

民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	55

8.1 期末基金资产组合情况	55
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	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	65
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银鑫喜混合
基金主代码	002455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 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	805,933,931.06 份
基金合同存续期	不定期

注：民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金于 2016 年 12 月 9 日成立，后经《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1286 号）变更注册，并经份额持有人大会表决于 2021 年 6 月 1 日通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，修订后的《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 6 月 2 日起生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过基金管理人研究团队深入、系统、科学的研究，挖掘具有长期投资价值的标的构建投资组合，在严格控制下行风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的持续稳健收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、财政政策、货币政策、市场利率以及各行业等方面的深入、系统、科学的研究，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，在严格控制风险和保持充足流动性的基础上，动态调整资产配置比例，力求最大限度降低投资组合的波动性，力争获取持续稳定的绝对收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证国债指数收益率×70%
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	北京市西城区金融大街 25 号

	2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	
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

注：经基金份额持有人大会表决于 2021 年 6 月 1 日通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjyfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	96,218,684.94	128,497,660.27	68,066,026.23
本期利润	71,058,078.00	150,669,097.92	88,407,749.53
加权平均基金份额本期利润	0.0900	0.2152	0.1268
本期加权平均净值利润率	7.07%	18.10%	11.77%
本期基金份额净值增长率	7.47%	19.78%	12.49%
3.1.2 期	2021 年末	2020 年末	2019 年末

末数据和指标			
期末可供分配利润	131,644,977.45	162,493,638.15	30,640,655.73
期末可供分配基金份额利润	0.1633	0.2277	0.0440
期末基金资产净值	970,774,319.20	929,446,462.92	757,743,735.85
期末基金份额净值	1.2045	1.3023	1.0872
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	62.86%	51.54%	26.51%

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 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

④修订后《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金》合同生效日为 2021 年 6 月 2 日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以 2016 年 12 月 9 日（初始成立日）为起始日进行编制。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.09%	0.35%	1.47%	0.23%	-0.38%	0.12%
过去六个月	3.06%	0.52%	1.01%	0.31%	2.05%	0.21%

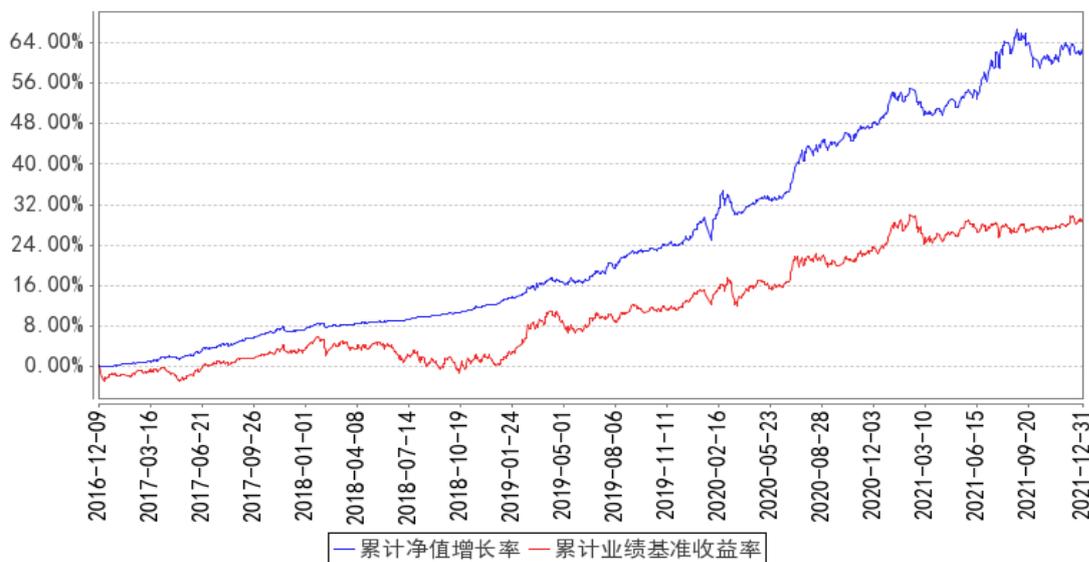
过去一年	7.47%	0.44%	2.85%	0.36%	4.62%	0.08%
过去三年	44.81%	0.36%	28.46%	0.38%	16.35%	-0.02%
过去五年	62.72%	0.29%	31.36%	0.35%	31.36%	-0.06%
自基金合同生效起至今	62.86%	0.28%	29.23%	0.35%	33.63%	-0.07%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*30%+中证国债指数收益率*70%

为保持历史数据的延续性，本部分所涉及自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 9 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

民生加银鑫喜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

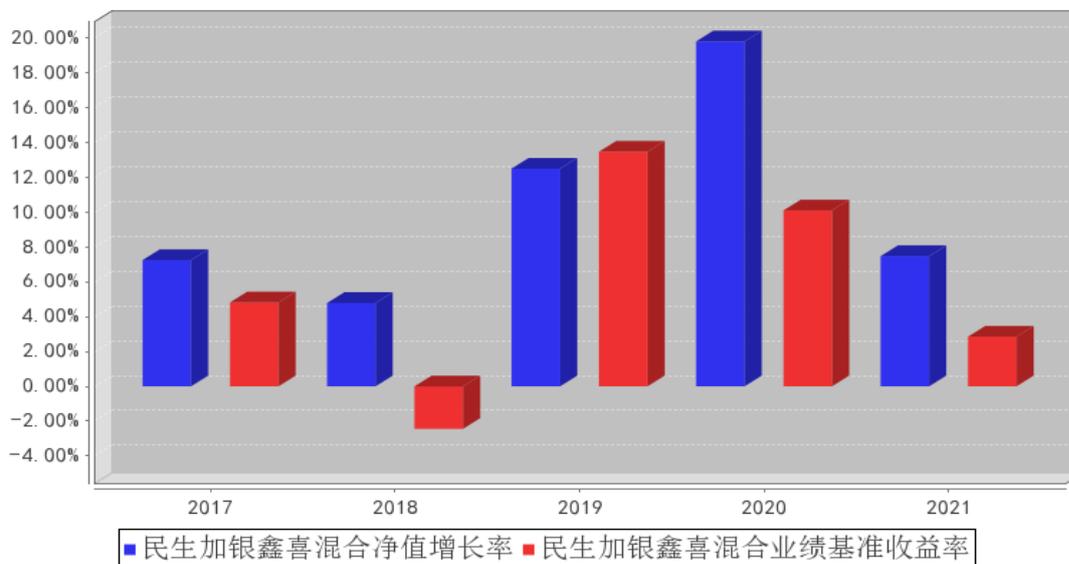


注：①本基金合同于 2016 年 12 月 9 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

②为保持历史数据的延续性，本部分所涉及自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 9 日（初始成立日）为起始日进行编制。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银鑫喜混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2016 年 12 月 9 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	1.8900	147,480,058.77	2,613,827.15	150,093,885.92	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	0.5600	39,028,964.99	17.22	39,028,982.21	-
合计	2.4500	186,509,023.76	2,613,844.37	189,122,868.13	-

§ 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。

基金管理情况：截至 2021 年 12 月 31 日，民生加银基金管理有限公司管理 96 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基金中基金 (FOF)、民生加银瑞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基金中基金 (FOF)、民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银康泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银聚优精选混合型证券投资基金、民生加银核心资产股票型证券投资基金、民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金 (FOF-LOF)、民生加银中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)。

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		
关键	本基金基金经理（兼任投资经理）	2021 年 3 月 16 日	-	12.0 年	中央财经大学硕士，12 年证券从业经历。自 2009 年 7 月至 2014 年 11 月在中国农业银行股份有限公司金融市场部担任高级投资经理；2014 年 11 月至 2015 年 8 月在中国人寿养老保险股份有限公司投资中心担任固定收益投资经理；自 2015 年 8 月至 2016 年 6 月，在景顺长城基金管理有限公司专户投资部担任固定收益投资经理。2016 年 9 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任基金经理兼任投资经理。自 2021 年 2 月至今担任民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 3 月至今担任民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2021 年 4 月至今担任民生加银鹏程混合

					型证券投资基金基金经理；自 2021 年 4 月至今担任民生加银增强收益债券型证券投资基金基金经理；自 2021 年 7 月至今担任民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。
邱世磊	已离任	2016 年 12 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	11 年	中国人民大学管理学本科、硕士，11 年证券从业经历，曾就职于海通证券债券部担任高级经理，在渤海证券资管部担任高级研究员，在东兴证券资管部担任高级投资经理。2015 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，曾担任固定收益部基金经理助理、基金经理，已离任。自 2016 年 1 月至 2016 年 6 月担任民生加银新动力灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理；自 2016 年 6 月至 2017 年 4 月担任民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金（由民生加银新动力灵活配置定期开放混合型证券投资基金转型而来）基金经理；自 2018 年 9 月至 2019 年 11 月担任民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 9 月至 2020 年 7 月担任民生加银汇鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；自 2016 年 1 月至 2020 年 7 月担任民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2016 年 12 月至 2021 年 3 月担任民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2016 年 8 月至 2021 年 3 月担任民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2018 年 3 月至 2021 年 6 月担任民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 8 月至 2021 年 6 月担任民生加银增强收益债券型证券投资基金基金经理；自 2019 年 11 月至 2021 年 6 月担任民生加银信用双利债券型证券投资基金基金经理；自 2020 年 5 月至 2021 年 6 月担任民生加银聚利 6 个月持有期混合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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
关键	公募基金	6	3,670,166,503.52	2021-2-22
	私募资产管理计划	3	4,933,633,206.34	2018-6-25
	其他组合	-	-	-
	合计	9	8,603,799,709.86	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同

同投资合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，本基金管理人进一步强化了公平交易的管控和监督，进一步加强了对投资指令、交易执行、反向交易、交易价差和组合收益率差异的监测和分析。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，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的情形。

4.3.3 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 年全球经济继续受到新冠疫情的持续影响，尽管较 2020 年有不同程度恢复，但疫情反复冲击带来的影响让主要国家普遍陷入类滞胀环境。经济弱增长、低就业与高通胀组合另全球货币政策继续维持宽松水平，下半年尽管受到了通胀持续走高的考验，但主要央行中，也仅有美联储开始了 taper 操作，经济在疫情下的脆弱性和就业低迷，直接决定了主要经济体无力回收流动性或采取加息动作。国内经济全年四个季度呈现前高后低的走势，其中既有基数效应，也有经济本身环比动能减弱的影响。除了疫情零星爆发带来的共性影响以外，国内“双碳”政策下导致的拉闸限电，政策对于房地产企业融资和销售的影响等，都对经济构成了一定压力。全年 PPI 高企，企业盈利大量向上游企业转移，叠加下游终端需求较弱，导致中游制造业普遍面临较大压力。CPI 全年相对平稳，并没有出现工业品价格向消费品的明显传导，背后是社会消费品零售增速持续低迷，内需不足已经不仅体现在投资端，而越来越多体现在了疫情影响下的居民消费端。货币政策全年保持相对宽松基调，下半年呈现出典型的宽货币、紧信用组合，在“房住不炒”的大背景下，信用派生短期内面临主体缺位的问题，地产融资的显著下滑，目前尚未看到有其他融资主体可以予以补充，而全年社融的逐步回落，也说明了在整体债务压力较大的环境下，进一步加杠杆的难度在持续加大。

从资本市场来看，股票市场呈现出显著的结构特征，两个类型表现较为突出，一是以新能源为代表的新兴产业，以及与之产业链密切相关的化工、有色、机械等行业；二是受益于供给侧持续受限，产品价格大幅上行的传统工业品，包括煤炭、钢铁、化工等。而其余行业则普遍缺乏

量价逻辑，尤其是消费相关行业，在连续两年的持续上涨后，较高的估值和相对偏弱的基本面，都导致了全年股价走势相对低迷。

受益于持续宽松的流动性水平和基本面的环比走弱，债券市场全年走出了一轮较为明显的牛市行情，无论利率债或是信用债，都出现了较大幅度的利率下行。房地产相关债券出现了较为剧烈和普遍的风险爆发，主要源于政策叠加下的房企流动性快速收紧，而地产企业目前风险仍未完全释放，在此轮波动后，大多数地产企业也将丧失公开市场的融资能力。

全年来看，本基金在债券方面主要以高等级信用债为主，严格防范信用风险，以获取基本票息作为底层收益为主，同时积极参与了利率债的交易机会，杠杆水平维持在较低水平。对于股票与可转债资产，配置方向主要聚焦于景气度较高的新能源相关行业，在股票和转债的选择上，都以个股基本面为主要出发点，选择基本面优秀，格局稳定，行业地位突出，有明显优势的各领域龙头公司为主。该策略在前期体现出较好的效果，但随着进入四季度，新能源个股的估值普遍进入高位，波动性明显加大，且行业轮动明显加快，热点较为散乱，缺乏明确主线，我们在此过程中经历了比较大的考验，也确实感受到了投资难度的增加。主要体现在几个方面：一是我们持仓的行业及个股并未发生基本面的明显变化，而市场对于估值的认可程度，以及由此带来的估值波动，确实超出我们的能力把握范围。在此情况下，尽管我们对于持仓个股的基本面仍然信心较强，但无法阻止短期股价回调带来的净值大幅波动，而我们也正在反思对于估值的判断和择时的必要性。二是由于我们前期坚持了较为集中的持仓风格，因此在市场调整过程中，也相应出现了较大的回撤，但这种回撤的控制对于固收+账户是很有必要的。我们也在思考对于这种回撤的应对，更多应该以降低集中度，或是绝对仓位的调整去加以应对。尽管思考仍然不成熟，但我们还将继续在投资过程中不断完善现有框架。三是在转债投资过程中，我们本身所秉持的择券理念和原则受到了一定挑战，尤其是对于正股资质的接受度方面。三季度开始，转债市场不断有资金涌入，导致整体估值持续上升，且热点轮动较快，较为散乱，市场短炒情绪较为浓厚。而我们之前的集中持仓，长期持有的思路受到了较大挑战，尤其是部分品种短期回调幅度较大时，对账户净值造成了较大影响。我们在不断思考，如何平衡正股资质、转债弹性以及持仓集中度等多个因素，同时维持账户较好的进攻性。四是我们需要加强对于止盈的重视，尤其对于固收+账户来说，绝对收益目标仍然是非常重要的。在一定时点进行止盈有利于稳定绝对收益，也可以降低账户的波动性，而并非以完全的相对业绩思路去运作。

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 1.2045 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.47%，业绩比较基准收益率为 2.85%。

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 2022 年，国内经济短期仍然面临一定的下行压力，稳增长措施和力度仍有待观察，宽信用有望带来实体投资和消费数据的阶段性好转。内需中投资仍然是短期托底经济的重要力量。随着疫情的进一步好转，就业和居民消费也有望进一步恢复。PPI 环比预计小幅回落，同比显著下降，CPI 全年同比预计维持在 3%以内，不会对货币政策构成实质压力。流动性预计全年维持宽松，政策更多转向稳增长背景下，进一步去杠杆的压力不大，有利于企业融资环境的修复和资本市场流动性。

权益资产方面，股票市场大概率继续维持结构性特征，全年对于中观行业的选择仍将是决定胜负的核心要素。我们将从景气度、相对估值水平和盈利等几个方面进行行业筛选和比较，目前来看稳增长下的地产、金融、建筑建材等相关板块仍然具有估值优势，在政策驱动下可能出现修复性机会；而景气度可以维持且相对较好的行业中，市场关注度普遍较高且估值偏贵，对于基本面的要求将更为严苛。我们相信后期会出现分化，优先从目前市场仍有分歧，且估值在调整后重新具备安全边际的角度出发，自下而上选择可以持有较长期限的品种。以期能从全年角度，获取较好的收益。

可转债方面，鉴于转债整体估值较高，相对于股票性价比不高，因此秉持中性防守策略，以估值作为有限考量标准，包括绝对价位与溢价率水平。关注银行、农业、家具家电等正股估值处于较低水平，同时转债价格相对较低的方向，以防守品种作为核心底仓，同时积极寻找个股较为优秀，有望走出独立行情的细分标的。积极参与一级市场发行认购。

债券方面，尽管短期收益率仍有下行，但宽信用、稳增长的政策组合下，收益率易上难下。全年收益率尽管不具备大幅度上行空间，短期可能出现利好出尽，经济在上半年可能出现小幅回暖，同时也将带来利率债的重新再配置机会。信用债性价比依然较低，且品种单一化趋势明显，可操作空间较小，操作上仅以高等级品种作为安全底仓，降低收益预期，以获取稳定票息收入。更多通过利率债的操作来调整账户久期，更多把握利率波动机会。

感谢持有人对我们的信任，本基金将在严格控制风险的基础上，力争获取固收产品基础上增强的收益，为您的财富增值做出应有的努力与贡献。

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，管理人内部对本基金的监察稽核工作主要针对本基金投资运作的合法、合规性，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部进行监察，通过实时监控、定期检查、专项检查、不定期抽查等方式，及时发现问题，提出整改意见并跟踪改进落实情况，并按照中国证监会的要求将《季度监察稽核报告》和《年度监察稽核报告》提交给公司全体董事审阅。

4.7 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、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金于 2021 年 5 月 26 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.646 元。共计派发红利 50,965,063.52 元，其中以现金形式发放金额为人民币 50,417,399.00 元，以红利再投资形式发放金额人民币 547,664.52 元。权益登记日 2021 年 5 月 27 日。

本基金于 2021 年 7 月 16 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.634 元。共计派发红利 50,035,648.82 元，其中以现金形式发放金额为人民币 49,455,625.79 元，以红利再投资形式发放金额人民币 580,023.03 元。权益登记日 2021 年 7 月 19 日。

本基金于 2021 年 11 月 16 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.61 元。共计派发红利 49,093,173.58 元，其中以现金形式发放金额为人民币 47,607,033.98 元，以红利再投资形式发放金额人民币 1,486,139.60 元。权益登记日 2021 年 11 月 17 日。

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合规守信、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，本基金实施利润分配的金额为 150,093,885.92 元。

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 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	安永华明（2022）审字第 60950520_H23 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	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

	<p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价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。</p> <p>（4）对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，就可能对民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日</p>

	可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	江钰辉
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,121,290.45	31,785,797.76
结算备付金		1,271,559.13	89,267.81
存出保证金		83,955.51	340,107.86
交易性金融资产	7.4.7.2	1,015,745,307.88	766,738,223.65
其中：股票投资		172,919,326.64	206,439,117.29
基金投资		-	-
债券投资		842,825,981.24	518,560,906.36
资产支持证券投资		-	41,738,200.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	140,000,260.00
应收证券清算款		11,868,978.63	-
应收利息	7.4.7.5	18,386,727.00	14,113,326.81
应收股利		-	-
应收申购款		999.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,051,478,818.10	953,066,983.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		77,799,879.00	-
应付证券清算款		1,797,273.84	22,698,699.93
应付赎回款		119.41	-
应付管理人报酬		494,262.86	461,800.30
应付托管费		123,565.72	115,450.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	227,653.95	113,045.25
应交税费		74,103.16	62,525.44
应付利息		8,640.66	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,000.30	169,000.00
负债合计		80,704,498.90	23,620,520.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	805,933,931.06	713,679,518.28
未分配利润	7.4.7.10	164,840,388.14	215,766,944.64
所有者权益合计		970,774,319.20	929,446,462.92
负债和所有者权益总计		1,051,478,818.10	953,066,983.89

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2045 元，基金份额总额 805,933,931.06 份。

7.2 利润表

会计主体：民生加银鑫喜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 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		81,842,195.60	160,205,115.68
1. 利息收入		31,959,429.02	32,514,444.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	140,683.18	265,460.98
债券利息收入		29,335,471.93	29,022,850.92
资产支持证券利息收入		1,088,132.04	2,523,916.15
买入返售金融资产收入		1,395,141.87	702,216.80
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		74,961,664.81	105,519,233.16

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	53,514,922.93	101,010,803.13
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	20,699,045.52	2,629,092.19
资产支持证券投资收 益	7.4.7.13.5	64,802.63	6,541.60
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	682,893.73	1,872,796.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-25,160,606.94	22,171,437.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	81,708.71	0.02
减：二、费用		10,784,117.60	9,536,017.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,031,581.76	4,985,178.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,507,895.45	1,246,294.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,990,780.68	1,523,851.64
5. 利息支出		885,614.20	1,467,618.47
其中：卖出回购金融资产支 出		885,614.20	1,467,618.47
6. 税金及附加		97,325.51	100,674.71
7. 其他费用	7.4.7.20	270,920.00	212,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71,058,078.00	150,669,097.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71,058,078.00	150,669,097.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银鑫喜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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	713,679,518.28	215,766,944.64	929,446,462.92
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期	-	71,058,078.00	71,058,078.00

利润)			
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)	92,254,412.78	28,109,251.42	120,363,664.20
其中:1.基金申购款	126,007,772.71	36,643,072.01	162,650,844.72
2.基金赎回款	-33,753,359.93	-8,533,820.59	-42,287,180.52
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)	-	-150,093,885.92	-150,093,885.92
五、期末所有者权益(基金净值)	805,933,931.06	164,840,388.14	970,774,319.20
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	696,946,130.49	60,797,605.36	757,743,735.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	150,669,097.92	150,669,097.92
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)	16,733,387.79	4,300,241.36	21,033,629.15
其中:1.基金申购款	16,735,536.06	4,300,614.96	21,036,151.02
2.基金赎回款	-2,148.27	-373.60	-2,521.87
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)	713,679,518.28	215,766,944.64	929,446,462.92

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：

<u>张焕南</u>	<u>朱永明</u>	<u>洪锐珠</u>
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

民生加银鑫喜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]221号《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]2312号文《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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发行人募集,基金合同于2016年12月9日正式生效,首次设立募集规模为200,048,869.29份基金份额,其中认购资金利息折合15,003.39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》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京01破270号之一及中国证监会指定,建设银行自包商银行股份有限公司(以下简称“包商银行”)被依法宣告破产之日起担任本基金的临时基金托管人。

后经召开基金份额持有人大会于2021年6月1日表决通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》,民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司。自2021年6月2日起,原《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,更换基金托管人后的《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

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(含创业板及其他经中国证监会允许投资的股票等),存托凭证,债券(含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,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)。

基金的投资组合比例为:本基金的股票资产投资比例为0%-95%。本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券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。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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证国债指数收益率×70%

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、货币市场工具和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时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和其他金融负债。本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量；在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继

续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、货币市场工具和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列

示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售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；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣

除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率逐日计提；

(3) 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；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计需要披露。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 12 月 31 日	
	上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	
活期存款	4,121,290.45	31,785,797.76
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	4,121,290.45	31,785,797.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	158,752,627.61	172,919,326.64	14,166,699.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	260,145,412.85	267,228,481.24	7,083,068.39
	银行间市场	570,210,630.66	575,597,500.00	5,386,869.34

	合计	830,356,043.51	842,825,981.24	12,469,937.73
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		989,108,671.12	1,015,745,307.88	26,636,636.76
项目	上年度末 2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		156,732,845.73	206,439,117.29	49,706,271.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	227,654,484.46	229,856,906.36	2,202,421.90
	银行间市场	289,092,931.34	288,704,000.00	-388,931.34
	合计	516,747,415.80	518,560,906.36	1,813,490.56
资产支持证券		41,460,718.42	41,738,200.00	277,481.58
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		714,940,979.95	766,738,223.65	51,797,243.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	120,000,260.00	-
合计	140,000,260.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,618.47	16,483.18
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	629.42	44.11
应收债券利息	18,384,437.53	12,762,681.42
应收资产支持证券利息	-	1,327,768.11
应收买入返售证券利息	-	6,181.58
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	41.58	168.41
合计	18,386,727.00	14,113,326.81

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	225,477.50	109,215.46
银行间市场应付交易费用	2,176.45	3,829.79
合计	227,653.95	113,045.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.30	-
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	50,000.00	40,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提银行间账户维护费	9,000.00	9,000.00
合计	179,000.30	169,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	713,679,518.28	713,679,518.28
本期申购	126,007,772.71	126,007,772.71

本期赎回（以“-”号填列）	-33,753,359.93	-33,753,359.93
- 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	805,933,931.06	805,933,931.06

注：本期申购含转换入、红利再投份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	162,493,638.15	53,273,306.49	215,766,944.64
本期利润	96,218,684.94	-25,160,606.94	71,058,078.00
本期基金份额交易产生的变动数	23,026,540.28	5,082,711.14	28,109,251.42
其中：基金申购款	30,040,971.06	6,602,100.95	36,643,072.01
基金赎回款	-7,014,430.78	-1,519,389.81	-8,533,820.59
本期已分配利润	-150,093,885.92	-	-150,093,885.92
本期末	131,644,977.45	33,195,410.69	164,840,388.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	88,550.85	198,919.76
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	49,603.60	60,255.89
其他	2,528.73	6,285.33
合计	140,683.18	265,460.98

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	53,514,922.93	101,010,803.13
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	53,514,922.93	101,010,803.13

7.4.7.12.2 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12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	747,235,564.32	589,887,516.45
减：卖出股票成本总 额	693,720,641.39	488,876,713.32
买卖股票差价收入	53,514,922.93	101,010,803.13

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	20,699,045.52	2,629,092.19
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	20,699,045.52	2,629,092.19

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债	969,386,419.25	518,458,698.80

券到期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	928,821,726.16	502,810,389.81
减: 应收利息总额	19,865,647.57	13,019,216.80
买卖债券差价收入	20,699,045.52	2,629,092.19

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注: 无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	43,974,065.35	21,695,466.77
减: 卖出资产支持证券成本总额	41,460,718.42	20,931,458.39
减: 应收利息总额	2,448,544.30	757,466.78
资产支持证券投资收益	64,802.63	6,541.60

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注: 无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注: 本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注: 无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注: 无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	682,893.73	1,872,796.24
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	682,893.73	1,872,796.24

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-25,160,606.94	22,171,437.65
股票投资	-35,539,572.53	33,029,436.70
债券投资	10,656,447.17	-10,937,157.44
资产支持证券投资	-277,481.58	79,158.39
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	-25,160,606.94	22,171,437.65

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月	2020年1月1日至2020年

	31 日	12 月 31 日
基金赎回费收入	81,332.82	0.02
基金转换费收入	375.89	-
合计	81,708.71	0.02

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,979,555.68	1,519,351.64
银行间市场交易费用	11,225.00	4,500.00
合计	1,990,780.68	1,523,851.64

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券账户维护费	36,000.00	45,000.00
公证费	10,000.00	-
律师费	50,000.00	-
其他费用	4,920.00	7,400.00
合计	270,920.00	212,400.00

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末，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。

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
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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	①临时基金托管人、基金销售机构（2021 年 2 月 7 日—2021 年 6 月 1 日）

	②基金托管人、基金销售机构(自 2021 年 6 月 2 日起)
包商银行股份有限公司 (“包商银行”)	基金托管人、基金销售机构(2021 年 2 月 7 日前)
中国民生银行股份有限公司 (“中国民生银行”)	基金管理人的股东
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：1) 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2) 2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。后经召开基金份额持有人大会于 2021 年 6 月 1 日通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

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

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。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,031,581.76	4,985,178.41
其中：支付销售机构的客户维护费	20,682.50	-

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2021 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 494,262.86 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 461,800.30 元）。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,507,895.45	1,246,294.53

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2021 年 12 月 31 日的应付基金托管费为人民币 123,565.72 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 115,450.05 元）。

3) 本期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日）应支付的托管费中，2021 年 1 月 1 日至 2021 年 2 月 7 日支付托管人包商银行的托管费为 150,324.41 元，2021 年 2 月 8 日至 2021 年 12 月 31 日支付托管人建设银行的托管费为 1,357,571.04 元。上年度可比期间（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日）应支付的托管费均为应支付给包商银行的金额。

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

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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均无运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均无投资本基金的情况。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
包商银行	-	40,061.58	31,785,797.76	198,919.76
中国建设银行	4,121,290.45	48,489.27	-	-

注：本基金的活期银行存款 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 2 月 19 日由基金托管人包商银行保管，按约定利率计息；本基金的活期银行存款 2021 年 2 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日由基金托管人建设银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年5月27日	-	2021年5月27日	0.6460	50,417,399.00	547,664.52	50,965,063.52	-
2	2021年7	-	2021年7	0.6340	49,455,625.79	580,023.03	50,035,648.82	-

	月 19 日		月 19 日					
3	2021 年 11 月 17 日	-	2021 年 11 月 17 日	0.6100	47,607,033.98	1,486,139.60	49,093,173.58	-
合计	-	-	-	1.8900	147,480,058.77	2,613,827.15	150,093,885.92	-

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 01 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净	2021 年	2022 年	新股流	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

	科技	7月15日	1月24日	通受限						
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年02月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年02月17日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年02月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

301055	张小泉	2021年 8月26 日	2022年 3月7 日	新股流 通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股流 通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年 9月1 日	2022年 3月9 日	新股流 通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年 9月3 日	2022年 3月14 日	新股流 通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 3月14 日	新股流 通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 3月14 日	新股流 通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股流 通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股流 通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股流 通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股流 通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 4月19 日	新股流 通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股流 通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 4月21 日	新股流 通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-

		日	日								
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股流 通受限	93.09	75.34	639	59,484.51	48,142.26		-
301088	戎美股份	2021年 10月19 日	2022年 4月28 日	新股流 通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68		-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股流 通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60		-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股流 通受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08		-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股流 通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96		-
301093	华兰股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股流 通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65		-
301096	百诚医药	2021年 12月13 日	2022年 6月20 日	新股流 通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16		-
301100	风光股份	2021年 12月10 日	2022年 6月17 日	新股流 通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86		-
301101	明月镜片	2021年 12月9 日	2022年 6月16 日	新股流 通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56		-
301108	洁雅股份	2021年 11月25 日	2022年 6月6 日	新股流 通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80		-
301111	粤万年青	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股流 通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72		-
301126	达嘉维康	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股流 通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26		-
301127	天源环保	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股流 通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20		-
301133	金钟股份	2021年 11月19 日	2022年 5月26 日	新股流 通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70		-
301136	招标	2021年	2022年	新股流	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-

	股份	12月31日	1月11日	通受限						
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	872	52,895.52	84,366.00	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	469	54,816.72	54,441.52	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-

301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688385	复旦微电子	2021年7月27日	2022年2月7日	新股流通受限	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688728	格科微	2021年8月11日	2022年2月18日	新股流通受限	14.38	29.31	23,033	331,214.54	675,097.23	-
688799	华纳药厂	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-

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。

7.4.12.2 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。

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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,999,879.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190202	19 国开 02	2022 年 1 月 4 日	100.04	20,000	2,000,800.00
合计				20,000	2,000,800.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 75,800,000.00 元,分别于 2022 年 01 月 06 日,2022 年 01 月 07 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:于 2021 年 12 月 31 日,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况,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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	80,769,000.00	19,862,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	114,389,392.40	19,944,000.00
合计	195,158,392.40	39,806,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资债券及超短期融资债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	29,200,200.00
合计	-	29,200,200.00

注：未评级资产支持证券的评级为 AAA。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,856,000.00	-
合计	9,856,000.00	-

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	419,106,230.53	351,727,186.70
AAA 以下	183,323,858.31	91,802,806.66
未评级	35,381,500.00	35,224,913.00
合计	637,811,588.84	478,754,906.36

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	12,538,000.00

AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	12,538,000.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末均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。

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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

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、存出保证金及债券投资等。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	4,121,290.45	-	-	-	-	-	4,121,290.45
结算备付金	1,271,559.13	-	-	-	-	-	1,271,559.13
存出保证金	83,955.51	-	-	-	-	-	83,955.51
交易性金融资产	63,614,178.80	50,452,000.00	166,633,713.60	522,685,776.53	39,440,312.31	172,919,326.64	1,015,745,307.88
应收利息	-	-	-	-	-	18,386,727.00	18,386,727.00
应收申购款	-	-	-	-	-	999.50	999.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,868,978.63	11,868,978.63
资产总计	69,090,983.89	50,452,000.00	166,633,713.60	522,685,776.53	39,440,312.31	203,176,031.77	1,051,478,818.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	119.41	119.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	494,262.86	494,262.86
应付托管费	-	-	-	-	-	123,565.72	123,565.72
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,797,273.84	1,797,273.84
卖出回购金融资产款	77,799,879.00	-	-	-	-	-	77,799,879.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	227,653.95	227,653.95
应付利息	-	-	-	-	-	8,640.66	8,640.66
应交税费	-	-	-	-	-	74,103.16	74,103.16
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.30	179,000.30

						0	
负债总计	77,799,879.00	-	-	-	-	2,904,619.90	80,704,498.90
利率敏感度缺口	-8,708,895.11	50,452,000.00	166,633,713.60	522,685,776.53	39,440,312.31	200,271,411.87	970,774,319.20
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	31,785,797.76	-	-	-	-	-	31,785,797.76
结算备付金	89,267.81	-	-	-	-	-	89,267.81
存出保证金	340,107.86	-	-	-	-	-	340,107.86
交易性金融资产	67,852,159.30	69,817,064.80	201,886,290.10	210,628,950.66	10,114,641.50	206,439,117.29	766,738,223.65
买入返售金融资产	140,000,260.00	-	-	-	-	-	140,000,260.00
应收利息	-	-	-	-	-	14,113,326.81	14,113,326.81
资产总计	240,067,592.73	69,817,064.80	201,886,290.10	210,628,950.66	10,114,641.50	220,552,444.10	953,066,983.89
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	461,800.30	461,800.30
应付托管费	-	-	-	-	-	115,450.05	115,450.05
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,698,699.93	22,698,699.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	113,045.25	113,045.25
应交税费	-	-	-	-	-	62,525.44	62,525.44
其他负债	-	-	-	-	-	169,000.00	169,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	23,620,520.97	23,620,520.97
利率敏感度缺口	240,067,592.73	69,817,064.80	201,886,290.10	210,628,950.66	10,114,641.50	196,931,923.13	929,446,462.92

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	2,946,989.63	1,528,421.53
	2. 市场利率上升 25 个基点	-2,933,749.34	-1,521,149.17

7.4.13.4.2 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。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		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	172,919,326.64	17.81	206,439,117.29	22.21
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	172,919,326.64	17.81	206,439,117.29	22.21

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	11,244,546.02	10,950,531.38
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-11,244,546.02	-10,950,531.38

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

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 12 月 31 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 233,529,827.19 元，划分为第二层次的余额为人民币 782,215,480.69 元，无划分为第三层次的余额。于 2020 年 12 月 31 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 221,693,365.42 元，划分为第二层次的余额为人民币 545,044,858.23 元，无划分为第三层次的余额。

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，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号—套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（以上统称新金融

工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除以上事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

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	172,919,326.64	16.45
	其中：股票	172,919,326.64	16.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	842,825,981.24	80.16
	其中：债券	842,825,981.24	80.16
	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	5,392,849.58	0.51
8	其他各项资产	30,340,660.64	2.89
9	合计	1,051,478,818.10	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	7,725,010.00	0.80
B	采矿业	10,463.66	0.00
C	制造业	139,542,337.81	14.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,485,758.00	0.36
E	建筑业	28,041.83	0.00
F	批发和零售业	1,233,681.71	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	3,518,057.00	0.36
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,404,001.85	0.14
J	金融业	69,749.68	0.01
K	房地产业	3,935,634.00	0.41

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,555,443.04	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	371,727.77	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,916,424.78	0.20
R	文化、体育和娱乐业	4,118,387.51	0.42
S	综合	-	-
	合计	172,919,326.64	17.81

8.2.2 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。

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	002311	海大集团	141,600	10,379,280.00	1.07
2	688518	联赢激光	168,620	8,307,907.40	0.86
3	688516	奥特维	29,299	7,199,350.28	0.74
4	002648	卫星化学	174,240	6,974,827.20	0.72
5	603806	福斯特	51,251	6,690,818.05	0.69
6	300856	科思股份	97,100	6,133,807.00	0.63
7	600438	通威股份	126,778	5,699,938.88	0.59
8	600702	舍得酒业	23,500	5,341,550.00	0.55
9	002157	正邦科技	500,300	4,832,898.00	0.50
10	002850	科达利	30,100	4,826,234.00	0.50
11	600519	贵州茅台	2,200	4,510,000.00	0.46
12	300012	华测检测	159,100	4,275,017.00	0.44
13	688680	海优新材	13,751	4,198,180.30	0.43
14	300144	宋城演艺	284,356	4,071,977.92	0.42
15	300776	帝尔激光	15,800	4,043,220.00	0.42
16	600048	保利发展	251,800	3,935,634.00	0.41
17	600872	中炬高新	103,600	3,933,692.00	0.41
18	300595	欧普康视	67,200	3,855,264.00	0.40
19	300274	阳光电源	26,100	3,805,380.00	0.39
20	300286	安科瑞	111,500	3,699,570.00	0.38
21	603288	海天味业	34,180	3,592,659.80	0.37
22	601865	福莱特	60,900	3,528,546.00	0.36
23	002930	宏川智慧	135,100	3,492,335.00	0.36
24	600021	上海电力	271,900	3,485,758.00	0.36
25	688357	建龙微纳	17,066	3,275,648.04	0.34
26	688006	杭可科技	29,852	3,211,478.16	0.33

27	688499	利元亨	10,094	2,957,542.00	0.30
28	002714	牧原股份	54,200	2,892,112.00	0.30
29	300450	先导智能	38,700	2,878,119.00	0.30
30	688779	长远锂科	113,406	2,658,236.64	0.27
31	002539	云图控股	194,200	2,577,034.00	0.27
32	688355	明志科技	71,091	2,377,283.04	0.24
33	000516	ST 国医	172,100	1,898,263.00	0.20
34	000568	泸州老窖	6,800	1,726,316.00	0.18
35	688235	百济神州	10,569	1,527,326.19	0.16
36	688187	时代电气	16,989	1,393,098.00	0.14
37	688005	容百科技	9,764	1,128,523.12	0.12
38	301155	海力风电	8,719	1,051,116.40	0.11
39	300340	科恒股份	45,700	887,037.00	0.09
40	688798	艾为电子	3,592	775,872.00	0.08
41	688728	格科微	23,033	675,097.23	0.07
42	688032	禾迈股份	844	594,167.56	0.06
43	301177	迪阿股份	4,686	591,181.28	0.06
44	688110	东芯股份	11,329	511,844.22	0.05
45	301087	可孚医疗	6,389	501,874.76	0.05
46	688131	皓元医药	1,955	486,169.40	0.05
47	688112	鼎阳科技	4,901	480,199.98	0.05
48	688182	灿勤科技	18,387	443,678.31	0.05
49	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.05
50	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.04
51	688151	华强科技	10,917	396,068.76	0.04
52	688230	芯导科技	2,594	370,682.60	0.04
53	301090	华润材料	27,635	360,304.12	0.04
54	301211	亨迪药业	9,664	359,633.72	0.04
55	688739	成大生物	4,694	357,354.22	0.04
56	301127	天源环保	16,843	334,584.06	0.03
57	688606	奥泰生物	2,703	332,496.03	0.03
58	688192	迪哲医药	8,926	330,351.26	0.03
59	688553	汇宇制药	8,928	300,248.64	0.03
60	688221	前沿生物	16,148	300,191.32	0.03
61	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
62	688211	中科微至	3,751	281,325.00	0.03
63	688248	南网科技	11,763	271,725.30	0.03
64	301221	光庭信息	2,791	264,566.77	0.03
65	301189	奥尼电子	4,345	259,307.90	0.03
66	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.03
67	301149	隆华新材	12,138	251,935.44	0.03
68	688269	凯立新材	1,941	242,625.00	0.02

69	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.02
70	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.02
71	301100	风光股份	5,985	218,204.16	0.02
72	301093	华兰股份	4,088	212,432.45	0.02
73	688049	炬芯科技	3,260	198,892.60	0.02
74	301101	明月镜片	3,703	197,280.72	0.02
75	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.02
76	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.02
77	301180	万祥科技	6,536	188,319.06	0.02
78	301088	戎美股份	7,036	181,366.48	0.02
79	301111	粤万年青	3,783	178,144.72	0.02
80	688510	航亚科技	5,991	174,158.37	0.02
81	301089	拓新药业	2,198	173,975.80	0.02
82	301190	善水科技	5,741	171,802.70	0.02
83	605117	德业股份	627	171,666.33	0.02
84	301108	洁雅股份	2,800	166,667.20	0.02
85	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.02
86	301138	华研精机	2,849	163,804.70	0.02
87	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.02
88	688305	科德数控	1,496	160,072.00	0.02
89	301188	力诺特玻	6,470	156,496.36	0.02
90	688682	霍莱沃	946	154,179.08	0.02
91	688793	倍轻松	1,454	151,943.00	0.02
92	301185	鸥玛软件	5,776	151,069.06	0.02
93	301126	达嘉维康	6,615	147,803.83	0.02
94	688121	卓然股份	3,681	141,534.45	0.01
95	301199	迈赫股份	4,014	139,825.80	0.01
96	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.01
97	688636	智明达	918	129,667.50	0.01
98	301092	争光股份	3,230	124,293.63	0.01
99	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.01
100	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.01
101	301182	凯旺科技	2,932	103,061.60	0.01
102	301133	金钟股份	2,860	102,096.28	0.01
103	688768	容知日新	907	101,130.50	0.01
104	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.01
105	688633	星球石墨	1,558	98,340.96	0.01
106	301198	喜悦智行	2,613	95,084.09	0.01
107	301193	家联科技	2,970	93,789.63	0.01
108	300919	中伟股份	610	92,421.10	0.01
109	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.01
110	300979	华利集团	925	82,371.25	0.01

111	301081	严牌股份	4,024	80,824.30	0.01
112	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
113	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
114	688622	禾信仪器	1,204	72,179.80	0.01
115	301083	百胜智能	4,160	70,270.72	0.01
116	688468	科美诊断	3,919	70,228.48	0.01
117	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
118	688255	凯尔达	1,648	66,183.68	0.01
119	603290	斯达半导	156	59,436.00	0.01
120	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
121	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
122	600893	航发动力	600	38,076.00	0.00
123	300910	瑞丰新材	474	37,848.90	0.00
124	600935	华塑股份	4,811	36,756.04	0.00
125	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
126	605089	味知香	370	35,094.50	0.00
127	300869	康泰医学	862	34,954.10	0.00
128	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
129	605080	浙江自然	374	27,975.20	0.00
130	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
131	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
132	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
133	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
134	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
135	688122	西部超导	213	20,648.22	0.00
136	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
137	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
138	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
139	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
140	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
141	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
142	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00
143	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
144	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
145	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
146	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
147	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
148	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
149	605566	福莱蒾特	435	13,350.15	0.00
150	603511	爱慕股份	553	13,117.16	0.00
151	300996	普联软件	385	12,162.15	0.00
152	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00

153	300943	春晖智控	255	11,801.40	0.00
154	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.00
155	688617	惠泰医疗	41	11,480.00	0.00
156	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
157	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
158	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
159	300978	东箭科技	593	10,709.58	0.00
160	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
161	605086	龙高股份	443	10,463.66	0.00
162	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
163	300922	天秦装备	287	10,446.80	0.00
164	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
165	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
166	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
167	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
168	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
169	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
170	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
171	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
172	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
173	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
174	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
175	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
176	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
177	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
178	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
179	688777	中控技术	98	7,436.24	0.00
180	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
181	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
182	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
183	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
184	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
185	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
186	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
187	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
188	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
189	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
190	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
191	601012	隆基股份	65	5,603.00	0.00
192	688276	百克生物	81	5,556.60	0.00
193	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
194	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00

195	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
196	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
197	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
198	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
199	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
200	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
201	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
202	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
203	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
204	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
205	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
206	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000725	京东方 A	32,966,856.00	3.55
2	600438	通威股份	28,551,508.80	3.07
3	300059	东方财富	22,978,489.81	2.47
4	002311	海大集团	19,856,950.00	2.14
5	002930	宏川智慧	18,925,688.62	2.04
6	300144	宋城演艺	18,880,689.40	2.03
7	000568	泸州老窖	16,205,843.00	1.74
8	000858	五粮液	15,854,221.00	1.71
9	600872	中炬高新	15,223,995.10	1.64
10	601012	隆基股份	13,388,286.87	1.44
11	600519	贵州茅台	13,362,455.00	1.44
12	601865	福莱特	13,227,476.00	1.42
13	000661	长春高新	12,794,360.00	1.38
14	002648	卫星化学	11,843,149.80	1.27
15	300776	帝尔激光	11,309,350.54	1.22
16	300896	爱美客	11,175,988.60	1.20
17	603338	浙江鼎力	11,006,860.00	1.18
18	300724	捷佳伟创	10,778,531.00	1.16
19	000009	中国宝安	10,525,070.80	1.13
20	300772	运达股份	10,384,595.10	1.12

注：“本期累计买入金额”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	000725	京东方 A	35,403,324.00	3.81
2	300059	东方财富	31,217,738.60	3.36
3	600438	通威股份	23,854,511.00	2.57
4	000858	五粮液	20,909,252.44	2.25
5	600519	贵州茅台	19,956,746.00	2.15
6	601012	隆基股份	18,225,422.62	1.96
7	000568	泸州老窖	17,421,009.00	1.87
8	000661	长春高新	16,651,372.00	1.79
9	002930	宏川智慧	15,826,288.42	1.70
10	600031	三一重工	14,792,474.48	1.59
11	300772	运达股份	14,017,615.00	1.51
12	688390	固德威	13,973,569.68	1.50
13	600036	招商银行	13,971,787.00	1.50
14	688680	海优新材	12,356,380.61	1.33
15	300896	爱美客	12,224,814.00	1.32
16	601100	恒立液压	12,080,593.20	1.30
17	300144	宋城演艺	11,810,667.00	1.27
18	300014	亿纬锂能	11,552,994.00	1.24
19	600872	中炬高新	11,444,522.00	1.23
20	601865	福莱特	11,208,210.00	1.21

注：“本期累计卖出金额”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	695,740,423.27
卖出股票收入（成交）总额	747,235,564.32

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	44,117,392.40	4.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,105,000.00	2.07
	其中：政策性金融债	10,004,000.00	1.03
4	企业债券	156,336,600.00	16.10
5	企业短期融资券	151,041,000.00	15.56
6	中期票据	394,595,500.00	40.65
7	可转债（可交换债）	66,774,488.84	6.88
8	同业存单	9,856,000.00	1.02
9	其他	-	-

10	合计	842,825,981.24	86.82
----	----	----------------	-------

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	101800206	18 陕交建 MTN001	400,000	41,708,000.00	4.30
2	175985	21 国投电	400,000	40,816,000.00	4.20
3	175986	21 财金 02	400,000	40,520,000.00	4.17
4	101800321	18 陕煤化 MTN002	300,000	31,170,000.00	3.21
5	102102161	21 榆林城投 MTN003	300,000	30,531,000.00	3.15

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票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。

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	83,955.51
2	应收证券清算款	11,868,978.63
3	应收股利	-
4	应收利息	18,386,727.00
5	应收申购款	999.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,340,660.64

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	123027	蓝晓转债	12,006,546.00	1.24
2	127018	本钢转债	11,800,338.03	1.22
3	123111	东财转3	8,642,770.20	0.89
4	127038	国微转债	8,047,114.11	0.83
5	113047	旗滨转债	5,738,356.80	0.59
6	118000	嘉元转债	4,187,379.60	0.43
7	132014	18中化EB	3,527,292.50	0.36

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 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

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 (%)
273	2,952,138.94	804,875,440.93	99.87	1,058,490.13	0.13

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	21,023.67	0.0026

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)
关键	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	0
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 12 月 9 日) 基金份额总额	200,048,869.29
本报告期期初基金份额总额	713,679,518.28
本报告期基金总申购份额	126,007,772.71
减：本报告期基金总赎回份额	33,753,359.93
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	805,933,931.06

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2021 年 6 月 1 日审议通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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、基金托管人基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期支付给安永华明会计师事务所的报酬为 50,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 5 年的审计服务。

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

本报告期内，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。

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	
天风证券	2	350,431,577.26	24.84%	183,261.70	17.95%	-
中信建投	4	220,751,554.31	15.65%	169,676.33	16.62%	-
安信证券	2	121,769,665.64	8.63%	113,404.21	11.11%	-
光大证券	1	115,413,237.27	8.18%	107,484.52	10.53%	-

广发证券	1	93,271,312.77	6.61%	67,203.83	6.58%	-
川财证券	2	91,224,882.87	6.47%	66,713.40	6.54%	-
东北证券	4	70,816,784.51	5.02%	48,662.56	4.77%	-
国金证券	2	62,351,750.57	4.42%	44,350.49	4.35%	-
方正证券	1	60,188,482.87	4.27%	42,812.31	4.19%	-
开源证券	2	58,264,636.90	4.13%	42,608.91	4.17%	-
华西证券	1	41,767,204.59	2.96%	30,543.66	2.99%	-
华泰证券	3	39,029,202.05	2.77%	27,761.67	2.72%	-
中泰证券	2	16,989,197.16	1.20%	15,822.01	1.55%	-
浙商证券	2	16,150,916.22	1.14%	11,488.14	1.13%	-
中金公司	2	15,924,923.02	1.13%	14,831.13	1.45%	-
中信证券	3	13,875,041.42	0.98%	12,921.37	1.27%	-
海通证券	1	13,042,304.56	0.92%	12,146.56	1.19%	-
招商证券	1	9,645,178.00	0.68%	8,982.45	0.88%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
天风证券	87,052,750.99	17.01%	999,000,000.00	18.02%	-	-
中信建投	84,539,533.70	16.52%	1,331,000,000.00	24.01%	-	-
安信证券	20,994,895.35	4.10%	-	-	-	-
光大证券	155,153,699.07	30.32%	60,000,000.00	1.08%	-	-
广发证券	12,435,486.08	2.43%	17,000,000.00	0.31%	-	-
川财证券	19,745,949.65	3.86%	750,000,000.00	13.53%	-	-
东北证券	-	-	255,600,000.00	4.61%	-	-
国金证券	2,334,122.63	0.46%	1,089,000,000.00	19.65%	-	-
方正证券	51,704,771.84	10.10%	-	-	-	-
开源证券	21,202,234.60	4.14%	540,000,000.00	9.74%	-	-
华西证券	18,679,156.10	3.65%	152,000,000.00	2.74%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	209,532.00	0.04%	4,000,000.00	0.07%	-	-
中信证券	20,368,388.30	3.98%	85,000,000.00	1.53%	-	-
海通证券	15,526,321.50	3.03%	260,000,000.00	4.69%	-	-
招商证券	1,992.64	0.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,800,000.00	0.35%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
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 本基金本报告期内列示的交易量包括转托管前在包商银行的，以及转托管后在建设银行的。其中包商银行的交易单元广发证券、兴业证券、国金证券，沪深交易单元各一个，已退租。

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	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	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 21 日

2	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 1 月 21 日
3	关于民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金由中国建设银行股份有限公司担任临时基金托管人的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 7 日
4	关于民生加银新动力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、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 19 日
5	民生加银鑫喜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）	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 19 日
6	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 19 日
7	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 19 日
8	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2021 年 2 月 19 日
9	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 18 日
10	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 23 日
11	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 23 日
12	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	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 3 月 30 日
14	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	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 21 日
15	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 21 日
16	关于以通讯开会方式召开民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 26 日
17	关于以通讯开会方式召开民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 27 日

18	关于以通讯开会方式召开民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 4 月 28 日
19	关于变更民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议常设联系人的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 10 日
20	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 次分红公告	中国证监会规定媒介	2021 年 5 月 26 日
21	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
22	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
23	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
24	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
25	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 2 日
26	民生加银基金管理有限公司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	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 30 日
27	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 30 日
28	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2021 年 6 月 30 日
29	民生加银鑫喜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）	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 2 日
30	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 2 日
31	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 次分红公告	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 16 日
32	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 21 日
33	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 21 日
34	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 23 日
35	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021 年 7 月 23 日
36	民生加银基金管理有限公司旗下部分	中国证监会规定媒介	2021 年 8 月 30 日

	基金 2021 年中期报告提示性公告		
37	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会规定媒介	2021 年 8 月 30 日
38	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2021 年 10 月 27 日
39	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2021 年 10 月 27 日
40	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 次分红公告	中国证监会规定媒介	2021 年 11 月 16 日

§ 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	20210101~20211231	597,379,999.12	-	-	597,379,999.12	74.12

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) 基金在短期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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】221号）准予注册。基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为包商银行股份有限公司，基金合同生效日为2016年12月9日。

2021年2月7日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。

2021年4月30日至2021年5月28日民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2021年6月2日起，原《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，更换基金托管人后的《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1 中国证监会准予基金募集注册的文件；
- 2 《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3 《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4 《民生加银鑫喜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。
- 7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及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

2022年3月30日