

益民创新优势混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2023 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 8 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
§ 5 托管人报告	13
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37

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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12	投资组合报告附注	43
§ 8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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的情况	45
§ 9	开放式基金份额变动	45
§ 10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	益民创新优势混合型证券投资基金
基金简称	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 11 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	362,065,517.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业，为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野，遵循从全球到国内的分析思路，从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面：技术创新，产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标，来综合构建基金组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

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		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	闫峥	秦一楠
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	ymxxpl@ymfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006508808	95599
传真		010-63100608	010-68121816
注册地址		重庆市渝中区上清寺路 110 号	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	北京市西城区宣武门外大街 10 号 庄胜广场中央办公楼南翼 13A 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100052	100031
法定代表人	党均章	谷澍

注：公司于 2023 年 8 月 11 日搬迁至新办公地址，北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 1 幢 SK 大厦 17 层 05、06、07A 室，邮政编码为 100022。

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	www.yfund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

注：公司于 2023 年 8 月 11 日搬迁至新办公地址，北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 1 幢 SK 大厦 17 层 05、06、07A 室。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	益民基金管理有限公司	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

注：公司于 2023 年 8 月 11 日搬迁至新办公地址，北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 1 幢 SK 大厦 17 层 05、06、07A 室。

§ 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	20,814,784.02
本期利润	26,096,654.88
加权平均基金份额本期利润	0.0704
本期加权平均净值利润率	5.30%
本期基金份额净值增长率	5.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	122,827,598.03
期末可供分配基金份额利润	0.3392
期末基金资产净值	484,893,115.72
期末基金份额净值	1.3392

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	35.98%

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	2.46%	0.55%	1.02%	0.65%	1.44%	-0.10%
过去三个月	-0.67%	0.51%	-3.37%	0.62%	2.70%	-0.11%
过去六个月	5.47%	0.48%	0.25%	0.63%	5.22%	-0.15%
过去一年	0.25%	0.85%	-9.74%	0.74%	9.99%	0.11%
过去三年	19.73%	1.48%	-1.30%	0.90%	21.03%	0.58%
自基金合同生效起至今	35.98%	1.59%	32.56%	1.19%	3.42%	0.40%

注：自 2009 年 5 月 1 日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准，由原来的“沪深 300 指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%”变更为“沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%”。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 75%、25%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额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
(2007年7月11日至2023年6月30日)



§ 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

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托股份有限公司(出资比例 65%)、中国新纪元有限公司(出资比例 35%)组成，注册资本为 1 亿元人民币，注册地：重庆，主要办公地点：北京。截至 2023 年 6 月末，公司管理的基金共有六只，均为开放式基金。其中，益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立，首发规模近 9 亿份；益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立，首发规模近 73 亿份；益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 16 日成立，首发规模超过 11 亿份；益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于 2013 年 12 月 13 日成立，首发规模超过 10 亿

份；益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 5 月 6 日成立，首发规模近 14 亿份；益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 4 月 23 日成立，首发规模超过 2 亿份。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
高喜阳	本基金 基金经 理	2022 年 8 月 11 日	-	16	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中原证券股份有限公司研究所研究员；天弘基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理；工银瑞信基金管理有限公司基金经理；中欧基金管理有限公司策略五组投资副总监、投资经理；新沃基金管理有限公司总经理助理、投资总监；久盈资本投资管理有限公司风控总监；北京曜德投资管理有限公司总经理、投资总监。2022 年 6 月加入益民基金，现任公司权益投资总监兼权益投资部总经理。自 2022 年 8 月 11 日起任益民创新优势混合型证券投资基金、益民红利成长混合型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
关旭	本基金 基金经 理助理	2022 年 9 月 1 日	-	7	中国国籍，理学硕士，具有基金从业资格。2016 年 5 月至 2019 年 12 月于方正富邦基金管理有限公司任研究员；2020 年 1 月至 2022 年 7 月于南华基金管理有限公司任基金经理助理；2022 年 7 月加入益民基金管理有限公司，自 2022 年 9 月 1 日起任益民红利成长混合型证券投资基金、益民创新优势混合

					型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金、益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理兼高级行业研究员。
张婷	本基金基金经理助理	2022 年 9 月 1 日	-	8	中国国籍，理学硕士，具有基金从业资格。2015 年 3 月至 2021 年 1 月于华夏财富创新投资管理有限公司从事投研工作；2021 年 1 月至 2022 年 8 月于方正富邦基金管理有限公司任研究员；2022 年 8 月加入益民基金管理有限公司，自 2022 年 9 月 1 日起任益民红利成长混合型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金、益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理兼高级行业研究员。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3. 为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及

基金合同的规定。

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

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，并建立了有效的公平交易行为日常监控和事后分析评估体系，确保公平对待所有投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

本基金管理人通过统计检验的方法，对管理的投资组合在不同时间窗口下(1 日内、3 日内、5 日内)的同向交易行为进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为，不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易，不存在报告期内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交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

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

上半年，基于对宏观经济和市场走势的判断，本基金采取了比较谨慎的投资策略。在保持低估值的地产、高 ROE 的白酒、早周期的汽车、家电等核心持仓外，配置了具有比较优势的新能源龙头，阶段性参与了人工智能主题相关核心标的。

具体运作上，我们对仓位和结构进行了比较大的调整。结构上，减仓了新能源，部分参与了人工智能相关机会，但是整体上，仍然保持了低估值蓝筹股的核心持仓。整个上半年，仓位是逐步降低的，二季度末，仓位保持在产品合同要求的下限附近。

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 1.3392 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.47%；同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场处在经济增长中枢确认期、政策等待窗口期、市场情绪脆弱期的“三期叠加”，市场“噪音”较多，保持定力和耐心尤为重要。

从二季度经济数据看，经济修复动能偏弱。地产拖累、居民消费低迷、民企投资信心不振是二

季度经济低于市场预期的主要原因。虽然有地方债务化解、房地产长周期见顶等硬约束，但是长期问题短期化、线性外推不可取。PPI 价格和工业产成品库存在底部区域，经济存在自身周期性修复潜能，不宜对经济过分悲观。

无论是相对估值还是绝对估值，从各种估值指标评估，市场都处在相对低位，具有中长期投资价值，但是单从当前时点看，市场缺少新的增量资金，处在一个弱勢的均衡暂态。政策发力的力度、经济自身修复的强弱、中美关系等影响风险偏好的事件都可能成为打破当前市场运行节奏的重要变量。我们将密切关注以上因素的变化，及时调整应对策略。

大概率上，三季度上证指数仍处在 2900-3400 点弱勢震荡的区间，向上波动的动力来自于政策力度强于当前共识，向下的压力来自于政策继续低于预期，或经济修复继续弱于预期等。我们应该保持足够的耐心和定力，等待更多积极因素的出现。

在总量机会不显著的时候，我们更多挖掘结构性机会。三季度，我们将采取精选有成长性的细分行业 and 阶段性参与顺周期的投资思路。重点配置有成长性或者短周期见底的子行业，例如空调、汽车零部件、算力、AI 应用、减重药、存储、量贩零食、火电、面板等子行业。另外，从博弈政策角度，会逐渐增加顺周期配置，例如地产、白酒、新能源、有色等行业，买预期，卖现实。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了益民基金管理有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”)，制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司领导、投资总监、研究发展部负责人、合规审计部负责人、运作保障部负责人、基金会计等成员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。督察长、基金经理列席会议，但不参与具体决策。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。会计师事务所和管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每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；

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一益民基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，益民基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，益民基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：益民创新优势混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	219,832,647.94	60,439,416.28
结算备付金		1,164,459.31	1,090,146.38
存出保证金		361,589.58	212,577.89
交易性金融资产	6.4.7.2	267,908,759.78	411,167,972.17
其中：股票投资		207,297,083.73	380,561,585.87
基金投资		-	-
债券投资		60,611,676.05	30,606,386.30
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	-	-
应收清算款		-	11,847,956.12
应收股利		-	-
应收申购款		3,549.82	7,495.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		489,271,006.43	484,765,564.45
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,027.00	-
应付赎回款		28,511.39	9,306.07
应付管理人报酬		597,342.57	622,821.80
应付托管费		99,557.09	103,803.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		2,520,454.02	2,520,454.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,130,998.64	1,692,880.17
负债合计		4,377,890.71	4,949,265.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	362,065,517.69	377,870,339.85
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	122,827,598.03	101,945,958.90
净资产合计		484,893,115.72	479,816,298.75
负债和净资产总计		489,271,006.43	484,765,564.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3392 元，基金份额总额 362,065,517.69 份。

6.2 利润表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,486,197.30	-88,312,009.34
1. 利息收入		650,086.26	361,719.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	650,086.26	361,719.24
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）		24,551,808.86	-105,032,879.24
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,002,844.35	-108,033,526.49
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	693,154.96	427,559.04
资产支持证券投 资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,855,809.55	2,573,088.21

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. 16	5, 281, 870. 86	16, 351, 324. 67
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. 17	2, 431. 32	7, 825. 99
减：二、营业总支出		4, 389, 542. 42	4, 594, 555. 25
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 664, 805. 78	3, 824, 457. 62
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	610, 800. 96	637, 409. 55
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
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. 18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 19	113, 935. 68	132, 688. 08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		26, 096, 654. 88	-92, 906, 564. 59
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		26, 096, 654. 88	-92, 906, 564. 59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26, 096, 654. 88	-92, 906, 564. 59

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	377, 870, 339. 85	-	101, 945, 958. 90	479, 816, 298. 75
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）	377,870,339.85	-	101,945,958.90	479,816,298.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,804,822.16	-	20,881,639.13	5,076,816.97
（一）、综合收益总额	-	-	26,096,654.88	26,096,654.88
（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）	-15,804,822.16	-	-5,215,015.75	-21,019,837.91
其中：1. 基金申购款	1,110,456.97	-	370,333.50	1,480,790.47
2. 基金赎回款	-16,915,279.13	-	-5,585,349.25	-22,500,628.38
（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）	362,065,517.69	-	122,827,598.03	484,893,115.72
项目	上年度可比期间			
	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）	405,560,617.96	-	228,793,239.91	634,353,857.87
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）	405,560,617.96	-	228,793,239.91	634,353,857.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,909,118.62	-	-97,905,412.71	-113,814,531.33

(一)、综合收益总额	-	-	-92,906,564.59	-92,906,564.59
(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)	-15,909,118.62	-	-4,998,848.12	-20,907,966.74
其中: 1. 基金申购款	3,528,192.17	-	1,129,596.09	4,657,788.26
2. 基金赎回款	-19,437,310.79	-	-6,128,444.21	-25,565,755.00
(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)	389,651,499.34	-	130,887,827.20	520,539,326.54

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：

王明德	樊振华	肖军
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

益民创新优势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2007 年 6 月 4 日(2007) 157 号文《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》的批准,由益民基金管理有限公司(以下简称“益民基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《益民创新优势混合型证券投资基金招募说明书》和《益民创新优势混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为益民基金,托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

本基金通过益民基金直销柜台、益民基金网上直销平台等共同销售,募集期为 2007 年 6 月 18 日至 2007 年 7 月 8 日。经向中国证监会备案,《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》(以下

简称“基金合同”)于 2007 年 7 月 11 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 7,238,122,974.81 份(含利息转份额 6,159,321.48 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《益民创新优势混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于监管机构允许投资的具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金 80%以上的股票资产将投资于具有持续创新能力的优势企业以及潜在的优势企业。本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的 40%-90%,债券资产为基金资产的 5% - 55%,权证为基金资产净值的 0 - 3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 75% + 中证全债指数收益率 \times 25%。

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<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会颁布的《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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1-6 月的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错更正。

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》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：

(1)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。

(2)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。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称“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。

(3)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。

(4)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。

(5)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。

(6)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。

(7)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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	219,832,647.94
等于：本金	219,788,223.33
加：应计利息	44,424.61
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	219,832,647.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	215,612,937.03	-	207,297,083.73	-8,315,853.30	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	59,820,420.00	323,676.05	60,611,676.05	467,580.00
	合计	59,820,420.00	323,676.05	60,611,676.05	467,580.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	275,433,357.03	323,676.05	267,908,759.78	-7,848,273.30	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	639,082.99
其中：交易所市场	638,857.99
银行间市场	225.00
应付利息	-
其他应付款_其他	404,564.37
预提费用	87,351.28
合计	1,130,998.64

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	377,870,339.85	377,870,339.85
本期申购	1,110,456.97	1,110,456.97
本期赎回（以“-”号填列）	-16,915,279.13	-16,915,279.13
本期末	362,065,517.69	362,065,517.69

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 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	265,530,447.00	-163,584,488.10	101,945,958.90
本期利润	20,814,784.02	5,281,870.86	26,096,654.88
本期基金份额交易产生的变动数	-11,756,817.12	6,541,801.37	-5,215,015.75
其中：基金申购款	821,096.55	-450,763.05	370,333.50
基金赎回款	-12,577,913.67	6,992,564.42	-5,585,349.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	274,588,413.90	-151,760,815.87	122,827,598.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
活期存款利息收入	638,037.21
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	9,520.90
其他	2,528.15
合计	650,086.26

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	21,002,844.35
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	21,002,844.35

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
卖出股票成交总额	835,199,272.73
减：卖出股票成本总额	811,882,246.46
减：交易费用	2,314,181.92
买卖股票差价收入	21,002,844.35

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	679,699.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	13,455.00
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	693,154.96

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	60,627,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,867,670.00
减：应计利息总额	745,200.00
减：交易费用	675.00
买卖债券差价收入	13,455.00

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,855,809.55
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,855,809.55

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,281,870.86
——股票投资	4,827,730.86
——债券投资	454,140.00
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	5,281,870.86

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,424.79
基金转出费收入	6.53
合计	2,431.32

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	27,000.00
银行费用	8,584.40
合计	113,935.68

6.4.7.18 分部报告

无。

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

本报告期内无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
益民基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司	基金管理人关联方

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国都证券	125,937,783.89	8.57%	38,845,806.38	1.31%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度均未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

本基金在本报告期内及上年度均未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

本基金在本报告期内及上年度均未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

本基金在本报告期内及上年度均未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	117,286.11	8.60%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	36,177.34	1.31%	36,177.34	2.70%

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 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	3,664,805.78	3,824,457.62
其中：支付销售机构的客户维护费	1,237,087.71	1,287,136.15

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	610,800.96	637,409.55
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年末均未投资过本基金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国农业银行股份有限公司	219,832,647.94	638,037.21	174,711,825.99	341,732.62

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在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

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末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

本基金本报告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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理主要由风险管理部门完成。

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。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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；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，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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,285,393.44	30,606,386.30
合计	30,285,393.44	30,606,386.30

注：表中列示的未评级债券投资为政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	30,326,282.61	-
合计	30,326,282.61	-

注：表中列示的未评级债券投资为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，且基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例的限制)，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并

在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

本基金所持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，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12 外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。于本报告期末，本基金所承担的金融负债的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(净资产) 无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	219,832,647.94	-	-	-	-	-	219,832,647.94
结算备付金	1,164,459.31	-	-	-	-	-	1,164,459.31
存出保证金	361,589.58	-	-	-	-	-	361,589.58
交易性金融资	-	-	30,285,393.44	-	30,326,282.61	207,297,083.73	267,908,759.78

产							
应收申购款	-	-	-	-	-	3,549.82	3,549.82
资产总计	221,358,696.83	-	30,285,393.44	-	30,326,282.61	207,300,633.55	489,271,006.43
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,027.00	1,027.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,511.39	28,511.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	597,342.57	597,342.57
应付托管费	-	-	-	-	-	99,557.09	99,557.09
应交税费	-	-	-	-	-	2,520,454.02	2,520,454.02
其他负债	-	-	-	-	-	1,130,998.64	1,130,998.64
负债总计	-	-	-	-	-	4,377,890.71	4,377,890.71
利率敏感度缺口	221,358,696.83	-	30,285,393.44	-	30,326,282.61	202,922,742.84	484,893,115.72
上年度末 2022 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	60,428,921.96	-	-	-	-	10,494.32	60,439,416.28
结算备付金	1,089,606.94	-	-	-	-	539.44	1,090,146.38
存出保证金	212,472.73	-	-	-	-	105.16	212,577.89
交易性金融资产	30,000,000.00	-	-	-	-	381,167,972.17	411,167,972.17
应收清算款	-	-	-	-	-	11,847,956.12	11,847,956.12
应收申购款	-	-	-	-	-	7,495.61	7,495.61
资产总计	91,731,001.63	-	-	-	-	393,034,562.82	484,765,564.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,306.07	9,306.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	622,821.80	622,821.80
应付托管费	-	-	-	-	-	103,803.64	103,803.64
应交税费	-	-	-	-	-	2,520,454.02	2,520,454.02
其他负债	-	-	-	-	-	1,692,880.17	1,692,880.17
负债总计	-	-	-	-	-	4,949,265.70	4,949,265.70
利率敏感度缺口	91,731,001.63	-	-	-	-	388,085,297.12	479,816,298.75

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末持有的债券投资占比并不重大。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所投资的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	207,297,083.73	42.75	380,561,585.87	79.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	207,297,083.73	42.75	380,561,585.87	79.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	23,475,992.58	25,787,504.25
	业绩比较基准下	-23,475,992.58	-25,787,504.25

	降 5%		
--	------	--	--

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的公开报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	207,297,083.73	378,063,862.93
第二层次	60,611,676.05	32,870,786.30
第三层次	-	233,322.94
合计	267,908,759.78	411,167,972.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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资产和负债主要包括银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	207,297,083.73	42.37
	其中：股票	207,297,083.73	42.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,611,676.05	12.39
	其中：债券	60,611,676.05	12.39
	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	220,997,107.25	45.17
8	其他各项资产	365,139.40	0.07
9	合计	489,271,006.43	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

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	1,773,600.00	0.37
B	采矿业	643,542.00	0.13
C	制造业	140,857,943.73	29.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	518,410.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,244,300.00	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,857,394.00	0.38
H	住宿和餐饮业	1,428,555.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,730,200.65	3.24
J	金融业	1,420,000.00	0.29
K	房地产业	32,885,894.00	6.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,917,069.90	0.81

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	20,174.45	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	207,297,083.73	42.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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	600048	保利发展	1,200,000	15,636,000.00	3.22
2	000858	五粮液	90,000	14,721,300.00	3.04
3	600383	金地集团	1,800,000	12,978,000.00	2.68
4	600519	贵州茅台	6,800	11,498,800.00	2.37
5	002475	立讯精密	220,500	7,155,225.00	1.48
6	000568	泸州老窖	30,000	6,287,100.00	1.30
7	600887	伊利股份	200,000	5,664,000.00	1.17
8	300274	阳光电源	46,800	5,458,284.00	1.13
9	600588	用友网络	264,200	5,416,100.00	1.12
10	002384	东山精密	200,000	5,180,000.00	1.07
11	300750	宁德时代	22,040	5,042,531.60	1.04
12	000002	万科 A	304,700	4,271,894.00	0.88
13	002459	晶澳科技	100,000	4,170,000.00	0.86
14	002007	华兰生物	171,600	3,845,556.00	0.79
15	603338	浙江鼎力	60,000	3,360,600.00	0.69
16	600031	三一重工	200,000	3,326,000.00	0.69
17	000333	美的集团	50,000	2,946,000.00	0.61
18	000651	格力电器	80,000	2,920,800.00	0.60
19	600760	中航沈飞	63,560	2,860,200.00	0.59
20	603197	保隆科技	50,000	2,712,500.00	0.56
21	603883	老百姓	88,000	2,626,800.00	0.54
22	002594	比亚迪	10,000	2,582,700.00	0.53
23	300450	先导智能	71,000	2,568,070.00	0.53
24	688223	晶科能源	170,047	2,390,860.82	0.49
25	600570	恒生电子	53,808	2,383,156.32	0.49
26	000060	中金岭南	491,700	2,335,575.00	0.48

27	000596	古井贡酒	9,400	2,325,372.00	0.48
28	002727	一心堂	86,600	2,286,240.00	0.47
29	603259	药明康德	36,600	2,280,546.00	0.47
30	603348	文灿股份	51,500	2,256,215.00	0.47
31	300122	智飞生物	50,850	2,247,570.00	0.46
32	688032	禾迈股份	6,152	2,184,882.80	0.45
33	001269	欧晶科技	28,000	2,058,840.00	0.42
34	301327	华宝新能	23,878	1,888,988.58	0.39
35	000960	锡业股份	120,000	1,866,000.00	0.38
36	300972	万辰生物	40,000	1,773,600.00	0.37
37	600584	长电科技	54,900	1,711,233.00	0.35
38	301235	华康医疗	50,300	1,600,546.00	0.33
39	002850	科达利	12,000	1,587,000.00	0.33
40	002223	鱼跃医疗	42,300	1,522,377.00	0.31
41	688111	金山办公	3,138	1,481,826.36	0.31
42	600161	天坛生物	53,700	1,457,955.00	0.30
43	301073	君亭酒店	39,300	1,428,555.00	0.29
44	603611	诺力股份	54,100	1,424,994.00	0.29
45	300059	东方财富	100,000	1,420,000.00	0.29
46	688507	索辰科技	10,435	1,363,124.05	0.28
47	002352	顺丰控股	30,000	1,352,700.00	0.28
48	603939	益丰药房	35,980	1,331,260.00	0.27
49	002906	华阳集团	38,900	1,329,991.00	0.27
50	300751	迈为股份	7,520	1,273,737.60	0.26
51	301013	利和兴	80,000	1,144,000.00	0.24
52	603876	鼎胜新材	59,580	1,143,340.20	0.24
53	600600	青岛啤酒	10,000	1,036,300.00	0.21
54	300776	帝尔激光	15,200	986,480.00	0.20
55	605089	味知香	24,840	976,212.00	0.20
56	601877	正泰电器	33,600	929,040.00	0.19
57	300613	富瀚微	16,300	924,862.00	0.19
58	002990	盛视科技	24,000	883,200.00	0.18
59	688256	寒武纪	4,449	836,412.00	0.17
60	002991	甘源食品	10,500	805,350.00	0.17
61	300415	伊之密	39,900	766,080.00	0.16
62	300850	新强联	18,300	684,054.00	0.14
63	601899	紫金矿业	56,600	643,542.00	0.13
64	603612	索通发展	37,000	641,210.00	0.13
65	003025	思进智能	37,380	603,687.00	0.12
66	300445	康斯特	37,100	588,035.00	0.12
67	002698	博实股份	31,600	552,684.00	0.11
68	300532	今天国际	26,400	542,784.00	0.11
69	000733	振华科技	5,600	536,760.00	0.11

70	000811	冰轮环境	33,800	532,688.00	0.11
71	600862	中航高科	20,900	528,979.00	0.11
72	600900	长江电力	23,500	518,410.00	0.11
73	300775	三角防务	15,200	513,456.00	0.11
74	002929	润建股份	11,800	512,238.00	0.11
75	600522	中天科技	32,100	510,711.00	0.11
76	688633	星球石墨	11,487	509,907.93	0.11
77	603187	海容冷链	25,340	506,546.60	0.10
78	603128	华贸物流	55,400	504,694.00	0.10
79	300908	仲景食品	11,100	503,385.00	0.10
80	600131	国网信通	24,600	496,674.00	0.10
81	605123	派克新材	4,500	488,925.00	0.10
82	688066	航天宏图	7,980	485,982.00	0.10
83	603283	赛腾股份	10,500	467,250.00	0.10
84	000021	深科技	20,200	403,798.00	0.08
85	002429	兆驰股份	73,200	402,600.00	0.08
86	002156	通富微电	17,800	402,280.00	0.08
87	603986	兆易创新	3,700	393,125.00	0.08
88	301308	江波龙	3,700	376,512.00	0.08
89	688521	芯原股份	5,126	368,661.92	0.08
90	688123	聚辰股份	5,362	288,046.64	0.06
91	300001	特锐德	11,997	249,297.66	0.05
92	301165	锐捷网络	431	26,601.32	0.01
93	688348	昱能科技	112	21,036.96	0.00
94	301391	卡莱特	173	20,270.41	0.00
95	301267	华夏眼科	331	20,174.45	0.00
96	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
97	301389	隆扬电子	1,026	18,652.68	0.00
98	301230	泓博医药	377	16,927.30	0.00
99	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
100	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
101	301377	鼎泰高科	626	14,398.00	0.00
102	301223	中荣股份	764	14,302.08	0.00
103	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
104	301379	天山电子	449	12,540.57	0.00
105	301365	矩阵股份	698	11,489.08	0.00
106	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
107	301335	天元宠物	470	11,204.80	0.00
108	301356	天振股份	497	10,884.30	0.00
109	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
110	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
111	688105	诺唯赞	248	7,561.52	0.00
112	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00

113	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
114	688197	首药控股	90	4,289.40	0.00
115	000513	丽珠集团	44	1,712.04	0.00
116	688670	金迪克	31	1,459.48	0.00
117	600557	康缘药业	20	549.20	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	300274	阳光电源	20,597,778.00	4.29
2	000858	五粮液	17,031,830.00	3.55
3	301327	华宝新能	16,807,320.42	3.50
4	600048	保利发展	15,932,633.00	3.32
5	600383	金地集团	14,260,397.66	2.97
6	600519	贵州茅台	14,243,352.00	2.97
7	002230	科大讯飞	14,130,614.00	2.95
8	002475	立讯精密	13,514,052.00	2.82
9	601633	长城汽车	12,322,099.00	2.57
10	000568	泸州老窖	12,113,483.00	2.52
11	605117	德业股份	11,275,721.00	2.35
12	002384	东山精密	11,138,420.00	2.32
13	688032	禾迈股份	10,331,655.42	2.15
14	000333	美的集团	9,931,732.00	2.07
15	002459	晶澳科技	9,660,335.00	2.01
16	600887	伊利股份	9,643,276.00	2.01
17	300724	捷佳伟创	8,334,919.00	1.74
18	300059	东方财富	7,270,083.00	1.52
19	002304	洋河股份	7,256,094.00	1.51
20	002992	宝明科技	6,471,396.00	1.35

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

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	300274	阳光电源	26,446,916.88	5.51
2	601166	兴业银行	23,463,640.20	4.89
3	002594	比亚迪	19,572,149.00	4.08

4	600104	上汽集团	17,831,196.30	3.72
5	002230	科大讯飞	15,651,240.00	3.26
6	600276	恒瑞医药	14,814,392.44	3.09
7	000651	格力电器	14,631,197.00	3.05
8	601318	中国平安	14,039,479.06	2.93
9	301327	华宝新能	13,298,682.22	2.77
10	002624	完美世界	12,532,244.00	2.61
11	000975	银泰黄金	11,978,373.20	2.50
12	601633	长城汽车	11,928,292.00	2.49
13	605117	德业股份	11,188,049.00	2.33
14	002415	海康威视	11,096,057.16	2.31
15	300014	亿纬锂能	10,719,882.59	2.23
16	300750	宁德时代	10,698,541.92	2.23
17	600048	保利发展	10,434,535.00	2.17
18	300724	捷佳伟创	10,239,597.00	2.13
19	600887	伊利股份	9,519,468.00	1.98
20	600383	金地集团	9,490,056.00	1.98

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

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	633,790,013.46
卖出股票收入（成交）总额	835,199,272.73

注：本项“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	30,326,282.61	6.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,285,393.44	6.25
	其中：政策性金融债	30,285,393.44	6.25
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	60,611,676.05	12.50

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

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	220025	22 付息国债 25	300,000	30,326,282.61	6.25
2	230301	23 进出 01	300,000	30,285,393.44	6.25

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

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

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

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

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金持有的东山精密(占本基金资产净值的比例为 1.07%)因企业食堂涉嫌安排未取得健康证明的人员从事直接入口食品的工作和超出许可经营范围经营食品,东莞市市场监督管理局于 2022 年 7 月 26 日对公司予以警告,没收违法所得 1260 元并处罚款 5000 元。

公司将持续关注上述公司的动态,积极维护基金份额持有人利益。

本基金投资的前十名证券中的其余证券的发行主体本期未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、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	361,589.58
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,549.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	365,139.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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)	人均持有的 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
23,408	15,467.60	953,733.12	0.26%	361,111,784.57	99.74%

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	76,329.96	0.0211%

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的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年7月11日）基金份额总额	7,238,122,974.81
本报告期期初基金份额总额	377,870,339.85
本报告期基金总申购份额	1,110,456.97
减：本报告期基金总赎回份额	16,915,279.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	362,065,517.69

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人

公司总经理助理发生变更：

经益民基金管理有限公司第四届董事会第二十二次会议审议通过，王峰先生于2023年5月29日辞去公司总经理助理职务。

公司财务负责人发生变更：

经益民基金管理有限公司第四届董事会第二十一次会议审议通过，副总经理李静女士于2023年5月5日正式担任财务负责人职务。

公司董事长发生变更：

经益民基金管理有限公司第四届董事会第二十一次会议审议通过，党均章先生于2023年4月27日辞去公司董事长职务。

经益民基金管理有限公司第四届董事会第二十一次会议审议通过，总经理王明德先生于 2023 年 4 月 27 日代任公司董事长职务。

基金托管人：

无。

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

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	179,454,356.82	12.22%	162,455.32	11.92%	
海通证券	2	177,216,701.80	12.06%	165,041.92	12.11%	
国联证券	1	159,055,562.16	10.83%	148,127.87	10.86%	
中银国际	1	138,231,134.13	9.41%	128,732.97	9.44%	
国都证券	1	125,937,783.89	8.57%	117,286.11	8.60%	
中信证券 (沪深)	2	121,384,522.49	8.26%	113,045.32	8.29%	
华创证券	1	120,008,805.88	8.17%	111,765.72	8.20%	

东北证券	1	115,582,568.75	7.87%	107,641.57	7.90%	
兴业证券	1	68,307,783.60	4.65%	63,614.32	4.67%	
申万宏源	1	52,954,414.86	3.60%	49,316.01	3.62%	
光大证券	2	52,616,139.97	3.58%	49,002.44	3.59%	
中金公司	2	51,030,957.52	3.47%	47,525.38	3.49%	
广发证券	1	29,650,462.00	2.02%	27,614.01	2.03%	
银河证券	2	27,544,657.95	1.88%	25,652.37	1.88%	
中信建投 (沪深)	2	24,597,350.05	1.67%	22,907.74	1.68%	
东方证券	1	19,521,670.63	1.33%	18,180.59	1.33%	
首创证券	1	5,894,413.69	0.40%	5,489.52	0.40%	
广州证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
国金证券 (沪深)	2	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
中投证券	1	-	-	-	-	
山西证券	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
太平洋证 券	1	-	-	-	-	
民族证券	1	-	-	-	-	
民生证券 (沪深)	2	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	
浙商证券	1	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

(一)财务状况良好，经营稳健，资本充足；经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构处罚；主要股东实力强大；

(二)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；

(三)有固定的研究机构和足够数量的专职研究人员，研究覆盖面广，能涵盖宏观、行业、个股、债券、策略等各项领域；

(四)具备较强的服务意识，能够主动提供市场信息、路演、外部专家交流、联合调研机会等，并根

据公司特点要求，提供专题研究报告。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(一)根据上述选择标准，确定选用其交易单元的券商。

(二)本公司与被选用的券商签订交易单元租用协议。

3、新增租用首创证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	益民基金管理有限公司 2022 年 12 月 31 日基金净值公告	公司官网	2023 年 1 月 1 日
2	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、公司官网	2023 年 1 月 20 日
3	益民创新优势混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
4	益民基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份基金信息的公告	公司官网	2023 年 2 月 10 日
5	益民基金管理有限公司公募风险等级划分结果说明	公司官网	2023 年 2 月 28 日
6	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	《证券时报》、公司官网	2023 年 3 月 30 日
7	益民创新优势混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
8	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、公司官网	2023 年 4 月 21 日
9	益民创新优势混合证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
10	益民基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
11	益民基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 6 日
12	益民基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 19 日
13	益民基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 30 日

14	益民基金管理有限公司关于旗下基金泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 12 日
15	益民基金管理有限公司关于旗下基金济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 13 日
16	益民基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东方证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 26 日
17	益民基金管理有限公司关于终止爱建证券有限责任公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》、公司官网、证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%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、中国证监会批准设立益民创新优势混合型证券投资基金的文件；
- 2、益民创新优势混合型证券投资基金基金合同；
- 3、益民创新优势混合型证券投资基金托管协议；
- 4、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人益民基金管理有限公司。

咨询电话：(86)010-63105559 4006508808

公司传真：(86)010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日