
兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

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:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2022 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2022年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴业聚利灵活配置混合
基金主代码	001272
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月07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	86,772,021.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金旨在力争获得高于业绩比较基准的投资收益，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1%。
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	胡斌
	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	上海证券报
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

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	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	42,894,424.36	78,939,713.12	51,816,546.67
本期利润	31,830,133.17	60,292,297.79	77,010,347.54
加权平均基金份额本期利润	0.3646	0.5714	0.5206
本期加权平均净值利润率	15.60%	30.31%	37.00%
本期基金份额净值增长率	17.34%	35.61%	48.30%

3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	135,796,979.52	103,721,756.26	74,975,103.18
期末可供分配基金份额利润	1.5650	1.1863	0.6120
期末基金资产净值	222,569,000.77	191,155,540.68	197,479,959.27
期末基金份额净值	2.565	2.186	1.612
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	156.50%	118.60%	61.20%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.38%	0.92%	0.95%	0.01%	8.43%	0.91%
过去六个月	12.45%	1.04%	1.89%	0.01%	10.56%	1.03%
过去一年	17.34%	0.96%	3.75%	0.01%	13.59%	0.95%
过去三年	135.97%	0.99%	11.25%	0.01%	124.72%	0.98%
过去五年	71.92%	1.01%	18.75%	0.01%	53.17%	1.00%
自基金合同生效起至今	156.50%	0.93%	25.19%	0.01%	131.31%	0.92%

注：本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）+1%

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



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：本基金基金合同于2015年5月7日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，兴业基金不忘“受人之托、代客理财”的初心本源，牢记“打造一家市场化程度高、专业性强、特色鲜明的优秀基金公司”的责任使命，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，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2021年12月31日，兴业基金共管理79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		
冯烜	权益投资总监、基金经理	2018-09-10	-	18年	中国籍，加拿大多伦多大学MBA及中国人民大学经济学硕士，特许金融分析师（CFA），具有证券投资基金从业资格。2002年7月至2003年8月在第一创业证券有限公司证券投资部

				担任研究员。2005年11月至2011年3月在汇丰晋信基金管理有限公司投资部担任研究员、高级研究员、基金经理，期间2009年7月至2010年12月担任汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理，2010年1月至2011年3月担任汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理。2011年3月至2014年6月在中国国际金融有限公司资产管理部担任投资经理（执行总经理级别），管理中金安心回报、中金股票策略、中金股票精选集合资产管理计划。2014年6月至2015年1月在汇丰晋信基金管理有限公司担任QFII投资咨询部总监，负责四只QFII基金的A股投顾工作。2015年2月加入兴业基金管理有限公司，现任权益投资总监、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、本基金自2022年3月4日起增加徐玉良为基金经理，自2022年3月7日起冯烜不再担任本基金基金经理，详情请见本基金管理人于2022年3月5日、2022年3月8日发布的《兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年一季度市场先涨后跌，春节前大幅上涨并且估值处于高位的核心资产在春节后快速调整，直接的触发因素是美债收益率上行。一季度科创50和创业板指数在主要指数中表现较差。二季度经济数据总体表现较好，社融数据开始下行但信贷仍较强，由于市场利率从高位有所回落、市场流动性合理充裕，市场在二季度总体呈震荡反弹格局，科创50指数及创业板指数领涨。三季度经济数据总体不佳，消费及投资数据均较疲弱，社融数据开始下行，经济呈现一定的类滞胀（上游胀）格局，信贷政策及房地产政策开始微调，拉闸限电的做法也开始纠偏。涨幅较大的科创50指数及创业板指数在三季度调整较明显。钢铁煤炭等受益于拉闸限电及价格上涨的板块三季度表现突出，大资管大财富逻辑推动券商板块明显上涨，医药消费板块三季度震荡调整。四季度经济数据总体不佳，消费及投资数据均较疲弱，社融数据（特别是企业中长期贷款）总体偏低、但11月开始反弹，PPI高位运行、CPI低位运行，中游制造业两头受压，大量制造业公司毛利率明显下降。四季度宏观政策开始边际宽松，市场在四季度总体呈震荡反弹格局，军工股

表现突出，消费股震荡反弹，全年强势的新能源及新能源汽车展开震荡，医药中的CXO热门赛道出现调整。

全年A股主要指数的收益率分布在-5%至12%，创业板指数表现最好。行业表现分化极大，全年来看，成长性较好的热门赛道领涨。

本基金全年总体保持了较高的股票仓位，上半年主要投资了金融地产、建筑、食品饮料、轻工等板块，在调整中增持了食品饮料，在反弹中减持了医药、计算机等个股。三季度本基金在上涨中减持了券商股，在调整中增持了消费股，四季度在个股层面做了一定交易。组合整体估值较低，基金年底主要配置的产业有金融地产、食品饮料、轻工、电子、建筑、医药、机械等。

本基金2021年收益率17.34%，显著超越了基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业聚利灵活配置混合基金份额净值为2.565元，本报告期内，基金份额净值增长率为17.34%，同期业绩比较基准收益率为3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期经济数据总体仍偏弱，投资和消费仍疲弱，出口数据相对较好。PPI开始高位回落，制造业成本端的压力有所缓和。各种数据显示国内经济总体偏弱，短期内仍缺乏动力。宏观政策稳字当头，稳增长的需求较强，四季度推出对双碳行业的再贷款政策，还进行了降准，LPR及MLF利率均开始下调，后续LPR降息及降准仍可期，地方层面也正在对房地产适度放松，一季度开始专项债推动的基建投资相对积极。前两个月调整之后A股市场可能整体震荡、结构性特征较强，传统行业中不少优质公司处于估值低位，伴随政策边际宽松及一季度基本面大概率企稳改善，中期内估值修复仍有空间，有相对可把握的绝对收益机会；高景气赛道中的不少细分领域长期成长空间较大，调整后可精选个股长期投资；另一方面，高估值板块不少个股尽管近期已有调整、但仍面临业绩压力。

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，2021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，进一步完善制度流程和授权管理机制，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：报告期内公司重外规宣贯和培训，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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

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、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。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。
会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。
定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。
本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

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(22)第P01821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	兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、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，公允反映了兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金 2021年12月31日的财务状况以及2021年度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，我们独立于兴业聚利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利灵活配置混合型证券投资基金2021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

	<p>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利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利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。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴业聚利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</p>

	<p>据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、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，就可能对兴业聚利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利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	上海市延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2022-03-28	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	14,953,627.27	3,467,878.30
结算备付金		104,628.78	328,912.44
存出保证金		87,653.03	88,807.60
交易性金融资产	7.4.7.2	214,914,141.48	187,030,980.62
其中：股票投资		202,632,019.28	174,082,980.62
基金投资		-	-
债券投资		12,282,122.20	12,948,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	902,616.93
应收利息	7.4.7.5	271,844.03	105,966.66
应收股利		-	-
应收申购款		136,158.29	170,756.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		230,468,052.88	192,095,919.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		7,102,918.16	-
应付赎回款		259,386.80	418,498.21
应付管理人报酬		203,590.24	216,373.37
应付托管费		16,965.88	18,031.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	137,191.03	117,475.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.00	170,000.00
负债合计		7,899,052.11	940,378.50
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	86,772,021.25	87,433,784.42
未分配利润	7.4.7.10	135,796,979.52	103,721,756.26
所有者权益合计		222,569,000.77	191,155,540.68
负债和所有者权益总计		230,468,052.88	192,095,919.18

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值2.565元，基金份额总额86,772,021.25份。

7.2 利润表

会计主体：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		35,684,147.62	64,030,771.80
1. 利息收入		306,567.29	486,486.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	43,613.27	72,682.71
债券利息收入		239,189.16	186,846.04

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,764.86	226,957.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		46,247,537.94	82,106,304.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	41,152,416.47	78,671,965.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	100,422.91	78,184.14
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,994,698.56	3,356,155.07
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-11,064,291.19	-18,647,415.33
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	194,333.58	85,396.62
减：二、费用		3,854,014.45	3,738,474.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	2,458,895.20	2,381,608.09
2. 托管费	7.4.10.2. 2	204,908.07	198,467.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	971,068.57	947,667.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.13

7. 其他费用	7.4.7.19	219,142.61	210,731.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,830,133.17	60,292,297.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,830,133.17	60,292,297.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	87,433,784.42	103,721,756.26	191,155,540.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,830,133.17	31,830,133.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-661,763.17	245,090.09	-416,673.08
其中：1. 基金申购款	54,617,935.66	74,063,586.63	128,681,522.29
2. 基金赎回款	-55,279,698.83	-73,818,496.54	-129,098,195.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	86,772,021.25	135,796,979.52	222,569,000.77
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	122,504,856.09	74,975,103.18	197,479,959.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	60,292,297.79	60,292,297.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-35,071,071.67	-31,545,644.71	-66,616,716.38
其中：1. 基金申购款	12,984,896.00	11,382,945.10	24,367,841.10
2. 基金赎回款	-48,055,967.67	-42,928,589.81	-90,984,557.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	87,433,784.42	103,721,756.26	191,155,540.68

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

兴业聚利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》、《兴业聚利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]680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 5,005,036,402.75 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0580号的验资报告。基金合同于2015年5月7日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、银行存款、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、债券回购等)、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,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:三年期银行定期存款利率(税后)+1%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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2021年12月31日的财务状况以及2021年度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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

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

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

2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于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股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资

产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

– 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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。

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

– 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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

资产支持证券投资收益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与应收利息(若有)后的差额确认。

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

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，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。

– 公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2) 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；

3) 每一基金份额享有同等分配权；

4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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]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，对受让方不再缴纳印花税。

5) 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	14,953,627.27	3,467,878.30
定期存款	-	-
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	-	-
合计	14,953,627.27	3,467,878.30

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		222,069,373.95	202,632,019.28	-19,437,354.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,293,630.51	12,282,122.20	-11,508.31
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,293,630.51	12,282,122.20	-11,508.31
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		234,363,004.46	214,914,141.48	-19,448,862.98
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		182,520,033.41	174,082,980.62	-8,437,052.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	12,895,519.00	12,948,000.00	52,481.00
	合计	12,895,519.00	12,948,000.00	52,481.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		195,415,552.41	187,030,980.62	-8,384,571.79

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

本基金本报告期末及上年度末均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均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,579.86	655.64
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	51.81	162.91
应收债券利息	270,168.91	105,104.11
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	43.45	44.00
合计	271,844.03	105,966.66

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	137,191.03	117,293.29
银行间市场应付交易费用	-	182.50
合计	137,191.03	117,475.79

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	179,000.00	170,000.00
合计	179,000.00	170,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,433,784.42	87,433,784.42
本期申购	54,617,935.66	54,617,935.66
本期赎回（以“-”号填列）	-55,279,698.83	-55,279,698.83
本期末	86,772,021.25	86,772,021.25

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期年赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	120,225,865.08	-16,504,108.82	103,721,756.26
本期利润	42,894,424.36	-11,064,291.19	31,830,133.17
本期基金份额交易产生的变动数	-170,680.17	415,770.26	245,090.09
其中：基金申购款	94,392,506.06	-20,328,919.43	74,063,586.63
基金赎回款	-94,563,186.23	20,744,689.69	-73,818,496.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	162,949,609.27	-27,152,629.75	135,796,979.52

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	35,895.69	48,457.11
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	6,532.52	22,417.90
其他	1,185.06	1,807.70
合计	43,613.27	72,682.71

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	358,334,567.79	361,595,909.04
减：卖出股票成本总额	317,182,151.32	282,923,943.87
买卖股票差价收入	41,152,416.47	78,671,965.17

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	100,422.91	78,184.14
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	100,422.91	78,184.14

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,840,521.23	32,839,496.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,445,034.79	32,162,198.30
减：应收利息总额	295,063.53	599,113.57
买卖债券差价收入	100,422.91	78,184.14

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
股票投资产生的股利收益	4,994,698.56	3,356,155.07

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,994,698.56	3,356,155.07

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-11,064,291.19	-18,647,415.33
——股票投资	-11,000,301.88	-18,687,356.33
——债券投资	-63,989.31	39,941.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-11,064,291.19	-18,647,415.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	194,125.70	84,990.71
转换费收入	207.88	355.59
其他	-	50.32
合计	194,333.58	85,396.62

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	971,068.57	946,827.35
银行间市场交易费用	-	839.75
合计	971,068.57	947,667.10

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
汇划手续费	3,242.61	3,531.38
帐户维护费	45,900.00	37,200.00
合计	219,142.61	210,731.38

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”）	基金管理人、基金销售机构、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、基金销售机构

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	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：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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内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 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,458,895.20	2,381,608.09
其中：支付销售机构的客户维护费	226,041.63	256,731.85

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1.20%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×1.20%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	204,908.07	198,467.31

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，逐日累计至每月月底，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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业财富	0.00	0.00%	10,944,760.90	12.52%

注：关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	14,953,627.27	35,895.69	3,467,878.30	48,457.11

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的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（2021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	可流通日	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
688296	和达科技	2021-07-19	2022-01-27	科创板打新限售	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688768	容知日新	2021-07-16	2022-01-26	科创板打新限售	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688697	纽威数控	2021-09-	2022-03-	科创板打	7.55	16.03	5,837	44,069.3	93,567.1	-

		09	17	新限售				5	1	
688787	海天瑞声	2021-08-05	2022-02-14	科创板打新限售	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	1,562	65,572.76	65,572.76	-
688255	凯尔达	2021-10-14	2022-04-25	科创板打新限售	47.11	37.87	1,078	50,784.58	40,823.86	-
688722	同益中	2021-10-08	2022-04-19	科创板打新限售	4.51	10.19	3,687	16,628.37	37,570.53	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	416	5,882.24	37,385.92	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.74	80	4,851.20	18,779.20	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	创业板打新限售	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
3011	海力	2021	2022	创业	60.6	96.7	164	9,94	15,8	-

55	风电	-11-17	-05-24	板打 新限售	6	5		8.24	67.00	
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业 板打 新限售	11.90	45.45	315	3,748.50	14,316.75	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	创业 板打 新限售	22.70	49.02	290	6,583.00	14,215.80	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	创业 板打 新限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	创业 板打 新限售	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业 板打 新限售	22.04	56.28	243	5,355.72	13,676.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业 板打 新限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业 板打 新限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	创业 板打 新限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

				售						
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	创业板打新限售	19.11	67.93	187	3,573.57	12,702.91	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	创业板打新限售	25.80	33.65	344	8,875.20	11,575.60	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板打新限售	6.96	12.51	909	6,326.64	11,371.59	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	创业板打新限售	13.00	20.48	509	6,617.00	10,424.32	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板打新限售	93.09	75.34	137	12,753.33	10,321.58	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-18	创业板打新限售	4.13	12.96	756	3,122.28	9,797.76	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	26.17	44.86	216	5,652.72	9,689.76	-
3010	东亚	2021	2022	创业	5.31	13.5	717	3,80	9,67	-

28	机械	-07-12	-01-20	板打 新限 售		0		7.27	9.50	
3011 01	明月 镜片	2021 -12- 09	2022 -06- 16	创业 板打 新限 售	26.9 1	43.3 6	223	6,00 0.93	9,66 9.28	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	创业 板打 新限 售	10.4 5	11.2 2	843	8,80 9.35	9,45 8.46	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3011 77	迪阿 股份	2021 -12- 08	2022 -06- 15	创业 板打 新限 售	116. 88	116. 08	80	9,35 0.40	9,28 6.40	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3010 78	孩子 王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	创业 板打 新限 售	5.77	12.1 4	756	4,36 2.12	9,17 7.84	-
3010 62	上海 艾录	2021 -09- 07	2022 -03- 14	创业 板打 新限 售	3.31	17.0 1	523	1,73 1.13	8,89 6.23	-
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -03- 01	创业 板打 新限	8.11	33.6 4	252	2,04 3.72	8,47 7.28	-

				售						
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 19	创业 板打 新限 售	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	创业 板打 新限 售	39.0 8	52.1 3	155	6,05 7.40	8,08 0.15	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	创业 板打 新限 售	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3010 91	深城 交	2021 -10- 20	2022 -04- 29	创业 板打 新限 售	36.5 0	31.3 1	249	9,08 8.50	7,79 6.19	-
3010 30	仕净 科技	2021 -07- 15	2022 -01- 24	创业 板打 新限 售	6.10	31.5 2	242	1,47 6.20	7,62 7.84	-
3011 00	风光 股份	2021 -12- 10	2022 -06- 17	创业 板打 新限 售	27.8 1	31.1 4	236	6,56 3.16	7,34 9.04	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	29.2 8	32.0 0	227	6,64 6.56	7,26 4.00	-
3011 82	凯旺 科技	2021 -12- 16	2022 -06- 23	创业 板打 新限 售	27.1 2	30.5 8	234	6,34 6.08	7,15 5.72	-
3011	奥尼	2021	2022	创业	66.1	56.6	126	8,33	7,13	-

89	电子	-12-21	-06-28	板打 新限售	8	2		8.68	4.12	
301081	严牌 股份	2021-10-13	2022-04-20	创业 板打 新限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔 园林	2021-11-04	2022-05-12	创业 板打 新限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301198	喜悦 智行	2021-11-25	2022-06-02	创业 板打 新限售	21.76	29.20	223	4,852.48	6,511.60	-
301033	迈普 医学	2021-07-15	2022-01-26	创业 板打 新限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301032	新柴 股份	2021-07-15	2022-01-24	创业 板打 新限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫 股份	2021-08-27	2022-03-07	创业 板打 新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301072	中捷 精工	2021-09-22	2022-03-29	创业 板打 新限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜 智能	2021-10-13	2022-04-21	创业 板打 新限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-

				售						
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	36.31	35.52	165	5,991.15	5,860.80	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	115	6,679.20	5,732.75	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	23.38	29.93	190	4,442.20	5,686.70	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.92	171	3,307.14	5,629.32	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	创业板打新限售	27.85	27.46	203	5,653.55	5,574.38	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板打新限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板打新限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	创业板打新限售	30.73	29.14	189	5,807.97	5,507.46	-
0012	泰慕	2021	2022	新股	16.5	16.5	333	5,50	5,50	-

34	士	-12-31	-01-11	未上市	3	3		4.49	4.49	
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	创业板打新限售	43.99	50.77	98	4,311.02	4,975.46	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板打新限售	79.60	78.53	61	4,855.60	4,790.33	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-17	创业板打新限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板打新限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-

301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	创业板打新限售	57.27	53.71	65	3,722.55	3,491.15	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板打新限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

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

本基金本报告期末持有的债券中无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末未持有按信用评级列示的债券。

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，按照穿透原则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 2021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	14,953,627.27	-	-	-	14,953,627.27
结算备付金	104,628.78	-	-	-	104,628.78
存出保证金	87,653.03	-	-	-	87,653.03
交易性金融资产	12,282,122.20	-	-	202,632,019.28	214,914,141.48

应收利息	-	-	-	271,844.03	271,844.03
应收申购款	-	-	-	136,158.29	136,158.29
资产总计	27,428,031.28	-	-	203,040,021.60	230,468,052.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,102,918.16	7,102,918.16
应付赎回款	-	-	-	259,386.80	259,386.80
应付管理人报酬	-	-	-	203,590.24	203,590.24
应付托管费	-	-	-	16,965.88	16,965.88
应付交易费用	-	-	-	137,191.03	137,191.03
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	-	-	-	7,899,052.11	7,899,052.11
利率敏感度缺口	27,428,031.28	-	-	195,140,969.49	222,569,000.77
上年度末 2020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	3,467,878.30	-	-	-	3,467,878.30
结算备付金	328,912.44	-	-	-	328,912.44
存出保证金	88,807.60	-	-	-	88,807.60
交易性金融资产	12,948,000.00	-	-	174,082,980.62	187,030,980.62
应收证券清算款	-	-	-	902,616.93	902,616.93
应收利息	-	-	-	105,966.66	105,966.66

应收申购款	-	-	-	170,756.63	170,756.63
资产总计	16,833,598.34	-	-	175,262,320.84	192,095,919.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	418,498.21	418,498.21
应付管理人报酬	-	-	-	216,373.37	216,373.37
应付托管费	-	-	-	18,031.13	18,031.13
应付交易费用	-	-	-	117,475.79	117,475.79
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	940,378.50	940,378.50
利率敏感度缺口	16,833,598.34	-	-	174,321,942.34	191,155,540.68

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	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-2,253.16	-12,022.10
	市场利率下降25个基点	2,259.18	12,062.71

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 2021年12月31日		上年度末 2020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	202,632,019.28	91.04	174,082,980.62	91.07
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—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	202,632,019.28	91.04	174,082,980.62	91.07
----	----------------	-------	----------------	-------

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	股票价格上升5%	10,131,600.96	8,704,149.03
	股票价格下降5%	-10,131,600.96	-8,704,149.03

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币201,506,988.70 元，属于第二层次的余额为人民币12,353,199.45元，属于第三层次的余额为人民币1,053,953.33 元（于 2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币173,299,792.30元，属于第二层次的余额为人民币13,731,188.29元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

截至本报告期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具属于第三层次的余额为人民币1,053,953.33元，系因新股锁定期而流通受限的股票，其估值根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》确定的模型计算得出。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	202,632,019.28	87.92
	其中：股票	202,632,019.28	87.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,282,122.20	5.33
	其中：债券	12,282,122.20	5.33
	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	15,058,256.05	6.53
8	其他各项资产	495,655.35	0.22
9	合计	230,468,052.88	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	1,188,250.00	0.53
C	制造业	106,432,329.58	47.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,171,019.99	1.87
F	批发和零售业	45,671.84	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	487,494.00	0.22
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	249,846.08	0.11
J	金融业	65,889,816.88	29.60
K	房地产业	14,552,422.00	6.54
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,525,486.70	4.28
N	水利、环境和公共设施管理业	20,528.71	0.01
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	0.01
R	文化、体育和娱乐业	46,383.72	0.02
S	综合	-	-
	合计	202,632,019.28	91.04

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	869,800	15,447,648.00	6.94
2	002078	太阳纸业	970,000	11,145,300.00	5.01
3	600196	复星医药	223,300	10,928,302.00	4.91
4	605339	南侨食品	326,564	10,881,112.48	4.89
5	000001	平安银行	652,600	10,754,848.00	4.83
6	603866	桃李面包	365,780	10,388,152.00	4.67
7	601318	中国平安	205,300	10,349,173.00	4.65
8	600887	伊利股份	243,405	10,091,571.30	4.53
9	601601	中国太保	361,400	9,801,168.00	4.40
10	002949	华阳国际	518,500	9,488,550.00	4.26
11	002146	荣盛发展	1,825,000	7,938,750.00	3.57
12	000910	大亚圣象	578,600	7,759,026.00	3.49
13	000002	万科A	334,700	6,613,672.00	2.97

14	002156	通富微电	326,600	6,345,838.00	2.85
15	601658	邮储银行	1,223,822	6,241,492.20	2.80
16	300718	长盛轴承	292,918	4,944,455.84	2.22
17	002511	中顺洁柔	290,400	4,852,584.00	2.18
18	600036	招商银行	90,400	4,403,384.00	1.98
19	000725	京东方 A	871,000	4,398,550.00	1.98
20	601668	中国建筑	831,900	4,159,500.00	1.87
21	601128	常熟银行	616,000	4,071,760.00	1.83
22	000333	美的集团	46,500	3,432,165.00	1.54
23	600999	招商证券	191,000	3,371,150.00	1.51
24	600745	闻泰科技	25,600	3,310,080.00	1.49
25	603195	公牛集团	19,000	3,178,700.00	1.43
26	002032	苏泊尔	36,300	2,259,312.00	1.02
27	600031	三一重工	97,900	2,232,120.00	1.00
28	000012	南玻 A	193,600	1,922,448.00	0.86
29	688012	中微公司	13,673	1,731,001.80	0.78
30	601233	桐昆股份	68,400	1,448,712.00	0.65
31	601939	建设银行	235,400	1,379,444.00	0.62
32	601899	紫金矿业	122,500	1,188,250.00	0.53
33	603501	韦尔股份	3,600	1,118,772.00	0.50
34	600966	博汇纸业	98,400	1,017,456.00	0.46
35	000651	格力电器	17,100	633,213.00	0.28
36	603517	绝味食品	9,200	628,636.00	0.28
37	688121	卓然股份	15,166	583,132.70	0.26
38	002468	申通快递	50,800	461,772.00	0.21
39	601100	恒立液压	2,800	229,040.00	0.10
40	688625	呈和科技	2,672	149,979.36	0.07
41	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.05
42	688768	容知日新	907	98,445.78	0.04
43	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.04
44	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.03

45	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.03
46	688262	国芯科技	1,562	65,572.76	0.03
47	688255	凯尔达	1,078	40,823.86	0.02
48	688517	金冠电气	2,892	39,446.88	0.02
49	688722	同益中	3,687	37,570.53	0.02
50	301029	怡合达	416	37,385.92	0.02
51	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
52	001317	三羊马	300	25,722.00	0.01
53	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
54	301050	雷电微力	80	18,779.20	0.01
55	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
56	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
57	301155	海力风电	164	15,867.00	0.01
58	300994	久祺股份	315	14,316.75	0.01
59	301118	恒光股份	290	14,215.80	0.01
60	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
61	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.01
62	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
63	301035	润丰股份	243	13,676.04	0.01
64	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
65	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
66	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
67	301089	拓新药业	187	12,702.91	0.01
68	301013	利和兴	471	12,104.70	0.01
69	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
70	301211	亨迪药业	344	11,575.60	0.01
71	301039	中集车辆	909	11,371.59	0.01
72	301188	力诺特玻	509	10,424.32	0.00
73	301087	可孚医疗	137	10,321.58	0.00
74	301048	金鹰重工	756	9,797.76	0.00
75	301138	华研精机	216	9,689.76	0.00

76	301028	东亚机械	717	9,679.50	0.00
77	301101	明月镜片	223	9,669.28	0.00
78	301090	华润材料	843	9,458.46	0.00
79	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
80	301177	迪阿股份	80	9,286.40	0.00
81	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
82	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
83	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
84	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
85	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
86	301168	通灵股份	155	8,080.15	0.00
87	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
88	301091	深城交	249	7,796.19	0.00
89	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
90	301100	风光股份	236	7,349.04	0.00
91	301199	迈赫股份	227	7,264.00	0.00
92	301182	凯旺科技	234	7,155.72	0.00
93	301189	C奥尼	126	7,134.12	0.00
94	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
95	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
96	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
97	301198	喜悦智行	223	6,511.60	0.00
98	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
99	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
100	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
101	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
102	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
103	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
104	301092	争光股份	165	5,860.80	0.00
105	301093	华兰股份	115	5,732.75	0.00
106	301036	双乐股份	190	5,686.70	0.00

107	301049	超越科技	171	5,629.32	0.00
108	301190	善水科技	203	5,574.38	0.00
109	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
110	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
111	301193	家联科技	189	5,507.46	0.00
112	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
113	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
114	301179	泽宇智能	98	4,975.46	0.00
115	301096	百诚医药	61	4,790.33	0.00
116	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
117	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00
118	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
119	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
120	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
121	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
122	301108	洁雅股份	65	3,491.15	0.00
123	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	600887	伊利股份	17,326,000.10	9.06
2	000001	平安银行	16,843,356.76	8.81
3	002032	苏泊尔	16,740,073.74	8.76
4	600745	闻泰科技	16,241,983.62	8.50
5	300718	长盛轴承	15,678,490.07	8.20
6	600196	复星医药	15,516,230.70	8.12
7	002557	洽洽食品	12,741,486.05	6.67
8	603866	桃李面包	12,673,108.16	6.63

9	002949	华阳国际	12,317,939.92	6.44
10	605339	南侨食品	12,019,853.72	6.29
11	002078	太阳纸业	11,777,160.21	6.16
12	000776	广发证券	10,836,461.00	5.67
13	601601	中国太保	8,869,667.00	4.64
14	688169	石头科技	8,240,582.19	4.31
15	688121	卓然股份	8,011,380.61	4.19
16	000725	京东方A	6,983,192.00	3.65
17	002156	通富微电	6,523,807.80	3.41
18	601128	常熟银行	6,411,422.00	3.35
19	002511	中顺洁柔	5,815,897.00	3.04
20	600519	贵州茅台	5,799,723.19	3.03
21	603995	甬金股份	5,710,376.39	2.99
22	600036	招商银行	5,097,849.00	2.67
23	601899	紫金矿业	4,768,356.00	2.49
24	000651	格力电器	4,766,747.00	2.49
25	600350	山东高速	4,293,753.00	2.25
26	688008	澜起科技	4,198,150.03	2.20
27	002555	三七互娱	4,091,901.58	2.14
28	605499	东鹏饮料	4,008,510.64	2.10

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	600745	闻泰科技	16,674,595.00	8.72
2	002032	苏泊尔	14,479,165.15	7.57
3	002557	洽洽食品	14,402,268.80	7.53
4	000776	广发证券	13,815,796.00	7.23
5	300718	长盛轴承	13,217,633.55	6.91

6	600887	伊利股份	13,085,664.37	6.85
7	601939	建设银行	12,985,821.00	6.79
8	603995	甬金股份	11,115,939.00	5.82
9	600036	招商银行	10,968,999.68	5.74
10	002949	华阳国际	10,663,527.95	5.58
11	688121	卓然股份	8,896,945.03	4.65
12	300284	苏交科	8,894,161.62	4.65
13	300166	东方国信	8,604,439.82	4.50
14	000001	平安银行	8,344,871.70	4.37
15	000538	云南白药	8,227,627.64	4.30
16	688169	石头科技	8,167,591.22	4.27
17	600196	复星医药	8,072,987.00	4.22
18	601398	工商银行	7,831,701.00	4.10
19	601658	邮储银行	7,757,145.00	4.06
20	600519	贵州茅台	6,266,618.00	3.28
21	601211	国泰君安	5,527,143.00	2.89
22	600048	保利发展	5,421,592.94	2.84
23	000651	格力电器	4,902,935.00	2.56
24	605499	东鹏饮料	4,704,617.00	2.46
25	600350	山东高速	4,631,464.00	2.42
26	600438	通威股份	4,459,448.00	2.33
27	600566	济川药业	4,431,125.00	2.32
28	601128	常熟银行	4,265,857.00	2.23
29	688008	澜起科技	4,123,993.57	2.16
30	002555	三七互娱	3,937,260.16	2.06
31	601818	光大银行	3,856,006.00	2.02

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	356,731,491.86
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	358,334,567.79
--------------	----------------

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	12,282,122.20	5.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,282,122.20	5.52

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	019649	21国债01	89,420	8,943,788.40	4.02
2	019628	20国债02	33,380	3,338,333.80	1.50

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现其它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	87,653.03

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	271,844.03
5	应收申购款	136,158.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	495,655.35

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

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,184	27,252.52	66,637,073.90	76.80%	20,134,947.35	23.20%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,020,910.12	1.1765%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	>100
-----------------	------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年05月07日)基金份额总额	5,005,036,402.75
本报告期期初基金份额总额	87,433,784.42
本报告期基金总申购份额	54,617,935.66
减：本报告期基金总赎回份额	55,279,698.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,772,021.25

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未产生基金份额持有人大会决议。

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、2021年6月30日，钱睿南先生担任兴业基金管理有限公司副总经理，详见本公司于2021年7月1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、2021年10月27日，庄孝强先生离任兴业基金管理有限公司总经理助理，详见本公司于2021年10月28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、2021年11月10日，王蕙女士离任兴业基金管理有限公司督察长，胡斌先生代任督察长，详见本公司于2021年11月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、2021年11月10日，张玲菡女士任兴业基金管理有限公司副总经理，详见本公司于2021年11月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

5、本基金托管人中国民生银行股份有限公司于2021年11月19日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内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7年。

由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）继续执行 2021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

1、本报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

2、本报告期内，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。

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	106,202,372.21	15.13%	77,666.15	15.01%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	152,063,687.57	21.66%	111,202.71	21.49%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风	2	114,925,174.76	16.37%	84,044.10	16.24%	-

证券						
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	45,301,245.39	6.45%	42,190.36	8.15%	-
中信 建投	2	28,998,091.83	4.13%	21,206.21	4.10%	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	254,668,560.29	36.27%	181,148.83	35.01%	-

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：广发
证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、长江证券股份有限公司。

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	成交金额	占当期	成交金	占当期	成交金	占当期

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	额	权证成交总额的比例	额	基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	11,529,268.00	42.10%	74,000,000.00	24.26%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	212,318.00	0.78%	16,000,000.00	5.25%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	4,437,153.10	16.20%	7,000,000.00	2.30%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	11,209,864.90	40.93%	208,000,000.00	68.20%	-	-	-	-

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旗下基金2020年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-01-22
2	兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第1号）	中国证监会规定的媒介	2021-03-19

3	兴业基金管理有限公司旗下公募基金2020年年度报告	中国证监会规定的媒介	2021-03-31
4	关于网络平台冒用“兴业基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会规定的媒介	2021-04-17
5	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-04-22
6	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	2021-07-01
7	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第二季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-07-21
8	兴业基金管理有限公司旗下公募基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2021-08-24
9	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年中期报告	中国证监会规定的媒介	2021-08-31
10	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第三季度报告	中国证监会规定的媒介	2021-10-27
11	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	2021-10-28
12	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	2021-11-11
13	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	2021-11-11

§ 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	1	20210101-20210209, 20210723-2	21,230,714.79	0.00	4,600,000.00	16,630,714.79	19.17%

构		0210819, 20211108-20211229					
	2	20211014-20211231	0.00	19,279,777.21	0.00	19,279,777.21	22.22%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：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利灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

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
二〇二二年三月三十一日

