

# 民生加银积极配置 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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内容的真实、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	18
<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	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 本报告期投资基金情况 .....	48
7.13 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.9 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	民生加银积极配置 6 个月持有混合（FOF）
基金主代码	012936
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 22 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	370,741,378.06 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过基金组合管理，在严格控制投资风险和保障资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略本基金采用宏观基本面分析和风险平价策略相结合的分析方法分析评估各大类资产（主要包括股票、债券、商品、货币等）的收益、风险和相关性等特征和投资机会，并结合基金管理人大类资产配置条线投资决策委员会的意见和建议，选取合适的资产种类，初步设定各大类资产的上下限比例，同时，定期或不定期地进行适时调整，将投资组合的风险敞口维持在可接受的范围内。 2、基金选择策略在确定了各类资产的种类和投资比例之后，需要对各类资产的子基金进行筛选。本基金将基于对现有基金产品体系化的研究，通过定量分析与定性分析相结合的方式，自下而上精选出各类别基金中优质的产品做各类资产配置的目标。此外还包括：A 股投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×5%（经汇率调整后）+中债综合指数收益率×35%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘静	郭明
	联系电话	010-68960037	(010) 66105799
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8888-388	95588

传真	0755-23999800	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518038	100140
法定代表人	张焕南	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjyfund.com.cn">http://www.msjyfund.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	-23,603,549.34
本期利润	-30,041,728.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0806
本期加权平均净值利润率	-9.21%
本期基金份额净值增长率	-8.04%
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	-27,473,489.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0741
期末基金资产净值	343,267,888.44
期末基金份额净值	0.9259
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	-7.41%

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 06 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

④本基金合同生效日为 2021 年 12 月 22 日。

### 3.2 基金净值表现

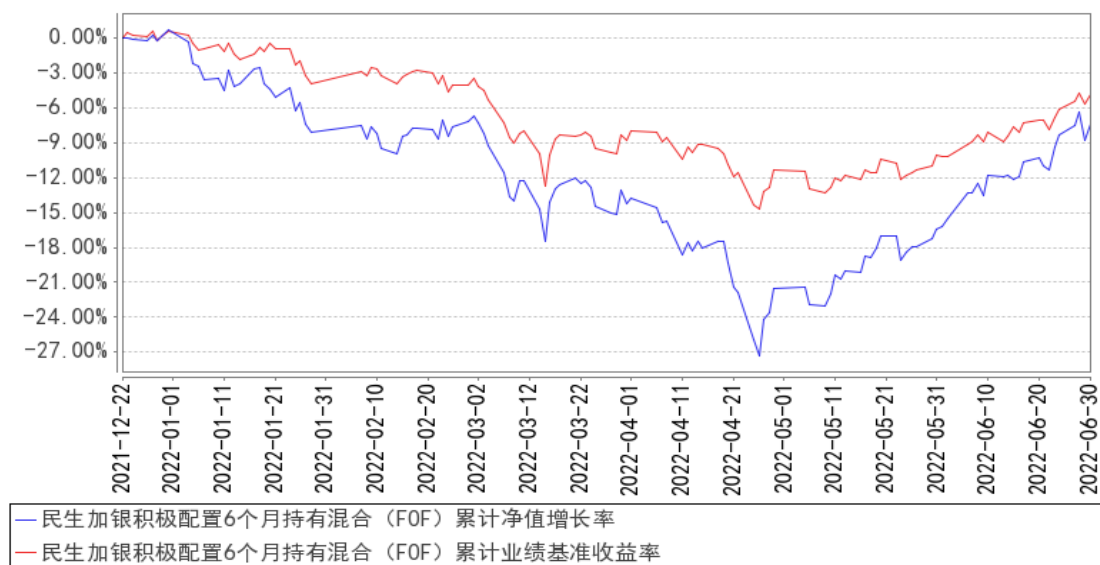
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.75%	1.19%	5.78%	0.70%	4.97%	0.49%
过去三个月	7.99%	1.59%	4.22%	0.92%	3.77%	0.67%
过去六个月	-8.04%	1.49%	-5.41%	0.95%	-2.63%	0.54%
自基金合同生效起至今	-7.41%	1.45%	-4.90%	0.93%	-2.51%	0.52%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×5%（经汇率调整后）+中债综合指数收益率×35%

#### 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

民生加银积极配置 6 个月持有混合 (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：1、本基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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		
苏辛	本基金的基金经理、资产配置部总监	2021 年 12 月 22 日	-	8 年	上海财经大学统计学专业博士，9 年证券从业经历。2013 年 9 月至 2016 年 5 月在上海证券交易所资本市场研究所担任研究员；2016 年 6 月至 2020 年 7 月在前海开源基金管理有限公司 FOF 投资部担任部门负责人、FOF 投决会秘书、FOF 基金经理。2020 年 7 月加入民生加银基金管理有限公司，担任资产配置部总监、大类资产配置条线投资决策委员会联席主席、基金投资顾问投资决策委员会主席、公司投资决策委员会成员、基金经理。自 2021 年 9 月至今担任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）基金经理；2021 年 12 月至今担任民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

2022 年上半年，市场经历了剧烈的深幅震荡，上证指数最深跌幅一度达到 20%，最终半年涨跌幅录得-6.63%，沪深 300 指数录得-9.22%，创业板指录得-15.41%。总体而言，各市场指数均有不同程度下跌。从过程上看，年初至 4 月底，受到多重宏观冲击影响，市场单边下行，经历了 3 次较大程度的急跌。其中，第一波急跌反映的是美联储加息节奏的不确定性和对政策稳增长能力的怀疑，第二波是俄乌冲突的超预期持续和对产业政策的极度悲观，第三波则是上海疫情爆发导致的雪上加霜。而后从 5 月份开始，随着上海疫情的好转和复产复工的顺利推进，虽然市场对经济恢复斜率一直抱有怀疑，但市场依然开启了连续上涨，尤其是前期跌幅较大的电力设备、汽车、军工等成长板块，在这一阶段表现突出。事后看，除了有疫情好转、复产复工、政策全力托底等因素，投资者信心恢复叠加流动性充裕也是市场反弹的重要驱动力。

在上述环境下，组合在上半年的运作有得有失，“失”主要在于组合在市场单边下行时同样经历了较大的回撤；“得”则是在后续的回撤中抓住了弹性较大的机会。报告期内，组合持有的品种基本保持稳定，维持新能源车、煤炭、光伏、军工等有扎实基本面、高景气度方向上的核心配置，辅以部分低回撤的价值类产品，同时在市场极度恐慌的时候进行了适当加仓。总体而言，组合在投资策略上符合“积极”的定位，后续将在维持组合弹性的情况下尽力减少波动，改进投资者的投资体验。

#### 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 0.9259 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.04%，业绩比较基准收益率为-5.41%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为总体是偏乐观的，市场再度出现持续大跌甚至突破前低的概率很小。

核心原因是能够看到，导致市场前期大跌的因素已趋于逆转，一是常态化疫情管理已较为成熟，防疫政策更加强调与经济发展相适应；二是经济政策有序发力，在企业和居民端均取得了一定的效果；三是国内外经济存在一定的周期错位，对于海外衰退的担忧反而变向凸显了国内资产的吸引力，而上述这些方面我们认为在未来 1-2 个季度内仍将持续，因此短期市场或许会因风险偏好和流动性的变化出现调整，但在海外真正出现衰退以前，总体尚不存在大幅度回调的驱动因子。对应到行业上，当前内需仍处于缓慢恢复的进程中，而海外则相反，通胀问题指向资源品价格高涨和短期需求旺盛。因此中短期而言，以新能源为首的高景气度制造业和以煤炭为首的部分周期行业仍可能是相对占优的配置方向。但往后也需要时刻关注内需的恢复情况，尤其是一旦海外发生实质性衰退，那么国内需求就将成为能否支撑市场的重要因素，届时相应行业或许也将成为新的市场主线。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——民生加银基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对民生加银基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：民生加银积极配置 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	20,827,590.67	105,308,741.83
结算备付金		94,318.27	-
存出保证金		35,687.88	-
交易性金融资产	6.4.7.2	325,043,215.35	269,806,976.18
其中：股票投资		743,008.00	-
基金投资		324,300,207.35	269,806,976.18
债券投资		-	-
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		-	3,500,000.00
应收股利		0.72	1,152,445.00
应收申购款		509.69	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	20,361.39
资产总计		346,001,322.58	379,788,524.40
<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		599,675.25	5,198,647.52
应付赎回款		1,750,142.93	-
应付管理人报酬		270,550.07	91,675.18
应付托管费		25,561.70	11,427.61
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	87,504.19	6,288.30
负债合计		2,733,434.14	5,308,038.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	370,741,378.06	371,965,270.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-27,473,489.62	2,515,215.34
净资产合计		343,267,888.44	374,480,485.79
负债和净资产总计		346,001,322.58	379,788,524.40

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9259 元，基金份额总额 370,741,378.06 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。

(3) 本基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效, 故无上年度可比期间数据。

## 6.2 利润表

会计主体: 民生加银积极配置 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
<b>一、营业总收入</b>		-28,194,966.95
1. 利息收入		45,885.60
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	45,885.60
债券利息收入		-
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)		-21,802,672.90
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-687,013.51
基金投资收益	6.4.7.15	-22,407,171.86
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
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	1,291,512.47
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	-6,438,179.65
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>		1,846,762.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,619,500.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	147,636.72
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		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-

7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.24	79,625.16
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-30,041,728.99
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-30,041,728.99
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-30,041,728.99

注: 本基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效, 故无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 民生加银积极配置 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)	371,965,270.45	-	2,515,215.34	374,480,485.79
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)	371,965,270.45	-	2,515,215.34	374,480,485.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,223,892.39	-	-29,988,704.96	-31,212,597.35
(一)、综合收益总额	-	-	-30,041,728.99	-30,041,728.99
(二)、本期基	-1,223,892.39	-	53,024.03	-1,170,868.36



基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	1,404,980.24	-	-157,577.98	1,247,402.26
2. 基金赎回款	-2,628,872.63	-	210,602.01	-2,418,270.62
(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、本期末净资产(基金净值)	370,741,378.06	-	-27,473,489.62	343,267,888.44

注：本基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效，故无上年度可比期间数据。

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：

张焕南

王国栋

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银积极配置 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 (以下简称“中国证监会”) 2021 年 5 月 31 日证监许可【2021】1854 号文核准募集。本基金由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》发售, 基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期间不定, 首次设立募集规模为 371, 965, 270.45 份基金份额, 上述募集资金已由安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙) 验证。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”), 基金托管人为中国工商银行股份有限公司 (以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和截至报告期末最新公告的《民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》的有关规定, 本基金的投资范围包括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允许上市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、可交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。

基金的投资组合比例为: 本基金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 60%-95%。投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产 50%。本基金保留的现金 (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%。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率  $\times$  60% + 恒生综合指数收益率  $\times$  5% (经汇率调整后) + 中债综合指数收益率  $\times$  35%。

## 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的要求,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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

自 2021 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间:

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债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。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

自 2022 年 1 月 1 日起:

#### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金

融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产

产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计

量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债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。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2021 年 12 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间：

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

自 2022 年 1 月 1 日起：

- (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础,对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额,即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时,本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失,是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款,本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外,本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回,则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是,被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。



#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时, 申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益, 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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量, 并全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认, 在债券实际持有期内逐日计提, 确认为投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债, 根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后, 逐日计提利息收入, 确认为投资收益。如票面利率与实际利率出现重大差异, 按实际利率计算利息收入, 确认为投资收益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额, 在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认, 直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额, 在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认, 直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

(c) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(d) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处

理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 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	20,827,590.67

等于：本金	20,825,462.42
加：应计利息	2,128.25
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	20,827,590.67

#### 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	793,628.00	-	743,008.00	-50,620.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	329,222,586.92	-	324,300,207.35	-4,922,379.57
其他	-	-	-	-
合计	330,016,214.92	-	325,043,215.35	-4,972,999.57

#### 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：本基金于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：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告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：本基金于本期末无其他资产。

#### 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	8,161.03
其中：交易所市场	8,161.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
合计	87,504.19

#### 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	371,965,270.45	371,965,270.45
本期申购	1,404,980.24	1,404,980.24
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,628,872.63	-2,628,872.63
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	370,741,378.06	370,741,378.06

注：此次申购含转换入份额，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	1,050,035.26	1,465,180.08	2,515,215.34
本期利润	-23,603,549.34	-6,438,179.65	-30,041,728.99
本期基金份额交易产生的变动数	130,620.74	-77,596.71	53,024.03
其中：基金申购款	-26,736.22	-130,841.76	-157,577.98
基金赎回款	157,356.96	53,245.05	210,602.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,422,893.34	-5,050,596.28	-27,473,489.62

#### 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	43,362.70
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	2,323.90
其他	199.00
合计	45,885.60

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 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	-687,013.51
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	-687,013.51

##### 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	3,443,819.00
减：卖出股票成本总额	4,120,805.69
减：交易费用	10,026.82
买卖股票差价收入	-687,013.51

##### 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	169,512,923.87
减：卖出/赎回基金成本总额	191,216,233.56
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	703,862.17

基金投资收益	-22,407,171.86
--------	----------------

#### 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

注：本基金于本期无债券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 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：无。

##### 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：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 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：本基金于本期无贵金属投资收益。

##### 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：本基金于本期无衍生工具收益。

**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	19,040.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,272,472.47
合计	1,291,512.47

**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	-6,438,179.65
股票投资	-50,620.00
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-6,387,559.65
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	-6,438,179.65

#### 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)	52,674.12
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	1,538,454.43
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	270,553.01

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	282.00
合计	79,625.16

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司 (“民生加银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

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、基金销售机构
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	基金管理人的子公司

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：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金在本报告期内没有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：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,619,500.16
其中：支付销售机构的客户维护费	798,047.94

注：支付基金管理人民生加银基金公司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 1.00%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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 × 1.00% / 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	
当期发生的基金应支付的托管费	147,636.72	

注：支付基金托管人中国工商银行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。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：本基金在本报告期内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未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人无运用固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未持有本基金。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	20,827,590.67	43,362.70

注：本基金通过“中国工商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 94,275.87 元（2021 年 12 月 31 日：人民币 0.00 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管理公司的公开募集证券投资基金合计人民币 0.00 元，占本基金资产净值的比例为 0.00%。

##### 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

注：本基金在本报告期内无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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1) 本基金于本期末未进行利润分配。

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

注：于 2022 年 06 月 30 日，本基金无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，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工商银行，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

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。



#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于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，另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。

#### 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 06 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。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，并按照合同约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
资产							
银行存款	20,825,462.42	-	-	-	-	2,128.25	20,827,590.67
结算备付金	94,275.87	-	-	-	-	42.40	94,318.27
存出保证金	35,671.88	-	-	-	-	16.00	35,687.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	325,043,215.35	325,043,215.35
应收股利	-	-	-	-	-	0.72	0.72
应收申购款	-	-	-	-	-	509.69	509.69
资产总计	20,955,410.17	-	-	-	-	325,045,912.41	346,001,322.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,750,142.93	1,750,142.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	270,550.07	270,550.07
应付托管费	-	-	-	-	-	25,561.70	25,561.70
应付清算款	-	-	-	-	-	599,675.25	599,675.25
其他负债	-	-	-	-	-	87,504.19	87,504.19

负债总计	-	-	-	-	-	2,733,434.14	2,733,434.14
利率敏感度缺口	20,955,410.17	-	-	-	-	322,312,478.27	343,267,888.44
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
资产							
银行存款	105,308,741.83	-	-	-	-	-	105,308,741.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	269,806,976.18	269,806,976.18
应收股利	-	-	-	-	-	1,152,445.00	1,152,445.00
应收清算款	-	-	-	-	-	3,500,000.00	3,500,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	20,361.39	20,361.39
资产总计	105,308,741.83	-	-	-	-	274,479,782.57	379,788,524.40
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	91,675.18	91,675.18
应付托管费	-	-	-	-	-	11,427.61	11,427.61
应付清算款	-	-	-	-	-	5,198,647.52	5,198,647.52
其他负债	-	-	-	-	-	6,288.30	6,288.30
负债总计	-	-	-	-	-	5,308,038.61	5,308,038.61
利率敏感度缺口	105,308,741.83	-	-	-	-	269,171,743.96	374,480,485.79

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金相关报告期末未持有利率敏感性资产或所持有的利率敏感性资产账面金额较小，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 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	743,008.00	0.22	-	-
交易性金融资产—基金投资	324,300,207.35	94.47	269,806,976.18	72.05
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	325,043,215.35	94.69	269,806,976.18	72.05

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	24,247,338.77	11,332,315.70
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-24,247,338.77	-11,332,315.70

#### 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	325,043,215.35	269,806,976.18
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	325,043,215.35	269,806,976.18

##### 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	743,008.00	0.21
	其中：股票	743,008.00	0.21
2	基金投资	324,300,207.35	93.73
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,921,908.94	6.05
8	其他各项资产	36,198.29	0.01
9	合计	346,001,322.58	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	501,704.00	0.15
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	241,304.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	743,008.00	0.22

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600256	广汇能源	47,600	501,704.00	0.15
2	600546	山煤国际	12,400	241,304.00	0.07

## 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	600988	赤峰黄金	1,388,121.00	0.37
2	601669	中国电建	949,811.00	0.25
3	600256	广汇能源	544,748.00	0.15
4	601800	中国交建	495,315.00	0.13
5	600547	山东黄金	395,565.00	0.11
6	601668	中国建筑	347,394.00	0.09
7	600546	山煤国际	248,880.00	0.07
8	002532	天山铝业	198,303.00	0.05
9	000933	神火股份	196,561.69	0.05
10	601868	中国能建	149,735.00	0.04

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	600988	赤峰黄金	1,108,020.00	0.30
2	601669	中国电建	747,387.00	0.20
3	601800	中国交建	428,400.00	0.11
4	601668	中国建筑	345,184.00	0.09
5	600547	山东黄金	313,374.00	0.08
6	000933	神火股份	215,730.00	0.06
7	002532	天山铝业	160,060.00	0.04
8	601868	中国能建	125,664.00	0.03

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	4,914,433.69
卖出股票收入（成交）总额	3,443,819.00

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、基金选择策略、A 股投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略。

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定风险。



## 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	005940	工银新能源汽车混合 C	契约型开放式	7,274,724.90	28,821,732.58	8.40	否
2	515220	国泰中证煤炭 ETF	交易型开放式 (ETF)	11,405,500.00	28,422,506.00	8.28	否
3	515790	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	交易型开放式 (ETF)	15,646,700.00	26,474,216.40	7.71	否
4	001790	国泰智能汽车股票 A	契约型开放式	9,070,703.08	25,878,715.89	7.54	否
5	519133	海富通改革驱动混合	契约型开放式	8,400,000.00	23,094,120.00	6.73	否
6	002132	广发鑫享混合	契约型开放式	6,254,475.29	19,575,882.21	5.70	否
7	001856	易方达环保主题混合	契约型开放式	3,827,317.60	17,146,382.85	5.00	否
8	519002	华安安信消费混合	契约型开放式	3,200,000.00	15,430,400.00	4.50	否
9	512660	国泰中证军工 ETF	交易型开放式 (ETF)	12,841,300.00	15,024,321.00	4.38	否

10	512690	鹏华中证酒 ETF	交易型开放式 (ETF)	15,108,100.00	14,095,857.30	4.11	否
11	515700	平安中证新能源汽车产业 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,809,000.00	11,579,360.00	3.37	否
12	159967	创成长	交易型开放式 (ETF)	15,635,100.00	10,772,583.90	3.14	否
13	159928	消费 ETF	交易型开放式 (ETF)	8,930,000.00	10,323,080.00	3.01	否
14	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	9,792,100.00	9,557,089.60	2.78	否
15	001018	易方达新经济混合	契约型开放式	2,251,124.45	9,252,121.49	2.70	否
16	512760	国泰 CES 半导体芯片 ETF	交易型开放式 (ETF)	7,712,700.00	9,000,720.90	2.62	否
17	005233	广发睿毅领先混合 A	契约型开放式	3,026,025.13	8,589,372.33	2.50	否
18	159865	养殖 ETF	交易型开放式 (ETF)	8,477,600.00	7,002,497.60	2.04	否
19	159825	农业 ETF	交易型开放式	6,999,200.00	6,971,203.20	2.03	否

			(ETF)				
20	159992	创新药	交易 型开 放式 (ETF)	5,183,700.00	5,588,028.60	1.63	否
21	159755	电池 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,305,700.00	4,171,793.40	1.22	否
22	510300	华泰柏瑞 沪深 300ETF	交易 型开 放式 (ETF)	800,000.00	3,606,400.00	1.05	否
23	510500	南方中证 500ETF	交易 型开 放式 (ETF)	370,800.00	2,723,896.80	0.79	否
24	515030	华夏中证 新能源汽车 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,137,600.00	2,681,323.20	0.78	否
25	510050	华夏上证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	800,000.00	2,455,200.00	0.72	否
26	512200	南方中证 全指房地 产 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,000,000.00	2,349,000.00	0.68	否
27	512400	南方中证 申万有色 金属 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,500,000.00	1,971,000.00	0.57	否
28	516110	国泰中证 800 汽车 与零部件	交易 型开 放式	842,800.00	1,025,687.60	0.30	否

		ETF	(ETF)				
29	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式 (ETF)	345,900.00	399,514.50	0.12	否
30	513330	华夏恒生互联网科技业 ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	600,000.00	316,200.00	0.09	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

山煤国际因违法违规被上海证券交易所处罚（上海证券交易所纪律处分决定书(2022)16号，作出处罚决定日期：2022年3月1日）。

山煤国际因违法违规被证监会山西监管局处罚（云南证监局行政监管措施决定书[2021]3号，作出处罚决定日期：2021年9月10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

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	35,687.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	0.72
4	应收利息	-
5	应收申购款	509.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,198.29

#### 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 (%)
2,148	172,598.41	497,512.44	0.13	370,243,865.62	99.87

### 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	1,939,544.02	0.5232

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 12 月 22 日) 基金份额总额	371,965,270.45
本报告期期初基金份额总额	371,965,270.45
本报告期基金总申购份额	1,404,980.24
减：本报告期基金总赎回份额	2,628,872.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	370,741,378.06

## § 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 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

本基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效，聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）向本基金提供审计服务。

## 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 (%)	
兴业证券	2	5,586,345.00	66.84	4,085.31	17.71	-
长江证券	2	2,001,253.00	23.94	1,463.50	6.34	-
华泰证券	1	770,654.69	9.22	17,523.81	75.95	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

### 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 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-	98,645,315.88	47.86
长江证券	-	-	-	-	-	-	70,081,096.10	34.00
华泰证券	-	-	-	-	-	-	37,406,098.16	18.15
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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本基金本期新增中信建投证券股份有限公司北京一个交易单元作为本基金交易单元。

## 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	民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 25 日
2	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
3	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
4	民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
5	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
6	民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 6 月 21 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) 《民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；
- (3) 《民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- (4) 《民生加银积极配置 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