

兴业聚惠混合型证券投资基金
(原兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型)

2022 年中期报告

2022 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:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

原兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金报告期自2022年1月1日至3月15日，兴业聚惠混合型证券投资基金报告期自2022年3月16日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现(转型后)	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	11
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)	54
6.1 资产负债表	54
6.2 利润表	56
6.3 净资产（基金净值）变动表	58
6.4 报表附注	61
§7 投资组合报告(转型后)	91
7.1 期末基金资产组合情况	91
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	92
7.3 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	93
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	95
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
7.6 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	98
7.7 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	98

7.8	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	98
7.9	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	98
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	99
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	99
7.12	投资组合报告附注	99
§7	投资组合报告（转型前）	100
7.1	期末基金资产组合情况	100
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	100
7.3	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	101
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	105
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	107
7.6	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	107
7.7	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	108
7.8	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	108
7.9	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	108
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	108
7.12	投资组合报告附注	108
§8	基金份额持有人信息(转型后)	109
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	109
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	109
8.3	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	110
§8	基金份额持有人信息(转型前)	110
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	110
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	111
8.3	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	111
§9	开放式基金份额变动(转型后)	112
§9	开放式基金份额变动(转型前)	112
§10	重大事件揭示	113
10.1	基金份额持有人大会决议	113
10.2	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	113
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	113
10.4	基金投资策略的改变	113
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	113
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	113
	转型后	113
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	113
	转型前	115
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	115
10.8	其他重大事件	118
§11	影响投资者决策的其他重要信息	119
11.1	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	119
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	120
§12	备查文件目录	120
12.1	备查文件目录	120
12.2	存放地点	120
12.3	查阅方式	120

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金名称	兴业聚惠混合型证券投资基金	
基金简称	兴业聚惠混合	
基金主代码	001547	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2022年03月16日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	305,615,765.44份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
下属分级基金的交易代码	001547	002923
报告期末下属分级基金的份额总额	44,917,849.52份	260,697,915.92份

转型前

基金名称	兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	兴业聚惠灵活配置混合	
基金主代码	001547	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月08日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	529,962,377.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001547	002923
报告期末下属分级基金的份额总额	130,135,838.34份	399,826,539.62份

2.2 基金产品说明

转型后

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。</p> <p>主要投资策略为资产配置策略、债权类资产投资策略、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	通过稳健的资产配置策略，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略充分控制下行风险。因势利导运用多样化的投资策略实现基金份额净值的长期平稳增长。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	兴业基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡斌
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn
客户服务电话	40000-95561	95568

传真	021-22211997	010-57093382
注册地址	福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址	上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	官恒秋	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现(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	报告期 (2022年03月16日-2022年06月30日)	
	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
本期已实现收益	-2,285,914.57	-16,420,244.39
本期利润	3,164,408.91	20,269,539.42
加权平均基金份额本期利润	0.0662	0.0664
本期加权平均净值利润率	3.93%	3.96%

本期基金份额净值增长率	4.23%	4.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	29,074,006.92	164,393,192.37
期末可供分配基金份额利润	0.6473	0.6306
期末基金资产净值	77,378,697.45	446,705,466.71
期末基金份额净值	1.723	1.713
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.23%	4.07%

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

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

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

4、2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业聚惠混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.77%	0.29%	1.68%	0.21%	0.09%	0.08%
过去三个月	2.26%	0.33%	1.55%	0.28%	0.71%	0.05%
自基金合同生效起至今	4.23%	0.36%	2.78%	0.29%	1.45%	0.07%

兴业聚惠混合C

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

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	1.72%	0.28%	1.68%	0.21%	0.04%	0.07%
过去三个月	2.21%	0.33%	1.55%	0.28%	0.66%	0.05%
自基金合同生效起至今	4.07%	0.36%	2.78%	0.29%	1.29%	0.07%

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

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

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业聚惠混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年03月16日-2022年06月30日)



兴业聚惠混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金的业绩比较基准自 2020 年 11 月 4 日起由“三年期银行定期存款利率（税后）+1%。”变更为“中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。
2、2022 年 3 月 16 日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年03月15日)	
	兴业聚惠灵活配置 混合A	兴业聚惠灵活配置 混合C
本期已实现收益	-405,254.71	-1,467,913.38
本期利润	-15,347,843.15	-49,811,413.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1045	-0.1062
本期加权平均净值利润率	-6.07%	-6.20%
本期基金份额净值增长率	-6.24%	-6.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末	

	(2022年03月15日)	
期末可供分配利润	85,042,790.00	258,278,022.44
期末可供分配基金份额利润	0.6535	0.6460
期末基金资产净值	215,178,628.34	658,104,562.06
期末基金份额净值	1.6530	1.6460
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年03月15日)	
基金份额累计净值增长率	65.30%	42.88%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

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

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

4、2022年3月16日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业聚惠灵活配置混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月 (2022年03月01日-2022年03月15日)	-3.05%	0.41%	-2.89%	0.37%	-0.16%	0.04%
过去三个月 (2022年01月01日-2022年03月15日)	-6.24%	0.33%	-4.09%	0.28%	-2.15%	0.05%

过去六个月 (2021年10月01日-2022年03月15日)	-3.67%	0.27%	-3.31%	0.22%	-0.36%	0.05%
过去一年(2021年04月01日-2022年03月15日)	-0.72%	0.29%	-2.91%	0.22%	2.19%	0.07%
过去三年(2019年04月01日-2022年03月15日)	34.94%	0.32%	4.69%	0.16%	30.25%	0.16%
自基金合同生效起至今 (2015年07月08日-2022年03月15日)	65.30%	0.30%	18.62%	0.11%	46.68%	0.19%

兴业聚惠灵活配置混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月 (2022年03月01日-2022年03月15日)	-3.06%	0.38%	-2.89%	0.37%	-0.17%	0.01%
过去三个月 (2022年01月01日-2022年03月15日)	-6.21%	0.32%	-4.09%	0.28%	-2.12%	0.04%
过去六个月 (2021年10月01日-2022年03月15日)	-3.69%	0.27%	-3.31%	0.22%	-0.38%	0.05%

过去一年(2021年04月01日-2022年03月15日)	-0.78%	0.28%	-2.91%	0.22%	2.13%	0.06%
过去三年(2019年04月01日-2022年03月15日)	34.48%	0.32%	4.69%	0.16%	29.79%	0.16%
自基金合同生效起至今(2016年07月01日-2022年03月15日)	42.88%	0.26%	14.87%	0.12%	28.01%	0.14%

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业聚惠灵活配置混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



兴业聚惠灵活配置混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金的业绩比较基准自 2020 年 11 月 4 日起由“三年期银行定期存款利率（税后）+1%。”变更为“中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。
2、2022 年 3 月 16 日起“兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金”转型为“兴业聚惠混合型证券投资基金”，兴业聚惠混合型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

§ 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2022年06月30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	2017-01-19	-	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。

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 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，“疫情”是国内经济、政策的关键词。市场反复在试图给疫情的冲击进行定价，并不断预测疫后经济复苏的斜率。显然，这是一个相对复杂的问题，我们将组合立足于相对确定的资金面上，以票息和骑乘收益为核心构建资产，并利用预期差进行适度的波段调整。在基本面相对偏弱概率更大的情况下，组合整体保持中性略偏积极的弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

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

截至2022年6月30日，兴业聚惠混合A基金份额净值为1.723元；自2022年3月16日至2022年6月30日本基金份额净值增长率为4.23%，同期业绩比较基准收益率为2.78%。

截至2022年6月30日，兴业聚惠混合C基金份额净值为1.713元；自2022年3月16日至2022年6月30日本基金份额净值增长率为4.07%，同期业绩比较基准收益率为2.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年市场参与者面对的场景更加复杂、多样，这促使我们在实践中去思考相对高效的策略方法。债券市场交易可以看作以全市场企业融资成本为中枢的零和博弈。那么，在策略选择上，结构应该是优先于趋势的。基于资金面相对宽松为基础，以票息和骑乘作为构建资产的出发点，在市场的变化运行中加入个券的挑选、曲线的搭配，实现一定程度的资本利得，是一个看似朴素却很实用的办法。展望后续，三季度或是一个看似平稳的时间段，持券观望是相对合适的。但变化往往在平静中酝酿，我们务实操作的同时需要足够的关注。我们也希望在一次次市场波动中优化自己的实践方法，以平稳的心态和扎实的评估去走好每一步。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,787,603.65
结算备付金		8,809,734.06
存出保证金		114,476.97

交易性金融资产	6.4.7.2	603,453,518.75
其中：股票投资		113,179,310.59
基金投资		-
债券投资		490,274,208.16
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		1,878,539.33
应收股利		-
应收申购款		1,172,846.94
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		632,216,719.70
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		68,000,000.00
应付清算款		10,011,397.18
应付赎回款		29,545,077.76
应付管理人报酬		269,664.39

应付托管费		44,944.07
应付销售服务费		38,622.81
应付投资顾问费		-
应交税费		16,462.66
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	206,386.67
负债合计		108,132,555.54
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	305,615,765.44
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	218,468,398.72
净资产合计		524,084,164.16
负债和净资产总计		632,216,719.70

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额305,615,765.44份，其中下属A类基金份额净值1.723元，基金份额44,917,849.52份，下属C类基金份额净值1.713元，基金份额260,697,915.92份。

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

6.2 利润表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月16日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年03月16日至2022年0 6月30日
一、营业总收入		25,454,818.81
1. 利息收入		65,827.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	61,574.39
债券利息收入		-

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,252.61
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,450,830.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,040,978.44
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	5,678,246.32
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	911,901.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	42,140,107.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	699,715.35
减：二、营业总支出		2,020,870.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,042,774.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	173,795.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	150,362.51
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		530,211.14
其中：卖出回购金融资产支出		530,211.14
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		9,706.50
8. 其他费用	6.4.7.18	114,020.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,433,948.33
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,433,948.33
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		23,433,948.33

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

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月16日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	529,962,377.96	-	343,320,812.44	873,283,190.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	529,962,377.96	-	343,320,812.44	873,283,190.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-224,346,612.52	-	-124,852,413.72	-349,199,026.24
（一）、综合收益总额	-	-	23,433,948.33	23,433,948.33
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-224,346,612.52	-	-148,286,362.05	-372,632,974.57
其中：1. 基金申购款	45,055,539.2	-	30,834,628.5	75,890,167.7

	7		1	8
2. 基金赎回款	-269,402,15 1.79	-	-179,120,99 0.56	-448,523,14 2.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	305,615,765. 44	-	218,468,398. 72	524,084,164. 16

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业聚惠混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合”)转型而来。兴业聚惠灵活配置混合系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]1274号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为207,655,310.13份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(15)第1160号的验资报告。基金合同于2015年7月8日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

2022年3月16日兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会。会议审议了《关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业聚

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、银行存款、同业存单、债券（国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-40%，本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的20%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准自2020年11月4日起由“三年期银行定期存款利率（税后）+1%”变更为：中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022年3月16日（基金合同生效日）至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2022年3月16日（基金合同生效日）至2022年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易

日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

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

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

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。【基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。/基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的

拆分比例计算认列。】 申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

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

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

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

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

（3）公允价值变动收益

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

（4）信用减值损失

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

6.4.4.10 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。

兴业聚惠混合A不收取销售服务费；兴业聚惠混合C的销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务，按前一日C类基金份额基金资产净值的0.10%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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

4) A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

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

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

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

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

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	16,787,603.65
等于: 本金	16,786,690.07
加: 应计利息	913.58
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	16,787,603.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	109,153,512.64	-	113,179,310.59	4,025,797.95	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	164,691,168.02	2,555,284.28	167,581,492.28	335,039.98
	银行间市场	317,734,028.66	4,278,215.88	322,692,715.88	680,471.34
	合计	482,425,196.68	6,833,500.16	490,274,208.16	1,015,511.32
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	591,578,709.32	6,833,500.16	603,453,518.75	5,041,309.27	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	113,084.11
其中：交易所市场	109,209.11
银行间市场	3,875.00
应付利息	-
预提费用	93,302.56
合计	206,386.67

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴业聚惠混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合A)	本期 2022年03月16日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	130,135,838.34	130,135,838.34
本期申购	153,767.47	153,767.47
本期赎回（以“-”号填列）	-85,371,756.29	-85,371,756.29
本期末	44,917,849.52	44,917,849.52

6.4.7.7.2 兴业聚惠混合C

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合C)	本期 2022年03月16日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	399,826,539.62	399,826,539.62
本期申购	44,901,771.80	44,901,771.80
本期赎回（以“-”号填列）	-184,030,395.50	-184,030,395.50
本期末	260,697,915.92	260,697,915.92

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴业聚惠混合A

单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	90,316,287.28	-5,273,497.28	85,042,790.00
本期利润	-2,285,914.57	5,450,323.48	3,164,408.91
本期基金份额交易产生的变动数	-58,956,365.79	3,210,014.81	-55,746,350.98
其中：基金申购款	101,051.58	4,228.84	105,280.42
基金赎回款	-59,057,417.37	3,205,785.97	-55,851,631.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,074,006.92	3,386,841.01	32,460,847.93

6.4.7.8.2 兴业聚惠混合C

单位：人民币元

项目 (兴业聚惠混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	271,247,554.25	-12,969,531.81	258,278,022.44
本期利润	-16,420,244.39	36,689,783.81	20,269,539.42
本期基金份额交易产生的变动数	-90,434,117.49	-2,105,893.58	-92,540,011.07
其中：基金申购款	28,274,913.32	2,454,434.77	30,729,348.09

基金赎回款	-118,709,030.81	-4,560,328.35	-123,269,359.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	164,393,192.37	21,614,358.42	186,007,550.79

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年03月16日至2022年06月30日	
活期存款利息收入	22,789.47	
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	38,184.71	
其他	600.21	
合计	61,574.39	

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年03月16日至2022年06月30日	
卖出股票成交总额	148,523,808.47	
减：卖出股票成本总额	172,221,667.43	
减：交易费用	343,119.48	
买卖股票差价收入	-24,040,978.44	

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年03月16日至2022年06月30日	
债券投资收益——利息收入	5,810,744.60	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-132,498.28	

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,678,246.32

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	536,139,383.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	530,127,392.89
减：应计利息总额	6,139,228.01
减：交易费用	5,260.57
买卖债券差价收入	-132,498.28

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	911,901.29

基金投资产生的股利收益	-
合计	911,901.29

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年03月16日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	42,140,107.29
——股票投资	40,165,526.50
——债券投资	1,974,580.79
——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	42,140,107.29

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月16日至2022年06月30日
基金赎回费收入	699,715.35
合计	699,715.35

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年06月30日
审计费用	14,657.93
信息披露费	35,178.39
汇划手续费	3,284.10
帐户维护费	10,900.00
律师费	40,000.00
公证费	10,000.00
合计	114,020.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

业财富”)

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的回购交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月16日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,042,774.21
其中：支付销售机构的客户维护费	243,153.21

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年03月16日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	173,795.70

注：支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年03月16日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C	合计
兴业基金	0.00	78,001.37	78,001.37
兴业银行	0.00	928.07	928.07
合计	0.00	78,929.44	78,929.44

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期
------	----

称	2022年03月16日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生 银行股份 有限公司	16,787,603.65	22,789.47

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

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	1-6个月（含）	新股打新限售	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688048	长光华芯	2022-03-25	1-6个月（含）	科创板打新限售	80.80	111.97	6,613	534,330.40	740,457.61	-
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内（含）	新股未上市	21.93	21.93	12,387	271,646.91	271,646.91	-

688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内（含）	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688193	仁度生物	2022-03-23	1-6个月（含）	科创板打新限售	72.65	51.57	1,635	118,782.75	84,316.95	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月（含）	创业板打新限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301236	软通动力	2022-03-08	1-6个月（含）	创业板打新限售	48.57	31.38	1,277	62,020.88	40,072.26	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	创业板打新限售	72.82	45.69	776	56,508.10	35,455.44	-
301216	万凯新材	2022-03-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	96.54	87.82	346	33,404.16	30,385.72	-
301215	中汽股份	2022-02-28	1-6个月（含）	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-

				售						
301109	军信股份	2022-04-06	1-6个月（含）	创业板打新限售	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301150	中一科技	2022-04-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	109.04	82.76	309	33,693.36	25,572.84	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月（含）	创业板打新限售	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301263	泰恩康	2022-03-22	1-6个月（含）	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月（含）	创业板打新限售	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月（含）	创业板打新限售	55.57	30.03	623	34,620.11	18,708.69	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
3011	国能	2022	1-6个月	创业	45.1	54.1	334	15,0	18,0	-

62	日新	-04-19	(含)	板打 新限售	3	1		73.4 2	72.7 4	
3011 53	中科 江南	2022 -05- 10	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	33.6 8	43.9 8	398	13,4 04.6 4	17,5 04.0 4	-
3011 23	奕东 电子	2022 -01- 14	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	37.2 3	25.3 9	656	24,4 22.8 8	16,6 55.8 4	-
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	32.6 9	32.0 2	507	16,5 75.0 0	16,2 34.1 4	-
3011 20	新特 电气	2022 -04- 11	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	13.7 3	15.4 9	1,032	14,1 69.3 6	15,9 85.6 8	-
3012 35	华康 医疗	2022 -01- 21	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	39.3 0	37.9 3	418	16,4 27.4 0	15,8 54.7 4	-
3011 51	冠龙 节能	2022 -03- 30	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	30.8 2	21.4 6	703	21,6 66.4 6	15,0 86.3 8	-
3011 17	佳缘 科技	2022 -01- 07	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	46.8 0	54.4 4	262	12,2 61.6 0	14,2 63.2 8	-
3012 48	杰创 智能	2022 -04- 13	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	39.0 7	29.8 7	472	18,4 41.0 4	14,0 98.6 4	-

				售						
301148	嘉戎技术	2022-04-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301258	富士莱	2022-03-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301097	天益医疗	2022-03-25	1-6个月（含）	创业板打新限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301237	和顺科技	2022-03-16	1-6个月（含）	创业板打新限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022-01-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
3012	清研	2022	1-6个月	创业	19.0	19.9	452	8,62	9,03	-

88	环境	-04-14	(含)	板打 新限售	9	8		8.68	0.96	
3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	22.5 5	37.7 0	237	5,34 4.35	8,93 4.90	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	40.2 5	30.5 9	257	10,3 44.2 5	7,86 1.63	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个月以 上	创业 板打 新限售	20.0 8	20.3 4	373	7,48 9.84	7,58 6.82	-

注：对于流通受限期内发生权益分派的股票，上表列示的认购价格为实际认购价格除权后的价格。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30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68,000,000.00元，于2022年7月1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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金报告期末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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日
AAA	283,716,463.55
AAA以下	73,836,877.21
未评级	0.00
合计	357,553,340.76

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,787,603.65	-	-	-	16,787,603.65
结算备付金	8,809,734.06	-	-	-	8,809,734.06
存出保证金	114,476.97	-	-	-	114,476.97

交易性金融资产	69,554,009.76	338,822,440.59	81,897,757.81	113,179,310.59	603,453,518.75
应收清算款	-	-	-	1,878,539.33	1,878,539.33
应收申购款	-	-	-	1,172,846.94	1,172,846.94
资产总计	95,265,824.44	338,822,440.59	81,897,757.81	116,230,696.86	632,216,719.70
负债					
卖出回购金融资产款	68,000,000.00	-	-	-	68,000,000.00
应付清算款	-	-	-	10,011,397.18	10,011,397.18
应付赎回款	-	-	-	29,545,077.76	29,545,077.76
应付管理人报酬	-	-	-	269,664.39	269,664.39
应付托管费	-	-	-	44,944.07	44,944.07
应付销售服务费	-	-	-	38,622.81	38,622.81
应交税费	-	-	-	16,462.66	16,462.66
其他负债	-	-	-	206,386.67	206,386.67
负债总计	68,000,000.00	-	-	40,132,555.54	108,132,555.54
利率敏感度缺口	27,265,824.44	338,822,440.59	81,897,757.81	76,098,141.32	524,084,164.16

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
假设	2、利率曲线平行移动	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末

		2022年06月30日
	市场利率上升25个基点	-4,999,015.13
	市场利率下降25个基点	5,061,237.46

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	113,179,310.59	21.60
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	113,179,310.59	21.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年06月30日
	股票价格上升5%	5,658,965.53
	股票价格下降5%	-5,658,965.53

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	110,520,958.09
第二层次	490,082,524.45
第三层次	2,850,036.21
合计	603,453,518.75

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年03月15日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,191,637.39	12,205,999.15
结算备付金		7,601,321.87	5,233,300.99
存出保证金		132,727.04	116,320.27
交易性金融资产	6.4.7.2	920,582,722.50	1,116,344,081.56
其中：股票投资		167,999,972.56	231,783,590.66
基金投资		-	-
债券投资		752,582,749.94	884,560,490.90
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	70,000,222.50
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		59,871,190.87	659,379.51
应收股利		-	-
应收申购款		343,746.88	744,859.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	11,207,717.28
资产总计		1,000,723,346.55	1,216,511,880.63
负债和净资产	附注号	本期末 2022年03月15日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		118,513,613.42	109,944,710.08
应付清算款		4,523,298.37	988,133.55
应付赎回款		3,729,079.45	4,253,584.02
应付管理人报酬		231,082.03	488,758.50
应付托管费		38,513.67	81,459.77
应付销售服务费		29,271.62	57,839.09
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,868.46	26,799.03
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	361,429.13	391,482.59
负债合计		127,440,156.15	116,232,766.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	529,962,377.96	626,293,354.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	343,320,812.44	473,985,759.71
净资产合计		873,283,190.40	1,100,279,114.00
负债和净资产总计		1,000,723,346.55	1,216,511,880.63

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

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

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

6.2 利润表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年03月15日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
一、营业总收入		-63,032,069.30	35,717,006.20
1. 利息收入		90,950.40	13,587,852.60
其中：存款利息收入	6.4.7.9	32,071.90	58,175.11
债券利息收入		-	13,390,254.55

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,878.50	139,422.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		131,946.82	25,294,072.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,147,981.94	22,130,579.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	5,291,241.52	1,935,118.85
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-11,312.76	1,228,374.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-63,286,088.81	-3,413,396.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	31,122.29	248,477.57
减：二、营业总支出		2,127,187.60	4,373,484.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,295,032.37	2,548,660.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	215,838.72	424,776.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	164,378.11	277,445.53

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		394,603.53	316,969.50
其中：卖出回购金融资产支出		394,603.53	316,969.50
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		9,676.00	33,767.69
8. 其他费用	6.4.7.18	47,658.87	771,864.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-65,159,256.90	31,343,521.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-65,159,256.90	31,343,521.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-65,159,256.90	31,343,521.44

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

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

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年03月15日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	626,293,354.29	-	473,985,759.71	1,100,279,114.00

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	626,293,354. 29	-	473,985,759. 71	1,100,279,11 4.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-96,330,976. 33	-	-130,664,94 7.27	-226,995,92 3.60
（一）、综合收益总 额	-	-	-65,159,256. 90	-65,159,256. 90
（二）、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数（净值减 少以“-”号填列）	-96,330,976. 33	-	-65,505,690. 37	-161,836,66 6.70
其中：1. 基金申购款	80,605,665.6 2	-	58,538,185.8 3	139,143,851. 45
2. 基金赎回 款	-176,936,64 1.95	-	-124,043,87 6.20	-300,980,51 8.15
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	529,962,377. 96	-	343,320,812. 44	873,283,190. 40
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	492,424,778.	-	320,325,973.	812,750,751.

（基金净值）	41		02	43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	492,424,778. 41	-	320,325,973. 02	812,750,751. 43
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	84,476,261.0 4	-	88,501,936.4 2	172,978,197. 46
（一）、综合收益总 额	-	-	31,343,521.4 4	31,343,521.4 4
（二）、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数（净值减 少以“-”号填列）	84,476,261.0 4	-	57,158,414.9 8	141,634,676. 02
其中：1. 基金申购款	271,024,278. 60	-	183,055,771. 15	454,080,049. 75
2. 基金赎回 款	-186,548,01 7.56	-	-125,897,35 6.17	-312,445,37 3.73
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	576,901,039. 45	-	408,827,909. 44	985,728,948. 89

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]1274号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为207,655,310.13份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(15)第1160号的验资报告。基金合同于2015年7月8日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据2016年6月28日发布的《关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》,从2016年7月1日起,本基金增设C级基金份额(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合C”),原有模式份额为A类基金份额(以下简称“兴业聚惠灵活配置混合A”)。其中,兴业聚惠灵活配置混合A是指在投资人申购基金时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;兴业聚惠灵活配置混合C是指从本类别基金资产中计提销售服务费,并不再收取申购费用的基金份额。

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。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%-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自2020年11月4日起由“三年期银行定期存款利率（税后）+1%。”变更为“中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%”。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

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

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融

资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

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

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

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

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

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日
活期存款	12,191,637.39
等于：本金	12,173,173.53
加：应计利息	18,463.86
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	12,191,637.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	204,139,701.11	-	167,999,972.56	-36,139,728.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	181,244,040.09	2,966,732.95	183,812,152.95	-398,620.09
	银行间市场	561,001,949.38	8,329,096.99	568,770,596.99	-560,449.38
	合计	742,245,989.47	11,295,829.94	752,582,749.94	-959,069.47
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	946,385,690.58	11,295,829.94	920,582,722.50	-37,098,798.02	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	174,562.89
其中：交易所市场	167,387.76
银行间市场	7,175.13
应付利息	-
预提费用	186,866.24
合计	361,429.13

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴业聚惠灵活配置混合A

金额单位：人民币元

项目 (兴业聚惠灵活配置混合A)	本期 2022年01月01日至2022年03月15日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,350,166.22	151,350,166.22

本期申购	1,067,630.17	1,067,630.17
本期赎回（以“-”号填列）	-22,281,958.05	-22,281,958.05
本期末	130,135,838.34	130,135,838.34

6.4.7.7.2 兴业聚惠灵活配置混合C

金额单位：人民币元

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

注：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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴业聚惠灵活配置混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	105,597,246.57	9,818,056.87	115,415,303.44
本期利润	-405,254.71	-14,942,588.44	-15,347,843.15
本期基金份额交易产生的变动数	-14,875,704.58	-148,965.71	-15,024,670.29
其中：基金申购款	749,251.91	37,772.95	787,024.86
基金赎回款	-15,624,956.49	-186,738.66	-15,811,695.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,316,287.28	-5,273,497.28	85,042,790.00

6.4.7.8.2 兴业聚惠灵活配置混合C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	324,142,834.75	34,427,621.52	358,570,456.27

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

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
活期存款利息收入	11,891.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,760.82
其他	419.62
合计	32,071.90

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
卖出股票成交总额	111,129,354.10
减：卖出股票成本总额	115,960,913.56
减：交易费用	316,422.48
买卖股票差价收入	-5,147,981.94

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年03月15日
债券投资收益——利息收入	5,806,369.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-515,128.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,291,241.52

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年03月15日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	658,368,281.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	651,613,374.37
减：应计利息总额	7,263,037.64
减：交易费用	6,997.49
买卖债券差价收入	-515,128.26

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
股票投资产生的股利收益	-11,312.76
基金投资产生的股利收益	-
合计	-11,312.76

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
1. 交易性金融资产	-63,286,088.81
——股票投资	-59,920,735.04
——债券投资	-3,365,353.77
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-63,286,088.81

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
基金赎回费收入	31,122.29
合计	31,122.29

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日
审计费用	10,137.26
信息披露费	24,328.98
汇划手续费	5,492.63
帐户维护费	7,700.00
合计	47,658.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

中海集团投资有限公司(以下简称“中海集团”)	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司（以下简称“兴业财富”）	基金管理人控制的公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的回购交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,295,032.37	2,548,660.38
其中：支付销售机构的客户维护费	172,107.15	63,659.06

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年03月15日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	215,838.72	424,776.78

注：支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年03月15日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	合计
兴业基金	0.00	74,632.66	74,632.66
兴业银行	0.00	928.07	928.07
合计	0.00	75,560.73	75,560.73
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业聚惠灵活配置混合A	兴业聚惠灵活配置混合C	合计
兴业基金	0.00	86,795.80	86,795.80
兴业银行	0.00	2,359.09	2,359.09
合计	0.00	89,154.89	89,154.89

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金不收取销售服务费，C类基金按前一日C类份额基金资产净值的0.10%的年费率计提，逐日累计，

按月支付。其计算公式为：C类基金日销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期间未及上年度可比期间未无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年03月15日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	12,191,637.39	11,891.46	23,191,460.51	44,161.38

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

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年03月15日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688082	盛美上海	2021-11-10	1-6个月（含）	科创板打新限售	85.00	86.99	7,403	629,255.00	643,986.97	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1个月内（含）	新股未上市	173.98	173.98	1,728	300,637.44	300,637.44	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1个月内（含）	新股未上市	39.88	39.88	5,772	230,187.36	230,187.36	-
688280	精进电动	2021-10-19	1-6个月（含）	科创板打新限售	13.78	10.12	21,211	292,287.58	214,655.32	-
688282	理工导航	2022-03-10	1个月内（含）	新股未上市	65.21	65.21	3,185	207,693.85	207,693.85	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	42.50	42.50	3,506	149,005.00	149,005.00	-
301256	华融化学	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	8.05	8.05	16,477	132,639.85	132,639.85	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1个月内（含）	新股未上市	15.37	15.37	5,787	88,946.19	88,946.19	-
3011	海力	2021	1-6个月	创业	60.6	87.6	861	52,2	75,4	-

55	风电	-11-17	(含)	板打 新限售	6	2		28.2 6	40.8 2	
3012 36	软通 动力	2022 -03- 08	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	72.8 8	57.1 6	851	62,0 20.8 8	48,6 43.1 6	-
3012 06	三元 生物	2022 -01- 26	6个月以 上	创业 板打 新限售	109. 30	91.7 9	517	56,5 08.1 0	47,4 55.4 3	-
3012 00	大族 数控	2022 -02- 18	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	76.5 6	54.1 6	857	65,6 11.9 2	46,4 15.1 2	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	19.1 1	178. 48	220	4,20 4.20	39,2 65.6 0	-
3012 01	诚达 药业	2022 -01- 12	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	72.6 9	108. 82	353	25,6 59.5 7	38,4 13.4 6	-
3012 19	腾远 钴业	2022 -03- 10	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	173. 98	173. 98	192	33,4 04.1 6	33,4 04.1 6	-
3011 77	迪阿 股份	2021 -12- 08	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	116. 88	76.3 3	436	50,9 59.6 8	33,2 79.8 8	-
3010 87	可孚 医疗	2021 -10- 15	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	93.0 9	64.6 2	515	47,9 41.3 5	33,2 79.3 0	-

				售						
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	56.88	50.75	569	32,364.72	28,876.75	-
301090	华润材料	2021-10-19	1-6个月（含）	创业板打新限售	10.45	10.30	2,764	28,883.80	28,469.20	-
301215	中汽股份	2022-02-28	1-6个月（含）	创业板打新限售	3.80	5.73	4,743	18,023.40	27,177.39	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.88	39.88	642	25,602.96	25,602.96	-
001308	康冠科技	2022-03-10	1个月内（含）	新股未上市	48.84	48.84	513	25,054.92	25,054.92	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	25.80	24.51	967	24,948.60	23,701.17	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月（含）	创业板打新限售	55.57	36.18	623	34,620.11	22,540.14	-
301166	优宁维	2021-12-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	86.06	83.89	253	21,773.18	21,224.17	-
301096	百诚医药	2021-12-	1-6个月（含）	创业板打	79.60	75.75	272	21,651.2	20,604.0	-

		13		新限售				0	0	
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月（含）	创业板打新限售	50.31	63.08	301	15,143.31	18,987.08	-
301235	华康医疗	2022-01-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.30	45.16	418	16,427.40	18,876.88	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	1-6个月（含）	创业板打新限售	5.17	34.74	539	2,786.63	18,724.86	-
301093	华兰股份	2021-10-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	58.08	41.95	409	23,754.72	17,157.55	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	37.23	25.31	656	24,422.88	16,603.36	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	42.50	42.50	390	16,575.00	16,575.00	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	1-6个月（含）	创业板打新限售	66.18	36.39	435	28,788.30	15,829.65	-
301091	深城交	2021-10-20	1-6个月（含）	创业板打新限售	36.50	28.97	524	19,126.00	15,180.28	-

301168	通灵股份	2021-12-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	39.08	45.52	329	12,857.32	14,976.08	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	8.05	8.05	1,831	14,739.55	14,739.55	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	1-6个月（含）	创业板打新限售	46.80	51.22	262	12,261.60	13,419.64	-
301078	孩子王	2021-09-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	5.77	17.60	756	4,362.12	13,305.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	10.48	34.79	379	3,971.92	13,185.41	-
301100	风光股份	2021-12-10	6个月以上	创业板打新限售	27.81	21.34	599	16,658.19	12,782.66	-
301118	恒光股份	2021-11-09	1-6个月（含）	创业板打新限售	22.70	40.57	315	7,150.50	12,779.55	-
301190	善水科技	2021-12-17	1-6个月（含）	创业板打新限售	27.85	22.01	575	16,013.75	12,655.75	-
301179	泽宇智能	2021-12-	1-6个月（含）	创业板打	43.99	42.42	295	12,977.0	12,513.9	-

		01		新限售				5	0	
301108	洁雅股份	2021-11-25	1-6个月（含）	创业板打新限售	57.27	43.86	280	16,035.60	12,280.80	-
301101	明月镜片	2021-12-09	1-6个月（含）	创业板打新限售	26.91	32.55	371	9,983.61	12,076.05	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	13.00	18.34	647	8,411.00	11,865.98	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	1-6个月（含）	创业板打新限售	33.98	34.36	332	11,281.36	11,407.52	-
301196	唯科科技	2022-01-04	1-6个月（含）	创业板打新限售	64.08	39.45	271	17,365.68	10,690.95	-
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月（含）	创业板打新限售	11.40	17.95	577	6,577.80	10,357.15	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	1-6个月（含）	创业板打新限售	15.37	15.37	644	9,898.28	9,898.28	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	1-6个月（含）	创业板打新限售	29.28	24.47	402	11,770.56	9,836.94	-

3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	22.5 5	41.1 2	237	5,34 4.35	9,74 5.44	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个月以 上	创业 板打 新限 售	20.0 8	25.4 7	373	7,48 9.84	9,50 0.31	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	36.3 1	28.4 9	323	11,7 28.1 3	9,20 2.27	-
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	26.1 7	30.3 2	285	7,45 8.45	8,64 1.20	-
3011 81	标榜 股份	2022 -02- 11	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	40.2 5	30.5 4	257	10,3 44.2 5	7,84 8.78	-
3011 93	家联 科技	2021 -12- 02	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	30.7 3	25.5 6	297	9,12 6.81	7,59 1.32	-
3010 98	金埔 园林	2021 -11- 04	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	12.3 6	22.7 4	307	3,79 4.52	6,98 1.18	-
3010 72	中捷 精工	2021 -09- 22	1-6个月 (含)	创业 板打 新限 售	7.46	38.1 2	181	1,35 0.26	6,89 9.72	-
3011 82	凯旺 科技	2021 -12-	1-6个月 (含)	创业 板打	27.1 2	22.7 1	294	7,97 3.28	6,67 6.74	-

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

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金报告期末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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	61,133,071.23	120,429,000.00
合计	61,133,071.23	120,429,000.00

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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	上年度末
--------	-----	------

	2022年03月15日	2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	117,082,000.00
合计	0.00	117,082,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
AAA	463,623,811.96	247,767,000.00
AAA以下	73,407,878.78	82,855,625.90
未评级	0.00	0.00
合计	537,031,690.74	330,622,625.90

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 3月15日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,191,637.39	-	-	-	12,191,637.39
结算备付金	7,601,321.87	-	-	-	7,601,321.87
存出保证金	132,727.04	-	-	-	132,727.04
交易性金融资产	138,136,074.89	530,704,484.34	83,742,190.71	167,999,972.56	920,582,722.50
应收清算款	-	-	-	59,871,190.87	59,871,190.87
应收申购款	-	-	-	343,746.88	343,746.88
资产总	158,061,761.19	530,704,484.34	83,742,190.71	228,214,910.31	1,000,723,346.55

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

计					
负债					
卖出回购金融资产款	118,513,613.42	-	-	-	118,513,613.42
应付清算款	-	-	-	4,523,298.37	4,523,298.37
应付赎回款	-	-	-	3,729,079.45	3,729,079.45
应付管理人报酬	-	-	-	231,082.03	231,082.03
应付托管费	-	-	-	38,513.67	38,513.67
应付销售服务费	-	-	-	29,271.62	29,271.62
应交税费	-	-	-	13,868.46	13,868.46
其他负债	-	-	-	361,429.13	361,429.13
负债总计	118,513,613.42	-	-	8,926,542.73	127,440,156.15
利率敏感度缺口	39,548,147.77	530,704,484.34	83,742,190.71	219,288,367.58	873,283,190.40
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,205,999.15	-	-	-	12,205,999.15
结算备付金	5,233,300.99	-	-	-	5,233,300.99
存出保证金	116,320.27	-	-	-	116,320.27
交易性金融资产	332,773,490.90	300,987,000.00	250,800,000.00	231,783,590.66	1,116,344,081.56
买入返售金融资产	70,000,222.50	-	-	-	70,000,222.50
应收证券清算	-	-	-	659,379.51	659,379.51

款					
应收利息	-	-	-	11,207,717.28	11,207,717.28
应收申购款	-	-	-	744,859.37	744,859.37
资产总计	420,329,333.81	300,987,000.00	250,800,000.00	244,395,546.82	1,216,511,880.63
负债					
卖出回购金融资产款	109,944,710.08	-	-	-	109,944,710.08
应付证券清算款	-	-	-	988,133.55	988,133.55
应付赎回款	-	-	-	4,253,584.02	4,253,584.02
应付管理人报酬	-	-	-	488,758.50	488,758.50
应付托管费	-	-	-	81,459.77	81,459.77
应付销售服务费	-	-	-	57,839.09	57,839.09
应付交易费用	-	-	-	229,264.70	229,264.70
应交税费	-	-	-	26,799.03	26,799.03
应付利息	-	-	-	-16,782.11	-16,782.11
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	109,944,710.08	-	-	6,288,056.55	116,232,766.63
利率敏感度缺口	310,384,623.73	300,987,000.00	250,800,000.00	238,107,490.27	1,100,279,114.00

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变
假设	2、利率曲线平行移动

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升25个基点	-6,932,396.23	-7,272,517.40
	市场利率下降25个基点	6,990,667.11	7,421,813.64

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年03月15日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	167,999,972.56	19.24	231,783,590.66	21.07

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	167,999,972.56	19.24	231,783,590.66	21.07

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年03月15日	上年度末 2021年12月31日
	股票价格上升5%	8,399,998.63	11,589,179.53
	股票价格下降5%	-8,399,998.63	-11,589,179.53

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年03月15日
---------------	--------------------

第一层次	164,950,761.06
第二层次	753,817,134.50
第三层次	1,814,826.94
合计	920,582,722.50

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告(转型后)

7.1 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	113,179,310.59	17.90
	其中：股票	113,179,310.59	17.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	490,274,208.16	77.55
	其中：债券	490,274,208.16	77.55
	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	25,597,337.71	4.05
8	其他各项资产	3,165,863.24	0.50
9	合计	632,216,719.70	100.00

7.2 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	3,499,017.44	0.67
C	制造业	65,078,629.82	12.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,830,690.00	1.49
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,676,909.00	1.85
J	金融业	25,158,333.60	4.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,836,137.93	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	41,997.72	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	113,179,310.59	21.60
--	----	----------------	-------

7.3 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	711,504	18,072,201.60	3.45
2	600519	贵州茅台	4,100	8,384,500.00	1.60
3	600690	海尔智家	301,600	8,281,936.00	1.58
4	601985	中国核电	1,141,500	7,830,690.00	1.49
5	002236	大华股份	265,070	4,352,449.40	0.83
6	600522	中天科技	152,500	3,522,750.00	0.67
7	600926	杭州银行	224,200	3,358,516.00	0.64
8	000333	美的集团	55,400	3,345,606.00	0.64
9	600570	恒生电子	68,634	2,988,324.36	0.57
10	600845	宝信软件	53,900	2,942,940.00	0.56
11	600887	伊利股份	71,000	2,765,450.00	0.53
12	300760	迈瑞医疗	8,700	2,724,840.00	0.52
13	002460	赣锋锂业	17,600	2,617,120.00	0.50
14	600745	闻泰科技	30,500	2,595,855.00	0.50
15	002555	三七互娱	119,400	2,534,862.00	0.48
16	600460	士兰微	48,500	2,522,000.00	0.48
17	002138	顺络电子	84,600	2,305,350.00	0.44
18	000858	五粮液	11,300	2,281,809.00	0.44
19	600809	山西汾酒	6,900	2,241,120.00	0.43
20	601225	陕西煤业	102,300	2,166,714.00	0.41
21	601009	南京银行	179,600	1,871,432.00	0.36
22	600919	江苏银行	260,700	1,856,184.00	0.35
23	603259	药明康德	17,140	1,782,388.60	0.34
24	002050	三花智控	62,000	1,703,760.00	0.33

25	300171	东富龙	50,000	1,695,500.00	0.32
26	600085	同仁堂	31,894	1,686,554.72	0.32
27	300124	汇川技术	24,900	1,640,163.00	0.31
28	002271	东方雨虹	26,300	1,353,661.00	0.26
29	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.25
30	002507	涪陵榨菜	35,900	1,239,268.00	0.24
31	002557	洽洽食品	20,900	1,189,837.00	0.23
32	603019	中科曙光	39,200	1,137,584.00	0.22
33	300253	卫宁健康	126,056	1,106,771.68	0.21
34	002241	歌尔股份	32,800	1,102,080.00	0.21
35	600111	北方稀土	27,400	963,384.00	0.18
36	688048	长光华芯	6,613	740,457.61	0.14
37	002013	中航机电	57,600	711,360.00	0.14
38	002179	中航光电	10,500	664,860.00	0.13
39	688400	凌云光	12,387	271,646.91	0.05
40	688800	瑞可达	1,967	248,451.77	0.05
41	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
42	600196	复星医药	2,000	88,180.00	0.02
43	688193	仁度生物	1,635	84,316.95	0.02
44	301200	大族数控	857	44,495.44	0.01
45	301236	软通动力	1,277	40,072.26	0.01
46	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
47	301206	三元生物	776	35,455.44	0.01
48	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.01
49	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.01
50	301219	腾远钴业	346	30,385.72	0.01
51	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
52	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.01
53	301150	中一科技	309	25,572.84	0.00
54	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
55	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00

56	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
57	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
58	300834	星辉环材	623	18,708.69	0.00
59	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
60	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
61	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
62	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
63	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
64	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
65	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
66	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
67	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
68	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
69	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
70	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
71	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
72	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
73	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
74	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
75	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
76	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
77	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
78	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
79	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
80	688208	道通科技	245	8,065.40	0.00
81	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
82	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
83	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	7,264,837.10	1.39
2	600926	杭州银行	6,304,231.00	1.20
3	600887	伊利股份	5,364,157.00	1.02
4	603259	药明康德	4,047,914.00	0.77
5	600690	海尔智家	3,793,881.39	0.72
6	002241	歌尔股份	3,639,191.58	0.69
7	300760	迈瑞医疗	2,997,587.00	0.57
8	002555	三七互娱	2,684,089.00	0.51
9	000333	美的集团	2,591,591.00	0.49
10	600196	复星医药	2,457,374.00	0.47
11	600460	士兰微	2,103,858.00	0.40
12	601985	中国核电	2,078,113.00	0.40
13	600845	宝信软件	1,921,082.00	0.37
14	300171	东富龙	1,902,691.00	0.36
15	600809	山西汾酒	1,771,295.20	0.34
16	600900	长江电力	1,603,686.00	0.31
17	300124	汇川技术	1,562,442.00	0.30
18	002460	赣锋锂业	1,318,381.00	0.25
19	688696	极米科技	1,308,976.90	0.25
20	300347	泰格医药	1,297,708.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	19,573,232.96	3.73
2	002236	大华股份	7,757,506.00	1.48

3	000333	美的集团	7,349,015.00	1.40
4	300347	泰格医药	5,779,279.00	1.10
5	600690	海尔智家	5,608,015.00	1.07
6	300253	卫宁健康	5,333,242.00	1.02
7	601939	建设银行	5,279,547.00	1.01
8	002241	歌尔股份	4,123,769.00	0.79
9	601009	南京银行	4,089,864.00	0.78
10	600085	同仁堂	4,085,009.87	0.78
11	600919	江苏银行	3,907,274.00	0.75
12	600196	复星医药	3,894,000.80	0.74
13	600161	天坛生物	3,658,740.16	0.70
14	600522	中天科技	3,235,160.00	0.62
15	600926	杭州银行	3,052,555.00	0.58
16	601985	中国核电	2,774,621.00	0.53
17	600460	士兰微	2,668,217.00	0.51
18	300498	温氏股份	2,637,120.20	0.50
19	600887	伊利股份	2,543,236.18	0.49
20	601225	陕西煤业	2,303,173.00	0.44

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。

7.4.3 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	77,235,478.96
卖出股票收入（成交）总额	148,523,808.47

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。

7.5 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	72,731,963.29	13.88
2	央行票据	-	-

3	金融债券	222,569,325.46	42.47
	其中：政策性金融债	59,988,904.11	11.45
4	企业债券	94,266,886.80	17.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	100,123,390.42	19.10
7	可转债(可交换债)	582,642.19	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	490,274,208.16	93.55

7.6 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	220210	22国开10	600,000	59,988,904.11	11.45
2	019664	21国债16	500,000	50,823,109.59	9.70
3	2120025	21杭州银行小微债01	400,000	40,954,684.93	7.81
4	101900085	19盐城资产MTN001	300,000	31,499,904.66	6.01
5	2128020	21招商银行小微债02	300,000	30,377,183.01	5.80

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	114,476.97
2	应收清算款	1,878,539.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,172,846.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,165,863.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,552,577.60	0.29
B	采矿业	3,235,650.00	0.37

C	制造业	89,653,604.72	10.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,902,223.00	1.02
E	建筑业	6,981.18	0.00
F	批发和零售业	67,809.65	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	6,487.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,638,192.54	1.45
J	金融业	45,860,540.60	5.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	255,790.32	0.03
M	科学研究和技术服务业	4,649,738.86	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	4,796.89	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	165,580.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	167,999,972.56	19.24

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300059	东方财富	1,314,820	30,017,340.60	3.44
2	002236	大华股份	697,170	11,161,691.70	1.28
3	601985	中国核电	1,207,900	8,902,223.00	1.02
4	600690	海尔智家	383,800	7,971,526.00	0.91
5	000333	美的集团	145,000	7,888,000.00	0.90
6	300253	卫宁健康	640,756	5,792,434.24	0.66
7	601009	南京银行	582,200	5,565,832.00	0.64

8	600919	江苏银行	857,600	5,162,752.00	0.59
9	601939	建设银行	878,800	5,114,616.00	0.59
10	600522	中天科技	292,000	5,051,600.00	0.58
11	600085	同仁堂	125,194	4,882,566.00	0.56
12	300347	泰格医药	51,800	4,558,400.00	0.52
13	600161	天坛生物	174,280	4,379,656.40	0.50
14	600570	恒生电子	95,534	4,193,942.60	0.48
15	601225	陕西煤业	244,200	3,235,650.00	0.37
16	600460	士兰微	50,400	2,804,256.00	0.32
17	600845	宝信软件	55,700	2,577,239.00	0.30
18	300498	温氏股份	135,920	2,552,577.60	0.29
19	603019	中科曙光	81,400	2,526,656.00	0.29
20	600745	闻泰科技	24,700	2,465,060.00	0.28
21	603501	韦尔股份	12,300	2,398,500.00	0.27
22	600111	北方稀土	60,100	2,361,930.00	0.27
23	002557	洽洽食品	52,000	2,323,360.00	0.27
24	002138	顺络电子	95,100	2,274,792.00	0.26
25	603799	华友钴业	24,600	2,261,970.00	0.26
26	600519	贵州茅台	1,300	2,083,900.00	0.24
27	600702	舍得酒业	11,300	1,981,907.00	0.23
28	600038	中直股份	39,700	1,948,476.00	0.22
29	688139	海尔生物	31,119	1,930,311.57	0.22
30	002043	兔宝宝	194,100	1,927,413.00	0.22
31	600196	复星医药	44,600	1,921,814.00	0.22
32	603986	兆易创新	12,800	1,879,680.00	0.22
33	002460	赣锋锂业	14,000	1,757,000.00	0.20
34	688396	华润微	31,990	1,756,251.00	0.20
35	002507	涪陵榨菜	59,800	1,726,426.00	0.20
36	600298	安琪酵母	40,100	1,709,062.00	0.20
37	000858	五粮液	10,500	1,650,075.00	0.19
38	002241	歌尔股份	47,600	1,644,580.00	0.19

39	002008	大族激光	40,600	1,603,700.00	0.18
40	002475	立讯精密	23,759	800,678.30	0.09
41	688082	盛美上海	7,403	643,986.97	0.07
42	301219	腾远钴业	1,920	334,041.60	0.04
43	301102	兆讯传媒	6,414	255,790.32	0.03
44	688280	精进电动	21,211	214,655.32	0.02
45	688282	理工导航	3,185	207,693.85	0.02
46	688800	瑞可达	1,967	175,849.80	0.02
47	301103	何氏眼科	3,896	165,580.00	0.02
48	301256	华融化学	18,308	147,379.40	0.02
49	301137	哈焊华通	6,431	98,844.47	0.01
50	301155	海力风电	861	75,440.82	0.01
51	301236	软通动力	851	48,643.16	0.01
52	301206	三元生物	517	47,455.43	0.01
53	301200	大族数控	857	46,415.12	0.01
54	301089	拓新药业	220	39,265.60	0.00
55	301201	诚达药业	353	38,413.46	0.00
56	301177	迪阿股份	436	33,279.88	0.00
57	301087	可孚医疗	515	33,279.30	0.00
58	301207	华兰疫苗	569	28,876.75	0.00
59	301090	华润材料	2,764	28,469.20	0.00
60	301215	中汽股份	4,743	27,177.39	0.00
61	001308	康冠科技	513	25,054.92	0.00
62	301211	亨迪药业	967	23,701.17	0.00
63	300834	星辉环材	623	22,540.14	0.00
64	301166	优宁维	253	21,224.17	0.00
65	301096	百诚医药	272	20,604.00	0.00
66	301122	采纳股份	301	18,987.08	0.00
67	301235	华康医疗	418	18,876.88	0.00
68	301069	凯盛新材	539	18,724.86	0.00
69	301093	华兰股份	409	17,157.55	0.00

70	301123	奕东电子	656	16,603.36	0.00
71	301189	奥尼电子	435	15,829.65	0.00
72	301091	深城交	524	15,180.28	0.00
73	301168	通灵股份	329	14,976.08	0.00
74	603070	万控智造	775	13,988.75	0.00
75	301117	佳缘科技	262	13,419.64	0.00
76	301078	孩子王	756	13,305.60	0.00
77	301111	粤万年青	379	13,185.41	0.00
78	301100	风光股份	599	12,782.66	0.00
79	301118	恒光股份	315	12,779.55	0.00
80	301190	善水科技	575	12,655.75	0.00
81	301179	泽宇智能	295	12,513.90	0.00
82	301108	洁雅股份	280	12,280.80	0.00
83	301101	明月镜片	371	12,076.05	0.00
84	301188	力诺特玻	647	11,865.98	0.00
85	301222	浙江恒威	332	11,407.52	0.00
86	301196	唯科科技	271	10,690.95	0.00
87	301116	益客食品	577	10,357.15	0.00
88	301199	迈赫股份	402	9,836.94	0.00
89	301130	西点药业	237	9,745.44	0.00
90	688208	道通科技	245	9,559.90	0.00
91	301228	实朴检测	373	9,500.31	0.00
92	301092	争光股份	323	9,202.27	0.00
93	301138	华研精机	285	8,641.20	0.00
94	301181	标榜股份	257	7,848.78	0.00
95	301193	家联科技	297	7,591.32	0.00
96	301098	金埔园林	307	6,981.18	0.00
97	301072	中捷精工	181	6,899.72	0.00
98	301182	凯旺科技	294	6,676.74	0.00
99	301198	喜悦智行	262	6,576.20	0.00
100	301081	严牌股份	403	6,516.51	0.00

101	301073	君亭酒店	144	6,487.20	0.00
102	301083	百胜智能	416	5,799.04	0.00
103	301030	仕净科技	242	5,517.60	0.00
104	301063	海锅股份	153	4,899.06	0.00
105	300854	中兰环保	203	4,796.89	0.00
106	301068	大地海洋	144	4,088.16	0.00
107	301079	邵阳液压	140	3,655.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

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

18	601009	南京银行	2,095,614.00	0.19
19	002460	赣锋锂业	2,059,326.56	0.19
20	603986	兆易创新	1,994,412.00	0.18

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600085	同仁堂	7,385,790.00	0.67
2	002557	洽洽食品	6,945,699.00	0.63
3	601985	中国核电	4,923,675.00	0.45
4	000858	五粮液	4,915,962.02	0.45
5	300347	泰格医药	4,379,220.48	0.40
6	002138	顺络电子	4,010,442.00	0.36
7	600519	贵州茅台	3,950,254.00	0.36
8	300059	东方财富	3,845,109.04	0.35
9	002043	兔宝宝	3,472,189.00	0.32
10	002008	大族激光	3,308,597.00	0.30
11	600886	国投电力	3,195,399.80	0.29
12	002262	恩华药业	3,158,467.00	0.29
13	002415	海康威视	3,145,746.00	0.29
14	688169	石头科技	2,806,557.74	0.26
15	601939	建设银行	2,786,848.00	0.25
16	688208	道通科技	2,427,932.38	0.22
17	002507	涪陵榨菜	2,294,612.00	0.21
18	603486	科沃斯	2,253,298.34	0.20
19	600111	北方稀土	2,242,545.00	0.20
20	600104	上汽集团	2,166,239.00	0.20

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	83,006,220.84	9.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	366,996,539.18	42.02
	其中：政策性金融债	71,411,767.13	8.18
4	企业债券	100,622,916.07	11.52
5	企业短期融资券	61,133,071.23	7.00
6	中期票据	140,640,986.58	16.10
7	可转债（可交换债）	183,016.04	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	752,582,749.94	86.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019664	21国债16	700,000	70,675,797.26	8.09
2	2128013	21交通银行小微债	500,000	52,114,301.37	5.97
3	2128039	21中国银行二级03	500,000	50,568,424.66	5.79
4	102101642	21晋能电力MT	400,000	42,217,170.4	4.83

		N001		1	
5	2120025	21杭州银行小微债01	400,000	41,758,356.16	4.78

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	132,727.04
2	应收清算款	59,871,190.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	343,746.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	60,347,664.79
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 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 基金份额持有人信息(转型后)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴业聚惠混合A	1,018	44,123.62	29,342,136.15	65.32%	15,575,713.37	34.68%
兴业聚惠混合C	63,970	4,075.32	132,269,152.77	50.74%	128,428,763.15	49.26%
合计	64,988	4,702.65	161,611,288.92	52.88%	144,004,476.52	47.12%

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴业聚惠混合A	81,699.56	0.1819%

	兴业聚惠混合C	400.34	0.0002%
	合计	82,099.90	0.0269%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴业聚惠灵活配置混合A	1,797	72,418.39	111,212,896.38	85.46%	18,922,941.96	14.54%
兴业聚惠	89,040	4,490.41	235,267,13	58.84%	164,559,39	41.16%

灵活配置混合C			9.82		9.80	
合计	90,837	5,834.21	346,480.036.20	65.38%	183,482.341.76	34.62%

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴业聚惠灵活配置混合A	81,699.56	0.0628%
	兴业聚惠灵活配置混合C	410.38	0.0001%
	合计	82,109.94	0.0155%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴业聚惠灵活配置混合A	0
	兴业聚惠灵活配置混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业聚惠灵活配置混合A	0
	兴业聚惠灵活配置	0

	混合C	
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	兴业聚惠混合A	兴业聚惠混合C
基金合同生效日(2022年03月16日)基金份额总额	130,135,838.34	399,826,539.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	153,767.47	44,901,771.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	85,371,756.29	184,030,395.50
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	44,917,849.52	260,697,915.92

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。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

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

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2、本报告期托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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

转型后

报告期2022年03月16日 - 2022年06月30日

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	218,199,034.64	100.00%	159,564.91	100.00%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	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、剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金 额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	109,893,26 2.30	100.00%	4,657,000,00 0.00	100.00%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

转型前

报告期2022年01月01日 - 2022年03月15日

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	54,030,823.19	25.23%	50,318.43	30.06%	-
华创证券	2	22,805,249.90	10.65%	16,677.59	9.96%	-
天风证券	2	137,281,036.09	64.11%	100,391.74	59.98%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。

ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。

iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。

iv 投研交综合实力较强。

v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③ 在上述租用的券商交易单元中，本期未新增交易单元，剔除交易单元：中信建投证券股份有限公司。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	10,025,418.63	3.74%	5,000,000.00	0.17%	-	-	-	-
天风证券	257,817,485.58	96.26%	2,995,500.00	99.83%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴业基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-01
2	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-14
3	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-01-22
4	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定的媒介	2022-02-14
5	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵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	2022-02-15
6	兴业基金管理有限公司关于以通讯方式召开兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定的媒介	2022-02-16
7	兴业基金管理有限公司旗下公募基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	中国证监会规定的媒介	2022-03-06
8	兴业基金管理有限公司关于兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
9	兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金公证书	中国证监会规定的媒介	2022-03-17

10	兴业聚惠混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
11	兴业聚惠混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
12	兴业聚惠混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
13	兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2022-03-17
14	兴业基金管理有限公司旗下公募基金2021年年度报告	中国证监会规定的媒介	2022-03-31
15	兴业基金管理有限公司旗下基金2022年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-04-22
16	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	2022-04-25
17	兴业基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28
18	兴业基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20220221-20220630	102,716,982.36	21,889,400.92	50,000,000.00	74,606,383.28	24.41%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的							

巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。

上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件
- （二）《兴业聚惠混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《兴业聚惠混合型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

12.3 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
二〇二二年八月三十一日