

# 兴业聚惠混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 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2024年3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。

本报告期自2023年1月1日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| §2 基金简介.....                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10 |
| §4 管理人报告.....                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 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.....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 15 |
| §5 托管人报告.....                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 16 |
| §6 审计报告.....                                 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 16 |
| §7 年度财务报表.....                               | 19 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 19 |
| 7.2 利润表.....                                 | 21 |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 23 |
| 7.4 报表附注.....                                | 25 |
| §8 投资组合报告.....                               | 54 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 54 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 55 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 56 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 57 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 59 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 60 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 60 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 60 |

|  |    |
|--|----|
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 60 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                 | 60 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 60 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                       | 61 |
| §9 基金份额持有人信息 .....                       | 62 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 62 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 63 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....    | 63 |
| §10 开放式基金份额变动.....                       | 63 |
| §11 重大事件揭示.....                          | 64 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 64 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 64 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 64 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 64 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 64 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....       | 65 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 65 |
| 11.8 其他重大事件.....                         | 66 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 67 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 68 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 68 |
| §13 备查文件目录.....                          | 68 |
| 13.1 备查文件目录.....                         | 68 |
| 13.2 存放地点 .....                          | 68 |
| 13.3 查阅方式 .....                          | 68 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                |                |
|-----------------|----------------|----------------|
| 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      | 63,198,579.60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 | 6,914,341.78份  | 56,284,237.82份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | <p>本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。</p> <p>主要投资策略为资产配置策略、债券类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、风险管理策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 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<br>负责人 | 姓名   | 张玲菡                     | 罗菲菲                |
|             | 联系电话 | 021-22211888            | 010-58560666       |
|             | 电子邮箱 | zhaoyue@cib-fund.com.cn | tgxxpl@cmbc.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       |      | 叶文煌                     | 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                |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cib-fund.com.cn  |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市浦东新区银城路167号13、14层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                 |
|--------|--------------------|----------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市延安东路222号外滩中心30楼   |
| 注册登记机构 | 兴业基金管理有限公司         | 上海市浦东新区银城路167号13、14层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |       |                  |
|---------------|-------|------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023年 | 2022年03月16日(基金合同 |
|---------------|-------|------------------|

|                      | 生效日) -2022年12月31日 |               |               |                |
|----------------------|-------------------|---------------|---------------|----------------|
|                      | 兴业聚惠混<br>合A       | 兴业聚惠混<br>合C   | 兴业聚惠混<br>合A   | 兴业聚惠混<br>合C    |
| 本期已实现收益              | -41,067.52        | -288,007.06   | -3,489,755.59 | -24,605,893.52 |
| 本期利润                 | 205,336.96        | 1,727,167.12  | 438,673.05    | 3,804,496.70   |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0218            | 0.0253        | 0.0108        | 0.0153         |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.31%             | 1.53%         | 0.64%         | 0.91%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 0.72%             | 0.61%         | -0.24%        | -0.36%         |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2023年末            |               | 2022年末        |                |
| 期末可供分配利润             | 4,189,823.82      | 33,066,445.88 | 8,099,860.72  | 82,260,381.86  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.6060            | 0.5875        | 0.6063        | 0.5893         |
| 期末基金资产净值             | 11,483,402.61     | 92,867,764.59 | 22,027,520.45 | 228,853,238.89 |
| 期末基金份额净值             | 1.6608            | 1.6500        | 1.6490        | 1.6400         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2023年末            |               | 2022年末        |                |
| 基金份额累计净值增长率          | 0.47%             | 0.24%         | -0.24%        | -0.36%         |

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -0.02%       | 0.17%               | -0.76%             | 0.16%                     | 0.74% | 0.01%  |
| 过去六个月          | -0.37%       | 0.16%               | -1.52%             | 0.17%                     | 1.15% | -0.01% |
| 过去一年           | 0.72%        | 0.15%               | -0.64%             | 0.17%                     | 1.36% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.47%        | 0.22%               | -0.61%             | 0.21%                     | 1.08% | 0.01%  |

兴业聚惠混合C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -0.04%       | 0.17%               | -0.76%             | 0.16%                     | 0.72% | 0.01%  |
| 过去六个月          | -0.42%       | 0.16%               | -1.52%             | 0.17%                     | 1.10% | -0.01% |
| 过去一年           | 0.61%        | 0.16%               | -0.64%             | 0.17%                     | 1.25% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.24%        | 0.22%               | -0.61%             | 0.21%                     | 0.85% | 0.01%  |

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-2023年12月31日)



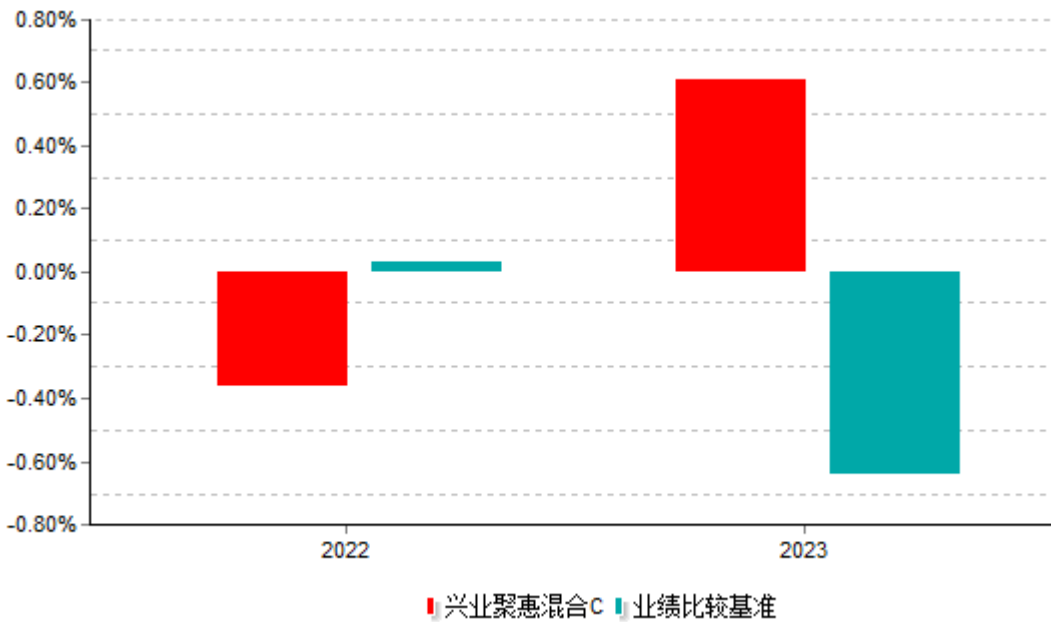
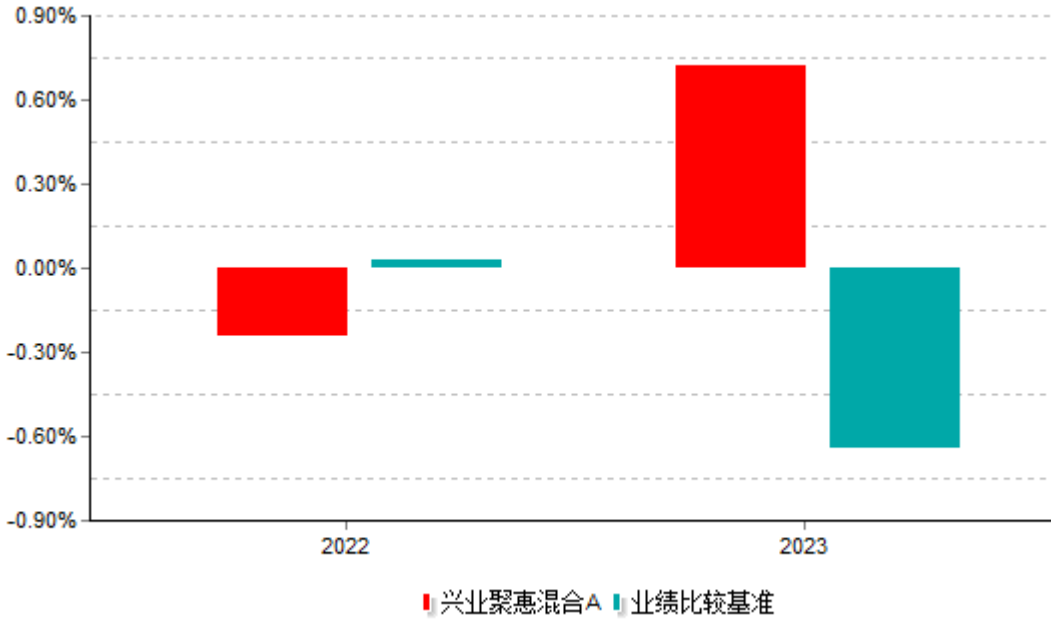
兴业聚惠混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年03月16日-2023年12月31日)



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。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，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2023年12月31日，兴业基金共管理90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 |        |   |
| 蔡艳菲 | 基金经理 | 2022-09-15      | -    | 15年    | 中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2008年7月至2013年8月在兴业证券固定收益部先后从事债券承销和债券研究、投资工作；2013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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，经济总体波折式复苏，有效需求不足，预期与信心偏弱，房地产销售低迷，地方债务风险边际缓释，价格水平维持低位，央行货币政策维持宽松基调，债券市场呈现牛平走势，10年期国债下行近30BP，信用利差收窄至历史低位。

具体来看，年初经济复苏预期较强，信贷脉冲效应，风险偏好提振带来无风险利率提升，资金价格中枢边际收敛，债券收益率平坦化上行，10年期国债由2022年底的2.82%小幅调整最高至2.93%。受益于信用利差优势，信用债配置需求释放，信用债表现好于利率债，信用利差自高位快速收窄。3至8月中旬，经济强复苏预期被证伪，央行于3月降准0.25%，资金面压力缓解，收益率曲线陡峭化下行；央行于6月和8月份分别降息10BP

和15BP，加速行情的演绎直至8月中旬，10年期国债最低下行至2.54%。8月下旬至11月底，自8月初以来，防“空转”和稳汇率导致资金价格中枢抬升，债券供给增加，债券收益率呈现平坦化上行，1年期国债最高上行近70BP，但10年期国债最高仅上行18BP，期限利差收窄至历史低位，信用债也跟随调整，但随着化债政策的落地，弱资质城投表现最佳。

12月汇率压力边际缓解，以及供给冲击结束，资金面宽松，债券做多情绪释放，利率债表现优于信用债，超长债表现最佳，曲线陡峭化小幅修复，但仍处于平坦状态，10年国债也突破了2.6%的关键点位至2.58%。

经济基本面偏弱，企业盈利持续下滑，私人部门信心与预期不足，风险偏好持续回落，估值持续压缩，2023年仅一季度受益于经济复苏预期带动有所上涨，随后总体呈现单边下跌态势，全年看沪深300指数下跌11.4%，高分红表现相对较好。尽管权益市场表现不佳，但受益于信用债收益率下行至低位，可转债全年仅下跌0.5%。

报告期内，随着债券收益率的波动，组合灵活调整久期和杠杆水平，优化持仓结构，年底制约债券市场的因素消退，组合适度拉长久期，股票仓位保持稳定，持续优化持仓结构。未来我们将继续根据各细分资产的风险和收益率预期变化，主动调整持仓的结构和仓位，持续优化组合的资产配置，力争实现较为稳健的净值增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业聚惠混合A基金份额净值为1.6608元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.72%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%；截至报告期末兴业聚惠混合C基金份额净值为1.6500元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.61%，同期业绩比较基准收益率为-0.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2024年宽财政加码、中美库存周期共振以及消费边际倾向维持修复，出口和消费带动总需求有限幅度的改善，通胀水平温和回升，企业盈利有望企稳修复，制造业投资维持弱修复态势，经济失速风险下降。但是，地产出清尚未完成，或将抑制信用扩张、信心与预期改善以及债务风险缓解，新动能难以抵消旧动能的增长缺口，需要加大财政支出维持基建投资适度增长。

基准情形下，预计经济增速中枢依然维持在潜在增速之下运行。货币政策配合，总量与结构政策并行。为配合宽财政，通过降准、增加MLF操作等释放中长期资金存在必要，资金面总体维持合理适度。尽管中美利差高位对降息存在阶段性掣肘，但美联储进入降息周期，美债收益率见顶回落，届时降息空间打开。总之，债市总体处于偏有利环境中，10年期国债收益率存在再创新低的可能。权益市场方面，经历近3年的调整，当前整体估值水平偏低，且风险偏好有望低位改善，权益市场或有所企稳。我们会根据基

本面环境和市场环境的变化，主动调整组合的资产结构，争取为基金持有人获得稳定的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2023年度主要从如下几个方面落实风险控制与合规管理、强化监察稽核职能：

1、建立健全公司治理结构、完善制度流程：报告期内公司持续优化公司治理和内部控制环境，有效推进监管新规内化落地工作，持续完善制度体系和授权管理机制，结合业务发展情况持续健全内部控制体系；

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监测：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求，组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对公司治理、投资研究、产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、落实全员合规理念、加强员工合规管理：报告期内公司持续开展外规宣贯和培训，密切关注外部监管要求，重视外规要求传达与内化，通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规内控意识；严格规范工作人员执业行为，开展警示案防教育，督促员工勤勉尽责，防范利用职务便利从事违法违规、超越权限或者其他损害客户合法权益的行为；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

6、持续完善内控合规体系建设、强化合规内控管理：报告期内，持续推进合规内控文化建设，强化法治治理能力，优化合规内控评价机制，强化合规引导，推进重点法规内化落地，有序开展各项合规内控工作，不断提升公司审慎规范经营和全面风险管理水平。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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约定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                   |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见             |
| 审计报告编号     | 德师报(审)字(24)第P00269号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|         |   |
|---------|---|
| 审计报告标题  | 审计报告  |
| 审计报告收件人 | 兴业聚惠混合型证券投资基金全体持有人：   |
| 审计意见    | 我们审计了兴业聚惠混合型证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴业聚惠混合型证券投资基金2023年12月31日的财务状况、2023年度的经营成 |



|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 果和净资产变动情况。  |
| 形成审计意见的基础       | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业聚惠混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。  |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | 兴业基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业聚惠混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业聚惠混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业聚惠混合型证券投资基金、终止运营  |

|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业聚惠混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业聚惠混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业聚惠混合型证券投资基金不能持续经营。(5) 评</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | 价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 注册会计师的姓名  | 汪芳、王硕   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市延安东路222号外滩中心30楼  |
| 审计报告日期    | 2024-03-27  |

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2023年12月31日

单位：人民币元

| 资产           | 附注号     | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b>   |         |                    |                     |
| 货币资金         | 7.4.7.1 | 460,789.65         | 965,039.63          |
| 结算备付金        |         | 136,818.34         | 1,530,810.95        |
| 存出保证金        |         | 4,436.49           | 48,919.17           |
| 交易性金融资产      | 7.4.7.2 | 118,636,962.48     | 284,319,233.77      |
| 其中：股票投资      |         | 19,913,567.71      | 37,910,003.19       |
| 基金投资         |         | -                  | -                   |
| 债券投资         |         | 98,723,394.77      | 246,409,230.58      |
| 资产支持证券投<br>资 |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资        |         | -                  | -                   |
| 其他投资         |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产       | 7.4.7.3 | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 199,070.40                 | 4,070,839.57                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 27,143.54                  | 7,292.03                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 119,465,220.90             | 290,942,135.12              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2022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        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 14,809,408.88              | 38,266,467.99               |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 49,223.33                  | 1,381,146.97                |
| 应付管理人报酬       |            | 52,993.74                  | 131,262.48                  |
| 应付托管费         |            | 8,832.29                   | 21,877.09                   |
| 应付销售服务费       |            | 7,851.28                   | 19,965.98                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 977.00                     | 8,428.36                    |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.6    | 184,767.18                 | 232,226.91                  |
| 负债合计          |            | 15,114,053.70              | 40,061,375.78               |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.7    | 63,198,579.60              | 152,945,701.10              |
| 未分配利润         | 7.4.7.8    | 41,152,587.60              | 97,935,058.24               |
| 净资产合计         |            | 104,351,167.20             | 250,880,759.34              |
| 负债和净资产总计      |            | 119,465,220.90             | 290,942,135.12              |

注：1、报告截止日2023年12月31日，基金份额总额63,198,579.60份，其中下属A类基金份额净值1.6608元，基金份额6,914,341.78份，下属C类基金份额净值1.6500元，基金份额56,284,237.82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。上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目                   | 附注号      | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日(基<br>金合同生效日)至2<br>022年12月31日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|---|
| 一、营业总收入              |          | 3,564,093.98                      | 8,944,492.13  |
| 1.利息收入               |          | 15,262.94                         | 113,144.04  |
| 其中：存款利息收入            | 7.4.7.9  | 15,145.90                         | 108,891.43  |
| 债券利息收入               |          | -                                 | -   |
| 资产支持证券利息<br>收入       |          | -                                 | -   |
| 买入返售金融资产<br>收入       |          | 117.04                            | 4,252.61  |
| 其他利息收入               |          | -                                 | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填<br>列） |          | 1,286,219.52                      | -24,218,579.65                                      |
| 其中：股票投资收益            | 7.4.7.10 | -1,515,742.04                     | -37,901,154.12                                      |
| 基金投资收益               |          | -                                 | -   |
| 债券投资收益               | 7.4.7.11 | 2,333,739.88                      | 11,987,889.82                                       |
| 资产支持证券投资<br>收益       | 7.4.7.12 | -                                 | -   |
| 贵金属投资收益              |          | -                                 | -   |

|                            |            |                     |                     |
|----------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.13   | -                   | -                   |
| 股利收益                       | 7.4.7.14   | 468,221.68          | 1,694,684.65        |
| 其他投资收益                     |            | -                   | -                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.15   | 2,261,578.66        | 32,338,818.86       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                   | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.16   | 1,032.86            | 711,108.88          |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>1,631,589.90</b> | <b>4,701,322.38</b> |
| 1.管理人报酬                    | 7.4.10.2.1 | 778,619.75          | 2,344,873.10        |
| 2.托管费                      | 7.4.10.2.2 | 129,769.94          | 390,812.21          |
| 3.销售服务费                    | 7.4.10.2.3 | 114,035.74          | 335,761.26          |
| 4.投资顾问费                    |            | -                   | -                   |
| 5.利息支出                     |            | 393,391.35          | 1,383,338.11        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 393,391.35          | 1,383,338.11        |
| 6.信用减值损失                   | 7.4.7.17   | -                   | -                   |
| 7.税金及附加                    |            | 3,537.64            | 21,131.13           |
| 8.其他费用                     | 7.4.7.18   | 212,235.48          | 225,406.57          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>1,932,504.08</b> | <b>4,243,169.75</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>1,932,504.08</b> | <b>4,243,169.75</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>            | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>1,932,504.08</b> | <b>4,243,169.75</b> |

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。上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：兴业聚惠混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日               |                |                 |
|--|---|----------------|-----------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 152,945,701.10                              | 97,935,058.24  | 250,880,759.34  |
| 二、本期期初净资产                                | 152,945,701.10                              | 97,935,058.24  | 250,880,759.34  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -89,747,121.50                              | -56,782,470.64 | -146,529,592.14 |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 1,932,504.08   | 1,932,504.08    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -89,747,121.50                              | -58,714,974.72 | -148,462,096.22 |
| 其中：1.基金申购款                               | 990,305.13                                  | 647,185.60     | 1,637,490.73    |
| 2.基金赎回款                                  | -90,737,426.63                              | -59,362,160.32 | -150,099,586.95 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -   | -              | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 63,198,579.60                               | 41,152,587.60  | 104,351,167.20  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |                |                 |

|  | 实收基金            | 未分配利润           | 净资产合计           |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|
| 一、上期期末净资产                                | -               | -               | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 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）                     | -377,016,676.86 | -245,385,754.20 | -622,402,431.06 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | 4,243,169.75    | 4,243,169.75    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -377,016,676.86 | -249,628,923.95 | -626,645,600.81 |
| 其中：1.基金申购款                               | 55,643,907.26   | 38,226,696.15   | 93,870,603.41   |
| 2.基金赎回款                                  | -432,660,584.12 | -287,855,620.10 | -720,516,204.22 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -               | -               | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 152,945,701.10  | 97,935,058.24   | 250,880,759.34  |

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。上年度可比期间不是完整报告期，按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

叶文煌

张顺国

楼怡斐

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴业聚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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2022年3月16日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1)金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征，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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

本基金在前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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊

余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[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]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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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，受让方不再缴纳印花税。自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 460,789.65         | 965,039.63          |
| 等于：本金        | 460,733.91         | 964,470.45          |
| 加：应计利息       | 55.74              | 569.18              |
| 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           | 460,789.65         | 965,039.63          |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2023年12月31日  |              |                |               |
|---------------|-------|---------------------|--------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 22,343,416.73       | -            | 19,913,567.71  | -2,429,849.02 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 42,974,026.05       | 326,477.21   | 43,141,121.01  | -159,382.25   |
|               | 银行间市场 | 54,827,869.23       | 663,573.76   | 55,582,273.76  | 90,830.77     |
|               | 合计    | 97,801,895.28       | 990,050.97   | 98,723,394.77  | -68,551.48    |
| 资产支持证券        |       | -                   | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 120,145,312.01      | 990,050.97   | 118,636,962.48 | -2,498,400.50 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2022年12月31日 |              |                |               |
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 40,136,659.72       | -            | 37,910,003.19  | -2,226,656.53 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 69,930,405.05       | 1,039,898.70 | 70,257,922.70  | -712,381.05   |
|               | 银行间市场 | 175,095,441.58      | 2,876,807.88 | 176,151,307.88 | -1,820,941.58 |
|               | 合计    | 245,025,846.63      | 3,916,706.58 | 246,409,230.58 | -2,533,322.63 |
| 资产支持证券        |       | -                   | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 285,162,506.35      | 3,916,706.58 | 284,319,233.77 | -4,759,979.16 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

##### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 5,767.18           | 53,226.91           |
| 其中：交易所市场    | 4,352.18           | 44,052.25           |
| 银行间市场       | 1,415.00           | 9,174.66            |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 179,000.00         | 179,000.00          |
| 合计          | 184,767.18         | 232,226.91          |

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 兴业聚惠混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(兴业聚惠混合A) | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |               |
|-----------------|-------------------------------|---------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末            | 13,359,861.06                 | 13,359,861.06 |
| 本期申购            | 196,138.31                    | 196,138.31    |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -6,641,657.59                 | -6,641,657.59 |
| 本期末             | 6,914,341.78                  | 6,914,341.78  |

##### 7.4.7.7.2 兴业聚惠混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(兴业聚惠混合C) | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                |
|-----------------|-------------------------------|----------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末            | 139,585,840.04                | 139,585,840.04 |
| 本期申购            | 794,166.82                    | 794,166.82     |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -84,095,769.04                | -84,095,769.04 |
| 本期末             | 56,284,237.82                 | 56,284,237.82  |

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

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 兴业聚惠混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(兴业聚惠混合A) | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|-----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末            | 8,099,860.72  | 567,798.67  | 8,667,659.39  |
| 本期期初            | 8,099,860.72  | 567,798.67  | 8,667,659.39  |
| 本期利润            | -41,067.52    | 246,404.48  | 205,336.96    |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -3,868,969.38 | -434,966.14 | -4,303,935.52 |
| 其中：基金申购款        | 118,456.21    | 10,266.95   | 128,723.16    |
| 基金赎回款           | -3,987,425.59 | -445,233.09 | -4,432,658.68 |
| 本期已分配利润         | -             | -           | -             |
| 本期末             | 4,189,823.82  | 379,237.01  | 4,569,060.83  |

##### 7.4.7.8.2 兴业聚惠混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(兴业聚惠混合C) | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|-----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末            | 82,260,381.86 | 7,007,016.99 | 89,267,398.85 |
| 本期期初            | 82,260,381.86 | 7,007,016.99 | 89,267,398.85 |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期利润           | -288,007.06    | 2,015,174.18  | 1,727,167.12   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -48,905,928.92 | -5,505,110.28 | -54,411,039.20 |
| 其中：基金申购款       | 463,801.37     | 54,661.07     | 518,462.44     |
| 基金赎回款          | -49,369,730.29 | -5,559,771.35 | -54,929,501.64 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 33,066,445.88  | 3,517,080.89  | 36,583,526.77  |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 活期存款利息收入  | 7,038.16                          | 37,370.53                                       |
| 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 | 7,827.06                          | 70,347.17                                       |
| 其他        | 280.68                            | 1,173.73  |
| 合计        | 15,145.90                         | 108,891.43                                      |

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------------|---|
| 卖出股票成交总额   | 31,121,154.95                     | 292,142,694.62                                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 32,581,927.15                     | 329,349,274.09                                  |
| 减：交易费用     | 54,969.84                         | 694,574.65                                      |
| 买卖股票差价收入   | -1,515,742.04                     | -37,901,154.12                                  |

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|---|
| 债券投资收益——利息收入                         | 4,023,769.04                      | 13,247,402.34                                   |
| 债券投资收益——买卖债券<br>（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | -1,690,029.16                     | -1,259,512.52                                   |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                   | -                                 | -   |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                   | -                                 | -   |
| 合计                                   | 2,333,739.88                      | 11,987,889.82                                   |

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                             | 本期<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）<br>至2022年12月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|---|
| 卖出债券（债转股<br>及债券到期兑付）<br>成交总额   | 232,733,285.67                    | 1,016,216,393.06                                |
| 减：卖出债券（债<br>转股及债券到期兑<br>付）成本总额 | 230,043,612.98                    | 1,004,438,815.00                                |
| 减：应计利息总额                       | 4,372,758.40                      | 13,023,935.01                                   |
| 减：交易费用                         | 6,943.45                          | 13,155.57                                       |
| 买卖债券差价收入                       | -1,690,029.16                     | -1,259,512.52                                   |

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|-------------|-----------------------------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 468,221.68                        | 1,694,684.65                                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                 | -   |
| 合计          | 468,221.68                        | 1,694,684.65                                    |

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2023年01月01日至20<br>23年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）<br>至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------------|---|
| 1.交易性金融资产  | 2,261,578.66                      | 32,338,818.86                                   |
| ——股票投资     | -203,192.49                       | 33,913,072.02                                   |
| ——债券投资     | 2,464,771.15                      | -1,574,253.16                                   |
| ——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                     | 2,261,578.66 | 32,338,818.86 |

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------------|---|
| 基金赎回费收入 | 1,032.86                          | 711,108.88                                      |
| 合计      | 1,032.86                          | 711,108.88                                      |

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效<br>日）至2022年12月31日 |
|-------|-----------------------------------|---|
| 审计费用  | 50,000.00                         | 39,862.74                                       |
| 信息披露费 | 120,000.00                        | 95,671.02                                       |
| 汇划手续费 | 5,035.48                          | 10,372.81                                       |
| 帐户维护费 | 37,200.00                         | 29,500.00                                       |
| 律师费   | -                                 | 40,000.00                                       |
| 公证费   | -                                 | 10,000.00                                       |
| 合计    | 212,235.48                        | 225,406.57                                      |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。



### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                    | 与本基金的关系               |
|--------------------------|-----------------------|
| 兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”）   | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”） | 基金托管人                 |
| 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：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；上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年01月01日<br>至2023年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同<br>生效日）至2022年12月31<br>日 |
|------------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 778,619.75                            | 2,344,873.10  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 157,456.31                            | 418,524.58  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 621,163.44                            | 1,926,348.52  |

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日<br>至2023年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生<br>效日）至2022年12月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 129,769.94                            | 390,812.21                                      |

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31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  | 63,040.58  | 63,040.58  |
| 兴业银行           | 0.00  | 1,876.64   | 1,876.64   |
| 合计             | 0.00  | 64,917.22  | 64,917.22  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）至2022年12月31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  | 169,620.45 | 169,620.45 |
| 兴业银行           | 0.00  | 1,974.80   | 1,974.80   |
| 合计             | 0.00  | 171,595.25 | 171,595.25 |

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |          | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）<br>至2022年12月31日 |           |
|-------|-------------------------------|----------|---|-----------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入   | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 中国民生  | 460,789.65                    | 7,038.16 | 965,039.63                                      | 37,370.53 |

|              |  |  |  |  |
|--------------|--|--|--|--|
| 银行股份<br>有限公司 |  |  |  |  |
|--------------|--|--|--|--|

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--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。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额14,809,408.88元，于2024年1月2日、1月3日、1月4日、1月5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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金基金管理人旗下其他基金共同持有一家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。

本基金报告期末及上年度末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 58,891,447.69      | 158,070,275.12      |
| AAA以下  | 14,476,685.11      | 37,658,618.47       |
| 未评级    | 5,022,418.03       | 10,056,098.63       |
| 合计     | 78,390,550.83      | 205,784,992.22      |

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金基金管理人主要通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023年1<br>2月31日 | 1年以内       | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计         |
|------------------------|------------|------|------|-----|------------|
| 资产                     |            |      |      |     |            |
| 货币资<br>金               | 460,789.65 | -    | -    | -   | 460,789.65 |
| 结算备<br>付金              | 136,818.34 | -    | -    | -   | 136,818.34 |
| 存出保                    | 4,436.49   | -    | -    | -   | 4,436.49   |

|                     |               |               |      |               |                |
|---------------------|---------------|---------------|------|---------------|----------------|
| 证金                  |               |               |      |               |                |
| 交易性金融资产             | 38,007,686.87 | 60,715,707.90 | -    | 19,913,567.71 | 118,636,962.48 |
| 应收清算款               | -             | -             | -    | 199,070.40    | 199,070.40     |
| 应收申购款               | -             | -             | -    | 27,143.54     | 27,143.54      |
| 资产总计                | 38,609,731.35 | 60,715,707.90 | -    | 20,139,781.65 | 119,465,220.90 |
| 负债                  |               |               |      |               |                |
| 卖出回购金融资产款           | 14,809,408.88 | -             | -    | -             | 14,809,408.88  |
| 应付赎回款               | -             | -             | -    | 49,223.33     | 49,223.33      |
| 应付管理人报酬             | -             | -             | -    | 52,993.74     | 52,993.74      |
| 应付托管费               | -             | -             | -    | 8,832.29      | 8,832.29       |
| 应付销售服务费             | -             | -             | -    | 7,851.28      | 7,851.28       |
| 应交税费                | -             | -             | -    | 977.00        | 977.00         |
| 其他负债                | -             | -             | -    | 184,767.18    | 184,767.18     |
| 负债总计                | 14,809,408.88 | -             | -    | 304,644.82    | 15,114,053.70  |
| 利率敏感度缺口             | 23,800,322.47 | 60,715,707.90 | -    | 19,835,136.83 | 104,351,167.20 |
| 上年度末<br>2022年12月31日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上 | 不计息           | 合计             |



|           |               |                |   |               |                |
|-----------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 资产        |               |                |   |               |                |
| 货币资金      | 965,039.63    | -              | - | -             | 965,039.63     |
| 结算备付金     | 1,530,810.95  | -              | - | -             | 1,530,810.95   |
| 存出保证金     | 48,919.17     | -              | - | -             | 48,919.17      |
| 交易性金融资产   | 38,772,853.15 | 207,636,377.43 | - | 37,910,003.19 | 284,319,233.77 |
| 应收清算款     | -             | -              | - | 4,070,839.57  | 4,070,839.57   |
| 应收申购款     | -             | -              | - | 7,292.03      | 7,292.03       |
| 资产总计      | 41,317,622.90 | 207,636,377.43 | - | 41,988,134.79 | 290,942,135.12 |
| 负债        |               |                |   |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | 38,266,467.99 | -              | - | -             | 38,266,467.99  |
| 应付赎回款     | -             | -              | - | 1,381,146.97  | 1,381,146.97   |
| 应付管理人报酬   | -             | -              | - | 131,262.48    | 131,262.48     |
| 应付托管费     | -             | -              | - | 21,877.09     | 21,877.09      |
| 应付销售服务费   | -             | -              | - | 19,965.98     | 19,965.98      |
| 应交税费      | -             | -              | - | 8,428.36      | 8,428.36       |
| 其他负债      | -             | -              | - | 232,226.91    | 232,226.91     |
| 负债总计      | 38,266,467.99 | -              | - | 1,794,907.79  | 40,061,375.78  |
| 利率敏       | 3,051,154.91  | 207,636,377.43 | - | 40,193,227.00 | 250,880,759.34 |

|      |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|
| 感度缺口 |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |               |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|---------------|
| 假设 | 利率曲线平行移动           |                                 |                     |               |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |               |
|    |                    | 本期末<br>2023年12月31日              | 上年度末<br>2022年12月31日 |               |
|    |                    | 市场利率上升25个基点                     | -491,944.35         | -1,648,003.72 |
|    |                    | 市场利率下降25个基点                     | 496,421.09          | 1,672,651.12  |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险可来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项，也可来源于市场整体波动。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，基金管理人对本基金所持仓证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量，以测试本基金所面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年12月31日 |                          | 上年度末<br>2022年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 19,913,567.71      | 19.08                    | 37,910,003.19       | 15.11                    |
| 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            | 19,913,567.71      | 19.08                    | 37,910,003.19       | 15.11                    |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除股票价格以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2023年12月31日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 股票价格上升5%           | 995,678.39                  | 1,895,500.16        |
|    | 股票价格下降5%           | -995,678.39                 | -1,895,500.16       |

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 35,523,740.83      | 38,060,626.71       |
| 第二层次          | 83,113,221.65      | 245,649,868.87      |
| 第三层次          | -                  | 608,738.19          |
| 合计            | 118,636,962.48     | 284,319,233.77      |

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |            |            |
|-----------|-------------------------------|------------|------------|
|           | 交易性金融资产                       |            | 合计         |
|           | 债券投资                          | 股票投资       |            |
| 期初余额      | -                             | 608,738.19 | 608,738.19 |
| 当期购买      | -                             | -          | -          |
| 当期出售/结算   | -                             | -          | -          |
| 转入第三层次    | -                             | -          | -          |
| 转出第三层次    | -                             | 716,165.07 | 716,165.07 |
| 当期利得或损失总额 | -                             | 107,426.88 | 107,426.88 |

|  |   |              |              |
|--|---|--------------|--------------|
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -   | 107,426.88   | 107,426.88   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -   | -            | -            |
| 期末余额                                       | -   | -            | -            |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -   | -            | -            |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2022年03月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |              |              |
|  | 交易性金融资产                                     |              | 合计           |
|  | 债券投资  | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -   | 1,814,826.94 | 1,814,826.94 |
| 当期购买                                       | -   | 2,808,156.89 | 2,808,156.89 |
| 当期出售/结算                                    | -   | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -   | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -   | 4,196,574.06 | 4,196,574.06 |
| 当期利得或损失总额                                  | -   | 182,328.42   | 182,328.42   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -   | 182,328.42   | 182,328.42   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -   | -            | -            |
| 期末余额                                       | -   | 608,738.19   | 608,738.19   |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -   | -255,675.37  | -255,675.37  |

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目   | 本期末公允价值    | 采用的估值技术    | 不可观察输入值            |               |            |
|------|------------|------------|--------------------|---------------|------------|
|      |            |            | 名称                 | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | -          | -          | -                  | -             | -          |
| 项目   | 上年度末公允价值   | 采用的估值技术    | 不可观察输入值            |               |            |
|      |            |            | 名称                 | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | 608,738.19 | 平均价格亚式期权模型 | 股票在剩余期限内股价的预期年化波动率 | 0.1444-0.5109 | 负相关        |

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 19,913,567.71 | 16.67        |
|    | 其中：股票  | 19,913,567.71 | 16.67        |
| 2  | 基金投资   | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 98,723,394.77 | 82.64        |
|    | 其中：债券  | 98,723,394.77 | 82.64        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 597,607.99     | 0.50   |
| 8 | 其他各项资产            | 230,650.43     | 0.19   |
| 9 | 合计                | 119,465,220.90 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 166,155.00    | 0.16         |
| C  | 制造业              | 13,029,050.36 | 12.49        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,171,910.00  | 2.08         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 1,084,706.00  | 1.04         |
| 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  | 1,502,963.55  | 1.44         |
| J  | 金融业              | 1,504,760.40  | 1.44         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 454,022.40    | 0.44         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| 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        | -             | -            |

|   |    |               |       |
|---|----|---------------|-------|
| S | 综合 | -             | -     |
|   | 合计 | 19,913,567.71 | 19.08 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 1,300   | 2,243,800.00 | 2.15         |
| 2  | 601985 | 中国核电 | 253,800 | 1,903,500.00 | 1.82         |
| 3  | 688187 | 时代电气 | 30,568  | 1,110,535.44 | 1.06         |
| 4  | 600522 | 中天科技 | 72,800  | 909,272.00   | 0.87         |
| 5  | 600690 | 海尔智家 | 38,200  | 802,200.00   | 0.77         |
| 6  | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,700   | 784,620.00   | 0.75         |
| 7  | 600845 | 宝信软件 | 15,904  | 776,115.20   | 0.74         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 20,600  | 709,670.00   | 0.68         |
| 9  | 300124 | 汇川技术 | 11,100  | 700,854.00   | 0.67         |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 24,600  | 684,372.00   | 0.66         |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 23,000  | 615,250.00   | 0.59         |
| 12 | 603939 | 益丰药房 | 13,800  | 552,552.00   | 0.53         |
| 13 | 300316 | 晶盛机电 | 12,200  | 537,898.00   | 0.52         |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 9,200   | 502,596.00   | 0.48         |
| 15 | 600352 | 浙江龙盛 | 59,000  | 495,600.00   | 0.47         |
| 16 | 002371 | 北方华创 | 2,000   | 491,420.00   | 0.47         |
| 17 | 300059 | 东方财富 | 33,085  | 464,513.40   | 0.45         |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 6,240   | 454,022.40   | 0.44         |
| 19 | 000777 | 中核科技 | 27,600  | 401,304.00   | 0.38         |
| 20 | 002472 | 双环传动 | 15,400  | 400,708.00   | 0.38         |
| 21 | 002273 | 水晶光电 | 28,300  | 383,182.00   | 0.37         |
| 22 | 600111 | 北方稀土 | 18,200  | 351,988.00   | 0.34         |
| 23 | 600406 | 国电南瑞 | 14,440  | 322,300.80   | 0.31         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 24 | 603345 | 安井食品 | 3,000  | 313,830.00 | 0.30 |
| 25 | 002311 | 海大集团 | 6,800  | 305,388.00 | 0.29 |
| 26 | 603233 | 大参林  | 11,980 | 298,302.00 | 0.29 |
| 27 | 688777 | 中控技术 | 6,413  | 290,829.55 | 0.28 |
| 28 | 600900 | 长江电力 | 11,500 | 268,410.00 | 0.26 |
| 29 | 002126 | 银轮股份 | 12,800 | 238,976.00 | 0.23 |
| 30 | 601688 | 华泰证券 | 16,900 | 235,755.00 | 0.23 |
| 31 | 002459 | 晶澳科技 | 8,900  | 184,408.00 | 0.18 |
| 32 | 601088 | 中国神华 | 5,300  | 166,155.00 | 0.16 |
| 33 | 600745 | 闻泰科技 | 3,900  | 165,009.00 | 0.16 |
| 34 | 000733 | 振华科技 | 2,600  | 152,984.00 | 0.15 |
| 35 | 000963 | 华东医药 | 3,300  | 136,818.00 | 0.13 |
| 36 | 688235 | 百济神州 | 873    | 121,381.92 | 0.12 |
| 37 | 600926 | 杭州银行 | 12,000 | 120,120.00 | 0.12 |
| 38 | 002463 | 沪电股份 | 4,800  | 106,176.00 | 0.10 |
| 39 | 601607 | 上海医药 | 5,800  | 97,034.00  | 0.09 |
| 40 | 688521 | 芯原股份 | 1,200  | 59,952.00  | 0.06 |
| 41 | 300031 | 宝通科技 | 2,900  | 53,766.00  | 0.05 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 688187 | 时代电气 | 1,653,352.51 | 0.66           |
| 2  | 600745 | 闻泰科技 | 1,007,585.00 | 0.40           |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 840,862.00   | 0.34           |
| 4  | 300316 | 晶盛机电 | 820,428.00   | 0.33           |
| 5  | 002459 | 晶澳科技 | 717,683.00   | 0.29           |
| 6  | 002371 | 北方华创 | 707,615.00   | 0.28           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 7  | 002273 | 水晶光电 | 684,903.00 | 0.27 |
| 8  | 600111 | 北方稀土 | 667,435.00 | 0.27 |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 646,437.00 | 0.26 |
| 10 | 600352 | 浙江龙盛 | 597,642.00 | 0.24 |
| 11 | 603939 | 益丰药房 | 539,843.00 | 0.22 |
| 12 | 688777 | 中控技术 | 411,435.34 | 0.16 |
| 13 | 002472 | 双环传动 | 403,557.00 | 0.16 |
| 14 | 000777 | 中核科技 | 366,740.00 | 0.15 |
| 15 | 600406 | 国电南瑞 | 358,188.00 | 0.14 |
| 16 | 603345 | 安井食品 | 336,005.00 | 0.13 |
| 17 | 603699 | 纽威股份 | 334,890.00 | 0.13 |
| 18 | 603290 | 斯达半导 | 250,281.00 | 0.10 |
| 19 | 601088 | 中国神华 | 247,081.00 | 0.10 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 239,811.00 | 0.10 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 601985 | 中国核电 | 3,102,008.00 | 1.24           |
| 2  | 600690 | 海尔智家 | 3,038,101.00 | 1.21           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 2,701,364.00 | 1.08           |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 2,391,365.40 | 0.95           |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 2,154,368.00 | 0.86           |
| 6  | 600522 | 中天科技 | 1,748,878.00 | 0.70           |
| 7  | 600845 | 宝信软件 | 1,627,122.00 | 0.65           |
| 8  | 603259 | 药明康德 | 1,152,933.00 | 0.46           |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 1,101,049.00 | 0.44           |
| 10 | 000733 | 振华科技 | 1,099,728.00 | 0.44           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 11 | 600745 | 闻泰科技 | 959,287.00 | 0.38 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 891,980.00 | 0.36 |
| 13 | 002179 | 中航光电 | 837,098.00 | 0.33 |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 764,493.80 | 0.30 |
| 15 | 601607 | 上海医药 | 643,744.00 | 0.26 |
| 16 | 002311 | 海大集团 | 587,760.00 | 0.23 |
| 17 | 600926 | 杭州银行 | 497,615.00 | 0.20 |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 492,522.00 | 0.20 |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 456,121.00 | 0.18 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 387,406.00 | 0.15 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 14,788,684.16 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 31,121,154.95 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 10,048,882.19 | 9.63         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 45,378,571.58 | 43.49        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,283,961.75 | 9.86         |
| 4  | 企业债券      | 17,482,065.70 | 16.75        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,203,702.18 | 9.78         |
| 7  | 可转债(可交换债) | 15,610,173.12 | 14.96        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |

|    |    |               |       |
|----|----|---------------|-------|
| 9  | 其他 | -             | -     |
| 10 | 合计 | 98,723,394.77 | 94.61 |

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称       | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 2228041 | 22农业银行二级01 | 100,000 | 10,356,295.08 | 9.92         |
| 2  | 188869  | 21中证19     | 100,000 | 10,286,226.85 | 9.86         |
| 3  | 210402  | 21农发02     | 100,000 | 10,283,961.75 | 9.86         |
| 4  | 019685  | 22国债20     | 100,000 | 10,048,882.19 | 9.63         |
| 5  | 110059  | 浦发转债       | 60,000  | 6,459,953.42  | 6.19         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资前十名证券发行主体中：

(1) 工商银行：于2023年6月7日因中国工商银行股份有限公司哈尔滨雷锋储蓄所未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会黑龙江监管局吊销金融许可证。

(2) 农业银行：于2023年4月10日因未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会随州监管分局罚款20万元；于2023年8月18日因未依法履行其他职责被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计4420.184584万元。其中，对总行罚款1760.092292万元，没收违法所得60.092292万元，对分支机构罚款2600万元；于2023年12月1日因未依法履行其他职责被中国银行保险监督管理委员会处罚款合计5709738元。

(3) 浙商银行：于2023年12月14日因未及时披露公司重大事项被中国证券监督管理委员会浙江监管局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。

(4) 中信证券：于2023年2月10日因未依法履行其他职责被中国人民银行罚款1376万元；于2023年3月30日因未依法履行其他职责被上海证券交易所出具问询函；于2023年4月6日因未及时披露公司重大事项被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施；于2023年4月12日因未及时披露公司重大事项被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

(5) 太平人寿：于2023年6月2日因未依法履行其他职责被中国人民银行上海分行处以罚款人民币800万元。

报告期内基金投资的前十名证券除上述主体外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金管理人的研究部门对其保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 4,436.49   |
| 2  | 应收清算款 | 199,070.40 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 27,143.54  |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | -          |
| 9 | 合计 | 230,650.43 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|---------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债  | 6,459,953.42 | 6.19          |
| 2  | 113042 | 上银转债  | 3,523,555.07 | 3.38          |
| 3  | 113056 | 重银转债  | 2,659,773.64 | 2.55          |
| 4  | 118031 | 天23转债 | 1,572,927.08 | 1.51          |
| 5  | 113050 | 南银转债  | 954,151.64   | 0.91          |
| 6  | 113045 | 环旭转债  | 227,256.93   | 0.22          |
| 7  | 113059 | 福莱转债  | 212,555.34   | 0.20          |

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 | 594       | 11,640.31 | 0.00          | 0.00%    | 6,914,341.78  | 100.0000% |
| 兴业聚惠    | 5,283     | 10,653.84 | 34,938,125.10 | 62.0744% | 21,346,112.72 | 37.9256%  |

|     |       |           |               |          |               |          |
|-----|-------|-----------|---------------|----------|---------------|----------|
| 混合C |       |           |               |          |               |          |
| 合计  | 5,877 | 10,753.54 | 34,938,125.10 | 55.2831% | 28,260,454.50 | 44.7169% |

注：1、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。  
2、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别    | 持有份额总数<br>(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 | 108,709.10    | 1.5722%  |
|                  | 兴业聚惠混合C | 254.51        | 0.0005%  |
|                  | 合计      | 108,963.61    | 0.1724%  |

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 兴业聚惠混合A | 0~10              |
|                                    | 兴业聚惠混合C | 0                 |
|                                    | 合计      | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 兴业聚惠混合A | 0~10              |
|                                    | 兴业聚惠混合C | 0                 |
|                                    | 合计      | 0~10              |

## §10 开放式基金份额变动

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 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 13,359,861.06  | 139,585,840.04 |
| 本报告期基金总申购份额                | 196,138.31     | 794,166.82     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 6,641,657.59   | 84,095,769.04  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 6,914,341.78   | 56,284,237.82  |

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未产生基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2023年4月17日，官恒秋先生离任兴业基金管理有限公司董事长、法定代表人，由叶文煌先生担任公司董事长、法定代表人。详见本公司于2023年4月19日发布的《兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2、2023年6月9日，胡斌先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长叶文煌先生代行公司总经理职务。详见本公司于2023年6月10日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、2023年9月8日，董事长叶文煌先生不再代行兴业基金管理有限公司总经理职务，由李辉先生担任公司总经理。详见本公司于2023年9月9日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况



报告期内应支付给会计师事务所的报酬为5万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为9年。

由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）继续执行 2023年年度报告审计。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 方正证券 | 2      | 35,827,147.39 | 78.52%       | 15,453.53 | 68.27%     | -  |
| 海通证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券 | 2      | 9,801,562.42  | 21.48%       | 7,181.01  | 31.73%     | -  |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具

备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务。

iv 投研交综合实力较强。

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

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增券商交易单元，剔除券商交易单元：兴业  
证券股份有限公司。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名<br>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<br>券成交总<br>额的比例 | 成交金额               | 占当期债<br>券回购成<br>交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期基<br>金成交总<br>额的比例 |
| 方正证<br>券 | 30,758,591.<br>91 | 48.89%               | 578,400,000.<br>00 | 67.55%                     | -    | -                    | -    | -                    |
| 海通证<br>券 | -                 | -                    | -                  | -                          | -    | -                    | -    | -                    |
| 招商证<br>券 | -                 | -                    | -                  | -                          | -    | -                    | -    | -                    |
| 华泰证<br>券 | 32,151,271.<br>72 | 51.11%               | 277,800,000.<br>00 | 32.45%                     | -    | -                    | -    | -                    |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                             | 法定披露方式     | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------|------------|------------|
| 1  | 兴业聚惠混合型证券投资基金2022年第4季度报告         | 中国证监会规定的媒介 | 2023-01-20 |
| 2  | 兴业聚惠混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号） | 中国证监会规定的媒介 | 2023-03-03 |

|    |  |            |            |
|----|--|------------|------------|
| 3  | 兴业聚惠混合型证券投资基金2022年年度报告                       | 中国证监会规定的媒介 | 2023-03-31 |
| 4  | 兴业基金管理有限公司关于董事长变更的公告                         | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-19 |
| 5  | 兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果的通知            | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-20 |
| 6  | 兴业聚惠混合型证券投资基金2023年第一季度报告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2023-04-21 |
| 7  | 兴业基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2023-06-10 |
| 8  | 兴业基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗活动的特别提示公告             | 中国证监会规定的媒介 | 2023-06-29 |
| 9  | 兴业聚惠混合型证券投资基金2023年第二季度报告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2023-07-21 |
| 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 | 2023-08-19 |
| 11 | 兴业聚惠混合型证券投资基金2023年中期报告                       | 中国证监会规定的媒介 | 2023-08-31 |
| 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 | 2023-09-09 |
| 13 | 兴业基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2023-09-13 |
| 14 | 兴业聚惠混合型证券投资基金2023年第三季度报告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2023-10-25 |
| 15 | 兴业基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告                | 中国证监会规定的媒介 | 2023-11-11 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |               |      | 报告期末持有基金情况    |               |        |
|---|----------------|------------------------|---------------|------|---------------|---------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20230101-20231231      | 34,938,125.10 | 0.00 | 0.00          | 34,938,125.10 | 55.28% |
|   | 2              | 20230101-20230105      | 50,606,383.28 | 0.00 | 50,606,383.28 | 0.00          | 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会关于准予兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- （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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

### 13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司  
二〇二四年三月三十日