

---

**兴业聚源混合型证券投资基金**  
(原兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型)

**2021年第4季度报告**

**2021年12月31日**

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月24日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

原兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金报告期自2021年10月1日至2021年10月12日，兴业聚源混合型证券投资基金报告期自2021年10月13日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 转型后

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 兴业聚源混合  |
| 基金主代码      | 002660  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金转型合同生效日  | 2021年10月13日   |
| 报告期末基金份额总额 | 466,780,951.63份   |
| 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       | 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。<br>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。 |
| 业绩比较基准     | 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%。   |
| 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。   |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 基金管理人           | 兴业基金管理有限公司      |                |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司      |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 兴业聚源混合A         | 兴业聚源混合C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 002660          | 013742         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 438,608,837.72份 | 28,172,113.91份 |

### 转型前

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 兴业聚源灵活配置混合   |
| 基金主代码      | 002660   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016年06月30日  |
| 报告期末基金份额总额 | 490,079,569.46份  |
| 投资目标       | 本基金以价值投资为基础，通过对市场运行规律的预判，动态调整投资组合，在严格控制风险并保证流动性的前提下，力求获取超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略       | 本基金在严控风险的情况下，根据对宏观经济和市场风险特征变化的判断，以价值投资为基础，通过不断优化资产配置，追求稳健收益。           |
| 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。                            |
| 基金管理人      | 兴业基金管理有限公司   |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司   |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期(2021年10月13日 - 2021年12月31日) |            |
|------------|--------------------------------|------------|
|            | 兴业聚源混合A                        | 兴业聚源混合C    |
| 1. 本期已实现收益 | 7,286,732.35                   | 149,473.89 |

|                 |                |               |
|-----------------|----------------|---------------|
| 2. 本期利润         | 19,130,605.28  | 502,658.47    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0430         | 0.0558        |
| 4. 期末基金资产净值     | 634,003,103.67 | 40,707,879.55 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4455         | 1.4450        |

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

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

### 3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021年10月01日 - 2021年10月12日） |  |
|-----------------|--------------------------------|--|
| 1. 本期已实现收益      | 365,298.02                     |  |
| 2. 本期利润         | -1,705,070.72                  |  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0035                        |  |
| 4. 期末基金资产净值     | 716,032,985.99                 |  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.461                          |  |

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

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

### 3.2 基金净值表现(转型后)

#### 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

兴业聚源混合A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 3.11%  | 0.19%     | 0.86%      | 0.16%         | 2.25% | 0.03% |

注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型后的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

#### 兴业聚源混合C净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 1.88%  | 0.22%     | 0.87%      | 0.16%         | 1.01% | 0.06% |

注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型后的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

3、本基金合同自2021年10月13日起生效并增设C类份额，自2021年11月19日起C类份额存续。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型后的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

3、本基金合同自2021年10月13日起生效，截至报告期末本基金基金合同未满1年。

4、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末基金仍处于建仓期。



注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型后的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

3、本基金合同自2021年10月13日起生效，截至报告期末本基金基金合同未满1年。

4、根据本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末基金仍处于建仓期。

5、本基金合同自2021年10月13日起生效并增设C类份额，自2021年11月19日起C类份额存续。

### 3.2 基金净值表现(转型前)

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                             | 净值增长率① | 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(2021年10月01日-2021年10月12日) | -0.27% | 0.31%     | -0.04%     | 0.26%         | -0.23% | 0.05% |

|                                     |        |       |        |       |        |       |
|-------------------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月(2021年07月01日-2021年10月12日)      | 0.41%  | 0.29% | -0.72% | 0.24% | 1.13%  | 0.05% |
| 过去一年(2021年01月01日-2021年10月12日)       | 3.91%  | 0.32% | 0.00%  | 0.26% | 3.91%  | 0.06% |
| 过去三年(2019年01月01日-2021年10月12日)       | 30.21% | 0.30% | 13.55% | 0.26% | 16.66% | 0.04% |
| 过去五年(2017年01月01日-2021年10月12日)       | 40.08% | 0.24% | 13.02% | 0.24% | 27.06% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今(2016年06月30日-2021年10月12日) | 46.10% | 0.26% | 12.94% | 0.23% | 33.16% | 0.03% |

注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型前的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型前的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*20%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|------|-------------|------|--------|--|
|    |      | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 徐青 | 基金经理 | 2021-10-13  | -    | 10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 |

|    |      |            |            |     |   |
|----|------|------------|------------|-----|---|
|    |      |            |            |     | <p>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，现任基金经理。</p> |
| 徐青 | 基金经理 | 2019-02-22 | 2021-10-13 | 10年 | <p>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</p>                               |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 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，现任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，《兴业聚源混合型证券投资基金基金合同》、《兴业聚源混合型证券投资基金托管协议》以及《兴业聚源混合型证券投资基金招募说明书》于2021年10月13日生效。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，货币政策再宽松经历预期反复，又再度降准的波折。市场在资金平稳同时稳增长预期升温的情况下，整体窄幅波动，不具有明显的方向性。组合在11月初根据货币政策边际变化进行适度加仓并波段止盈，整体保持中性略偏积极的久期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年10月12日，兴业聚源灵活配置混合基金份额净值为1.461元；自2021年10月1日至2021年10月12日本基金份额净值增长率为-0.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

截至2021年12月31日，兴业聚源混合A基金份额净值为1.4455元；自2021年10月13日至2021年12月31日本基金份额净值增长率为3.11%，同期业绩比较基准收益率为0.86%。

截至2021年12月31日，兴业聚源混合C基金份额净值为1.4450元；自2021年10月13日至2021年12月31日本基金份额净值增长率为1.88%，同期业绩比较基准收益率为0.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告(转型后)

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 145,412,902.62 | 20.13        |
|    | 其中：股票             | 145,412,902.62 | 20.13        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 538,823,829.80 | 74.59        |
|    | 其中：债券             | 538,823,829.80 | 74.59        |
|    | 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      | 30,788,709.56  | 4.26         |
| 8  | 其他资产              | 7,401,035.88   | 1.02         |
| 9  | 合计                | 722,426,477.86 | 100.00       |

## 5.2 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         | 1,527,318.00   | 0.23         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 86,124,078.30  | 12.76        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,095,188.00  | 1.64         |
| E  | 建筑业              | 11,519.99      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 79,637.10      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 4,608.00       | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,371,736.01  | 2.13         |
| J  | 金融业              | 24,910,245.65  | 3.69         |
| 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       | 4,786,476.16   | 0.71         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 21,351.71      | 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          | 18,161.78      | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,462,581.92   | 0.36         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 145,412,902.62 | 21.55        |

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 526,291 | 19,530,659.01 | 2.89         |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 410,500 | 9,638,540.00  | 1.43         |
| 3  | 600085 | 同仁堂  | 167,100 | 7,516,158.00  | 1.11         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 601985 | 中国核电 | 894,000 | 7,420,200.00 | 1.10 |
| 5  | 300253 | 卫宁健康 | 399,200 | 6,690,592.00 | 0.99 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 87,200  | 6,436,232.00 | 0.95 |
| 7  | 002557 | 洽洽食品 | 103,200 | 6,332,352.00 | 0.94 |
| 8  | 300347 | 泰格医药 | 37,000  | 4,728,600.00 | 0.70 |
| 9  | 600570 | 恒生电子 | 75,540  | 4,694,811.00 | 0.70 |
| 10 | 002138 | 顺络电子 | 122,500 | 4,677,050.00 | 0.69 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 40,008,000.00  | 5.93         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 191,172,000.00 | 28.33        |
|    | 其中：政策性金融债 | 110,352,000.00 | 16.36        |
| 4  | 企业债券      | 106,542,000.00 | 15.79        |
| 5  | 企业短期融资券   | 100,343,000.00 | 14.87        |
| 6  | 中期票据      | 80,993,500.00  | 12.00        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 23,329.80      | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | 19,742,000.00  | 2.93         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 538,823,829.80 | 79.86        |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 210215    | 21国开15      | 1,100,000 | 110,352,000.00 | 16.36        |
| 2  | 019649    | 21国债01      | 400,000   | 40,008,000.00  | 5.93         |
| 3  | 2128047   | 21招商银行永续债   | 300,000   | 30,243,000.00  | 4.48         |
| 4  | 101900328 | 19沪港务MTN001 | 300,000   | 30,207,000.00  | 4.48         |
| 5  | 042100344 | 21晋能电力CP002 | 300,000   | 30,114,000.00  | 4.46         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 63,555.44    |
| 2 | 应收证券清算款 | -            |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 7,334,533.24 |
| 5 | 应收申购款   | 2,947.20     |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 其他      | -            |
| 8 | 合计      | 7,401,035.88 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告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。

### §5 投资组合报告（转型前）

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 151,584,402.48 | 20.66            |
|    | 其中：股票             | 151,584,402.48 | 20.66            |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 546,199,564.00 | 74.44            |
|    | 其中：债券             | 546,199,564.00 | 74.44            |
|    | 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          | 18,000,347.00  | 2.45             |
|    | 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      | 10,207,042.41  | 1.39             |
| 8  | 其他资产              | 7,764,668.84   | 1.06             |
| 9  | 合计                | 733,756,024.73 | 100.00           |

## 5.2 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              | 7,197,509.00   | 1.01         |
| C  | 制造业              | 69,037,342.11  | 9.64         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,463,212.00   | 1.32         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 7,281,534.96   | 1.02         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 3,244.32       | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 22,404,820.00  | 3.13         |
| J  | 金融业              | 32,261,726.00  | 4.51         |
| 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       | 3,911,345.06   | 0.55         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 14,546.11      | 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          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 9,122.92       | 0.00         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 151,584,402.48 | 21.17        |

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 552,691 | 18,117,210.98 | 2.53         |
| 2  | 002236 | 大华股份 | 499,800 | 11,775,288.00 | 1.64         |
| 3  | 300253 | 卫宁健康 | 789,700 | 11,008,418.00 | 1.54         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 4  | 002557 | 洽洽食品 | 197,300   | 9,306,641.00 | 1.30 |
| 5  | 600570 | 恒生电子 | 134,840   | 7,658,912.00 | 1.07 |
| 6  | 601607 | 上海医药 | 375,200   | 7,203,840.00 | 1.01 |
| 7  | 600028 | 中国石化 | 1,595,900 | 7,197,509.00 | 1.01 |
| 8  | 601985 | 中国核电 | 920,000   | 6,062,800.00 | 0.85 |
| 9  | 600926 | 杭州银行 | 288,200   | 4,435,398.00 | 0.62 |
| 10 | 002138 | 顺络电子 | 128,300   | 4,274,956.00 | 0.60 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 50,035,000.00  | 6.99         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 80,376,000.00  | 11.23        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 133,121,500.00 | 18.59        |
| 5  | 企业短期融资券   | 100,107,000.00 | 13.98        |
| 6  | 中期票据      | 182,482,000.00 | 25.49        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 78,064.00      | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 546,199,564.00 | 76.28        |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019649    | 21国债01      | 500,000 | 50,035,000.00 | 6.99         |
| 2  | 101900763 | 19鲁钢铁MTN001 | 300,000 | 30,390,000.00 | 4.24         |
| 3  | 102100810 | 21电网MTN001  | 300,000 | 30,219,000.00 | 4.22         |
| 4  | 101900328 | 19沪港务MTN001 | 300,000 | 30,195,000.00 | 4.22         |
| 5  | 042100344 | 21晋能电力CP002 | 300,000 | 30,048,000.00 | 4.20         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 58,916.52 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 7,678,152.42 |
| 5 | 应收申购款 | 27,599.90    |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 7,764,668.84 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|
| 1  | 123107 | 温氏转债 | 78,064.00 | 0.01         |

#### 5.11.5 报告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。

### § 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

|                                    | 兴业聚源混合A        | 兴业聚源混合C       |
|------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2021年10月13日)基金份额总额         | 490,079,569.46 | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 79,569,981.30  | 28,177,869.51 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 131,040,713.04 | 5,755.60      |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -             |
| 报告期期末基金份额总额                        | 438,608,837.72 | 28,172,113.91 |

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。

### § 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

|                |                |
|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 490,768,730.00 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 36,466.96      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 725,627.50     |

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 490,079,569.46 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 20211210-20211212      | 69,178,905.35 | 14,100,394.81 | -          | 83,279,300.16 | 17.84% |

#### 产品特有风险

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

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日表决通过了《关于

兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源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，《兴业聚源混合型证券投资基金基金合同》、《兴业聚源混合型证券投资基金托管协议》以及《兴业聚源混合型证券投资基金招募说明书》于2021年10月13日生效。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 9.3 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

2022年01月24日