

民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基  
金中基金（FOF）  
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	13
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 本报告期投资基金情况 .....	51
7.13 投资组合报告附注 .....	错误!未定义书签。
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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.....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.9 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	民生加银卓越配置 6 个月混合型 FOF
基金主代码	008886
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 20 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	2,102,501,767.71 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在经济运行中，经济增长速度、经济周期循环、货币政策、财政政策等宏观经济因素会给不同资产、行业带来不同投资机会。本基金在严格控制风险的前提下，通过有效的动态资产配置策略，发掘不同时期不同资产类别、行业的投资机会和超额收益，追求基金资产的长期稳健增值。
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收益。 具体包括大类资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×65%+一年期定期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	刘静	李申
	联系电话	010-68960037	021-60637102
	电子邮箱	liujing@msjyfund.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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjfund.com.cn">http://www.msjfund.com.cn</a>
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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,176,313.32
本期利润	-108,392,803.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0476
本期加权平均净值利润率	-4.48%
本期基金份额净值增长率	-3.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	183,374,794.55
期末可供分配基金份额利润	0.0872
期末基金资产净值	2,285,876,562.26
期末基金份额净值	1.0872
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.72%

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

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

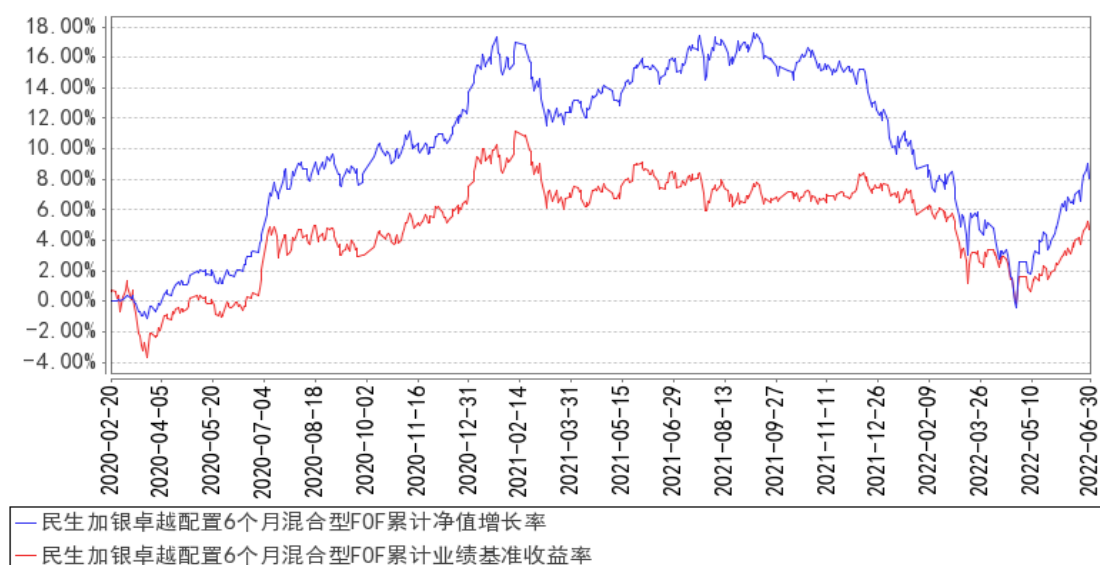
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.62%	0.52%	2.67%	0.32%	0.95%	0.20%
过去三个月	3.75%	0.60%	2.17%	0.43%	1.58%	0.17%
过去六个月	-3.40%	0.60%	-2.33%	0.44%	-1.07%	0.16%
过去一年	-6.23%	0.50%	-2.88%	0.37%	-3.35%	0.13%
自基金合同生效起至今	8.72%	0.42%	5.22%	0.39%	3.50%	0.03%

注：本基金业务比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×65%+一年期定期存款基准利率（税后）×5%

### 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

民生加银卓越配置6个月混合型FOF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 2020 年 2 月 20 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。

## § 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2022年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理95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、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）、民生加银双核动力混合型证券投资基金、民生加银恒祥债券型证券投资基金、民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。

#### 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		
于善	本基金基	2020 年 2	-	21 年	北京大学数学科学学院理学硕士，21 年

辉	金经理、 公司副 总经理	月 20 日			证券从业经历。曾任职于天相投资顾问有限公司，任分析师、金融创新部经理、总裁助理、副总经理等职。2012 年加入民生加银基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理、公司投资决策委员会成员、权益资产条线投资决策委员会成员、固收资产条线投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金投资顾问投资决策委员会成员。自 2019 年 4 月至今担任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）基金经理，自 2020 年 2 月至今担任民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；自 2020 年 9 月至今担任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）基金经理；自 2021 年 2 月至今担任民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；自 2021 年 7 月至今担任民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；自 2021 年 12 月至今担任民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF-LOF）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《中华人民共和国证券投资基金法》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

根据本基金的合同约定和产品定位，秉承配置决定风险和收益的理念，本基金采用稳健的风险收益配置策略，在有效控制组合回撤水平的前提下，把握了债券和股票市场的投资机会，在获取固收类资产平稳收益的同时，积极把握权益类资产超额收益的机会，并利用固收类资产和权益类资产的不相关属性，适度降低组合的回撤水平，基本实现了组合平稳增值的目标。但由于年初以来俄乌冲突升级、美债收益率大幅上行、海外通胀持续抬升、国内疫情反复等众多意料之外的事件频发，期望中的“跨年行情”并未开启，资本市场反而出现了较大的波动，市场情绪也一度达到了冰点，基金净值也出现了一定的回撤，让持有人承担了较大的波动。4 月底市场开始逐渐平稳后，本基金及时的抓住了机会，较好的控制了回撤并追回了部分收益。后续我们将认真反思和完善我们的投资框架，进一步提升回撤控制水平，审慎管好投资组合，不负持有人的信任。

##### 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 1.0872 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.40%，业绩比较基准收益率为-2.33%。

#### 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 年下半年，虽然近期市场修复的时间和幅度均远超市场预期，但是 A 股整体和部分优质标的的估值依然处于历史合理的区间。疫后复苏和政策发力有望延续，国内经济将处于稳中有升的趋势中，企业盈利相较于上半年将呈现一定的修复迹象。经济复苏将带动社会总需求回暖，预计下半年信用将进一步扩张。资金方面，在理财新规、房住不炒的大背景之下，居民理财入市

仍是大势所趋，权益市场并不缺乏增量资金。但值得注意的是，由于国内经济复苏、海外政策收紧，下半年“大水漫灌”的概率较小，流动性驱动的估值抬升可能在下半年遇到一些阻力。情绪方面，地缘政治冲突和全球疫情变化仍将是影响投资者风险偏好的重要因素，在少部分时间内可能加大市场的波动。总体来看，我们认为在基本面边际改善的背景下，A股结构性行情仍将持续，目前市场依然处于值得长期配置的合理位置，结构上将依照基本面沿着高景气 and 困境反转两条线索进行布局，白酒、出行、养殖、医药、新能源及新能源车、军工、传统基建、港股互联网等板块均是值得配置的投资方向。本基金将维持中性适度积极的大类资产配置比例，通过对细分资产的选择和结构优化获取相对较好的超额收益，在有效控制风险的前提下，努力实现本基金稳健配置、较高平稳增值的目标定位，用时间来熨平短期的波动和回撤水平。

#### 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。

#### 4.7 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《中华人民共和

国证券投资基金法》、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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,154,160.18	5,174,729.56
结算备付金		153,157.96	2,356,295.32
存出保证金		78,167.45	264,286.68
交易性金融资产	6.4.7.2	2,292,066,871.36	2,772,199,387.80
其中：股票投资		149,396,360.83	172,601,371.56
基金投资		2,026,075,541.75	2,468,671,516.24
债券投资		116,594,968.78	130,926,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		174,021.01	172,966,703.92
应收股利		-	1,050,000.00
应收申购款		289,125.29	277,984.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,335,359.55
资产总计		2,295,915,503.25	2,955,624,747.51
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2.87	10.39
应付赎回款		8,855,561.74	42,777,510.35
应付管理人报酬		824,194.58	1,033,532.95
应付托管费		217,157.63	275,620.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	142,024.17	291,189.57
负债合计		10,038,940.99	44,377,863.28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,102,501,767.71	2,586,737,883.23
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	183,374,794.55	324,509,001.00
净资产合计		2,285,876,562.26	2,911,246,884.23
负债和净资产总计		2,295,915,503.25	2,955,624,747.51

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0872 元，基金份额总额 2,102,501,767.71 份。

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

## 6.2 利润表

会计主体：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-101,641,384.07	197,110,274.57
1. 利息收入		46,709.49	6,246,383.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,709.49	180,361.93
债券利息收入		-	6,066,021.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,471,603.83	318,286,160.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,812,899.61	246,131,363.75
基金投资收益	6.4.7.15	-14,927,723.03	17,262,422.55
债券投资收益	6.4.7.16	1,597,968.74	2,007,423.39
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	19,671,050.07	52,884,950.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-97,216,489.73	-127,422,269.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		6,751,418.98	28,632,401.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,256,717.50	20,160,489.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,391,049.37	4,874,172.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		2,950.60	1,689.19

其中：卖出回购金融资产支出		2,950.60	1,689.19
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		0.06	94,998.55
8. 其他费用	6.4.7.24	100,701.45	3,501,051.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-108,392,803.05	168,477,873.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-108,392,803.05	168,477,873.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-108,392,803.05	168,477,873.25

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

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,586,737,883.23	-	324,509,001.00	2,911,246,884.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,586,737,883.23	-	324,509,001.00	2,911,246,884.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-484,236,115.52	-	-141,134,206.45	-625,370,321.97



(一)、综合收益总额	-	-	-108,392,803.05	-108,392,803.05
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-484,236,115.52	-	-32,741,403.40	-516,977,518.92
其中：1. 基金申购款	11,081,744.76	-	735,573.86	11,817,318.62
2. 基金赎回款	-495,317,860.28	-	-33,476,977.26	-528,794,837.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,102,501,767.71	-	183,374,794.55	2,285,876,562.26
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,882,033,357.59	-	1,218,854,674.54	10,100,888,032.13
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期 差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净资产 (基金 净值)	8,882,033,357.59	-	1,218,854,674.54	10,100,888,032.13
三、本期 增减变动 额(减少 以“-”号 填列)	- 2,861,097,075.43	-	-259,326,916.45	-3,120,423,991.88
(一)、综 合收益总 额	-	-	168,477,873.25	168,477,873.25
(二)、本 期基金份 额交易产 生的基金 净值变动 数 (净值减 少以“-” 号填列)	- 2,861,097,075.43	-	-427,804,789.70	-3,288,901,865.13
其中：1. 基金申购 款	1,607,306,336.07	-	213,236,043.80	1,820,542,379.87
2. 基金赎回 款	- 4,468,403,411.50	-	-641,040,833.50	-5,109,444,245.00
(三)、本 期向基金 份额持有 人分配利 润产生的 基金净值 变动(净 值减少以 “-”号填 列)	-	-	-	-
(四)、其 他综合收 益结转留 存收益	-	-	-	-

四、本期 期末净资 产（基金 净值）	6,020,936,282.16	-	959,527,758.09	6,980,464,040.25
-----------------------------	------------------	---	----------------	------------------

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：

<u>张焕南</u>	<u>王国栋</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）《关于准予民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可〔2019〕2710 号文）核准，由民生加银基金管理有限公司依照国家相关法律法规的规定、《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》、《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告》的规定发售，基金合同于 2020 年 2 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,982,103,499.05 份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司（以下简称“民生加银基金公司”），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《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（含 QDII 基金、香港互认基金）、股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及港股通标的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含

QDII 基金、香港互认基金)的比例不低于 80%。其中投资于股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 10%—50%。投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产 50%。基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*30%+中债综合指数收益率\*65%+一年期定期存款基准利率(税后)\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况、2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号—套期会计(修订)》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报(修订)》(以下统称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税〔2005〕103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改

增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：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。

2018年1月1日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、

红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,154,160.18
等于：本金	3,153,666.26
加：应计利息	493.92
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,154,160.18

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	146,146,433.49	-	149,396,360.83	3,249,927.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,490,912.78	116,594,968.78	-189,575.15
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,490,912.78	116,594,968.78	-189,575.15
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,933,257,099.08	-	2,026,075,541.75	92,818,442.67
其他	-	-	-	-
合计	2,193,697,163.72	2,490,912.78	2,292,066,871.36	95,878,794.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 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：本基金本期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。



#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本期末无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,764.02
其中：交易所市场	52,764.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	142,024.17

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,586,737,883.23	2,586,737,883.23
本期申购	11,081,744.76	11,081,744.76

本期赎回（以“-”号填列）	-495,317,860.28	-495,317,860.28
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	2,102,501,767.71	2,102,501,767.71

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	239,716,511.22	84,792,489.78	324,509,001.00
本期利润	-11,176,313.32	-97,216,489.73	-108,392,803.05
本期基金份额交易产生的变动数	-44,064,272.12	11,322,868.72	-32,741,403.40
其中：基金申购款	1,001,216.46	-265,642.60	735,573.86
基金赎回款	-45,065,488.58	11,588,511.32	-33,476,977.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,475,925.78	-1,101,131.23	183,374,794.55

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	39,067.84
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	6,355.40
其他	1,286.25
合计	46,709.49

注：其他为结算保证金利息收入、深港通预付款利息收入、深港通风控资金利息收入等。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,812,899.61
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	-10,812,899.61

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	142,213,461.18
减：卖出股票成本总额	152,635,808.54
减：交易费用	390,552.25
买卖股票差价收入	-10,812,899.61

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	456,617,730.40
减：卖出/赎回基金成本总额	471,285,539.12
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	259,914.31
基金投资收益	-14,927,723.03

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,548,024.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	49,944.08
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	1,597,968.74

**6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,353,765.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,774,363.55
减：应计利息总额	529,404.74
减：交易费用	53.40
买卖债券差价收入	49,944.08

**6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 资产支持证券投资收益****6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：无。

**6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 贵金属投资收益****6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内无衍生工具投资收益。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,026,302.80
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	18,644,747.27
合计	19,671,050.07

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-97,216,489.73
股票投资	-11,044,643.94
债券投资	-150,395.15
资产支持证券投资	-
基金投资	-86,021,450.64
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	-97,216,489.73

#### 6.4.7.22 其他收入

注：本基金于本期无其他收入。

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	8,753,521.52
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	1,936,973.66

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金于本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,681.13
深港通证券组合费	760.17
合计	100,701.45

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.10 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：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方的交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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

###### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方的交易单元进行过基金交易。

###### 6.4.10.1.5 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。

###### 6.4.10.1.6 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,256,717.50	20,160,489.32
其中：支付销售机构的客户维护 费	3,544,022.49	13,354,780.39

注：①支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分的0.60%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日的基金资产净值扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分×0.60%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,391,049.37	4,874,172.51

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.15%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日的基金资产净值扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内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：本基金的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。

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

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	3,154,160.18	39,067.84	153,642,314.03	148,882.30

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金，于2022年6月30日的相关余额为人民币153,089.06元。（2021年12月31日：人民币2,356,295.32元）



#### 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：本基金在本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人民生加银基金公司的公开募集证券投资基金合计 611,449,268.35 元，占本基金资产净值的比例为 26.75%。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	9,550.19	15,336.83
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	4,173,910.67	8,232,258.30
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	751,155.53	1,685,793.63
当期交易基金产生的交易费 （元）	-	886.96
当期交易基金产生的转换费 （元）	11,071.00	27,068.88

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1) 本基金在本报告期内未进行过利润分配。

2) 本基金资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前的利润分配情况，详见本报告

“6.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

#### 6.4.12 期末(2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-

301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	109.18	82.76	403	43,997.64	33,352.28	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-

		日									
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-	
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-	
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-	
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-	
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-	
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-	
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	48.59	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-	
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-	
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-	
301256	华融	2022年	6个月	新股流	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-	

	化学	3月14日		通受限							
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-	
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-	
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-	
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-	
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-	
688052	纳芯微	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	230.00	350.81	6,090	1,400,700.00	2,136,432.90	-	
688173	希荻微	2022年1月13日	6个月	新股流通受限	33.57	31.62	4,236	142,202.52	133,942.32	-	
688207	格灵深瞳	2022年3月9日	6个月	新股流通受限	39.49	26.38	13,391	528,810.59	353,254.58	-	
688283	坤恒顺维	2022年2月8日	6个月	新股流通受限	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-	
688331	荣昌生物	2022年3月24日	6个月	新股流通受限	48.00	42.94	15,915	763,920.00	683,390.10	-	

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于2022年6月30日，本基金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：于 2022 年 6 月 30 日，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 2022 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 2022 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现”风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会合规与风险管理委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以合规与风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### 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。本基金的银行存款存放在

本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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证券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，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,112,232.88	-
合计	10,112,232.88	-

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	106,482,735.90	130,926,500.00
合计	106,482,735.90	130,926,500.00

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。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。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 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受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证



金及债券投资等。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进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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
<b>资产</b>							
银行存款	3,153,666.26	-	-	-	-	493.92	3,154,160.18
结算备付金	153,089.06	-	-	-	-	68.90	153,157.96
存出保证金	78,132.25	-	-	-	-	35.20	78,167.45
交易性金融资产	-	100,100,000.00	14,004,056.00	-	-	2,177,962,815.36	2,292,066,871.36
应收申购款	-	-	-	-	-	289,125.29	289,125.29
应收清算款	-	-	-	-	-	174,021.01	174,021.01
资产总计	3,384,887.57	100,100,000.00	14,004,056.00	-	-	2,178,426,559.68	2,295,915,503.25
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,855,561.74	8,855,561.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	824,194.58	824,194.58
应付托管费	-	-	-	-	-	217,157.63	217,157.63
应付清算款	-	-	-	-	-	2.87	2.87
其他负债	-	-	-	-	-	142,024.17	142,024.17
负债总计	-	-	-	-	-	10,038,940.99	10,038,940.99
利率敏感度缺口	3,384,887.57	100,100,000.00	14,004,056.00	-	-	2,168,387,618.69	2,285,876,562.26
上年度末 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
<b>资产</b>							
银行存款	5,174,729.56	-	-	-	-	-	5,174,729.56

结算备付金	2,356,295.32	-	-	-	-	2,356,295.32
存出保证金	264,286.68	-	-	-	-	264,286.68
交易性金融资产	-	-	130,926,500.00	-	-	2,641,272,887.80
应收股利	-	-	-	-	-	1,050,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	277,984.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	172,966,703.92
其他资产	-	-	-	-	-	1,335,359.55
资产总计	7,795,311.56	-	130,926,500.00	-	-	2,816,902,935.95
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,777,510.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,033,532.95
应付托管费	-	-	-	-	-	275,620.02
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10.39
其他负债	-	-	-	-	-	291,189.57
负债总计	-	-	-	-	-	44,377,863.28
利率敏感度缺口	7,795,311.56	-	130,926,500.00	-	-	2,772,525,072.67
						884.23

#### 6.4.13.4.1.2 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。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降25个基点	47,341.37	197,632.32

	2. 市场利率上升 25 个基点	-47,267.64	-197,242.00
--	---------------------	------------	-------------

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	149,396,360.83	6.54	172,601,371.56	5.93
交易性金融资产—基金投资	2,026,075,541.75	88.63	2,468,671,516.24	84.80
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	2,175,471,902.58	95.17	2,641,272,887.80	90.73

##### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	43,497,972.98	42,154,842.44
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-43,497,972.98	-42,154,842.44

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,170,490,537.79	2,636,052,194.83
第二层次	121,576,333.57	136,147,192.97
第三层次	-	-
合计	2,292,066,871.36	2,772,199,387.80

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2021 年 12 月 31

日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 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	149,396,360.83	6.51
	其中：股票	149,396,360.83	6.51
2	基金投资	2,026,075,541.75	88.25
3	固定收益投资	116,594,968.78	5.08
	其中：债券	116,594,968.78	5.08
	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	3,307,318.14	0.14
8	其他各项资产	541,313.75	0.02
9	合计	2,295,915,503.25	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 12,729,332.11 元，占基金资产净值比例 0.56%。

### 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	-	-
B	采矿业	4,665,000.00	0.20
C	制造业	89,344,104.52	3.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,290,000.00	0.28

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,790,500.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,855,716.84	1.04
J	金融业	9,144,000.00	0.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	272,976.40	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	136,667,028.72	5.98

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信业务	12,729,332.11	0.56
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	12,729,332.11	0.56

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	600309	万华化学	200,000	19,398,000.00	0.85
2	600845	宝信软件	300,000	16,380,000.00	0.72
3	300750	宁德时代	30,000	16,020,000.00	0.70
4	00700	腾讯控股	42,000	12,729,332.11	0.56
5	300059	东方财富	360,000	9,144,000.00	0.40
6	002594	比亚迪	25,000	8,337,250.00	0.36

7	002326	永太科技	200,000	6,586,000.00	0.29
8	600905	三峡能源	1,000,000	6,290,000.00	0.28
9	002129	TCL 中环	100,000	5,889,000.00	0.26
10	002475	立讯精密	150,000	5,068,500.00	0.22
11	002601	龙佰集团	250,000	5,012,500.00	0.22
12	601899	紫金矿业	500,000	4,665,000.00	0.20
13	002405	四维图新	300,000	4,521,000.00	0.20
14	688167	炬光科技	30,000	4,462,500.00	0.20
15	300390	天华超净	39,900	3,487,260.00	0.15
16	300316	晶盛机电	50,000	3,379,500.00	0.15
17	688187	时代电气	50,000	3,249,500.00	0.14
18	002352	顺丰控股	50,000	2,790,500.00	0.12
19	600089	特变电工	100,000	2,739,000.00	0.12
20	688120	华海清科	10,000	2,484,000.00	0.11
21	688052	纳芯微	6,090	2,136,432.90	0.09
22	300401	花园生物	100,000	1,734,000.00	0.08
23	688331	荣昌生物	15,915	683,390.10	0.03
24	688207	格灵深瞳	13,391	353,254.58	0.02
25	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
26	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
27	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
28	688173	希荻微	4,236	133,942.32	0.01
29	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
30	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
31	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
32	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
33	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
34	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
35	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
36	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
37	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
38	301150	中一科技	403	33,352.28	0.00
39	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
40	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
41	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
42	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
43	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
44	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
45	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
46	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
47	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
48	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00

49	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
50	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
51	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
52	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
53	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
54	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
55	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
56	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
57	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
58	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
59	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
60	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
61	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
62	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
63	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
64	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
65	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
66	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
67	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
68	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
69	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
70	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	8,640,960.94	0.30
2	600309	万华化学	8,216,861.00	0.28
3	300390	天华超净	7,100,296.00	0.24
4	002352	顺丰控股	6,772,000.00	0.23
5	600905	三峡能源	6,576,216.00	0.23
6	002475	立讯精密	6,436,679.00	0.22
7	300316	晶盛机电	6,075,268.54	0.21
8	002326	永太科技	5,631,045.00	0.19
9	603986	兆易创新	4,992,519.48	0.17
10	002129	TCL 中环	4,777,191.00	0.16
11	600859	王府井	4,719,597.00	0.16
12	688120	华海清科	4,510,000.00	0.15
13	002405	四维图新	4,398,519.00	0.15
14	002601	龙佰集团	3,996,508.00	0.14
15	002594	比亚迪	3,652,084.00	0.13



16	000858	五粮液	3,359,971.00	0.12
17	000739	普洛药业	3,310,000.00	0.11
18	000807	云铝股份	2,851,414.50	0.10
19	688187	时代电气	2,832,732.32	0.10
20	688167	炬光科技	2,723,806.34	0.09

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。

#### 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	002460	赣锋锂业	12,320,099.00	0.42
2	02269	药明生物	11,807,906.25	0.41
3	00941	中国移动	11,680,893.20	0.40
4	00981	中芯国际	8,647,743.35	0.30
5	002326	永太科技	5,282,532.00	0.18
6	600859	王府井	4,773,361.00	0.16
7	300390	天华超净	4,707,190.00	0.16
8	601899	紫金矿业	4,560,000.00	0.16
9	603338	浙江鼎力	3,956,955.00	0.14
10	601888	中国中免	3,839,304.00	0.13
11	603986	兆易创新	3,604,800.00	0.12
12	600038	中直股份	3,548,819.00	0.12
13	603690	至纯科技	3,527,844.00	0.12
14	000825	太钢不锈	3,362,388.00	0.12
15	300316	晶盛机电	3,203,059.00	0.11
16	600438	通威股份	2,958,016.00	0.10
17	002906	华阳集团	2,899,938.00	0.10
18	688120	华海清科	2,570,694.40	0.09
19	002352	顺丰控股	2,540,003.00	0.09
20	000858	五粮液	2,371,964.36	0.08

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。

#### 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	140,475,441.75
卖出股票收入（成交）总额	142,213,461.18

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	116,594,968.78	5.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,594,968.78	5.10

## 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	019641	20 国债 11	1,000,000	102,428,986.30	4.48
2	019666	22 国债 01	100,000	10,112,232.88	0.44
3	019648	20 国债 18	39,700	4,053,749.60	0.18

## 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 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。

## 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 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 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

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收益。

本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000563	南方通利债券 A	契约型开放式	160,313,333.37	179,935,685.37	7.87	否
2	519718	交银纯债债券发起 A/B	契约型开放式	133,293,639.57	144,263,706.11	6.31	否
3	100018	富国天利增长债券	契约型开放式	104,326,840.54	141,863,637.77	6.21	否
4	100058	富国产业债债券 A	契约型开放式	102,927,103.89	121,309,884.64	5.31	否
5	164902	交银信用添利债券 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	94,590,649.61	118,399,116.12	5.18	否

6	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	99,955,077.41	111,559,861.90	4.88	否
7	690007	民生加银景气行业混合 A	契约型开放式	23,005,493.59	108,171,830.86	4.73	是
8	005354	富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式 A	契约型开放式	76,751,095.09	103,790,505.89	4.54	否
9	000136	民生加银策略精选混合 A	契约型开放式	21,893,748.78	98,521,869.51	4.31	是
10	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	83,696,019.93	96,250,422.92	4.21	否
11	340009	兴全磐稳增利债券 A	契约型开放式	59,902,138.42	94,783,153.62	4.15	否
12	004224	南方军工改革灵活配置混合 A	契约型开放式	45,812,130.17	74,806,627.35	3.27	否
13	690002	民生增强收益债券 A	契约型开放式	45,195,331.12	71,770,185.82	3.14	是
14	000355	南方丰元信用增强债券 A	契约型开放式	54,722,174.77	70,093,633.66	3.07	否
15	675111	西部利得汇享债券 A	契约型开放式	45,657,017.62	54,153,788.60	2.37	否
16	000408	民生加银城镇化混合 A	契约型开放式	22,691,872.62	47,993,310.59	2.10	是

17	010116	民生加银 新兴产业 混合 A	契约 型开 放式	52,138,287.21	47,555,331.76	2.08	是
18	009580	招商双债 增强 (LOF)D	上市 契约 型开 放式 (LOF)	30,074,436.09	43,186,890.23	1.89	否
19	001220	民生加银 研究精选 混合	契约 型开 放式	21,961,932.65	42,320,644.22	1.85	是
20	690011	民生加银 积极成长 混合	契约 型开 放式	10,928,410.45	37,265,879.63	1.63	是
21	006058	民生加银 新兴成长 混合	契约 型开 放式	16,716,070.97	35,215,746.71	1.54	是
22	000884	民生加银 优选股票	契约 型开 放式	12,539,883.46	28,014,099.65	1.23	是
23	003382	民生加银 鑫享债券 A	契约 型开 放式	26,771,217.76	24,037,876.43	1.05	是
24	002683	民生加银 前沿科技 混合	契约 型开 放式	13,946,055.39	22,508,933.40	0.98	是
25	008383	招商安心 收益债券 A	契约 型开 放式	12,300,785.18	21,635,851.05	0.95	否
26	690005	民生加银 内需增长 混合	契约 型开 放式	7,362,259.17	16,447,286.99	0.72	是
27	003949	兴全稳泰 债券 A	契约 型开 放式	13,413,968.87	14,994,134.40	0.66	否
28	002649	民生加银	契约	6,538,067.24	14,248,409.94	0.62	是

		智造 2025 混合	型开放式				
29	217022	招商产业债券 A	契约型开放式	6,556,721.31	10,851,373.77	0.47	否
30	690004	民生加银稳健成长混合	契约型开放式	3,109,757.25	10,439,455.09	0.46	是
31	007731	民生加银持续成长混合 A	契约型开放式	4,781,481.46	6,938,407.75	0.30	是
32	513330	华夏恒生互联网科技业 ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	12,000,000.00	6,324,000.00	0.28	否
33	515220	国泰中证煤炭 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000,000.00	2,492,000.00	0.11	否
34	516950	银华中证基建 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,000,000.00	2,066,000.00	0.09	否
35	512690	鹏华中证酒 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,000,000.00	1,866,000.00	0.08	否

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

腾讯控股因违法违规被国家市场监督管理总局处罚（国市监处(2021)67号，作出处罚决定日期：2021年7月24日）。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	78,167.45
2	应收清算款	174,021.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	289,125.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	541,313.75

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 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。

### 7.13.6 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（%）
795,359	2,643.46	263,950.03	0.01	2,102,237,817.68	99.99

### 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	27,938.50	0.0013

### 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、基金投资和相关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（2020年2月20日） 基金份额总额	2,982,103,499.05
本报告期期初基金份额总额	2,586,737,883.23
本报告期基金总申购份额	11,081,744.76
减：本报告期基金总赎回份额	495,317,860.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,102,501,767.71

## § 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

1、本基金管理人于 2022 年 3 月 26 日发布公告，自 2022 年 3 月 25 日起李操纲先生不再担任公司总经理、首席信息官，由公司董事长张焕南先生代行总经理职务。

2、本基金管理人于 2022 年 6 月 23 日发布公告，自 2022 年 6 月 22 日起聘任刘静女士担任公司督察长，邢颖女士不再担任公司督察长职务。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。



## 10.6 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。

## 10.7 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、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚的情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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 (%)	
华泰证券	4	128,932,614.14	49.83	54,769.83	36.83	-
国盛证券	2	61,204,161.86	23.65	44,758.60	30.10	-
浙商证券	2	36,126,410.52	13.96	26,417.79	17.77	-
招商证券	1	20,821,076.02	8.05	14,574.60	9.80	-
长江证券	1	11,680,893.20	4.51	8,176.63	5.50	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	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	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

## 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债 券回购成 交总额 的比例(%)	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当 期基 金成 交总 额 的 比 例 (%)
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	4,367,994.00	6.55
国盛证 券	23,266,872.10	43.96	22,300,000.00	48.80	-	-	22,962,849.70	34.45
浙商证 券	29,659,824.00	56.04	23,400,000.00	51.20	-	-	39,331,858.30	59.00
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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 本基金本期新增华泰证券交易单元一个作为本基金的交易单元。

## 10.9 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	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）恢复大额申购、大额定期定额投资的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 21 日
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日

3	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日
4	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新招募说明书 (2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022 年 2 月 18 日
5	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022 年 2 月 18 日
6	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
7	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
8	关于旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构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	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 19 日
9	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
10	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
11	关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构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	中国证监会规定媒介	2022 年 5 月 28 日

## § 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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 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. 中国证监会准予基金募集注册的文件；
2. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
3. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；

4. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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。

## 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

2022 年 8 月 30 日