.73	75,560.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	合计
兴业基金	0.00	170,897.31	170,897.31
兴业银行	0.00	5,203.05	5,203.05
合计	0.00	176,100.36	176,100.36

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金不收取销售服务费，C类基金按前一日C类份额基金资产净值的0.10%的年费率计提，逐日累计，按月支付。其计算公式为：C类基金日销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.10%÷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

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

本基金本报告期间及上年度可比期间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

本基金本报告期间末及上年度可比期间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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2022年01月01日至2022年03月15日		2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生 银行股份 有限公司	12,191,637.39	11,891.46	12,205,999.15	121,000.33

注：本基金的活期银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022年03月15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

金额单位：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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688082	盛美上海	2021-11-10	1-6个月（含）	科创板打新限售	85.00	86.99	7,403	629,255.00	643,986.97	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1个月内（含）	新股未上市	173.98	173.98	1,728	300,637.44	300,637.44	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1个月内（含）	新股未上市	39.88	39.88	5,772	230,187.36	230,187.36	-

688280	精进电动	2021-10-19	1-6个月（含）	科创板打新限售	13.78	10.12	21,211	292,287.58	214,655.32	-
688282	理工导航	2022-03-10	1个月内（含）	新股未上市	65.21	65.21	3,185	207,693.85	207,693.85	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	42.50	42.50	3,506	149,005.00	149,005.00	-
301256	华融化学	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	8.05	8.05	16,477	132,639.85	132,639.85	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	15.37	15.37	5,787	88,946.19	88,946.19	-
301155	海力风电	2021-11-17	1-6个月（含）	创业板打新限售	60.66	87.62	861	52,228.26	75,440.82	-
301236	软通动力	2022-03-08	1-6个月（含）	创业板打新限售	72.88	57.16	851	62,020.88	48,643.16	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月（含）	创业板打新限售	109.30	91.79	517	56,508.10	47,455.43	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月（含）	创业板打新限售	76.56	54.16	857	65,611.92	46,415.12	-
301089	拓新	2021-10-2	1-6个月	创业	19.11	178.48	220	4,204.20	39,265.60	-

	药业	0	(含)	板打 新限售							
3012 01	诚达 药业	2022 -01-1 2	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	72.69	108.8 2	353	25,65 9.57	38,41 3.46	-	
3011 77	迪阿 股份	2021 -12-0 8	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	116.8 8	76.33	436	50,95 9.68	33,27 9.88	-	
3010 87	可孚 医疗	2021 -10-1 5	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	93.09	64.62	515	47,94 1.35	33,27 9.30	-	
3012 07	华兰 疫苗	2022 -02-1 0	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	56.88	50.75	569	32,36 4.72	28,87 6.75	-	
3010 90	华润 材料	2021 -10-1 9	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	10.45	10.30	2,764	28,88 3.80	28,46 9.20	-	
3012 15	中汽 股份	2022 -02-2 8	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	3.80	5.73	4,743	18,02 3.40	27,17 7.39	-	
0013 08	康冠 科技	2022 -03-1 0	1个月内 (含)	新股 未上 市	48.84	48.84	513	25,05 4.92	25,05 4.92	-	
3012 11	亨迪 药业	2021 -12-1 4	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	25.80	24.51	967	24,94 8.60	23,70 1.17	-	

300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月（含）	创业板打新限售	55.57	36.18	623	34,620.11	22,540.14	-
301166	优宁维	2021-12-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	86.06	83.89	253	21,773.18	21,224.17	-
301096	百诚医药	2021-12-13	1-6个月（含）	创业板打新限售	79.60	75.75	272	21,651.20	20,604.00	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月（含）	创业板打新限售	50.31	63.08	301	15,143.31	18,987.08	-
301235	华康医疗	2022-01-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.30	45.16	418	16,427.40	18,876.88	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	1-6个月（含）	创业板打新限售	5.17	34.74	539	2,786.63	18,724.86	-
301093	华兰股份	2021-10-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	58.08	41.95	409	23,754.72	17,157.55	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	37.23	25.31	656	24,422.88	16,603.36	-
301189	奥尼电子	2021-12-2	1-6个月（含）	创业板打	66.18	36.39	435	28,788.30	15,829.65	-

		1		新限售							
301091	深城交	2021-10-20	1-6个月（含）	创业板打新限售	36.50	28.97	524	19,126.00	15,180.28	-	
301168	通灵股份	2021-12-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.08	45.52	329	12,857.32	14,976.08	-	
301117	佳缘科技	2022-01-07	1-6个月（含）	创业板打新限售	46.80	51.22	262	12,261.60	13,419.64	-	
301078	孩子王	2021-09-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	5.77	17.60	756	4,362.12	13,305.60	-	
301111	粤万年青	2021-11-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	10.48	34.79	379	3,971.92	13,185.41	-	
301100	风光股份	2021-12-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	27.81	21.34	599	16,658.19	12,782.66	-	
301118	恒光股份	2021-11-09	1-6个月（含）	创业板打新限售	22.70	40.57	315	7,150.50	12,779.55	-	
301190	善水科技	2021-12-17	1-6个月（含）	创业板打新限售	27.85	22.01	575	16,013.75	12,655.75	-	

301179	泽宇智能	2021-12-01	1-6个月（含）	创业板打新限售	43.99	42.42	295	12,977.05	12,513.90	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	1-6个月（含）	创业板打新限售	57.27	43.86	280	16,035.60	12,280.80	-
301101	明月镜片	2021-12-09	1-6个月（含）	创业板打新限售	26.91	32.55	371	9,983.61	12,076.05	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	13.00	18.34	647	8,411.00	11,865.98	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	33.98	34.36	332	11,281.36	11,407.52	-
301196	唯科科技	2022-01-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	64.08	39.45	271	17,365.68	10,690.95	-
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	11.40	17.95	577	6,577.80	10,357.15	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	29.28	24.47	402	11,770.56	9,836.94	-
301130	西点药业	2022-02-1	1-6个月（含）	创业板打	22.55	41.12	237	5,344.35	9,745.44	-

		6		新限售							
301228	实朴检测	2022-01-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	20.08	25.47	373	7,489.84	9,500.31	-	
301092	争光股份	2021-10-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	36.31	28.49	323	11,728.13	9,202.27	-	
301138	华研精机	2021-12-08	1-6个月（含）	创业板打新限售	26.17	30.32	285	7,458.45	8,641.20	-	
301181	标榜股份	2022-02-11	1-6个月（含）	创业板打新限售	40.25	30.54	257	10,344.25	7,848.78	-	
301193	家联科技	2021-12-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	30.73	25.56	297	9,126.81	7,591.32	-	
301098	金埔园林	2021-11-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	12.36	22.74	307	3,794.52	6,981.18	-	
301072	中捷精工	2021-09-22	1-6个月（含）	创业板打新限售	7.46	38.12	181	1,350.26	6,899.72	-	
301182	凯旺科技	2021-12-16	1-6个月（含）	创业板打新限售	27.12	22.71	294	7,973.28	6,676.74	-	



301198	喜悦智行	2021-11-25	1-6个月（含）	创业板打新限售	21.76	25.10	262	5,701.12	6,576.20	-
301081	严牌股份	2021-10-13	1-6个月（含）	创业板打新限售	12.95	16.17	403	5,218.85	6,516.51	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	1-6个月（含）	创业板打新限售	12.24	45.05	144	1,762.56	6,487.20	-
301083	百胜智能	2021-10-13	1-6个月（含）	创业板打新限售	9.08	13.94	416	3,777.28	5,799.04	-
301063	海锅股份	2021-09-09	1-6个月（含）	创业板打新限售	17.40	32.02	153	2,662.20	4,899.06	-
300854	中兰环保	2021-09-08	1-6个月（含）	创业板打新限售	9.96	23.63	203	2,021.88	4,796.89	-
301068	大地海洋	2021-09-16	1-6个月（含）	创业板打新限售	13.98	28.39	144	2,013.12	4,088.16	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	1-6个月（含）	创业板打新限售	11.92	26.11	140	1,668.80	3,655.40	-
301219	腾远钴业	2022-03-1	1-6个月（含）	创业板打	173.98	173.98	192	33,404.16	33,404.16	-

		0		新限售						
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.88	39.88	642	25,602.96	25,602.96	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	42.50	42.50	390	16,575.00	16,575.00	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	8.05	8.05	1,831	14,739.55	14,739.55	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	15.37	15.37	644	9,898.28	9,898.28	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113641	华友转债	2022-02-28	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末2022年3月15日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额118,513,613.42元，于2022年3月17日、3月18日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资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。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，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。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指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；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。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，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。本基金通过对银行间同业市场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基金管理人旗下其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。

本基金报告期末及上年度末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中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 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	61,133,071.23	120,429,000.00
合计	61,133,071.23	120,429,000.00

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	117,082,000.00
合计	0.00	117,082,000.00

#### 7.4.13.2.4 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	上年度末
--------	-----	------

	2022年03月15日	2021年12月31日
AAA	463,623,811.96	247,767,000.00
AAA以下	73,407,878.78	82,855,625.90
未评级	0.00	0.00
合计	537,031,690.74	330,622,625.90

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

### 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。本基金基金管理人主要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 2022年 03月15 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,191,637.39	-	-	-	12,191,637.39
清算备付金	7,601,321.87	-	-	-	7,601,321.87
存出保证金	132,727.04	-	-	-	132,727.04
交易性金融资产	138,136,074.89	530,704,484.34	83,742,190.71	167,999,972.56	920,582,722.50
应收证券清算款	-	-	-	59,871,190.87	59,871,190.87
应收申购款	-	-	-	343,746.88	343,746.88
资产总计	158,061,761.19	530,704,484.34	83,742,190.71	228,214,910.31	1,000,723,346.55
负债					
卖出回购金额资产款	118,513,613.42	-	-	-	118,513,613.42
应付证券清算款	-	-	-	4,523,298.37	4,523,298.37

兴业聚惠混合型证券投资基金（原兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型）2022 年年度报告

应付赎回	-	-	-	3,729,079.45	3,729,079.45
应付管理人报酬	-	-	-	231,082.03	231,082.03
应付托管费	-	-	-	38,513.67	38,513.67
应付销售服务费	-	-	-	29,271.62	29,271.62
应交税费	-	-	-	13,868.46	13,868.46
其他负债	-	-	-	361,429.13	361,429.13
负债总计	118,513,613.42	-	-	8,926,542.73	127,440,156.15
利率敏感度缺口	39,548,147.77	530,704,484.34	83,742,190.71	219,288,367.58	873,283,190.40
上年度末 2021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	12,205,999.15	-	-	-	12,205,999.15
清算备付金	5,233,300.99	-	-	-	5,233,300.99
存出保证金	116,320.27	-	-	-	116,320.27
交易性金融资产	332,773,490.90	300,987,000.00	250,800,000.00	231,783,590.66	1,116,344,081.56
买入返售金额资产	70,000,222.50	-	-	-	70,000,222.50
应收证券清算款	-	-	-	659,379.51	659,379.51
应收利息	-	-	-	11,207,717.28	11,207,717.28
应收申购款	-	-	-	744,859.37	744,859.37

资产总计	420,329,333.81	300,987,000.00	250,800,000.00	244,395,546.82	1,216,511,880.63
负债					
卖出回购金额 资产款	109,944,710.08	-	-	-	109,944,710.08
应付证 券清算 款	-	-	-	988,133.55	988,133.55
应付赎 回	-	-	-	4,253,584.02	4,253,584.02
应付管 理人报 酬	-	-	-	488,758.50	488,758.50
应付托 管费	-	-	-	81,459.77	81,459.77
应付销 售服务 费	-	-	-	57,839.09	57,839.09
应付交 易费用	-	-	-	229,264.70	229,264.70
应付利 息	-	-	-	-16,782.11	-16,782.11
应交税 费	-	-	-	26,799.03	26,799.03
其他负 债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总 计	109,944,710.08	-	-	6,288,056.55	116,232,766.63
利率敏 感度缺 口	310,384,623.73	300,987,000.00	250,800,000.00	238,107,490.27	1,100,279,114.00

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	利率曲线平行移动		
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 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日



	市场利率上升25个基点	-6,932,396.23	-7,272,517.40
	市场利率下降25个基点	6,990,667.11	7,421,813.64

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，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。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以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，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所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 2022年03月15日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	167,999,972.56	19.24	231,783,590.66	21.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-

产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	167,999,972.56	19.24	231,783,590.66	21.07

#### 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 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
	股票价格上升5%	8,399,998.63	11,589,179.53
	股票价格下降5%	-8,399,998.63	-11,589,179.53

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	165,133,777.10	227,441,521.82
第二层次	753,634,118.46	884,840,644.91
第三层次	1,814,826.94	4,061,914.83
合计	920,582,722.50	1,116,344,081.56

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,061,914.83	4,061,914.83
当期购买	-	421,467.17	421,467.17
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,060,494.16	2,060,494.16
当期利得或损失总额	-	-608,060.90	-608,060.90
其中：计入损益的利得或损失	-	-608,060.90	-608,060.90
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,814,826.94	1,814,826.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-41,677.61	-41,677.61
项目	上年度可比同期		

	2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,825,881.37	2,825,881.37
当期购买	-	3,936,556.43	3,936,556.43
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,891,128.27	6,891,128.27
当期利得或损失总额	-	4,190,605.30	4,190,605.30
其中：计入损益的利得或损失	-	4,190,605.30	4,190,605.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,061,914.83	4,061,914.83
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,034,570.54	2,034,570.54

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,814,826.94	平均价格亚式期权模型	股票在剩余期限内的股价的预期年化波动率	0.3104-2.5052	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	4,061,914.	平均价格亚	股票在剩余期限内的股	0.3215-1.	负相关

投资	83	式期权模型	价的预期年化波动率	7836	
----	----	-------	-----------	------	--

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### §8 投资组合报告(转型后)

#### 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	37,910,003.19	13.03
	其中：股票	37,910,003.19	13.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	246,409,230.58	84.69
	其中：债券	246,409,230.58	84.69
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,495,850.58	0.86
8	其他各项资产	4,127,050.77	1.42
9	合计	290,942,135.12	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,605,018.61	8.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,082,300.00	2.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	991,669.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	273,212.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,790,656.00	0.71
J	金融业	7,551,940.60	3.01
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	1,501,740.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	113,466.98	0.05
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	37,910,003.19	15.11

## 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	725,600	4,353,600.00	1.74
2	600690	海尔智家	161,000	3,938,060.00	1.57
3	600036	招商银行	98,100	3,655,206.00	1.46

4	600519	贵州茅台	1,800	3,108,600.00	1.24
5	300124	汇川技术	42,000	2,919,000.00	1.16
6	300059	东方财富	146,204	2,836,357.60	1.13
7	600522	中天科技	171,200	2,764,880.00	1.10
8	600845	宝信软件	39,970	1,790,656.00	0.71
9	300760	迈瑞医疗	5,500	1,737,835.00	0.69
10	603259	药明康德	18,540	1,501,740.00	0.60
11	000733	振华科技	13,000	1,484,990.00	0.59
12	002460	赣锋锂业	12,640	878,606.40	0.35
13	002179	中航光电	14,700	849,072.00	0.34
14	002311	海大集团	13,700	845,701.00	0.34
15	600887	伊利股份	24,200	750,200.00	0.30
16	600900	长江电力	34,700	728,700.00	0.29
17	600926	杭州银行	52,700	689,316.00	0.27
18	601607	上海医药	28,300	504,589.00	0.20
19	603233	大参林	12,300	487,080.00	0.19
20	002475	立讯精密	15,300	485,775.00	0.19
21	600919	江苏银行	50,900	371,061.00	0.15
22	600745	闻泰科技	6,600	347,028.00	0.14
23	601006	大秦铁路	40,900	273,212.00	0.11
24	688035	德邦科技	4,981	243,172.42	0.10
25	688275	万润新能	1,083	182,864.55	0.07
26	688370	丛麟科技	3,254	113,466.98	0.05
27	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.03

#### 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	600887	伊利股份	14,952,940.90	5.96

2	600519	贵州茅台	9,098,162.10	3.63
3	600926	杭州银行	8,188,663.00	3.26
4	601985	中国核电	7,261,123.00	2.89
5	600036	招商银行	7,113,593.00	2.84
6	603259	药明康德	6,965,328.00	2.78
7	600845	宝信软件	6,917,306.20	2.76
8	600690	海尔智家	6,007,309.39	2.39
9	300124	汇川技术	5,688,455.00	2.27
10	600900	长江电力	4,937,601.00	1.97
11	000333	美的集团	4,535,059.00	1.81
12	600919	江苏银行	4,123,198.00	1.64
13	002241	歌尔股份	4,093,059.58	1.63
14	300760	迈瑞医疗	3,994,480.00	1.59
15	002555	三七互娱	3,841,831.00	1.53
16	000733	振华科技	2,810,128.00	1.12
17	002460	赣锋锂业	2,794,030.00	1.11
18	600745	闻泰科技	2,558,407.00	1.02
19	600196	复星医药	2,457,374.00	0.98
20	002001	新和成	2,448,745.00	0.98

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	300059	东方财富	33,381,776.26	13.31
2	600887	伊利股份	12,758,899.18	5.09
3	000333	美的集团	12,056,260.00	4.81
4	002236	大华股份	11,728,257.80	4.67
5	600690	海尔智家	10,941,566.00	4.36
6	601985	中国核电	10,137,833.00	4.04



7	600919	江苏银行	9,432,553.50	3.76
8	600845	宝信软件	7,762,743.07	3.09
9	601009	南京银行	7,679,469.08	3.06
10	600519	贵州茅台	7,294,798.00	2.91
11	600926	杭州银行	6,787,968.96	2.71
12	300253	卫宁健康	6,435,719.68	2.57
13	300347	泰格医药	6,225,701.00	2.48
14	600085	同仁堂	5,567,597.73	2.22
15	601939	建设银行	5,279,547.00	2.10
16	002241	歌尔股份	5,044,268.00	2.01
17	600570	恒生电子	4,856,201.32	1.94
18	002138	顺络电子	4,690,453.00	1.87
19	603259	药明康德	4,613,379.00	1.84
20	600460	士兰微	4,480,587.53	1.79

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	165,346,232.70
卖出股票收入（成交）总额	292,142,694.62

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	20,137,800.00	8.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	111,697,899.17	44.52
	其中：政策性金融债	20,486,438.36	8.17
4	企业债券	59,364,643.18	23.66
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	54,449,526.52	21.70
7	可转债(可交换债)	759,361.71	0.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	246,409,230.58	98.22

### 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	101900085	19盐城资产M TN001	200,000	21,161,578.08	8.43
2	2128020	21招商银行小 微债02	200,000	20,503,946.30	8.17
3	180211	18国开11	200,000	20,486,438.36	8.17
4	188588	21兴业04	200,000	20,218,923.84	8.06
5	152156	PR19海门	200,000	16,695,655.89	6.65

### 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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末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	48,919.17
2	应收清算款	4,070,839.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,292.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,127,050.77

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 投资组合报告（转型前）

### 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	167,999,972.56	16.79
	其中：股票	167,999,972.56	16.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	752,582,749.94	75.20
	其中：债券	752,582,749.94	75.20
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,792,959.26	1.98
8	其他各项资产	60,347,664.79	6.03
9	合计	1,000,723,346.55	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,552,577.60	0.29
B	采矿业	3,235,650.00	0.37
C	制造业	89,653,604.72	10.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,902,223.00	1.02
E	建筑业	6,981.18	0.00
F	批发和零售业	67,809.65	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,487.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,638,192.54	1.45
J	金融业	45,860,540.60	5.25

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	255,790.32	0.03
M	科学研究和技术服务业	4,649,738.86	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	4,796.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	165,580.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	167,999,972.56	19.24

### 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(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	1,314,820	30,017,340.60	3.44
2	002236	大华股份	697,170	11,161,691.70	1.28
3	601985	中国核电	1,207,900	8,902,223.00	1.02
4	600690	海尔智家	383,800	7,971,526.00	0.91
5	000333	美的集团	145,000	7,888,000.00	0.90
6	300253	卫宁健康	640,756	5,792,434.24	0.66
7	601009	南京银行	582,200	5,565,832.00	0.64
8	600919	江苏银行	857,600	5,162,752.00	0.59
9	601939	建设银行	878,800	5,114,616.00	0.59
10	600522	中天科技	292,000	5,051,600.00	0.58
11	600085	同仁堂	125,194	4,882,566.00	0.56
12	300347	泰格医药	51,800	4,558,400.00	0.52
13	600161	天坛生物	174,280	4,379,656.40	0.50
14	600570	恒生电子	95,534	4,193,942.60	0.48
15	601225	陕西煤业	244,200	3,235,650.00	0.37

16	600460	士兰微	50,400	2,804,256.00	0.32
17	600845	宝信软件	55,700	2,577,239.00	0.30
18	300498	温氏股份	135,920	2,552,577.60	0.29
19	603019	中科曙光	81,400	2,526,656.00	0.29
20	600745	闻泰科技	24,700	2,465,060.00	0.28
21	603501	韦尔股份	12,300	2,398,500.00	0.27
22	600111	北方稀土	60,100	2,361,930.00	0.27
23	002557	洽洽食品	52,000	2,323,360.00	0.27
24	002138	顺络电子	95,100	2,274,792.00	0.26
25	603799	华友钴业	24,600	2,261,970.00	0.26
26	600519	贵州茅台	1,300	2,083,900.00	0.24
27	600702	舍得酒业	11,300	1,981,907.00	0.23
28	600038	中直股份	39,700	1,948,476.00	0.22
29	688139	海尔生物	31,119	1,930,311.57	0.22
30	002043	兔宝宝	194,100	1,927,413.00	0.22
31	600196	复星医药	44,600	1,921,814.00	0.22
32	603986	兆易创新	12,800	1,879,680.00	0.22
33	002460	赣锋锂业	14,000	1,757,000.00	0.20
34	688396	华润微	31,990	1,756,251.00	0.20
35	002507	涪陵榨菜	59,800	1,726,426.00	0.20
36	600298	安琪酵母	40,100	1,709,062.00	0.20
37	000858	五粮液	10,500	1,650,075.00	0.19
38	002241	歌尔股份	47,600	1,644,580.00	0.19
39	002008	大族激光	40,600	1,603,700.00	0.18
40	002475	立讯精密	23,759	800,678.30	0.09
41	688082	盛美上海	7,403	643,986.97	0.07
42	301219	腾远钴业	1,920	334,041.60	0.04
43	301102	兆讯传媒	6,414	255,790.32	0.03
44	688280	精进电动	21,211	214,655.32	0.02
45	688282	理工导航	3,185	207,693.85	0.02
46	688800	瑞可达	1,967	175,849.80	0.02

47	301103	何氏眼科	3,896	165,580.00	0.02
48	301256	华融化学	18,308	147,379.40	0.02
49	301137	哈焊华通	6,431	98,844.47	0.01
50	301155	海力风电	861	75,440.82	0.01
51	301236	软通动力	851	48,643.16	0.01
52	301206	三元生物	517	47,455.43	0.01
53	301200	大族数控	857	46,415.12	0.01
54	301089	拓新药业	220	39,265.60	0.00
55	301201	诚达药业	353	38,413.46	0.00
56	301177	迪阿股份	436	33,279.88	0.00
57	301087	可孚医疗	515	33,279.30	0.00
58	301207	华兰疫苗	569	28,876.75	0.00
59	301090	华润材料	2,764	28,469.20	0.00
60	301215	中汽股份	4,743	27,177.39	0.00
61	001308	康冠科技	513	25,054.92	0.00
62	301211	亨迪药业	967	23,701.17	0.00
63	300834	星辉环材	623	22,540.14	0.00
64	301166	优宁维	253	21,224.17	0.00
65	301096	百诚医药	272	20,604.00	0.00
66	301122	采纳股份	301	18,987.08	0.00
67	301235	华康医疗	418	18,876.88	0.00
68	301069	凯盛新材	539	18,724.86	0.00
69	301093	华兰股份	409	17,157.55	0.00
70	301123	奕东电子	656	16,603.36	0.00
71	301189	奥尼电子	435	15,829.65	0.00
72	301091	深城交	524	15,180.28	0.00
73	301168	通灵股份	329	14,976.08	0.00
74	603070	万控智造	775	13,988.75	0.00
75	301117	佳缘科技	262	13,419.64	0.00
76	301078	孩子王	756	13,305.60	0.00
77	301111	粤万年青	379	13,185.41	0.00

78	301100	风光股份	599	12,782.66	0.00
79	301118	恒光股份	315	12,779.55	0.00
80	301190	善水科技	575	12,655.75	0.00
81	301179	泽宇智能	295	12,513.90	0.00
82	301108	洁雅股份	280	12,280.80	0.00
83	301101	明月镜片	371	12,076.05	0.00
84	301188	力诺特玻	647	11,865.98	0.00
85	301222	浙江恒威	332	11,407.52	0.00
86	301196	唯科科技	271	10,690.95	0.00
87	301116	益客食品	577	10,357.15	0.00
88	301199	迈赫股份	402	9,836.94	0.00
89	301130	西点药业	237	9,745.44	0.00
90	688208	道通科技	245	9,559.90	0.00
91	301228	实朴检测	373	9,500.31	0.00
92	301092	争光股份	323	9,202.27	0.00
93	301138	华研精机	285	8,641.20	0.00
94	301181	标榜股份	257	7,848.78	0.00
95	301193	家联科技	297	7,591.32	0.00
96	301098	金埔园林	307	6,981.18	0.00
97	301072	中捷精工	181	6,899.72	0.00
98	301182	凯旺科技	294	6,676.74	0.00
99	301198	喜悦智行	262	6,576.20	0.00
100	301081	严牌股份	403	6,516.51	0.00
101	301073	君亭酒店	144	6,487.20	0.00
102	301083	百胜智能	416	5,799.04	0.00
103	301030	仕净科技	242	5,517.60	0.00
104	301063	海锅股份	153	4,899.06	0.00
105	300854	中兰环保	203	4,796.89	0.00
106	301068	大地海洋	144	4,088.16	0.00
107	301079	邵阳液压	140	3,655.40	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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	17,982,771.00	1.63
2	600161	天坛生物	7,543,922.54	0.69
3	600690	海尔智家	6,793,720.00	0.62
4	600919	江苏银行	5,868,956.30	0.53
5	601939	建设银行	5,636,020.00	0.51
6	002008	大族激光	4,264,000.00	0.39
7	300347	泰格医药	4,180,886.00	0.38
8	002262	恩华药业	3,813,744.00	0.35
9	601985	中国核电	3,790,623.00	0.34
10	600745	闻泰科技	3,436,533.00	0.31
11	601225	陕西煤业	3,382,204.00	0.31
12	600845	宝信软件	2,764,323.00	0.25
13	603019	中科曙光	2,635,123.00	0.24
14	600038	中直股份	2,438,637.00	0.22
15	300253	卫宁健康	2,179,439.00	0.20
16	600309	万华化学	2,175,073.00	0.20
17	000858	五粮液	2,160,696.00	0.20
18	601009	南京银行	2,095,614.00	0.19
19	002460	赣锋锂业	2,059,326.56	0.19
20	603986	兆易创新	1,994,412.00	0.18

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600085	同仁堂	7,385,790.00	0.67

2	002557	洽洽食品	6,945,699.00	0.63
3	601985	中国核电	4,923,675.00	0.45
4	000858	五粮液	4,915,962.02	0.45
5	300347	泰格医药	4,379,220.48	0.40
6	002138	顺络电子	4,010,442.00	0.36
7	600519	贵州茅台	3,950,254.00	0.36
8	300059	东方财富	3,845,109.04	0.35
9	002043	兔宝宝	3,472,189.00	0.32
10	002008	大族激光	3,308,597.00	0.30
11	600886	国投电力	3,195,399.80	0.29
12	002262	恩华药业	3,158,467.00	0.29
13	002415	海康威视	3,145,746.00	0.29
14	688169	石头科技	2,806,557.74	0.26
15	601939	建设银行	2,786,848.00	0.25
16	688208	道通科技	2,427,932.38	0.22
17	002507	涪陵榨菜	2,294,612.00	0.21
18	603486	科沃斯	2,253,298.34	0.20
19	600111	北方稀土	2,242,545.00	0.20
20	600104	上汽集团	2,166,239.00	0.20

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	112,098,030.50
卖出股票收入（成交）总额	111,129,354.10

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	83,006,220.84	9.51

2	央行票据	-	-
3	金融债券	366,996,539.18	42.02
	其中：政策性金融债	71,411,767.13	8.18
4	企业债券	100,622,916.07	11.52
5	企业短期融资券	61,133,071.23	7.00
6	中期票据	140,640,986.58	16.10
7	可转债（可交换债）	183,016.04	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	752,582,749.94	86.18

### 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	019664	21国债16	700,000	70,675,797.26	8.09
2	2128013	21交通银行小微债	500,000	52,114,301.37	5.97
3	2128039	21中国银行二级03	500,000	50,568,424.66	5.79
4	102101642	21晋能电力MTN001	400,000	42,217,170.41	4.83
5	2120025	21杭州银行小微债01	400,000	41,758,356.16	4.78

### 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 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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

## 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	132,727.04
2	应收清算款	59,871,190.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	343,746.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,347,664.79

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息(转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
兴业聚惠混合A	845	15,810.49	0.00	0.00%	13,359,861.06	100.00%
兴业聚惠混合C	18,530	7,532.96	90,285,158.37	64.68%	49,300,681.67	35.32%
合计	19,292	7,927.93	90,285,158.37	59.03%	62,660,542.73	40.97%

注：1、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。  
2、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴业聚惠混合A	81,699.56	0.6115%
	兴业聚惠混合C	400.34	0.0003%

	合计	82,099.90	0.0537%
--	----	-----------	---------

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	兴业聚惠混合A	0
	兴业聚惠混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	兴业聚惠混合A	0
	兴业聚惠混合C	0
	合计	0

## §9 基金份额持有人信息(转型前)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
兴业 聚惠 灵活 配置 混合A	1,797	72,418.39	111,21 2,896. 38	85.4 6%	18,92 2,941. 96	14.54%
兴业 聚惠 灵活 配置	89,040	4,490.41	235,26 7,139. 82	58.8 4%	164,55 9,399. 80	41.16%

混合C						
合计	90,837	5,834.21	346,480,036.20	65.38%	183,482,341.76	34.62%

注：1、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。  
2、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴业聚惠灵活配置混合A	81,699.56	0.0628%
	兴业聚惠灵活配置混合C	410.38	0.0001%
	合计	82,109.94	0.0155%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	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	兴业聚惠灵活配置混合A	0
	兴业聚惠灵活配置混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业聚惠灵活配置混合A	0
	兴业聚惠灵活配置混合C	0

	合计	0
--	----	---

### §10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
基金合同生效日(2022年03月16日)基金份额总额	130,135,838.34	399,826,539.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	757,033.69	54,886,873.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	117,533,010.97	315,127,573.15
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	13,359,861.06	139,585,840.04

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

### §10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C
基金合同生效日(2015年07月08日)基金份额总额	207,655,310.13	-
本报告期期初基金份额总额	151,350,166.22	474,943,188.07
本报告期基金总申购份额	1,067,630.17	79,538,035.45
减：本报告期基金总赎回份额	22,281,958.05	154,654,683.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	130,135,838.34	399,826,539.62

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

### §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，兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金自2022年2月15日起至2022年3月15日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2022年3月16日表决通过了《关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚惠混合型证券投资基金有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会决议，本基金修订后的《兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同》、《兴业聚惠混合型证券投资基金托管协议》以及《兴业聚惠混合型证券投资基金招募说明书》于2022年3月16日生效。

## 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

1、2022年1月13日，云凤生先生担任兴业基金管理有限公司首席信息官，详见本公司于2022年1月14日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2022年8月8日，张玲菡女士离任兴业基金管理有限公司副总经理，担任兴业基金管理有限公司督察长，总经理胡斌先生不再代行督察长职务。详见本公司于2022年8月9日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、本报告期内，基金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

根据基金份额持有人大会决议，自2022年3月16日起，兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚惠混合型证券投资基金，投资策略由“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。”改变为“本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。主要投资策略为资产配置策略、债券类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、风险管理策略。”

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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8年。

由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）继续执行2022年年度报告审计。

## 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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 转型后

报告期2022年03月16日 - 2022年12月31日

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	12,199,352.00	2.75%	5,261.60	1.64%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	431,796,109.27	97.25%	315,769.54	98.36%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

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)。

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，本期未新增券商交易单元，剔除券商交易单元：华创证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

方正证券	209,923.00	0.12%	88,755,000.00	1.03%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	176,400,102.69	99.88%	8,564,600,000.00	98.97%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 转型前

报告期2022年01月01日 - 2022年03月15日

### 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	54,030,823.19	25.23%	50,318.43	30.06%	-
华创证券	2	22,805,249.90	10.65%	16,677.59	9.96%	-
天风证券	2	137,281,036.09	64.11%	100,391.74	59.98%	-

兴业 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	4	-	-	-	-	-

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 资历雄厚，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)。

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，本期未新增交易单元，剔除交易单元：中信建投证券股份有限公司。

## 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	10,025,418.63	3.74%	5,000,000.00	0.17%	-	-	-	-
天风证券	257,817,485.58	96.26%	2,995,500,000.00	99.83%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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旗下资产管理产品执行新金融工具相关准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-01
2	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-14
3	兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-01-24
4	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定的媒介	2022-02-14
5	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵	中国证监会规定的媒介	2022-02-15

	活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
6	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2022-02-16
7	兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2022-03-05
8	兴业基金管理有限公司关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
9	兴业聚惠混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
10	兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
11	兴业聚惠混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
12	兴业聚惠混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
13	兴业聚惠混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定的媒介	2022-03-31
14	兴业聚惠混合型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-04-22
15	关于网络平台冒用兴业财富名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会规定的媒介	2022-04-25
16	兴业基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司业务合作的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28

17	兴业基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司业务合作的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28
18	兴业聚惠混合型证券投资基金2022年第二季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-07-21
19	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-08-09
20	兴业聚惠混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2022-08-19
21	兴业基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级评级的通知	中国证监会规定的媒介	2022-08-23
22	兴业聚惠混合型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定的媒介	2022-08-31
23	兴业聚惠混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-09-16
24	兴业聚惠混合型证券投资基金招募说明书更新（2022年第1号）	中国证监会规定的媒介	2022-09-20
25	兴业聚惠混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2022-09-20
26	兴业聚惠混合型证券投资基金2022年第三季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-10-26

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20221129-20221231	17,170,329.67	34,938,125.10	17,170,329.67	34,938,125.10	22.84%
	2	20220221-20221231	102,716,982.36	21,889,400.92	74,000,000.00	50,606,383.28	33.09%
产品特有风险							



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

上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业聚惠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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

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  
二〇二三年三月三十一日