

民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人中国建设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	6
3.3 其他指标	8
§ 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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45

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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银养老服务混合
基金主代码	002547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 21 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,300,583.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，精选与养老服务相关行业中的优质企业进行投资，分享养老服务行业发展所带来的投资机会，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，积极主动构建投资组合，在适当分散风险和严格控制下行风险的前提下，精选与养老服务相关行业中的优质企业进行投资，分享养老服务行业发展所带来的投资机会，力争实现超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益基金。

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		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邢颖	李申
	联系电话	010-88566571	021-60637102
	电子邮箱	xingying@msjfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	021-60637111
传真		0755-23999800	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码		518038	100033
法定代表人		张焕南	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

§ 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1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	78,873,396.90
本期利润	-1,095,959.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0092
本期加权平均净值利润率	-0.35%
本期基金份额净值增长率	3.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	40,723,348.36
期末可供分配基金份额利润	1.7477
期末基金资产净值	64,371,779.80
期末基金份额净值	2.763
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	176.30%

注：①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。

②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。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

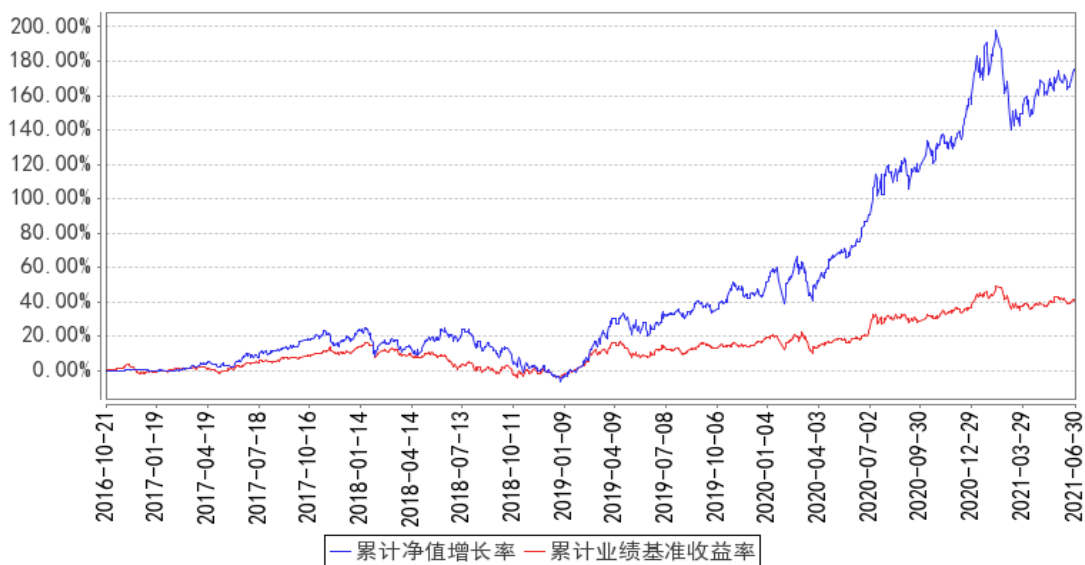
阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.21%	0.86%	-1.22%	0.49%	2.43%	0.37%
过去三个月	9.08%	1.13%	2.69%	0.59%	6.39%	0.54%
过去六个月	3.87%	1.62%	1.26%	0.79%	2.61%	0.83%
过去一年	44.81%	1.56%	16.19%	0.80%	28.62%	0.76%
过去三年	129.49%	1.44%	35.90%	0.81%	93.59%	0.63%
自基金合同生效起至今	176.30%	1.26%	41.19%	0.71%	135.11%	0.55%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*40%

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

民生加银养老服务混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2016 年 10 月 21 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的

约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会[2008]1187号文批准，于2008年11月3日在深圳正式成立，2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2021年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理88只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银汇鑫一年定期开放债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数型证券投资基金、民生加银鑫元纯债债券型证券投资基金、民生加银智造2025灵活配置混合型证券投资基金、民生加银家盈半年定期宝理财

债券型证券投资基金、民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银恒益纯债债券型证券投资基金、民生加银新兴成长混合型证券投资基金、民生加银创新成长混合型证券投资基金、民生加银睿通 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银兴盈债券型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、民生加银中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、民生加银聚益纯债债券型证券投资基金、民生加银添鑫纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银新动能一年定期开放混合型证券投资基金、民生加银高等级信用债债券型证券投资基金、民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、民生加银嘉益债券型证券投资基金、民生加银瑞盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银医药健康股票型证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新兴产业混合型证券投资基金、民生加银康利混合型证券投资基金、民生加银成长优选股票型证券投资基金、民生加银恒泽债券型证券投资基金、民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银质量领先混合型证券投资基金、民生加银汇智 3 个月定期开放债券型证券投资基金、民生加银汇利混合型证券投资基金、民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金、民生加银瑞利混合型证券投资基金、民生加银润利混合型证券投资基金、民生加银兴利混合型证券投资基金、民生加银内核驱动混合型证券投资基金、民生加银价值优选 6 个月持有期股票型证券投资基金、民生加银周期优选混合型证券投资基金。

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		
高松	本基金基	2016 年	-	11 年	北京大学医学部博士，加拿大多伦多大学

	金经理	12月5日			医学院博士后, 11年证券从业经历, 曾于国金通用基金公司(筹)研究部担任研究员; 于方正富邦基金管理有限公司研究部、投资部先后担任研究员、基金经理。2016年7月加入民生加银基金管理有限公司, 担任基金经理、权益资产条线投资决策委员会成员。自2016年12月至今担任民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 自2017年3月至今担任民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 自2019年8月至今担任民生加银优选股票型证券投资基金基金经理; 自2020年4月至今担任民生加银品质消费股票型证券投资基金基金经理; 自2020年8月至今担任民生加银医药健康股票型证券投资基金基金经理; 自2019年3月至2020年5月担任民生加银信用双利债券型证券投资基金基金经理。
--	-----	-------	--	--	---

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。②证券从业的含义遵从《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, 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 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

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 完善了公司公平交易制度, 制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动, 同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节, 形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易, 公司启用了交易系统内的公平交易程序, 在指令分发及指令执行阶段, 均由系统强制执行公平委托; 此外, 公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易, 公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公

司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年的行情分为三段。第一段是年初到春节前，延续去年下半年的行情，科技、消费、医药板块中的核心资产加速上涨。第二段是春节后倒 V 型拐头下跌，前期领涨的核心资产领跌。第三段是 3 月下旬启动的筑底反弹/反转，反弹/反转至今没有结束。我们在年初的年度策略中即判断，决定今年指数的行情和市场风格的主要矛盾是股市的流动性，因此加强了宏观研究和学习。我们当时预期，今年，随着疫苗上市，叠加全球各国严格执行隔离政策，疫情会得到有效控制，经济修复、货币流动性边际收敛是必然趋势。因此从年初就减持了部分医药、科技、消费板块中高估值的核心资产，增配了一些低估值金融标的，以及医药、消费板块中的防御标的，以实现组合均衡化。但是事情并未如期演进。一方面，印度、欧洲等地区疫情防控不力，发生二次传播高峰，并出现毒性更强的变异株。另一方面，由于产能不够，疫苗的接种速度慢于预期。因此经济修复缓慢，促使美联储加强释放出前所未有的宽裕的流动性，而国内的流动性也相应维持宽松。受益于国内宽松的流动性和美国更加宽松的流动性，A 股市场的风险偏好不断提升，增量资金不断流入。在此背景下，二季度走出一波持续上涨行情，尤其是创业板指数，强势反转，创 2016 年以来历史新高。由于我们相对谨慎，因此并未从强势反弹/反转中充分获益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.763 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.87%，业绩比较基准收益率为 1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然认为全球经济复苏，美联储以及国内货币流动性收敛是趋势所在，但是节奏难以把握。市场总体可能呈现波动，指数机会不如上半年，但自下而上结构性机会仍然值得挖掘。并且，疫情之后，中国股市在全球范围内的吸引力将得到提升，中国的经济转型将更加

坚决而且加速，代表中国经济转型的产业中将会蕴含更多的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照相关会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、固定收益部、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究各部门参加人员应包含相关行业研究员及固定收益信评人员。分管运营的公司领导任估值委员会主席。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期可不进行利润分配。

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元的情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,411,218.15	45,405,244.49
结算备付金		259,943.81	954,150.96
存出保证金		216,378.76	171,928.69
交易性金融资产	6.4.7.2	52,883,771.46	422,090,240.07
其中：股票投资		52,846,411.56	422,090,240.07
基金投资		-	-
债券投资		37,359.90	-
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	-	-
应收证券清算款		399,644.31	219,584.57
应收利息	6.4.7.5	1,644.07	4,775.89
应收股利		-	-
应收申购款		65,320.82	136,661.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		65,237,921.38	468,982,586.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		94.85	4,202,301.77
应付赎回款		369,566.07	164,149.78
应付管理人报酬		31,223.27	216,358.69
应付托管费		7,805.84	54,089.70

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	372,850.32	366,299.48
应交税费		0.34	0.02
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,600.89	154,813.45
负债合计		866,141.58	5,158,012.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	23,300,583.25	174,383,739.74
未分配利润	6.4.7.10	41,071,196.55	289,440,833.77
所有者权益合计		64,371,779.80	463,824,573.51
负债和所有者权益总计		65,237,921.38	468,982,586.40

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.763 元，基金份额总额 23,300,583.25 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,091,854.40	8,959,040.33
1. 利息收入		108,818.35	45,748.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	108,482.90	15,817.47
债券利息收入		335.45	2,917.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	27,013.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		81,365,051.35	6,472,642.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	80,763,788.47	5,039,591.54
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	285,275.74	1,234,959.34
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	315,987.14	198,091.40

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-79,969,355.91	2,335,179.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	587,340.61	105,470.41
减：二、费用		3,187,813.41	375,653.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	967,738.10	104,512.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	241,934.54	26,128.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,884,597.33	188,244.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	10.47
7. 其他费用	6.4.7.20	93,543.40	56,757.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,095,959.01	8,583,386.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,095,959.01	8,583,386.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 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）	174,383,739.74	289,440,833.77	463,824,573.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,095,959.01	-1,095,959.01
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）	-151,083,156.49	-247,273,678.21	-398,356,834.70
其中：1. 基金申	14,262,797.45	23,860,329.95	38,123,127.40

购款			
2. 基金赎回款	-165,345,953.94	-271,134,008.16	-436,479,962.10
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）	23,300,583.25	41,071,196.55	64,371,779.80
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6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）	26,001,238.90	12,877,236.80	38,878,475.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,583,386.81	8,583,386.81
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）	-5,003,519.03	-2,404,123.29	-7,407,642.32
其中：1. 基金申购款	15,628,393.16	9,633,232.37	25,261,625.53
2. 基金赎回款	-20,631,912.19	-12,037,355.66	-32,669,267.85
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）	20,997,719.87	19,056,500.32	40,054,220.19

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：

李操纲

朱永明

洪锐珠

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

民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]444号《关于准予民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2016年10月21日正式生效，首次设立募集规模为264,233,513.40份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、衍生工具（权证、股票期权、股指期货等）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换公司债券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、大额存单、同业存单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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%。基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约等衍生工具所需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金投资于与养老服务相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式和买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，并自 2018 年 1

月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。自 2015 年 9 月 8 日起，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 6 月 30 日
活期存款	11,411,218.15

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	11,411,218.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	45,798,331.22	52,846,411.56	7,048,080.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	37,359.90	10,359.90
	银行间市场	-	-
	合计	37,359.90	10,359.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	45,825,331.22	52,883,771.46	7,058,440.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无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 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,421.01
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	117.00
应收债券利息	8.76

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	-
应收出借证券利息	-
其他	97.30
合计	1,644.07

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	372,850.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	372,850.32

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	757.73
应付证券出借违约金	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
预提银行间账户维护费	4,500.00
合计	84,600.89

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,383,739.74	174,383,739.74
本期申购	14,262,797.45	14,262,797.45
本期赎回（以“-”号填列）	-165,345,953.94	-165,345,953.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	23,300,583.25	23,300,583.25

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	160,245,685.29	129,195,148.48	289,440,833.77
本期利润	78,873,396.90	-79,969,355.91	-1,095,959.01
本期基金份额交易产生的变动数	-198,395,733.83	-48,877,944.38	-247,273,678.21
其中：基金申购款	17,243,486.56	6,616,843.39	23,860,329.95
基金赎回款	-215,639,220.39	-55,494,787.77	-271,134,008.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,723,348.36	347,848.19	41,071,196.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	100,265.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,647.72
其他	1,569.68
合计	108,482.90

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	80,763,788.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	80,763,788.47

6.4.7.12.2 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1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	820,657,504.59
减：卖出股票成本总额	739,893,716.12
买卖股票差价收入	80,763,788.47

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6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	285,275.74
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	285,275.74

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,943,602.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,658,000.00
减：应收利息总额	327.06
买卖债券差价收入	285,275.74

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	315,987.14
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	315,987.14

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-79,969,355.91
股票投资	-79,979,715.81
债券投资	10,359.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-79,969,355.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	587,105.97
基金转换费收入	234.64
合计	587,340.61

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,884,597.33
银行间市场交易费用	-
合计	1,884,597.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,200.24
账户维护费	9,000.00
合计	93,543.40

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准日，本基金无需作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

本基金本报告期不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。

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
民生加银基金管理有限公司（“民生加银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末及上年度末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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	967,738.10	104,512.89
其中：支付销售机构的客户维护 费	58,571.59	45,357.17

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金管理费年费率

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	241,934.54	26,128.24

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金托管费年费率

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

注：本基金于本期及上年度可比期间均未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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

注：本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	11,411,218.15	100,265.50	6,140,863.71	12,998.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-

300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	306	10,165.32	26,775.00	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	254	6,324.60	6,301.74	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联	2021年	2021	新股流	20.81	42.23	90	1,872.90	3,800.70	-

	软件	5月26日	2021年12月3日	通受限							
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	267	1,412.43	3,855.48		-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股流通受限	12.54	27.89	181	2,269.74	5,048.09		-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月21日	新股流通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89		-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00		-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00		-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股流通受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88		-
688619	罗普特	2021年2月8日	2021年8月23日	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44		-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52		-
688819	天能股份	2021年1月7日	2021年7月19日	新股流通受限	41.79	43.69	6,740	281,664.60	294,470.60		-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	新股流通受限	24.60	163.00	457	11,242.20	74,491.00		-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据证券上市公告书估算的流通日期，最终可流通日期

以证券解禁上市流通的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于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

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2021 年 06 月 30 日，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以投资决策委员会为核心的、由风险控制委员会、投资各部门、交易部、监察稽核部、风险管理部、研究各部门等相关业务部门构成的金融工具风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证

券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易与中国证券登记结算有限责任公司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；基金在进行银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	37,359.90	-
未评级	-	-
合计	37,359.90	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,411,218.15	-	-	-	-	-	11,411,218.15
结算备付金	259,943.81	-	-	-	-	-	259,943.81
存出保证金	216,378.76	-	-	-	-	-	216,378.76
交易性金融资产	-	-	-	-	37,359.90	52,846,411.56	52,883,771.46
应收利息	-	-	-	-	-	1,644.07	1,644.07
应收申购款	-	-	-	-	-	65,320.82	65,320.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-	399,644.31	399,644.31
资产总计	11,887,540.72	-	-	-	37,359.90	53,313,020.76	65,237,921.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	369,566.07	369,566.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,223.27	31,223.27
应付托管费	-	-	-	-	-	7,805.84	7,805.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-	94.85	94.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	372,850.32	372,850.32
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	84,600.89	84,600.89
负债总计	-	-	-	-	-	866,141.58	866,141.58
利率敏感度缺口	11,887,540.72	-	-	-	37,359.90	52,446,879.18	64,371,779.80
上年度末 2020年12 月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	45,405,244.49	-	-	-	-	-	45,405,244.49
结算备付金	954,150.96	-	-	-	-	-	954,150.96
存出保证金	171,928.69	-	-	-	-	-	171,928.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	422,090,240.07	422,090,240.07

应收利息	-	-	-	-	4,775.89	4,775.89
应收申购款	-	-	-	-	136,661.73	136,661.73
应收证券清算款	-	-	-	-	219,584.57	219,584.57
资产总计	46,531,324.14	-	-	-	422,451,262.26	468,982,586.40
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	164,149.78	164,149.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	216,358.69	216,358.69
应付托管费	-	-	-	-	54,089.70	54,089.70
应付证券清算款	-	-	-	-	4,202,301.77	4,202,301.77
应付交易费用	-	-	-	-	366,299.48	366,299.48
应交税费	-	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	-	154,813.45	154,813.45
负债总计	-	-	-	-	5,158,012.89	5,158,012.89
利率敏感度缺口	46,531,324.14	-	-	-	417,293,249.37	463,824,573.51

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.06% (2020 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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6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	52,846,411.56	82.10	422,090,240.07	91.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	52,846,411.56	82.10	422,090,240.07	91.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	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6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	5,783,212.99	37,266,578.82
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-5,783,212.99	-37,266,578.82

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他应

收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 51,465,249.54 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 420,365,343.35 元），划分为第二层次的余额为人民币 1,418,521.92 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 1,724,896.72 元），无划分为第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：无）。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 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	52,846,411.56	81.01
	其中：股票	52,846,411.56	81.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,359.90	0.06
	其中：债券	37,359.90	0.06
	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	11,671,161.96	17.89
8	其他各项资产	682,987.96	1.05
9	合计	65,237,921.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	5,439.50	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,407,712.60	61.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,289.04	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.04
F	批发和零售业	2,354,876.43	3.66
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	1,531,699.69	2.38
J	金融业	5,770,797.00	8.96
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,701,787.60	5.75
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.07
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	52,846,411.56	82.10

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601012	隆基股份	52,640	4,676,537.60	7.26
2	000661	长春高新	11,460	4,435,020.00	6.89
3	300750	宁德时代	7,600	4,064,480.00	6.31
4	603259	药明康德	23,640	3,701,787.60	5.75
5	300122	智飞生物	19,822	3,701,362.06	5.75
6	300601	康泰生物	23,206	3,457,694.00	5.37
7	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	4.79

8	000333	美的集团	29,730	2,121,830.10	3.30
9	603833	欧派家居	14,862	2,109,809.52	3.28
10	600036	招商银行	32,700	1,772,013.00	2.75
11	300059	东方财富	50,500	1,655,895.00	2.57
12	300274	阳光电源	14,100	1,622,346.00	2.52
13	002812	恩捷股份	6,000	1,404,600.00	2.18
14	002475	立讯精密	26,700	1,228,200.00	1.91
15	000001	平安银行	53,700	1,214,694.00	1.89
16	000858	五粮液	4,000	1,191,560.00	1.85
17	603233	大参林	23,235	1,187,540.85	1.84
18	002727	一心堂	34,986	1,158,386.46	1.80
19	688111	金山办公	2,877	1,135,839.60	1.76
20	601166	兴业银行	54,900	1,128,195.00	1.75
21	300751	迈为股份	2,160	982,152.00	1.53
22	688518	联赢激光	36,777	690,304.29	1.07
23	603345	安井食品	2,600	660,452.00	1.03
24	600196	复星医药	9,000	649,170.00	1.01
25	300049	福瑞股份	54,300	640,740.00	1.00
26	300014	亿纬锂能	5,991	622,644.63	0.97
27	600690	海尔智家	23,400	606,294.00	0.94
28	688819	天能股份	6,740	294,470.60	0.46
29	688606	奥泰生物	1,892	281,908.00	0.44
30	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.25
31	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.24
32	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.19
33	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.15
34	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.14
35	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.13
36	300919	中伟股份	457	74,491.00	0.12
37	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.07
38	300894	火星人	628	42,704.00	0.07
39	300973	立高食品	360	41,655.60	0.06
40	300979	华利集团	306	26,775.00	0.04
41	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.04
42	001207	联科科技	682	22,581.02	0.04
43	300941	创识科技	399	19,926.06	0.03
44	300925	法本信息	600	15,774.00	0.02
45	300932	三友联众	492	15,601.32	0.02
46	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.02
47	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.02
48	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
49	300940	南极光	307	13,317.66	0.02

50	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.02
51	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.02
52	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
53	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.02
54	603171	税友股份	535	10,272.00	0.02
55	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.02
56	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
57	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
58	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
59	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
60	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
61	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
62	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
63	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
64	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
65	300986	志特新材	264	8,070.48	0.01
66	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.01
67	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
68	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.01
69	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
70	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.01
71	300991	创益通	254	6,733.54	0.01
72	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
73	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.01
74	300985	致远新能	254	6,301.74	0.01
75	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.01
76	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.01
77	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.01
78	300960	通业科技	234	5,396.04	0.01
79	301009	可靠股份	181	5,048.09	0.01
80	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.01
81	605011	杭州热电	483	4,289.04	0.01
82	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.01
83	301007	德迈仕	267	3,855.48	0.01
84	300996	普联软件	90	3,800.70	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	600298	安琪酵母	25,294,293.00	5.45
2	603233	大参林	21,322,280.80	4.60

3	000858	五 粮 液	20,573,820.00	4.44
4	300059	东方财富	20,328,622.00	4.38
5	002507	涪陵榨菜	19,373,710.00	4.18
6	300529	健帆生物	19,142,222.00	4.13
7	300601	康泰生物	18,267,182.23	3.94
8	002727	一心堂	14,988,169.88	3.23
9	601166	兴业银行	14,685,801.63	3.17
10	300274	阳光电源	12,982,440.41	2.80
11	688012	中微公司	12,743,589.19	2.75
12	603883	老百姓	12,222,164.80	2.64
13	603456	九洲药业	11,997,388.00	2.59
14	000001	平安银行	11,200,334.00	2.41
15	600926	杭州银行	11,068,469.00	2.39
16	002352	顺丰控股	9,911,730.00	2.14
17	601601	中国太保	9,528,090.00	2.05
18	688063	派能科技	9,204,065.75	1.98
19	601009	南京银行	8,544,359.00	1.84
20	603369	今世缘	8,346,484.00	1.80

注：“本期累计买入金额”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。

7.4.2 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	300601	康泰生物	39,840,920.86	8.59
2	300014	亿纬锂能	39,048,612.07	8.42
3	000661	长春高新	33,446,097.50	7.21
4	603833	欧派家居	29,733,053.06	6.41
5	600690	海尔智家	26,599,220.09	5.73
6	000858	五 粮 液	26,497,700.00	5.71
7	600298	安琪酵母	25,045,919.00	5.40
8	000333	美的集团	24,638,975.00	5.31
9	300750	宁德时代	23,777,525.00	5.13
10	601601	中国太保	22,105,912.94	4.77
11	300529	健帆生物	21,366,087.81	4.61
12	002475	立讯精密	20,079,062.40	4.33
13	002727	一心堂	20,068,290.00	4.33
14	603233	大参林	19,982,909.78	4.31
15	300059	东方财富	19,843,012.86	4.28
16	601012	隆基股份	19,841,724.90	4.28
17	601318	中国平安	19,472,676.77	4.20

18	600036	招商银行	18,945,988.43	4.08
19	002507	涪陵榨菜	18,894,549.29	4.07
20	603883	老百姓	15,302,495.10	3.30
21	002050	三花智控	15,072,958.00	3.25
22	300463	迈克生物	13,402,401.79	2.89
23	688111	金山办公	12,856,872.71	2.77
24	601166	兴业银行	12,452,724.00	2.68
25	300122	智飞生物	12,445,630.47	2.68
26	603369	今世缘	11,947,200.20	2.58
27	688012	中微公司	11,741,527.83	2.53
28	600438	通威股份	11,643,213.00	2.51
29	600926	杭州银行	10,968,680.00	2.36
30	300751	迈为股份	10,953,971.00	2.36
31	300274	阳光电源	10,779,097.00	2.32
32	603456	九洲药业	10,745,953.00	2.32
33	601021	春秋航空	10,662,216.53	2.30
34	000001	平安银行	9,802,487.00	2.11
35	002352	顺丰控股	9,792,066.00	2.11
36	601888	中国中免	9,581,190.86	2.07

注：“本期累计卖出金额”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。

7.4.3 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	450,629,603.42
卖出股票收入（成交）总额	820,657,504.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	37,359.90	0.06
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	37,359.90	0.06

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	123114	三角转债	270	37,359.90	0.06

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。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，以降低投资组合的整体风险。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

招商银行因违法违规被中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字(2021)16号，收到处罚决定日期：2021年5月18日）

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票没有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	216,378.76
2	应收证券清算款	399,644.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,644.07
5	应收申购款	65,320.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,987.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
16,020	1,454.47	4,626,665.79	19.86	18,673,917.46	80.14

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	5,528.33	0.0237

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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年10月21日) 基金份额总额	264,233,513.40
本报告期期初基金份额总额	174,383,739.74
本报告期基金总申购份额	14,262,797.45
减：本报告期基金总赎回份额	165,345,953.94
本报告期基金拆分变动份额 (份额减 少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	23,300,583.25

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无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

本报告期内，基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略中增加了存托凭证投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
中信建投	4	353,536,833.43	27.95%	259,325.30	27.84%	-
国盛证券	2	305,806,649.44	24.18%	223,637.74	24.01%	-
财达证券	2	251,688,306.54	19.90%	180,734.31	19.40%	-
英大证券	2	131,282,996.16	10.38%	95,993.81	10.31%	-
西部证券	1	105,625,011.39	8.35%	75,131.82	8.07%	-
国信证券	1	51,874,820.76	4.10%	48,311.26	5.19%	-
方正证券	1	20,998,136.61	1.66%	14,936.02	1.60%	-
华西证券	1	13,399,457.11	1.06%	9,798.99	1.05%	-
中金公司	2	10,871,603.35	0.86%	10,124.91	1.09%	-
川财证券	2	10,084,147.95	0.80%	6,425.62	0.69%	-
浙商证券	2	4,908,190.22	0.39%	3,589.12	0.39%	-
中泰证券	2	4,752,656.89	0.38%	3,380.78	0.36%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-

证券						
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	3	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

中银国际	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	
	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
中信建投	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	1,943,602.80	100.00%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

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 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商评价表》

ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案；

- iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见；
- iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议；
- v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计；
- vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续；
- vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试；
- viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息；
- ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。
- 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本基金本期新增英大证券上海及深圳交易单元各一个。

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	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-15
2	民生加银基金管理有限公司关于暂停使用招商银行卡办理网上直销部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-20
3	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-21
4	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第四季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-21
5	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东方财富证券股份有限公司并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-19
6	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-03-30

		报、公司网站、证监会基金电子披露网站	
7	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
8	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-21
9	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第一季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-21
10	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份资料信息的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-30
11	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 1 号)	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-04
12	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-04
13	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资的公告	中国证券报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-24
14	关于民生加银基金管理有限公司旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站、深圳证券交易所网站、上海证券交易所网站	2021-06-30
15	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-30
16	民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-30

§ 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

	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

投资者类别	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	20210101~20210517	78,616,090.15	-	78,616,090.15	-	-
	2	20210101~20210425	39,307,914.05	-	39,307,914.05	-	-
	3	20210101~20210425	39,307,914.05	-	39,307,914.05	-	-

产品特有风险

1、大额赎回风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

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

- 1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 2 《民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3 《民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4 《民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5 法律意见书；

6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日