

---

# 兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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

送出日期:2021 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。本中期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2021年8月27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。

本报告期自2021年1月1日起至2021年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	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴业聚宝灵活配置混合
基金主代码	002330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年02月03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	42,303,127.21份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础下，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过预测资本市场资金环境、宏观经济的发展趋势，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合，谋求超额收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%
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	王蕙
	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137号信和广场25楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路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18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	证券时报
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

### 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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	20,399,825.55
加权平均基金份额本期利润	0.1147
本期加权平均净值利润率	6.86%
本期基金份额净值增长率	5.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末

	(2021年06月30日)
期末可供分配利润	17,259,499.03
期末可供分配基金份额利润	0.4080
期末基金资产净值	71,787,507.71
期末基金份额净值	1.697
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	69.70%

- 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.11%	0.66%	-0.63%	0.25%	-0.48%	0.41%
过去三个月	0.59%	0.83%	1.41%	0.29%	-0.82%	0.54%
过去六个月	5.67%	0.91%	0.74%	0.40%	4.93%	0.51%
过去一年	21.74%	0.91%	7.38%	0.39%	14.36%	0.52%
过去三年	68.52%	1.07%	17.95%	0.40%	50.57%	0.67%
自基金合同生效起至今	69.70%	0.86%	22.30%	0.35%	47.40%	0.51%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*70%+沪深300指数收益率\*30%。

#### 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



## § 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6月30日，兴业基金共管理76只公募基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯烜	权益投资总监、基金经理	2017-07-26	2021-06-18	17年	中国籍，加拿大多伦多大学MBA及中国人民大学经济学硕士，特许金融分析师（CFA），具有证券投资基金从业资格。2002年7月至2003年8月在第一创业证券有限公司证券投资部担任研究员。2005年11月至2011年3月在汇丰晋信基金管理有限公司投资部担任研究员、高级研究员、基金经理，期间2009年7月至2010年12月担任汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理，2010年1月至2011年3月担任汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理。2011年3月至2014年6月在中国国际金融有限公司资产管理部担任投资经理（执行总经理级别），管理中金安心回报、中金股票策略、中金股票精选集合资产管理计划。2014年6月至2015年1月在汇丰晋信基金管理有限公司担任QFII投资咨询部总监，负责四只QFII基金的A股投顾工

					作。2015年2月加入兴业基金管理有限公司，现任权益投资总监、基金经理。
张诗悦	基金经理	2021-01-04	-	5年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2015年7月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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

2020年上半年，经济数据总体表现良好，国内疫情可控，市场在总体呈震荡上涨格局。结构上看，市场分化较为明显，科创50指数及创业板指数领涨，半导体、新能源汽车及CXO等版块表现突出，消费、金融地产等版块相对较弱。

本基金上半年进行了基金经理调整，对持仓结构进行了调整，本基金着重配置于长期成长趋势明确、商业模式良好、竞争力突出的企业，积极把握成长机遇，分享企业成长的红利。

行业方面，本基金配置较多的是食品饮料、美丽健康、建材家居等版块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业聚宝灵活配置混合基金份额净值为1.697元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.67%，同期业绩比较基准收益率为0.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2021年上半年，市场方向相比于过往两年有些变化，但不变的是市场对于高景气赛道的追逐。以消费白马为代表的一批股票面临着压力，我们认为，虽然一些企业的经营存在波动，但更大的压力是过去几年的大幅上涨使得一批股票的估值处在相对高的位置，因而带来预期回报率降低的压力，这样的问题也伴随着市场的调整得以缓解。

展望后续，我们对我国经济高质量发展是乐观的，人民对美好生活的追求是持续的。伴随其间，我们认为优秀的企业仍将持续成长，我们将持续提升研究和认知，把握优质企业的成长，分享企业成长的红利。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任；副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任；专业委员若干名，由研究部门、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险管理部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

###### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.7 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》，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。

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，基金托管人在兴业聚宝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宝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宝灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,585,790.89	5,983,169.10
结算备付金		417,456.57	641,256.88
存出保证金		171,329.86	150,118.18
交易性金融资产	6.4.7.2	60,130,598.17	383,085,693.29
其中：股票投资		55,788,560.87	358,997,693.29
基金投资		-	-
债券投资		4,342,037.30	24,088,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	20,000,000.00
应收证券清算款		-	7,426,424.88
应收利息	6.4.7.5	49,012.26	698,789.86
应收股利		-	-
应收申购款		1,322.46	4,900.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		72,355,510.21	417,990,352.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,984,682.94
应付赎回款		35,998.85	109,648.99
应付管理人报酬		41,271.35	248,647.46
应付托管费		14,739.78	88,802.70
应付销售服务费		29,479.56	177,605.33
应付交易费用	6.4.7.7	353,208.25	183,331.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,304.71	170,001.90
负债合计		568,002.50	4,962,721.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	42,303,127.21	257,163,855.74
未分配利润	6.4.7.10	29,484,380.50	155,863,775.36
所有者权益合计		71,787,507.71	413,027,631.10
负债和所有者权益总计		72,355,510.21	417,990,352.19

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.697元，基金份额总额42,303,127.21份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴业聚宝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06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日

<b>一、收入</b>		23,985,549.10	3,339,647.40
1. 利息收入		413,552.87	144,232.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	51,005.79	31,404.61
债券利息收入		284,570.80	66,374.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		77,976.28	46,453.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,246,487.23	9,915,724.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,709,168.83	8,866,838.32
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-117,599.90	38,103.98
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	654,918.30	1,010,782.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,317,703.68	-6,774,573.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,805.32	54,263.93
<b>减：二、费用</b>		3,585,723.55	1,033,710.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	1,049,620.26	342,975.74
2. 托管费	6.4.10.2. 2	374,864.41	122,491.30
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	749,728.73	244,982.66

4. 交易费用	6.4.7.20	1,298,907.59	224,578.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.07
7. 其他费用	6.4.7.21	112,602.56	98,681.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		20,399,825.55	2,305,936.73
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		20,399,825.55	2,305,936.73

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业聚宝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06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30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）	257,163,855.74	155,863,775.36	413,027,631.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,399,825.55	20,399,825.55
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）	-214,860,728.53	-146,779,220.41	-361,639,948.94
其中：1. 基金申购款	2,540,328.46	1,732,541.74	4,272,870.20
2. 基金赎回款	-217,401,056.99	-148,511,762.15	-365,912,819.14
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)	42,303,127.21	29,484,380.50	71,787,507.71
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30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)	76,482,098.99	24,627,210.92	101,109,309.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	2,305,936.73	2,305,936.73
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)	-25,288,569.82	-6,745,028.24	-32,033,598.06
其中：1. 基金申购款	53,821,210.62	18,351,233.23	72,172,443.85
2. 基金赎回款	-79,109,780.44	-25,096,261.47	-104,206,041.91
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)	51,193,529.17	20,188,119.41	71,381,648.58

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

庄孝强

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

兴业聚宝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》、《兴业聚宝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]1686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 201,709,827.61 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0077号验资报告。基金合同于2016年2月3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。

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\*70%+沪深300指数收益率\*30%。

### 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。

### 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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日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

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。

#### 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 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。

#### 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》、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]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；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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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。

#### 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
----	-----

	2021年06月30日
活期存款	11,585,790.89
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	11,585,790.89

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,600,540.42	55,788,560.87	2,188,020.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,336,445.70	4,342,037.30
	银行间市场	-	-
	合计	4,336,445.70	4,342,037.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	57,936,986.12	60,130,598.17	2,193,612.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,239.12
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	187.90
应收债券利息	46,508.14
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	77.10
合计	49,012.26

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	353,208.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	353,208.25

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.15
预提费用	33,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	93,304.71

#### 6.4.7.9 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06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	257,163,855.74	257,163,855.74
本期申购	2,540,328.46	2,540,328.46
本期赎回（以“-”号填列）	-217,401,056.99	-217,401,056.99
本期末	42,303,127.21	42,303,127.21

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 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	168,705,443.53	-12,841,668.17	155,863,775.36
本期利润	7,082,121.87	13,317,703.68	20,399,825.55
本期基金份额交易产生的变动数	-158,528,066.37	11,748,845.96	-146,779,220.41
其中：基金申购款	1,799,338.24	-66,796.50	1,732,541.74
基金赎回款	-160,327,404.61	11,815,642.46	-148,511,762.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,259,499.03	12,224,881.47	29,484,380.50

#### 6.4.7.11 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06月30日
活期存款利息收入	39,884.36
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	10,123.44
其他	997.99
合计	51,005.79

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	588,061,920.97
减：卖出股票成本总额	578,352,752.14
买卖股票差价收入	9,709,168.83

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 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06月30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	-117,599.90
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	-117,599.90

#### 6.4.7.14.2 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06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,999,535.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,125,999.90
减：应收利息总额	991,135.35
买卖债券差价收入	-117,599.90

#### 6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	654,918.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	654,918.30

#### 6.4.7.18 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06月30日
1. 交易性金融资产	13,317,703.68
——股票投资	13,270,580.08
——债券投资	47,123.60
——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	13,317,703.68

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	7,805.32
合计	7,805.32

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,298,907.59
银行间市场交易费用	-
合计	1,298,907.59

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	700.00
帐户维护费	27,600.00
合计	112,602.56

#### 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
交通银行股份有限公司	基金托管人
兴业财富资产管理有限公司	基金管理人控制的公司
兴业基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
兴业银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,049,620.26	342,975.74
其中：支付销售机构的客户维护费	16,853.46	48,078.18

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0.70%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×0.70%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	374,864.41	122,491.30

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0.25%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×0.25%÷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
	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
兴业基金	724,360.20
兴业银行	12,301.73
合计	736,661.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业基金	172,164.41
兴业银行	52,303.35
合计	224,467.76

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日的基金资产净值×0.50%÷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

本基金本报告期内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。

### 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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无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

份额单位：份

关联方名	本期末	上年度末

称	2021年06月30日		2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业财富	37,313,432.84	88.2%	37,313,432.84	14.51%

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
交通银行股份有限公司	11,585,790.89	39,884.36	2,981,502.95	27,793.32

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业或协议利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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——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。

#### 6.4.12 期末（2021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	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
6886	惠泰	2020	2021	科创	74.4	373.	1,573	117,	587,	-

17	医疗	-12-30	-07-07	板打 新限售	6	24		125.58	106.52	
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	科创板打 新限售	15.57	48.55	4,486	69,847.02	217,795.30	-
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	科创板打 新限售	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	科创板打 新限售	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	科创板打 新限售	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打 新限售	47.33	251.96	314	14,861.62	79,115.44	-
688616	西力科技	2021-03-10	2021-09-22	科创板打 新限售	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打 新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打 新限售	33.22	87.50	333	11,062.26	29,137.50	-

				售						
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	211	10,252.49	19,072.29	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
3009	药易	2021	2021	创业	12.2	53.7	244	2,98	13,1	-

37	购	-01- 20	-07- 27	板打 新限 售	5	1		9.00	05.2 4	
3009 42	易瑞 生物	2021 -02- 02	2021 -08- 09	创业 板打 新限 售	5.31	28.5 2	443	2,35 2.33	12,6 34.3 6	-
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	创业 板打 新限 售	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 55	嘉亨 家化	2021 -03- 16	2021 -09- 24	创业 板打 新限 售	16.5 3	46.0 7	232	3,83 4.96	10,6 88.2 4	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	创业 板打 新限 售	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	创业 板打 新限 售	11.7 2	27.0 8	340	3,98 4.80	9,20 7.20	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	创业 板打 新限 售	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	创业 板打 新限 售	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-

300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-	2021-07-	创业板打	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

		29	07	新限售						
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	24.81	280	6,972.00	6,946.80	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	创业板打新限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	353	1,743.82	4,606.65	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	42.23	107	2,226.67	4,518.61	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300998	宁波方正	2021-05-	2021-12-	创业板打	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

		25	02	新限售						
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	70	1,309.70	4,033.40	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	267	1,412.43	3,855.48	-

注：冠中生态（300948）在流通受限期内发生送股。

#### 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

本基金本期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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。

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

#### 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 2021年06 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	11,585,790.89	-	-	-	11,585,790.89
结算备付金	417,456.57	-	-	-	417,456.57

存出保证金	171,329.86	-	-	-	171,329.86
交易性金融资产	4,342,037.30	-	-	55,788,560.87	60,130,598.17
应收利息	-	-	-	49,012.26	49,012.26
应收申购款	-	-	-	1,322.46	1,322.46
资产总计	16,516,614.62	0.00	0.00	55,838,895.59	72,355,510.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,998.85	35,998.85
应付管理人报酬	-	-	-	41,271.35	41,271.35
应付托管费	-	-	-	14,739.78	14,739.78
应付销售服务费	-	-	-	29,479.56	29,479.56
应付交易费用	-	-	-	353,208.25	353,208.25
其他负债	-	-	-	93,304.71	93,304.71
负债总计	0.00	-	-	568,002.50	568,002.50
利率敏感度缺口	16,516,614.62	0.00	0.00	55,270,893.09	71,787,507.71
上年度末 2020年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,983,169.10	-	-	-	5,983,169.10
结算备付金	641,256.88	-	-	-	641,256.88
存出保证金	150,118.18	-	-	-	150,118.18
交易性金融资产	24,088,000.00	-	-	358,997,693.29	383,085,693.29
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	7,426,424.88	7,426,424.88
应收利息	-	-	-	698,789.86	698,789.86
应收申购款	-	-	-	4,900.00	4,900.00
资产总计	50,862,544.16	0.00	0.00	367,127,808.03	417,990,352.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,984,682.94	3,984,682.94
应付赎回款	-	-	-	109,648.99	109,648.99
应付管理	-	-	-	248,647.46	248,647.46

人报酬					
应付托管费	-	-	-	88,802.70	88,802.70
应付销售服务费	-	-	-	177,605.33	177,605.33
应付交易费用	-	-	-	183,331.77	183,331.77
其他负债	-	-	-	170,001.90	170,001.90
负债总计	0.00	-	-	4,962,721.09	4,962,721.09
利率敏感度缺口	50,862,544.16	0.00	0.00	362,165,086.94	413,027,631.10

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-5,944.96	-16,046.75
	市场利率下降25个基点	5,967.68	16,097.03

#### 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 2021年06月30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	55,788,560.87	77.71	358,997,693.29	86.92
交易性金融资产—基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	0.00	-	0.00	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	0.00	-	0.00	-
合计	55,788,560.87	77.71	358,997,693.29	86.92

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1、股票价格上升5%	2,789,428.04	17,949,884.66

	2、股票价格下降5%	-2,789,428.04	-17,949,884.66
--	------------	---------------	----------------

#### 6.4.14 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

### 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	55,788,560.87	77.10
	其中：股票	55,788,560.87	77.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,342,037.30	6.00
	其中：债券	4,342,037.30	6.00
	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	12,003,247.46	16.59
8	其他各项资产	221,664.58	0.31
9	合计	72,355,510.21	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	479,604.28	0.67
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,090,655.17	73.96

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.04
F	批发和零售业	28,465.12	0.04
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	60,518.88	0.08
J	金融业	265,373.40	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	979,780.30	1.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	85,810.35	0.12
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	768,320.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	55,788,560.87	77.71

### 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	600519	贵州茅台	2,500	5,141,750.00	7.16
2	000858	五粮液	17,200	5,123,708.00	7.14
3	603345	安井食品	15,800	4,013,516.00	5.59
4	000568	泸州老窖	13,600	3,208,784.00	4.47
5	603517	绝味食品	30,600	2,579,274.00	3.59
6	600887	伊利股份	67,166	2,473,723.78	3.45
7	002311	海大集团	27,600	2,252,160.00	3.14
8	603187	海容冷链	49,280	2,113,126.40	2.94

9	688008	澜起科技	31,913	1,990,732.94	2.77
10	300973	立高食品	12,060	1,855,155.60	2.58
11	600600	青岛啤酒	13,900	1,607,535.00	2.24
12	300957	贝泰妮	5,514	1,491,903.44	2.08
13	600060	海信视像	87,300	1,475,370.00	2.06
14	603605	珀莱雅	7,500	1,475,325.00	2.06
15	002557	洽洽食品	33,910	1,461,521.00	2.04
16	002507	涪陵榨菜	31,800	1,197,588.00	1.67
17	603833	欧派家居	8,200	1,164,072.00	1.62
18	603737	三棵树	5,800	1,020,800.00	1.42
19	002568	百润股份	10,220	968,753.80	1.35
20	002304	洋河股份	4,500	932,400.00	1.30
21	601888	中国中免	3,100	930,310.00	1.30
22	600745	闻泰科技	9,600	930,240.00	1.30
23	603317	天味食品	31,560	928,810.80	1.29
24	002271	东方雨虹	14,900	824,268.00	1.15
25	300413	芒果超媒	11,200	768,320.00	1.07
26	603877	太平鸟	13,700	731,306.00	1.02
27	605089	味知香	7,100	617,842.00	0.86
28	002475	立讯精密	13,400	616,400.00	0.86
29	688617	惠泰医疗	1,573	587,106.52	0.82
30	688063	派能科技	2,921	574,852.80	0.80
31	002032	苏泊尔	8,400	535,836.00	0.75
32	600438	通威股份	11,600	501,932.00	0.70
33	002714	牧原股份	7,700	468,314.00	0.65
34	002991	甘源食品	6,500	392,145.00	0.55
35	600809	山西汾酒	800	358,400.00	0.50
36	000333	美的集团	3,200	228,384.00	0.32
37	688076	诺泰生物	4,486	217,795.30	0.30
38	600305	恒顺醋业	9,600	183,552.00	0.26
39	000776	广发证券	11,100	168,054.00	0.23

40	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.22
41	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.21
42	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.16
43	688269	凯立新材	752	104,919.04	0.15
44	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.13
45	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.12
46	688216	气派科技	975	65,032.50	0.09
47	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.09
48	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.08
49	688425	铁建重工	8,697	53,225.64	0.07
50	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.07
51	300894	火星人	628	42,704.00	0.06
52	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.06
53	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.05
54	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05
55	300979	华利集团	333	29,137.50	0.04
56	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.03
57	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
58	300941	创识科技	399	19,926.06	0.03
59	300981	中红医疗	211	19,072.29	0.03
60	300925	法本信息	600	15,774.00	0.02
61	300932	三友联众	492	15,601.32	0.02
62	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.02
63	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.02
64	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
65	300940	南极光	307	13,317.66	0.02
66	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.02
67	300937	药易购	244	13,105.24	0.02
68	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.02
69	603171	N税友	637	12,230.40	0.02
70	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.02

71	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.02
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
73	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
74	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.01
75	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
76	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
77	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
78	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
79	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
80	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
81	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
82	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
83	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
84	300986	志特新材	264	8,070.48	0.01
85	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.01
86	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.01
87	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
88	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.01
89	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
90	300985	致远新能	280	6,946.80	0.01
91	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.01
92	300991	创益通	254	6,733.54	0.01
93	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
94	300975	商络电子	492	6,410.76	0.01
95	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.01
96	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.01
97	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.01
98	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.01
99	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.01
100	300960	通业科技	234	5,396.04	0.01
101	605011	N杭热	525	4,662.00	0.01

102	300997	欢乐家	353	4,606.65	0.01
103	300996	普联软件	107	4,518.61	0.01
104	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.01
105	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.01
106	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.01
107	301002	崧盛股份	70	4,033.40	0.01
108	301007	德迈仕	267	3,855.48	0.01

## 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	600887	伊利股份	18,782,998.02	4.55
2	002032	苏泊尔	15,547,061.38	3.76
3	603866	桃李面包	15,035,925.20	3.64
4	002557	洽洽食品	14,575,797.10	3.53
5	600745	闻泰科技	14,298,495.30	3.46
6	600196	复星医药	13,604,413.44	3.29
7	601601	中国太保	10,397,554.80	2.52
8	688008	澜起科技	10,290,937.64	2.49
9	600350	山东高速	10,201,487.00	2.47
10	002949	华阳国际	8,529,650.00	2.07
11	000776	广发证券	8,093,344.00	1.96
12	603517	绝味食品	7,697,554.00	1.86
13	600519	贵州茅台	6,619,041.00	1.60
14	601211	国泰君安	6,493,763.00	1.57
15	600438	通威股份	6,011,079.00	1.46
16	603658	安图生物	5,077,933.00	1.23
17	601688	华泰证券	5,055,365.00	1.22
18	000858	五粮液	4,986,844.00	1.21

19	600999	招商证券	4,471,695.73	1.08
20	000651	格力电器	4,177,816.82	1.01

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	601688	华泰证券	33,535,881.00	8.12
2	601939	建设银行	27,600,068.79	6.68
3	601658	邮储银行	24,900,617.88	6.03
4	002146	荣盛发展	23,204,466.30	5.62
5	002949	华阳国际	23,022,366.11	5.57
6	600196	复星医药	21,230,578.32	5.14
7	000910	大亚圣象	19,644,085.70	4.76
8	601601	中国太保	19,482,669.84	4.72
9	600036	招商银行	19,294,887.31	4.67
10	002032	苏泊尔	18,710,904.29	4.53
11	601318	中国平安	18,445,853.00	4.47
12	002557	洽洽食品	17,447,628.20	4.22
13	600887	伊利股份	17,203,841.26	4.17
14	300284	苏交科	15,767,091.38	3.82
15	600745	闻泰科技	14,674,308.00	3.55
16	000002	万科A	14,397,263.28	3.49
17	603866	桃李面包	14,131,136.87	3.42
18	601398	工商银行	13,178,535.04	3.19
19	601818	光大银行	12,551,248.00	3.04
20	603995	甬金股份	12,051,566.82	2.92
21	600048	保利地产	11,745,007.00	2.84
22	600350	山东高速	11,435,946.44	2.77
23	601668	中国建筑	11,204,397.00	2.71

24	601211	国泰君安	11,176,699.67	2.71
25	300166	东方国信	11,146,765.00	2.70
26	000538	云南白药	9,221,617.16	2.23
27	600406	国电南瑞	8,859,006.96	2.14
28	601288	农业银行	8,513,706.00	2.06

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	261,873,039.64
卖出股票收入（成交）总额	588,061,920.97

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	4,342,037.30	6.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,342,037.30	6.05

#### 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	019649	21国债01	43,390	4,342,037.30	6.05

本报告期本基金仅持有上述1只债券。

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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参与股指期货投资。

##### 7.10.2 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。

#### 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 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参与国债期货投资。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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	171,329.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,012.26
5	应收申购款	1,322.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	221,664.58

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300973	立高食品	41,655.60	0.06	创业板打新限售

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
826	51,214.44	37,313,432.84	88.20%	4,989,694.37	11.80%

## 8.2 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	11,973.79	0.03%

## 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年02月03日)基金份额总额	201,709,827.61
本报告期期初基金份额总额	257,163,855.74
本报告期基金总申购份额	2,540,328.46
减：本报告期基金总赎回份额	217,401,056.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,303,127.21

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未产生基金份额持有人大会决议。

## 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、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、本报告期内，本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

## 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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	32,470,419.36	3.85%	23,743.99	3.85%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	261,426,054.34	31.01%	191,181.17	31.01%	-
广发	2	-	-	-	-	-

证券						
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	23,365,999.12	2.77%	17,087.57	2.77%	-
海通证券	2	525,885,070.53	62.37%	384,575.41	62.37%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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，本期新增席位：国泰君安证券股份有限公司，广发证券股份有限公司，长江证券股份有限公司。本期没有剔除的券商交易单元。

## 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	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	16,341,313.60	100.00%	676,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2021-01-05
2	兴业聚宝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	2021-01-07
3	兴业聚宝灵活配置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	2021-01-07
4	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
5	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第2号）	中国证监会规定的媒介	2021-03-19

6	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
7	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
8	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
9	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2021-06-19
10	兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第3号）	中国证监会规定的媒介	2021-06-23
11	兴业聚宝灵活配置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	2021-06-23
12	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2021-07-01

## § 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	20210406-20210630	37,313,432.84	0.00	0.00	37,313,432.84	88.20%
	2	20210101-20210517	53,153,791.64	0.00	53,153,791.64	-	0.00%
	3	20210101-20210405	106,307,583.27	0.00	106,307,583.27	-	0.00%
	4	20210101-20210517	53,153,791.64	0.00	53,153,791.64	-	0.00%

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

### 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  
二〇二一年八月三十一日