
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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

原兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金报告期自2021年1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。

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	6
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	14
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）	14
3.1 主要会计数据和财务指标	15
3.2 基金净值表现	16
3.3 过去三年基金的利润分配情况	18
§4 管理人报告	18
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	21
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	31
7.2 利润表	32
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	34
7.4 报表附注	35
§7 年度财务报表(转型前)	68
7.1 资产负债表	68
7.2 利润表	70
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	72

7.4 报表附注.....	73
§8 投资组合报告(转型后)	105
8.1 期末基金资产组合情况.....	105
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	106
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.....	107
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.....	112
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.....	113
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.....	113
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.....	113
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	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.....	114
§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.....	116
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	120
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	121
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.....	122
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.....	122
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.....	122
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	123
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	123
8.12 投资组合报告附注.....	123
§9 基金份额持有人信息(转型后)	124
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	124
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.....	125
§9 基金份额持有人信息(转型前)	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.....	126
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
§10 开放式基金份额变动(转型后)	126
§10 开放式基金份额变动(转型前)	127
§11 重大事件揭示.....	127
11.1 基金份额持有人大会决议.....	127
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.....	127
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	127
11.4 基金投资策略的改变.....	128
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	128
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.....	128
转型后.....	128
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	128
转型前.....	130
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	130

11.8 其他重大事件.....	132
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	135
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.....	135
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	135
§13 备查文件目录.....	135
13.1 备查文件目录.....	135
13.2 存放地点.....	136
13.3 查阅方式.....	136

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金名称	兴业聚源混合型证券投资基金	
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	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	466,780,951.63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

基金名称	兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金	
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	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	490,079,569.46份	
基金合同存续期	不定期	

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	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。

转型前

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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	95559
传真	021-22211997	021-62701216
注册地址	福建省福州市鼓楼区五四路1	中国（上海）自由贸易试验区

	37号信和广场25楼	银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区银城路167号 13、14层	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	官恒秋	任德奇

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	2021年10月13日（基金合同生效日） - 2021年12月31日	
	兴业聚源混合A	兴业聚源混合C
本期已实现收益	7,286,732.35	149,473.89
本期利润	19,130,605.28	502,658.47
加权平均基金份额本期利润	0.0430	0.0558

本期加权平均净值利润率	3.00%	3.89%
本期基金份额净值增长率	3.11%	1.88%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	
期末可供分配利润	170,045,887.94	10,907,728.31
期末可供分配基金份额利润	0.3877	0.3872
期末基金资产净值	634,003,103.67	40,707,879.55
期末基金份额净值	1.4455	1.4450
3.1.3 累计期末指标	2021年末	
基金份额累计净值增长率	3.11%	1.88%

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

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

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

4、本报告期内，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。

5、兴业聚源混合型证券投资基金报告期自2021年10月13日至2021年12月31日止。截至本报告期末，本基金转型不满一年，本报告期不是完整报告期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业聚源混合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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

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

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
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。上述业绩表现按实际存续期计算。

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



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。

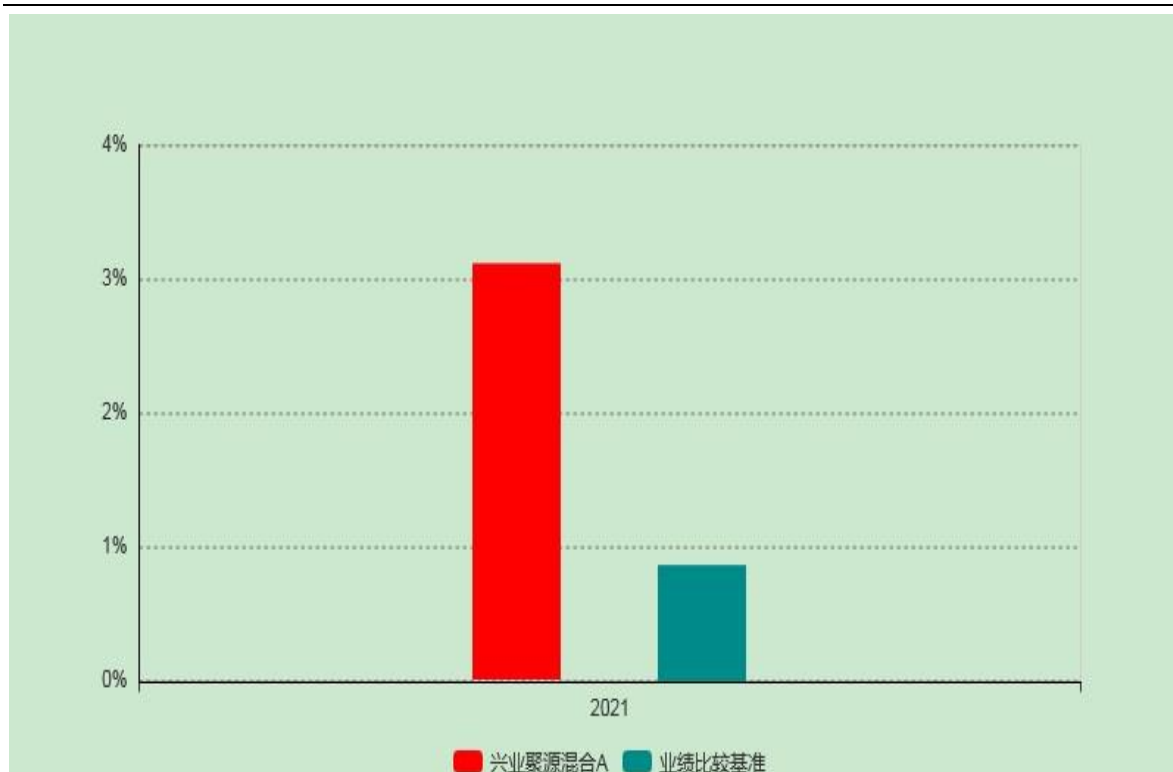
2、本基金转型后的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。

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。

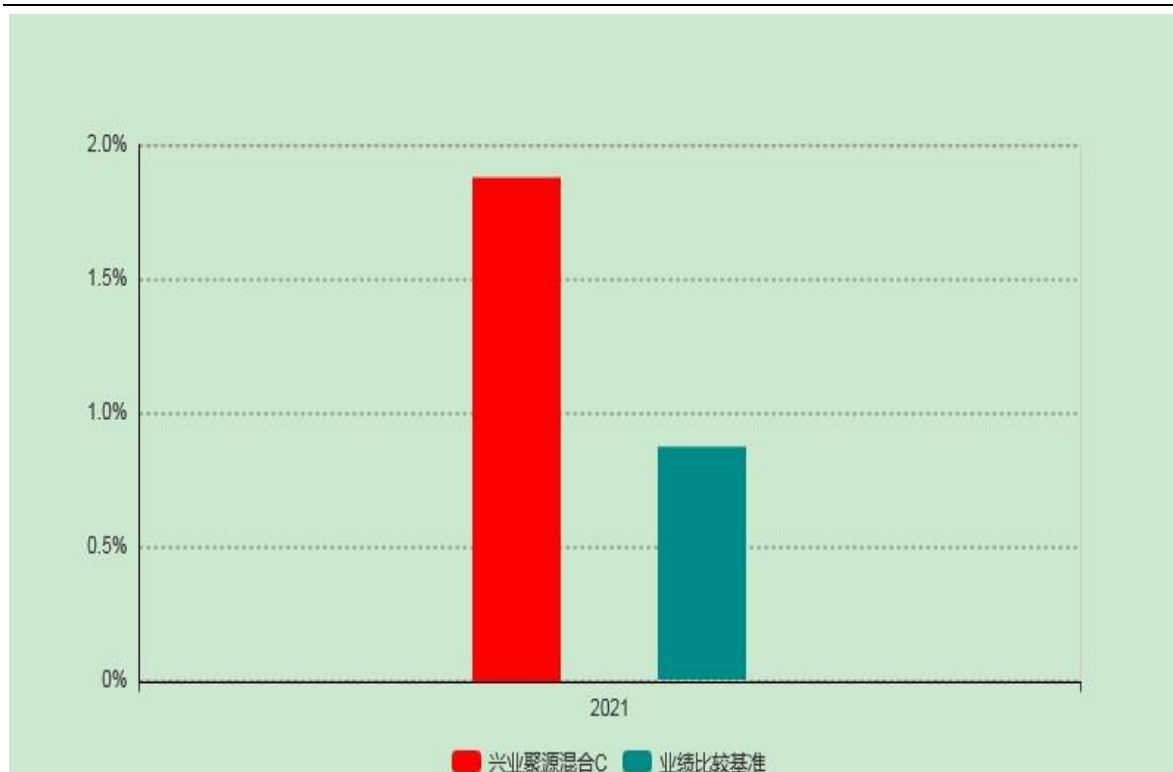
5、本基金合同自 2021 年 10 月 13 日起生效并增设 C 类份额，自 2021 年 11 月 19 日起 C 类份额存续。上述业绩表现按实际存续期计算。

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、本基金基金合同于 2021 年 10 月 13 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。



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。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

兴业聚源混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	0.590	20,928,532.31	7,974,906.56	28,903,438.87	-
合计	0.590	20,928,532.31	7,974,906.56	28,903,438.87	-

注：兴业聚源混合C本报告期未进行利润分配。

§ 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	2021年01月01日 - 2021年10月12日	2020年	2019年
本期已实现收益	41,551,376.21	65,567,293.99	4,011,190.48
本期利润	24,561,420.39	85,214,276.88	3,853,411.89
加权平均基金份额本期利润	0.0585	0.2518	0.0431
本期加权平均净值利润率	4.07%	19.19%	3.78%
本期基金份额净值增长率	3.91%	20.89%	3.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年10月12日)	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	210,738,105.01	193,008,618.33	11,559,592.31
期末可供分配基金份额利润	0.4300	0.3302	0.1582
期末基金资产净值	716,032,985.99	821,815,160.69	84,972,689.69
期末基金份额净值	1.461	1.406	1.163
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年10月12日)	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	46.10%	40.60%	16.30%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

4、本报告期内，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。

5、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金于2021年10月13日转型，本年度报告期自2021年1月1日至2021年10月12日止。

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 (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	46.10%	0.26%	12.94%	0.23%	33.16%	0.03%

(2016年06月30日-2021年10月12日)						
---------------------------	--	--	--	--	--	--

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

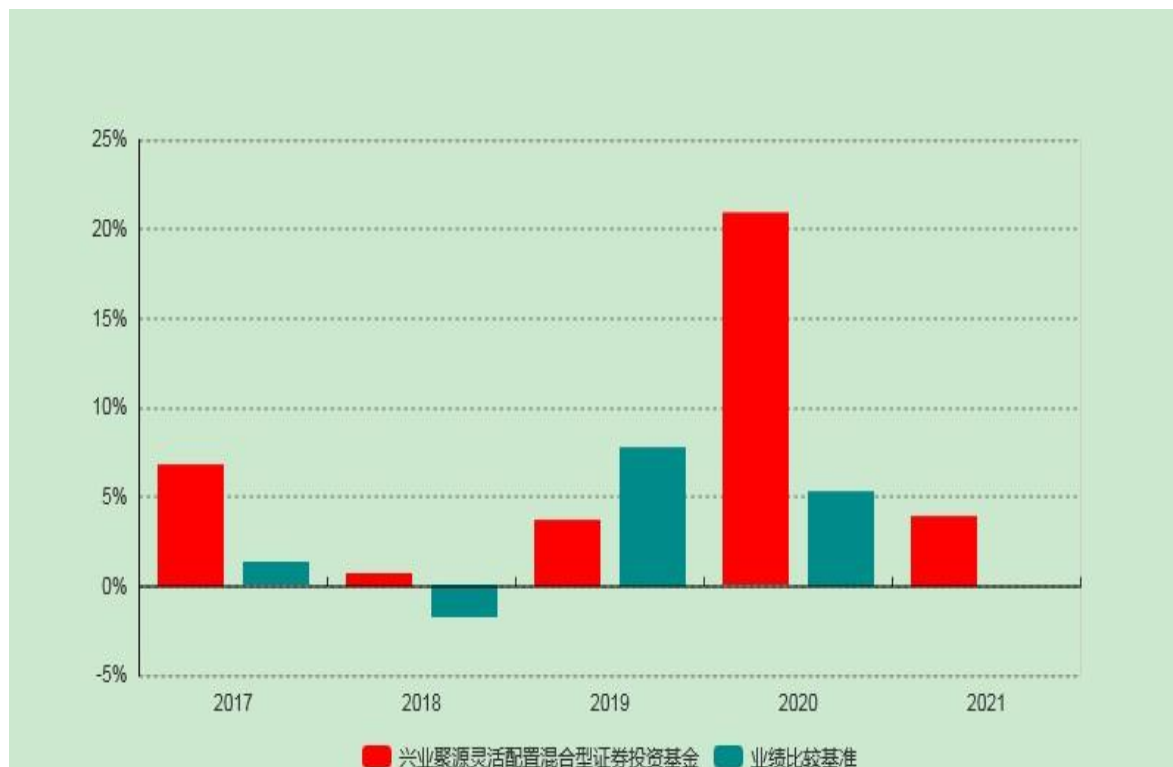


注：1、本报告期内，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金自2021年9月15日起至2021年10月12日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于2021年10月13日计票并表决通过了《关于兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚源混合型证券投资基金有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会决议，兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，本次大会决议自2021年10月13日生效。详

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%。

3.2.3 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、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金于2021年10月13日正式转型为兴业聚源混合型证券投资基金，2021年度期间为2021年1月1日至2021年10月12日，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

兴业聚源灵活配置混合型证券投资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		
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

					<p>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>

- 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

报告期内，基于紧信用下经济基本面整体偏弱且有疫情反复扰动的考虑，组合大部分时间保持中性略偏积极的配置思路。只是在去年三季度，基于市场预期过于一致，组合进行了减仓操作。但步入10月底，考虑到央行的投放操作重新回归积极，组合也相应的进行了较大幅度的加仓，提升弹性。

4.4.2 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1月1日至2021年10月12日本基金份额净值增长率为3.91%，同期业绩比较基准收益率为0.00%。

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%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如果说过去一年是紧信用+宽货币的主线，那么2022年影响市场的因素明显更多，也更复杂。特别是在相对更低的收益率水平下，波动加大在所难免。从基本面分析的角度来看，再详实的分析也很难用多个不确定的东西指向一个确定性的策略。在这样的情况下，如果我们还执着于把某几个因素分析作为投资决策的核心，未免有些刻舟求剑。与其追求精确的错误，倒不如立足于模糊的正确。即，市场处于宽货币向（预期）宽信用过渡过程中，货币短期难紧。基于此，我们会将更多的精力放置在优化组合配置，以及各个品种的相对价值此消彼长带来的小波段机会。今年组合将核心着眼于票息与骑乘效应，以更加包容性的心态去面对各类资产以及更加勤勉的操作去参与每个确定性机会。

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

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期内进行利润分配28,903,438.87元。

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，基金托管人在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）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，兴业基金管理有限公司在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）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业聚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）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告（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(22)第P01845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	兴业聚源混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了兴业聚源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10月13日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。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，公允反映了兴业聚源混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年10月13日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间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，我们独立于兴业聚源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源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。

	<p>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源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源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源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</p>

	<p>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，就可能对兴业聚源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源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	

§ 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(22)第P01844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	兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年10月12日（基金合同失效前日）的资产负债表，2021年1月1日至2021年10月12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，公允反映了兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金2021年10月12日（基金合同失效前日）的财务状况以及2021年1月1日至2021年10月12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，我们独立于兴业聚源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

	<p>源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源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源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源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</p>

	<p>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，就可能对兴业聚源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源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(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚源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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	23,673,916.26
结算备付金		7,114,793.30
存出保证金		63,555.44
交易性金融资产	7.4.7.2	684,236,732.42
其中：股票投资		145,412,902.62
基金投资		-
债券投资		538,823,829.80
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		-
应收利息	7.4.7.5	7,334,533.24
应收股利		-
应收申购款		2,947.20
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		722,426,477.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021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		33,000,000.00
应付证券清算款		13,967,035.83
应付赎回款		6,875.99
应付管理人报酬		323,665.33
应付托管费		53,944.24
应付销售服务费		6,680.30
应付交易费用	7.4.7.7	172,989.75
应交税费		25,642.93
应付利息		-20,342.47
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	179,002.74
负债合计		47,715,494.64
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	466,780,951.63
未分配利润	7.4.7.10	207,930,031.59
所有者权益合计		674,710,983.22
负债和所有者权益总计		722,426,477.86

注：1、报告截止日2021年12月31日，基金份额总额466,780,951.63份，其中下属A类基金份额净值1.4455元，基金份额438,608,837.72份，下属C类基金份额净值1.4450元，基金份额28,172,113.91份。

2、本财务报表的实际编制期间为2021年10月13日（基金转型生效日）至2021年12月31日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，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：兴业聚源混合型证券投资基金

本报告期：2021年10月13日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年10月13日至2021年1
----	-----	--------------------------

		2月31日
一、收入		21,389,455.70
1. 利息收入		4,076,872.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	42,480.70
债券利息收入		4,032,782.72
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,609.41
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,968,050.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,587,463.34
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-580,360.44
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	-39,052.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	12,197,057.51
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	147,475.36
减：二、费用		1,756,191.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	854,779.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,463.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	8,498.00
4. 交易费用	7.4.7.18	349,636.50
5. 利息支出		290,029.12
其中：卖出回购金融资产支出		290,029.12
6. 税金及附加		10,806.89
7. 其他费用	7.4.7.19	99,978.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,633,263.75

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,633,263.75

注：本财务报表的实际编制期间为2021年10月13日（基金转型生效日）至2021年12月31日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚源混合型证券投资基金

本报告期：2021年10月13日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年10月13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)	490,079,569.46	225,953,416.53	716,032,985.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,633,263.75	19,633,263.75
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)	-23,298,617.83	-8,753,209.82	-32,051,827.65
其中：1. 基金申购款	107,747,850.81	46,776,821.72	154,524,672.53
2. 基金赎回款	-131,046,468.64	-55,530,031.54	-186,576,500.18
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)	-	-28,903,438.87	-28,903,438.87

五、期末所有者权益（基金净值）	466,780,951.63	207,930,031.59	674,710,983.22
-----------------	----------------	----------------	----------------

注：本财务报表的实际编制期间为2021年10月13日（基金转型生效日）至2021年12月31日。截至报告期末本基金转型生效未满一年，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：

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

兴业聚源混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“兴业聚源灵活配置混合”)转型而来。兴业聚源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》、《兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“兴业聚源灵活配置混合合同”)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]2313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204,752,395.74份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第0610号的验资报告。兴业聚源灵活配置混合合同于2016年6月30日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

2021年9月15日兴业聚源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》,内容包括,将兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金的基金名称变更为兴业聚源混合型证券投资基金,调整基金的投资、基金资产估值、分设两类基金份额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2021年10月13日起,《兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《兴业聚源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。

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“兴业聚源混合A”)和C类基金份额(以下简称“兴业聚源混合C”)两类份额。其中,兴业聚源混合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

源混合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10月13日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2021年10月13日（基金合同生效日）至2021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

金融资产分类

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。

金融负债分类

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，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；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0.60%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。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日C类基金资产净值的0.30%年费率计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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

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
活期存款	23,673,916.26
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	23,673,916.26

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		130,880,581.33	145,412,902.62	14,532,321.29
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	127,182,289.27	126,363,329.80	-818,959.47
	银行间市场	411,107,670.02	412,460,500.00	1,352,829.98
	合计	538,289,959.29	538,823,829.80	533,870.51
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		669,170,540.62	684,236,732.42	15,066,191.80

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。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	4,578.50
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	3,521.87
应收债券利息	7,326,401.41
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	31.46
合计	7,334,533.24

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	167,002.25
银行间市场应付交易费用	5,987.50
合计	172,989.75

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.74
预提费用	179,000.00
合计	179,002.74

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 兴业聚源混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚源混合A)	本期 2021年10月13日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	490,079,569.46	490,079,569.46
-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	-	-
本期申购	79,569,981.30	79,569,981.30
本期赎回(以“-”号填列)	-131,040,713.04	-131,040,713.04
本期末	438,608,837.72	438,608,837.72

7.4.7.9.2 兴业聚源混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚源混合C)	本期 2021年10月13日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
-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	-	-
本期申购	28,177,869.51	28,177,869.51
本期赎回(以“-”号填列)	-5,755.60	-5,755.60
本期末	28,172,113.91	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。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 兴业聚源混合A

单位：人民币元

项目 (兴业聚源混合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	210,738,105.01	15,215,311.52	225,953,416.53
本期利润	7,286,732.35	11,843,872.93	19,130,605.28
本期基金份额交易产生的变动数	-19,075,510.55	-1,710,806.44	-20,786,316.99
其中：基金申购款	30,529,861.86	4,211,314.60	34,741,176.46
基金赎回款	-49,605,372.41	-5,922,121.04	-55,527,493.45
本期已分配利润	-28,903,438.87	-	-28,903,438.87
本期末	170,045,887.94	25,348,378.01	195,394,265.95

7.4.7.10.2 兴业聚源混合C

单位：人民币元

项目 (兴业聚源混合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	-	-	-
本期利润	149,473.89	353,184.58	502,658.47
本期基金份额交易产生的变动数	10,758,254.42	1,274,852.75	12,033,107.17
其中：基金申购款	10,760,471.91	1,275,173.35	12,035,645.26
基金赎回款	-2,217.49	-320.60	-2,538.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,907,728.31	1,628,037.33	12,535,765.64

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月13日至2021年12月31日
活期存款利息收入	27,399.04
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	14,870.73

其他	210.93
合计	42,480.70

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10月13日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	130,096,035.51
减：卖出股票成本总额	124,508,572.17
买卖股票差价收入	5,587,463.34

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10月13日至2021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	-580,360.44
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	-580,360.44

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10月13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	294,227,724.51
减：卖出债券（、	290,138,900.55

债转股及债券到期 兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	4,669,184.40
买卖债券差价收入	-580,360.44

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

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10月13日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	-39,052.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	-39,052.90

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10月13日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	12,197,057.51
——股票投资	10,173,439.38
——债券投资	2,023,618.13
——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	12,197,057.51

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月13日至2021年12月31日
基金赎回费收入	147,475.36
合计	147,475.36

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月13日至2021年12月31日
交易所市场交易费用	344,511.50
银行间市场交易费用	5,125.00
合计	349,636.50

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月13日至2021年12月31日
审计费用	10,957.85
信息披露费	26,300.55
汇划手续费	4,594.36
账户维护费	8,126.16
公证费	10,000.00

律师费	40,000.00
合计	99,978.92

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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10月13日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	854,779.29
其中：支付销售机构的客户维护费	50,366.56

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×管理费的年费率计提，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 2021年10月13日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	142,463.23

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值×托管费的年费率计提，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 2021年10月13日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚源混合A	兴业聚源混合C	合计

兴业基金	0.00	6,977.13	6,977.13
合计	0.00	6,977.13	6,977.13

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务年费率为0.30%，按前一日C类基金资产净值的0.30%年费率计提。逐日累计至每月月末，按月支付。销售服务费的计算方法如下：C类基金份额每日应计提的销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.30%÷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 2021年10月13日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	23,673,916.26	27,399.04

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

兴业聚源混合A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021-10-28	2021-10-28	0.590	20,928,532.31	7,974,906.56	28,903,438.87	-
合计			0.590	20,928,532.31	7,974,906.56	28,903,438.87	-

注：兴业聚源混合C本报告期末未进行利润分配。

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
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	科创板打新限售	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	5,407	226,985.86	226,985.86	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	科创板打新限售	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-
688091	上海谊众	2021-09-01	2022-03-09	科创板打新限售	38.10	42.81	3,294	125,501.40	141,016.14	-
301050	雷电微力	2021-08-	2022-02-	创业板打	60.64	234.74	233	14,129.1	54,694.4	-

		17	24	新限售				2	2	
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板打新限售	60.66	96.75	521	31,603.86	50,406.75	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	116.88	116.08	297	34,713.36	34,475.76	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板打新限售	93.09	75.34	437	40,680.33	32,923.58	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	创业板打新限售	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板打新限售	10.45	11.22	2,599	27,159.55	29,160.78	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板打新限售	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-

301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
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	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	86.06	94.50	241	20,740.46	22,774.50	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	389	22,593.12	19,391.65	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板打新限售	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
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	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	创业板打新限售	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301096	百诚医药	2021-12-	2022-06-	创业板打	79.60	78.53	218	17,352.8	17,119.5	-

		13	20	新限售				0	4	
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	创业板打新限售	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	创业板打新限售	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	创业板打新限售	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	创业板打新限售	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	创业板打新限售	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
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	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	创业板打新限售	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-

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	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	创业板打新限售	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
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	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
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	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	创业板打新限售	57.27	53.71	233	13,343.91	12,514.43	-
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	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-02	2022-02-02	创业板打	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.2	-

		11	18	新限售					8	
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	创业板打新限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板打新限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	创业板打新限售	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	创业板打新限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	创业板打新限售	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-03-01	创业板打新限售	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-

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	-
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	-
3011 98	喜悦 智行	2021 -11- 25	2022 -06- 02	创业 板打 新限 售	21.7 6	29.2 0	262	5,70 1.12	7,65 0.40	-
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	-
3010 81	严牌 股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	创业 板打 新限 售	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-
3010 98	金埔 园林	2021 -11- 04	2022 -05- 12	创业 板打 新限 售	12.3 6	22.1 7	307	3,79 4.52	6,80 6.19	-
3010 33	迈普 医学	2021 -07- 15	2022 -01- 26	创业 板打 新限 售	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-
3010 49	超越 科技	2021 -08- 17	2022 -02- 24	创业 板打 新限 售	19.3 4	32.9 2	196	3,79 0.64	6,45 2.32	-
3010 32	新柴 股份	2021 -07- 06	2022 -01- 19	创业 板打 新限 售	4.97	12.5 1	513	2,54 9.61	6,41 7.63	-

		15	24	新限售						
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	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
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	-
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	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
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	-
3010	华蓝	2021	2022	创业	11.4	16.6	286	3,27	4,76	-

27	集团	-07-08	-01-17	板打新限售	5	5		4.70	1.90	
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	-
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

本基金本报告期末无从事银行间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2021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33,000,000.00元，于2022年01月04日到期。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 2021年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	100,343,000.00
合计	100,343,000.00

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 2021年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	19,742,000.00
合计	19,742,000.00

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 2021年12月31日
AAA	210,611,500.00

AAA以下	57,767,329.80
未评级	-
合计	268,378,829.80

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，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，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	23,673,916.26	-	-	-	23,673,916.26
结算备付金	7,114,793.30	-	-	-	7,114,793.30
存出保证金	63,555.44	-	-	-	63,555.44
交易性金融资产	255,051,829.80	173,420,000.00	110,352,000.00	145,412,902.62	684,236,732.42
应收利息	-	-	-	7,334,533.24	7,334,533.24
应收申购款	-	-	-	2,947.20	2,947.20
资产总计	285,904,094.80	173,420,000.00	110,352,000.00	152,750,383.06	722,426,477.86
负债					
卖出回购金融资产款	33,000,000.00	-	-	-	33,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	13,967,035.83	13,967,035.83
应付赎回款	-	-	-	6,875.99	6,875.99
应付管理人报酬	-	-	-	323,665.33	323,665.33
应付托管费	-	-	-	53,944.24	53,944.24
应付销售服务	-	-	-	6,680.30	6,680.30

费					
应付交易费用	-	-	-	172,989.75	172,989.75
应交税费	-	-	-	25,642.93	25,642.93
应付利息	-	-	-	-20,342.47	-20,342.47
其他负债	-	-	-	179,002.74	179,002.74
负债总计	33,000,000.00	-	-	14,715,494.64	47,715,494.64
利率敏感度缺口	252,904,094.80	173,420,000.00	110,352,000.00	138,034,888.42	674,710,983.22

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 2021年12月31日
	市场利率上升25个基点	-3,792,168.55
	市场利率下降25个基点	3,870,234.14

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	145,412,902.62	21.55
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	145,412,902.62	21.55

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
	股票价格上升5%	7,270,645.13
	股票价格下降5%	-7,270,645.13

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143,693,845.95元，属于第二层次的余额为人民币539,032,990.35元，属于第三层次的余额为人民币1,509,896.12元。

(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1,509,896.12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。

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年10月12日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年10月12日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	7,728,865.28	7,881,670.48
结算备付金		2,478,177.13	1,282,110.22
存出保证金		58,916.52	105,788.62
交易性金融资产	7.4.7.2	697,783,966.48	840,784,620.35

其中：股票投资		151,584,402.48	171,104,620.35
基金投资		-	-
债券投资		546,199,564.00	669,680,000.00
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	18,000,347.00	7,000,000.00
应收证券清算款		-	4,110,718.01
应收利息	7.4.7.5	7,678,152.42	13,589,577.95
应收股利		-	-
应收申购款		27,599.90	55,170.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		733,756,024.73	874,809,655.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年10月12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		16,000,000.00	46,400,000.00
应付证券清算款		1,001,239.86	5,555,833.07
应付赎回款		25,693.20	4,179.72
应付管理人报酬		141,828.93	412,099.45
应付托管费		182,983.01	312,681.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	177,899.31	120,921.35
应交税费		50,454.51	46,164.18
应付利息		-	12,616.36
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	142,939.92	130,000.00
负债合计		17,723,038.74	52,994,495.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	490,079,569.46	584,503,761.20
未分配利润	7.4.7.10	225,953,416.53	237,311,399.49
所有者权益合计		716,032,985.99	821,815,160.69
负债和所有者权益总计		733,756,024.73	874,809,655.89

注：1、报告截止日2021年10月12日，基金份额净值1.461元，基金份额总额490,079,569.46份。

2、本期财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年10月12日止（基金合同失效前日），本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

7.2 利润表

会计主体：兴业聚源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10月12日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年10月12日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
一、收入		29,463,603.02	90,367,045.02
1. 利息收入		13,974,765.55	12,669,028.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	162,318.20	142,357.75
债券利息收入		13,530,142.02	12,269,605.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		282,305.33	257,065.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,356,257.10	58,043,772.40

其中：股票投资收益	7.4.7.12	31,571,872.07	60,136,499.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-682,793.85	-3,950,661.35
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	1,467,178.88	1,857,933.80
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-16,989,955.82	19,646,982.89
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	122,536.19	7,261.05
减：二、费用		4,902,182.63	5,152,768.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	2,869,751.20	2,608,442.10
2. 托管费	7.4.10.2. 2	478,292.01	434,740.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,014,042.94	1,239,323.19
5. 利息支出		318,523.03	657,628.71
其中：卖出回购金融资产 支出		318,523.03	657,628.71
6. 税金及附加		36,962.46	30,149.07
7. 其他费用	7.4.7.19	184,610.99	182,484.68
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		24,561,420.39	85,214,276.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		24,561,420.39	85,214,276.88

注：本期财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年10月12日止（基金合同失效前日），本报告期不是完整报告期，本报告期按实际存续期计算。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚源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10月12日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年10月12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)	584,503,761.20	237,311,399.49	821,815,160.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,561,420.39	24,561,420.39
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)	-94,424,191.74	-35,919,403.35	-130,343,595.09
其中：1. 基金申购款	341,228,862.29	150,792,471.80	492,021,334.09
2. 基金赎回款	-435,653,054.03	-186,711,875.15	-622,364,929.18
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)	490,079,569.46	225,953,416.53	716,032,985.99
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)	73,053,250.71	11,919,438.98	84,972,689.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	85,214,276.88	85,214,276.88
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)	511,450,510.49	140,177,683.63	651,628,194.12
其中：1. 基金申购款	585,690,721.35	157,947,999.41	743,638,720.76
2. 基金赎回款	-74,240,210.86	-17,770,315.78	-92,010,526.64
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)	584,503,761.20	237,311,399.49	821,815,160.69

注：本期财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年10月12日止（基金合同失效前日），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

兴业聚源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》、《兴业聚源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]2313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204,752,395.74份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(16)第0610号的验资报告。基金合同于2016年6月30日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

自2021年10月13日起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,修订后的《兴业聚源混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效,基金合同于同日失效。

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 \times 80%+沪深300指数收益率 \times 20%。

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10月12日（基金合同失效前日）的财务状况以及2021年1月1日至2021年10月12日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年10月12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

金融资产分类

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。

金融负债分类

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，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；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。

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。

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。

– 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0.60%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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

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

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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10月12日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	7,728,865.28	7,881,670.48
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	7,728,865.28	7,881,670.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年10月12日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		147,225,520.57	151,584,402.48	4,358,881.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	152,129,351.00	150,828,564.00	-1,300,787.00
	银行间市场	395,559,960.62	395,371,000.00	-188,960.62
	合计	547,689,311.62	546,199,564.00	-1,489,747.62
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		694,914,832.19	697,783,966.48	2,869,134.29
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		148,625,358.87	171,104,620.35	22,479,261.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	101,779,961.66	100,011,000.00	-1,768,961.66
	银行间市场	570,520,209.71	569,669,000.00	-851,209.71
	合计	672,300,171.37	669,680,000.00	-2,620,171.37
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		820,925,530.24	840,784,620.35	19,859,090.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

项目	本期末 2021年10月12日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	18,000,347.00	-
合计	18,000,347.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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10月12日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	6,540.15	3,017.35
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	3,210.04	634.70
应收债券利息	7,637,910.53	13,585,873.54
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	30,416.20	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	75.50	52.36
合计	7,678,152.42	13,589,577.95

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10月12日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	172,564.81	114,927.71
银行间市场应付交易费用	5,334.50	5,993.64
合计	177,899.31	120,921.35

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年10月12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	24.48	-
预提费用	142,915.44	130,000.00
合计	142,939.92	130,000.00

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10月12日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	584,503,761.20	584,503,761.20

本期申购	341,228,862.29	341,228,862.29
本期赎回（以“-”号填列）	-435,653,054.03	-435,653,054.03
本期末	490,079,569.46	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。

7.4.7.10 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	193,008,618.33	44,302,781.16	237,311,399.49
本期利润	41,551,376.21	-16,989,955.82	24,561,420.39
本期基金份额交易产生的变动数	-23,821,889.53	-12,097,513.82	-35,919,403.35
其中：基金申购款	138,958,538.08	11,833,933.72	150,792,471.80
基金赎回款	-162,780,427.61	-23,931,447.54	-186,711,875.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,738,105.01	15,215,311.52	225,953,416.53

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 10月12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	137,523.32	118,176.13
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	23,633.42	23,031.65
其他	1,161.46	1,149.97
合计	162,318.20	142,357.75

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年 10月12日	2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	376,190,813.50	436,329,309.11
减：卖出股票成本总额	344,618,941.43	376,192,809.16
买卖股票差价收入	31,571,872.07	60,136,499.95

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 10月12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	-682,793.85	-3,950,661.35
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	-682,793.85	-3,950,661.35

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10月 12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	1,043,379,473.35	226,118,013.05
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	1,027,512,768.62	223,999,839.44
减：应收利息总额	16,549,498.58	6,068,834.96

买卖债券差价收入	-682,793.85	-3,950,661.35
----------	-------------	---------------

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 10月12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	1,467,178.88	1,857,933.80
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,467,178.88	1,857,933.80

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10 月12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	-16,989,955.82	19,646,982.89
——股票投资	-18,120,379.57	22,479,261.48
——债券投资	1,130,423.75	-2,832,278.59
——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	-16,989,955.82	19,646,982.89

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 10月12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	122,536.19	7,105.37
其他	-	155.68
合计	122,536.19	7,261.05

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 10月12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	998,442.94	1,227,673.19
银行间市场交易费用	15,600.00	11,650.00
合计	1,014,042.94	1,239,323.19

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 10月12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	39,042.15	50,000.00
信息披露费	93,699.45	80,000.00

汇划手续费	13,795.55	15,284.68
账户维护费	38,073.84	37,200.00
合计	184,610.99	182,484.68

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

本报告期内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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
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10月12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	2,869,751.20	2,608,442.10
其中：支付销售机构的客户维护费	42,611.39	4,384.88

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×管理费的年费率计提，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 2021年01月01日至2021年10月12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	478,292.01	434,740.39

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值×托管费的年费率计提，逐日累计至每年6月和12月末，按半年支付。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

本基金本报告期末及上年度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 2021年01月01日至2021年10月12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
交通银行	7,728,865.28	137,523.32	7,881,670.48	118,176.13

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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10月12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
688383	新益昌	2021-04-	2021-10-	科创板打	19.58	125.05	2,701	52,885.5	337,760.	-

		21	28	新限售				8	05	
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	科创板打新限售	36.22	73.44	3,069	111,159.18	225,387.36	-
688772	珠海冠宇	2021-09-30	2021-10-15	新股未上市	14.43	14.43	12,960	187,012.80	187,012.80	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	科创板打新限售	15.49	47.89	3,409	52,805.41	163,257.01	-
688091	上海谊众	2021-09-01	2022-03-09	科创板打新限售	38.10	39.72	3,294	125,501.40	130,837.68	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	科创板打新限售	11.03	85.51	1,496	16,500.88	127,922.96	-
301078	孩子王	2021-09-30	2021-10-14	新股未上市	5.77	5.77	6,795	39,207.15	39,207.15	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	158.69	233	14,129.12	36,974.77	-
688272	富吉瑞	2021-10-08	2021-10-18	新股未上市	22.56	22.56	1,263	28,493.28	28,493.28	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	58.63	462	6,532.68	27,087.06	-

				售						
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	39.08	644	14,193.76	25,167.52	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板打新限售	6.96	10.76	2,064	14,365.44	22,208.64	-
688722	同益中	2021-10-08	2021-10-19	新股未上市	4.51	4.51	3,687	16,628.37	16,628.37	-
001218	丽臣实业	2021-09-28	2021-10-15	新股未上市	45.51	45.51	350	15,928.50	15,928.50	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2021-10-19	新股未上市	11.92	11.92	1,256	14,971.52	14,971.52	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	23.53	555	4,917.30	13,059.15	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	27.15	462	3,529.68	12,543.30	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	22.60	539	2,786.63	12,181.40	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	28.61	420	4,998.00	12,016.20	-

3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	9.46	39.1 3	290	2,74 3.40	11,3 47.7 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	10.6 4	26.2 6	421	4,47 9.44	11,0 55.4 6	-
0012 16	华瓷 股份	2021 -10- 12	2021 -10- 19	新股 未上 市	9.37	9.37	1,177	11,0 28.4 9	11,0 28.4 9	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限 售	8.34	35.9 4	290	2,41 8.60	10,4 22.6 0	-
3010 13	利和 兴	2021 -06- 21	2021 -12- 29	创业 板打 新限 售	8.72	21.3 3	471	4,10 7.12	10,0 46.4 3	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板打 新限 售	18.0 3	45.2 0	203	3,66 0.09	9,17 5.60	-
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 18	创业 板打 新限 售	4.13	10.3 5	843	3,48 1.59	8,72 5.05	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	创业 板打 新限 售	4.17	14.5 2	587	2,44 7.79	8,52 3.24	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	创业 板打 新限	5.31	10.3 2	733	3,89 2.23	7,56 4.56	-

				售						
605567	春雪食品	2021-09-28	2021-10-13	新股未上市	11.80	11.80	629	7,422.20	7,422.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	25.76	275	3,781.25	7,084.00	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	13.57	27.58	241	3,270.37	6,646.78	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	23.38	28.81	205	4,792.90	5,906.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	18.81	312	2,436.72	5,868.72	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	4.97	11.22	513	2,549.61	5,755.86	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	33.22	170	1,368.50	5,647.40	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板打新限售	8.40	16.72	328	2,755.20	5,484.16	-
301062	上海艾录	2021-09-	2022-03-	创业板打	3.31	10.40	523	1,731.13	5,439.20	-

		07	14	新限售						
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	27.32	196	3,790.64	5,354.72	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-03-01	创业板打新限售	8.11	20.21	252	2,043.72	5,092.92	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	4.57	11.26	444	2,029.08	4,999.44	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	8.69	572	2,247.96	4,970.68	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	43.46	108	1,635.12	4,693.68	-
001219	青岛食品	2021-10-11	2021-10-21	新股未上市	17.20	17.20	272	4,678.40	4,678.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	6.10	19.14	242	1,476.20	4,631.88	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板打新限售	17.40	29.70	153	2,662.20	4,544.10	-
3010	晶雪	2021	2021	创业	7.83	20.1	218	1,70	4,39	-

10	节能	-06-09	-12-20	板打新限售		4		6.94	0.52	
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板打新限售	5.77	5.77	756	4,362.12	4,362.12	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	16.06	266	1,776.88	4,271.96	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板打新限售	9.96	20.65	203	2,021.88	4,191.95	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-19	创业板打新限售	1.55	10.00	403	624.65	4,030.00	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	14.82	20.27	193	2,860.26	3,912.11	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-17	创业板打新限售	11.45	13.25	286	3,274.70	3,789.50	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板打新限售	11.87	23.04	155	1,839.85	3,571.20	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	22.53	144	1,762.56	3,244.32	-

				售						
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	13.98	22.10	144	2,013.12	3,182.40	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板打新限售	7.46	15.62	181	1,350.26	2,827.22	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板打新限售	11.92	11.92	140	1,668.80	1,668.80	-

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

本基金本报告期末无从事银行间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2021年10月12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16,000,000.00元，于2021年10月13日到期。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年10月12日	2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	100,107,000.00	-
合计	100,107,000.00	-

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

本基金本报告期末及上年度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 2021年10月12日	上年度末 2020年12月31日
AAA	266,410,064.00	135,083,000.00
AAA以下	99,428,500.00	299,479,000.00
未评级	30,219,000.00	-
合计	396,057,564.00	434,562,000.00

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，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 0月12日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

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 年年度报告

银行存款	7,728,865.28	-	-	-	7,728,865.28
结算备付金	2,478,177.13	-	-	-	2,478,177.13
存出保证金	58,916.52	-	-	-	58,916.52
交易性金融资产	310,970,564.00	235,229,000.00	-	151,584,402.48	697,783,966.48
买入返售金融资产	18,000,347.00	-	-	-	18,000,347.00
应收利息	-	-	-	7,678,152.42	7,678,152.42
应收申购款	-	-	-	27,599.90	27,599.90
资产总计	339,236,869.93	235,229,000.00	-	159,290,154.80	733,756,024.73
负债					
卖出回购金融资产款	16,000,000.00	-	-	-	16,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,001,239.86	1,001,239.86
应付赎回款	-	-	-	25,693.20	25,693.20
应付管理人报酬	-	-	-	141,828.93	141,828.93
应付托管费	-	-	-	182,983.01	182,983.01
应付交易费用	-	-	-	177,899.31	177,899.31
应交税费	-	-	-	50,454.51	50,454.51
其他负债	-	-	-	142,939.92	142,939.92
负债总计	16,000,000.00	-	-	1,723,038.74	17,723,038.74
利率敏感度缺口	323,236,869.93	235,229,000.00	-	157,567,116.06	716,032,985.99
上年度末 2020年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

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 年年度报告

2月31日					
资产					
银行存款	7,881,670.48	-	-	-	7,881,670.48
结算备付金	1,282,110.22	-	-	-	1,282,110.22
存出保证金	105,788.62	-	-	-	105,788.62
交易性金融资产	108,198,000.00	501,072,000.00	60,410,000.00	171,104,620.35	840,784,620.35
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	4,110,718.01	4,110,718.01
应收利息	-	-	-	13,589,577.95	13,589,577.95
应收申购款	-	-	-	55,170.26	55,170.26
资产总计	124,467,569.32	501,072,000.00	60,410,000.00	188,860,086.57	874,809,655.89
负债					
卖出回购金融资产款	46,400,000.00	-	-	-	46,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	5,555,833.07	5,555,833.07
应付赎回款	-	-	-	4,179.72	4,179.72
应付管理人报酬	-	-	-	412,099.45	412,099.45
应付托管费	-	-	-	312,681.07	312,681.07
应付交易费用	-	-	-	120,921.35	120,921.35
应交税费	-	-	-	46,164.18	46,164.18
应付利息	-	-	-	12,616.36	12,616.36
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00

负债总计	46,400,000.00	-	-	6,594,495.20	52,994,495.20
利率敏感度缺口	78,067,569.32	501,072,000.00	60,410,000.00	182,265,591.37	821,815,160.69

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变			
假设	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10月12日	上年度末 2020年12月31日	
		市场利率上升25个基点	-1,458,625.96	-3,980,112.25
		市场利率下降25个基点	1,468,497.25	4,030,279.04

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10月12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	151,584,402.48	21.17	171,104,620.35	20.82
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	151,584,402.48	21.17	171,104,620.35	20.82

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10月12日	上年度末 2020年12月31日
	股票价格上升5%	7,579,220.12	8,555,231.02
	股票价格下降5%	-7,579,220.12	-8,555,231.02

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10月12日(基金合同失效前日)，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149,988,270.34元，属于第二层次的余额为人民币546,452,901.63元，属于第三层次的余额为人民币1,342,794.51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167,070,626.35元，属于第二层次的余额为人民币673,713,994.00元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

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1,342,794.51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(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	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	其他各项资产	7,401,035.88	1.02
9	合计	722,426,477.86	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	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

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	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
11	600519	贵州茅台	2,000	4,100,000.00	0.61
12	600886	国投电力	320,400	3,674,988.00	0.54
13	002043	兔宝宝	270,100	3,262,808.00	0.48
14	000858	五粮液	13,900	3,094,974.00	0.46
15	600196	复星医药	62,100	3,039,174.00	0.45
16	603501	韦尔股份	9,000	2,796,930.00	0.41
17	600690	海尔智家	92,600	2,767,814.00	0.41
18	601009	南京银行	303,934	2,723,248.64	0.40
19	601939	建设银行	453,300	2,656,338.00	0.39
20	688169	石头科技	2,779	2,259,327.00	0.33
21	002475	立讯精密	43,930	2,161,356.00	0.32
22	600522	中天科技	123,000	2,086,080.00	0.31
23	600111	北方稀土	45,100	2,065,580.00	0.31
24	600702	舍得酒业	8,400	1,909,320.00	0.28
25	002241	歌尔股份	32,300	1,747,430.00	0.26

26	000661	长春高新	6,400	1,736,960.00	0.26
27	600183	生益科技	72,400	1,705,020.00	0.25
28	300413	芒果超媒	29,000	1,659,380.00	0.25
29	603799	华友钴业	14,600	1,610,526.00	0.24
30	002415	海康威视	29,600	1,548,672.00	0.23
31	002507	涪陵榨菜	40,500	1,530,900.00	0.23
32	300498	温氏股份	79,300	1,527,318.00	0.23
33	603486	科沃斯	9,900	1,494,405.00	0.22
34	002555	三七互娱	53,500	1,445,570.00	0.21
35	688139	海尔生物	15,431	1,401,443.42	0.21
36	600460	士兰微	24,700	1,338,740.00	0.20
37	688208	道通科技	16,517	1,311,449.80	0.19
38	300454	深信服	6,800	1,298,800.00	0.19
39	600298	安琪酵母	21,200	1,279,632.00	0.19
40	300114	中航电测	70,700	1,249,976.00	0.19
41	600104	上汽集团	57,100	1,177,973.00	0.17
42	000681	视觉中国	32,900	786,310.00	0.12
43	002008	大族激光	14,500	783,000.00	0.12
44	002371	北方华创	1,600	555,232.00	0.08
45	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.04
46	688262	国芯科技	5,407	226,985.86	0.03
47	688161	威高骨科	3,069	195,556.68	0.03
48	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.02
49	688091	上海谊众	3,294	141,016.14	0.02
50	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
51	301155	海力风电	521	50,406.75	0.01
52	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
53	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
54	301177	迪阿股份	297	34,475.76	0.01
55	301087	可孚医疗	437	32,923.58	0.00
56	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00

57	301090	华润材料	2,599	29,160.78	0.00
58	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
59	301189	C奥尼	435	24,629.70	0.00
60	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
61	301166	C优宁维	241	22,774.50	0.00
62	301093	华兰股份	389	19,391.65	0.00
63	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
64	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
65	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
66	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
67	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
68	301096	百诚医药	218	17,119.54	0.00
69	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
70	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
71	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
72	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
73	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
74	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
75	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
76	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
77	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
78	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
79	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
80	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
81	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
82	301108	洁雅股份	233	12,514.43	0.00
83	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
84	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
85	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
86	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
87	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00

88	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
89	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
90	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
91	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
92	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
93	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
94	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
95	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
96	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
97	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
98	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
99	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
100	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
101	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
102	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
103	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
104	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
105	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
106	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
107	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
108	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
109	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
110	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
111	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
112	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00
113	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
114	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
115	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
116	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
117	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	600085	同仁堂	9,609,748.00	1.42
2	600196	复星医药	8,134,228.00	1.21
3	600111	北方稀土	5,912,359.86	0.88
4	600519	贵州茅台	5,470,604.00	0.81
5	300059	东方财富	4,975,645.12	0.74
6	601985	中国核电	4,848,195.00	0.72
7	300347	泰格医药	4,763,040.24	0.71
8	000333	美的集团	4,289,815.00	0.64
9	600886	国投电力	4,284,701.00	0.64
10	002236	大华股份	3,344,690.00	0.50
11	000858	五粮液	3,123,294.00	0.46
12	600298	安琪酵母	3,051,416.00	0.45
13	601939	建设银行	2,672,418.00	0.40
14	002138	顺络电子	2,356,753.00	0.35
15	002714	牧原股份	1,931,764.00	0.29
16	300498	温氏股份	1,876,945.00	0.28
17	600702	舍得酒业	1,860,012.00	0.28
18	300413	芒果超媒	1,820,138.00	0.27
19	601601	中国太保	1,787,241.00	0.26
20	603799	华友钴业	1,714,681.00	0.25

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	600028	中国石化	7,899,071.00	1.17
2	601607	上海医药	6,935,108.44	1.03
3	002557	洽洽食品	5,991,244.13	0.89
4	300059	东方财富	5,820,421.40	0.86
5	300253	卫宁健康	5,458,162.00	0.81
6	002236	大华股份	5,433,967.68	0.81
7	601985	中国核电	5,075,291.00	0.75
8	600570	恒生电子	5,052,041.29	0.75
9	600196	复星医药	5,050,717.00	0.75
10	600522	中天科技	4,728,615.00	0.70
11	600886	国投电力	4,462,577.30	0.66
12	600926	杭州银行	3,943,088.00	0.58
13	601939	建设银行	3,790,226.00	0.56
14	600085	同仁堂	3,772,622.00	0.56
15	600519	贵州茅台	3,489,531.98	0.52
16	601601	中国太保	3,321,723.40	0.49
17	600161	天坛生物	3,233,639.22	0.48
18	600111	北方稀土	3,221,805.00	0.48
19	000768	中航西飞	3,053,776.54	0.45
20	002138	顺络电子	2,361,948.00	0.35

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	108,163,632.93
卖出股票收入（成交）总额	130,096,035.51

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	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

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	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

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投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

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	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,401,035.88

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	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	其他各项资产	7,764,668.84	1.06
9	合计	733,756,024.73	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	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

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	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
11	601939	建设银行	650,800	3,963,372.00	0.55
12	601009	南京银行	400,334	3,907,259.84	0.55
13	300454	深信服	15,800	3,737,490.00	0.52
14	600522	中天科技	391,200	3,653,808.00	0.51
15	000333	美的集团	50,800	3,638,296.00	0.51
16	600690	海尔智家	136,300	3,631,032.00	0.51
17	002043	兔宝宝	366,600	3,585,348.00	0.50
18	600161	天坛生物	109,040	3,466,381.60	0.48
19	300347	泰格医药	20,700	3,435,165.00	0.48
20	600886	国投电力	321,400	3,400,412.00	0.47
21	000768	中航西飞	103,200	2,961,840.00	0.41
22	600183	生益科技	106,800	2,322,900.00	0.32
23	603501	韦尔股份	9,600	2,172,480.00	0.30
24	000661	长春高新	6,400	1,878,400.00	0.26
25	600519	贵州茅台	1,000	1,870,990.00	0.26
26	601601	中国太保	62,174	1,838,485.18	0.26
27	002415	海康威视	29,600	1,667,368.00	0.23
28	002475	立讯精密	43,930	1,601,248.50	0.22
29	603486	科沃斯	9,900	1,440,450.00	0.20
30	002507	涪陵榨菜	44,700	1,393,746.00	0.19
31	300114	中航电测	90,400	1,379,504.00	0.19

32	002050	三花智控	57,500	1,359,300.00	0.19
33	002241	歌尔股份	32,300	1,288,770.00	0.18
34	688208	道通科技	16,517	1,220,606.30	0.17
35	688169	石头科技	1,386	944,697.60	0.13
36	300124	汇川技术	10,500	624,855.00	0.09
37	603259	药明康德	3,200	457,696.00	0.06
38	688383	新益昌	2,701	337,760.05	0.05
39	688161	威高骨科	3,069	225,387.36	0.03
40	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.03
41	688733	壹石通	3,409	163,257.01	0.02
42	688091	上海谊众	3,294	130,837.68	0.02
43	688305	科德数控	1,496	127,922.96	0.02
44	301078	孩子王	7,551	43,569.27	0.01
45	301050	雷电微力	233	36,974.77	0.01
46	688272	富吉瑞	1,263	28,493.28	0.00
47	001217	华尔泰	1,239	27,332.34	0.00
48	301029	怡合达	462	27,087.06	0.00
49	301035	润丰股份	644	25,167.52	0.00
50	301039	中集车辆	2,064	22,208.64	0.00
51	301079	邵阳液压	1,396	16,640.32	0.00
52	688722	同益中	3,687	16,628.37	0.00
53	001218	丽臣实业	350	15,928.50	0.00
54	301017	漱玉平民	555	13,059.15	0.00
55	301015	百洋医药	462	12,543.30	0.00
56	301069	凯盛新材	539	12,181.40	0.00
57	300994	久祺股份	420	12,016.20	0.00
58	301021	英诺激光	290	11,347.70	0.00
59	301020	密封科技	421	11,055.46	0.00
60	001216	华瓷股份	1,177	11,028.49	0.00
61	301046	能辉科技	290	10,422.60	0.00
62	301013	利和兴	471	10,046.43	0.00

63	301026	浩通科技	203	9,175.60	0.00
64	301048	金鹰重工	843	8,725.05	0.00
65	301060	兰卫医学	587	8,523.24	0.00
66	301028	东亚机械	733	7,564.56	0.00
67	605567	春雪食品	629	7,422.20	0.00
68	301016	雷尔伟	275	7,084.00	0.00
69	301040	中环海陆	241	6,646.78	0.00
70	301036	双乐股份	205	5,906.05	0.00
71	301004	嘉益股份	312	5,868.72	0.00
72	301032	新柴股份	513	5,755.86	0.00
73	301012	扬电科技	170	5,647.40	0.00
74	300814	中富电路	328	5,484.16	0.00
75	301062	上海艾录	523	5,439.20	0.00
76	301049	超越科技	196	5,354.72	0.00
77	301052	果麦文化	252	5,092.92	0.00
78	300774	倍杰特	444	4,999.44	0.00
79	301056	森赫股份	572	4,970.68	0.00
80	301033	迈普医学	108	4,693.68	0.00
81	001219	青岛食品	272	4,678.40	0.00
82	301030	仕净科技	242	4,631.88	0.00
83	301063	海锅股份	153	4,544.10	0.00
84	301010	晶雪节能	218	4,390.52	0.00
85	301038	深水规院	266	4,271.96	0.00
86	300854	中兰环保	203	4,191.95	0.00
87	301025	读客文化	403	4,030.00	0.00
88	301037	保立佳	193	3,912.11	0.00
89	301027	华蓝集团	286	3,789.50	0.00
90	301053	远信工业	155	3,571.20	0.00
91	301073	C君亭	144	3,244.32	0.00
92	301068	大地海洋	144	3,182.40	0.00
93	301072	C中捷	181	2,827.22	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	601939	建设银行	27,465,445.21	3.34
2	300253	卫宁健康	18,410,639.48	2.24
3	600886	国投电力	15,533,556.00	1.89
4	600570	恒生电子	14,917,730.78	1.82
5	002236	大华股份	13,067,380.00	1.59
6	300059	东方财富	11,911,183.00	1.45
7	600048	保利发展	11,311,594.00	1.38
8	002138	顺络电子	10,512,705.00	1.28
9	600872	中炬高新	9,740,473.74	1.19
10	603501	韦尔股份	9,721,954.86	1.18
11	002511	中顺洁柔	8,803,434.00	1.07
12	601985	中国核电	8,635,067.00	1.05
13	000049	德赛电池	8,494,843.85	1.03
14	002557	洽洽食品	8,247,138.00	1.00
15	002507	涪陵榨菜	7,718,996.59	0.94
16	601607	上海医药	7,461,297.00	0.91
17	600028	中国石化	7,103,117.00	0.86
18	002677	浙江美大	6,790,203.16	0.83
19	601009	南京银行	6,710,562.00	0.82
20	000661	长春高新	5,516,152.24	0.67

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	601939	建设银行	23,978,071.00	2.92
2	300059	东方财富	22,927,204.68	2.79
3	601601	中国太保	18,983,823.55	2.31
4	600048	保利发展	17,824,802.21	2.17
5	601318	中国平安	15,276,099.00	1.86
6	600570	恒生电子	13,884,121.34	1.69
7	600886	国投电力	13,623,216.00	1.66
8	002511	中顺洁柔	9,931,066.69	1.21
9	600298	安琪酵母	9,621,439.00	1.17
10	600036	招商银行	9,531,714.84	1.16
11	002138	顺络电子	9,104,800.58	1.11
12	603501	韦尔股份	8,954,166.00	1.09
13	002508	老板电器	8,897,993.33	1.08
14	600519	贵州茅台	7,593,787.00	0.92
15	000049	德赛电池	7,502,408.77	0.91
16	000333	美的集团	7,469,013.00	0.91
17	600872	中炬高新	7,312,688.00	0.89
18	601985	中国核电	6,622,918.02	0.81
19	002236	大华股份	6,206,231.96	0.76
20	002677	浙江美大	5,918,492.86	0.72

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	343,219,103.13
卖出股票收入（成交）总额	376,190,813.50

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	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

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	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

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投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

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	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,764,668.84

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

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
兴业聚源混合A	936	468,599.19	430,348,772.29	98.12%	8,260,065.43	1.88%
兴业	89	316,540.61	28,028,941.37	99.4	143,172.54	0.51%

聚源混合C				9%		
合计	1,025	455,396.05	458,377,713.66	98.20%	8,403,237.97	1.80%

注：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	兴业聚源混合A	3,485.39	0.00%
	兴业聚源混合C	0.00	0.00%
	合计	3,485.39	0.00%

注：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）。

9.3 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	兴业聚源混合A	0
	兴业聚源混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业聚源混合A	0
	兴业聚源混合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

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
903	542, 723. 78	482, 080, 159. 85	98. 37%	7, 999, 409. 61	1. 63%

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	3, 481. 19	0. 00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动(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	-	-
本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。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日(2016年06月30日)基金份额总额	204,752,395.74
本报告期期初基金份额总额	584,503,761.20
本报告期基金总申购份额	341,228,862.29
减：本报告期基金总赎回份额	435,653,054.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本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。

§ 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，本基金修订后的《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。

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，王慧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、本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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2021年10月13日起，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，主要投资策略由“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。”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6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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

转型后

报告期2021年10月13日 - 2021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	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	40,411,208.29	17.70%	29,553.37	17.70%	-
申万宏源证券	2	187,954,631.82	82.30%	137,448.88	82.30%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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，本期未新增及剔除券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	280,000,000.00	9.20%	-	-	-	-
申万宏源证券	10,094,372.91	100.00%	2,765,000,000.00	90.80%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

转型前

报告期2021年01月01日 - 2021年10月12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	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	99,070,956.78	14.01%	72,450.70	14.01%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	139,716,392.73	19.76%	102,173.53	19.76%	-
国信证券	2	220,291,680.05	31.15%	161,097.81	31.15%	-
海通证券	2	248,031,362.22	35.08%	181,381.51	35.08%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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构处罚。
- 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，本期新增交易单元：国泰君安、广发证券、长江证券；未剔除券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	47,152,377.20	31.97%	1,112,000,000.00	37.85%	-	-	-	-
国信证券	17,399,618.60	11.80%	535,000,000.00	18.21%	-	-	-	-
海通证券	82,958,104.88	56.24%	1,291,100,000.00	43.94%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购(含转换转入和定期定额投资)的公告	中国证监会规定的媒介	2021-03-04
3	兴业聚源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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚源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	2021-09-13
12	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚源灵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	中国证监会规定的媒介	2021-09-14
13	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚源灵	中国证监会规定的媒介	2021-09-15

	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		
14	兴业基金管理有限公司关于兴业聚源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的公告	中国证监会规定的媒介	2021-10-14
15	兴业聚源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公证书	中国证监会规定的媒介	2021-10-14
16	兴业聚源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	2021-10-14
17	兴业聚源混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2021-10-14
18	兴业聚源混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定的媒介	2021-10-14
19	兴业聚源混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2021-10-14
20	兴业聚源混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入和定期定额投资）的公告	中国证监会规定的媒介	2021-10-15
21	兴业聚源混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入和定期定额投资）的公告	中国证监会规定的媒介	2021-10-25
22	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
23	兴业聚源混合型证券投资基金2021年第1次分红公告	中国证监会规定的媒介	2021-10-27
24	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
25	兴业聚源混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入	中国证监会规定的媒介	2021-10-28

	和定期定额投资)的公告		
26	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
27	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
机构	1	20211210-20211212	-	83,279,300.16	-	83,279,300.16	17.84%
	2	20210305-20210608	74,183,234.42	-	74,183,234.42	-	0.00%
	3	20210101-20210301	122,242,391.25	-	122,242,391.25	-	0.00%
	4	20210302-20210304	85,396,242.53	-	85,396,242.53	-	0.00%
	5	20210101-20210606	123,151,888.34	-	52,500,000.00	70,651,888.34	15.14%
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。

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源灵活配置混合型证券投资基金变更注册为兴业聚源混合型证券投资基金的文件

- （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

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