

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：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：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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
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	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	61

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银品牌蓝筹混合
基金主代码	690001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 17 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	175,990,177.84 份
基金合同存续期	不定期

注：原民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金于 2009 年 3 月 27 日成立，后经《关于准予民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2020]3089 号）变更注册并实施转型，新的基金合同于 2021 年 3 月 17 日生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，并重点投资于具有品牌优势的蓝筹企业，在充分控制基金资产风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、普通债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略等，详见基金合同或招募说明书。</p> <p>本基金主要对国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势等进行综合分析，采用定量和定性相结合的研究方法，确定本基金在股票、债券等各类资产的投资比例。</p> <p>本基金将基于宏观环境等因素，重点考虑以沪深 300 成份指数为样本的权益市场平均估值水平（PE）等因素，在不同阶段对基金产品的股票仓位进行分段控制，并在此基础上进行权益资产的投资操作。</p> <p>本基金将积极关注、深入分析并论证蓝筹股企业的投资机会，通过综合分析行业空间、行业地位、竞争格局、产品竞争力、盈利能力多方面因素，去选择细分领域的龙头公司或具备成长为优质公司潜力的企业进行投资，分享企业长期增长带来的收益率。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。

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	王小飞
	联系电话	010-68960037	021-60637103

电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-8888-388	021-60637228
传真	0755-23999800	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518038	100033
法定代表人	张焕南	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-45,065,186.83
本期利润	-43,892,016.11
加权平均基金份额本期利润	-0.3294
本期加权平均净值利润率	-14.02%
本期基金份额净值增长率	-7.38%
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	180,495,138.36
期末可供分配基金份额利润	1.0256
期末基金资产净值	356,485,316.20
期末基金份额净值	2.0256
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	-18.30%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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

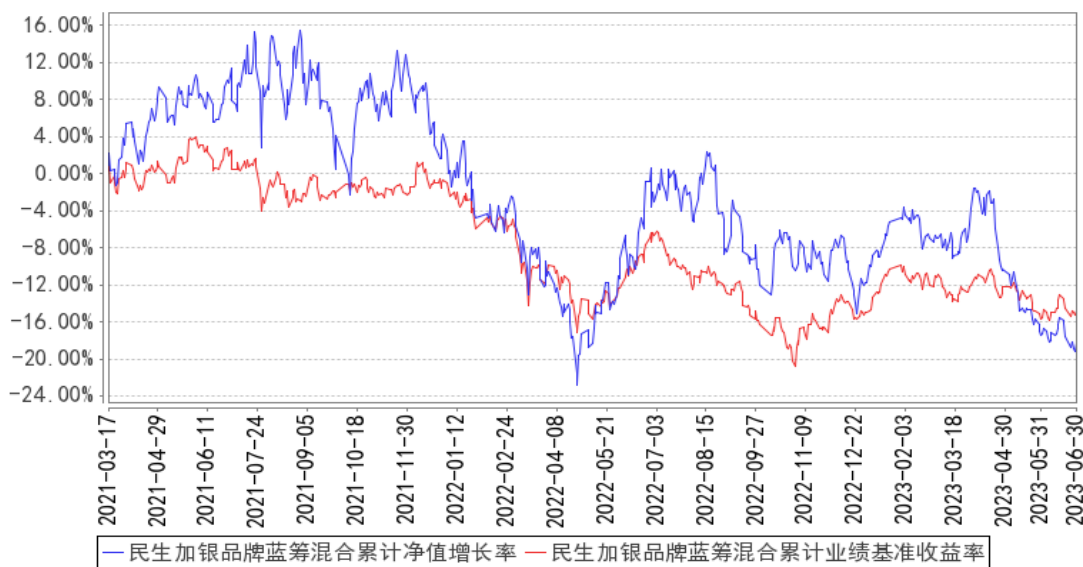
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.11%	0.81%	0.95%	0.61%	-2.06%	0.20%
过去三个月	-15.19%	1.07%	-3.18%	0.58%	-12.01%	0.49%
过去六个月	-7.38%	1.03%	0.20%	0.59%	-7.58%	0.44%
过去一年	-16.66%	1.19%	-9.04%	0.69%	-7.62%	0.50%
自基金合同生效起至今	-18.30%	1.48%	-14.81%	0.78%	-3.49%	0.70%

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

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

民生加银品牌蓝筹混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金为转型基金，转型后合同于 2021 年 3 月 17 日生效。

§ 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：2023年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理98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、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、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、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银科技创新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）、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、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、民生加银金融优选混合型证券投资基金、民生加银月月乐 30 天持有期短债债券型证券投资基金、民生加银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金、民生加银瑞丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银恒宁债券型证券投资基金、民生加银瑞华绿色债券一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银均衡优选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
芮定坤	本基金的基金经理	2021 年 12 月 6 日	-	12 年	清华大学经济管理学院国际工商管理专业硕士，12 年证券从业经历。自 2008 年 7 月至 2011 年 2 月在中国中投证券有限责任公司任分析师；自 2011 年 2 月至 2011 年 7 月在泰达宏利基金管理有限公司研究部任研究员；自 2011 年 7 月至 2015 年 1 月

					在嘉实基金管理有限公司任分析师。2018年4月加入民生加银基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理，现任基金经理。自2021年12月至今担任民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自2022年12月至今担任民生加银周期优选混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 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

上半年市场波动较大，1季度总的来说市场的机会多于去年，市场以终局思维看好疫情后的经济修复，在这个思路下收益的顺周期板块和消费都有一定表现，人工智能的催化3月开始科技成长板块表现较好。我们主要布局了一些顺周期和底部未来有望改善的板块，持仓均衡，获得了一定收益。

2季度开始顺周期调整较大，我们也有一定幅度的回撤。主要因为4、5月部分经济数据相对较为平淡，同时市场担心长期地产销售下滑后对整体经济的影响。和经济弱相关的农业、火电也

有相对收益。2 季度主要的行情集中在以 AI、机器人为代表的科技方向，行业有比较多的催化事件。

操作上我们聚焦在制造业和顺周期，均衡配置。基金仓位上保持中高水平，通过行业比较选出好赛道，同时精选个股，考虑到估值和增长的匹配，在成长投资的基础上更注重投资的“质量”，注重估值的安全边际，在周期类投资上更注意逆向和买入的位置，通过这两者的结合保证组合的低回撤，也保持对市场弹性的跟踪和敏感。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.0256 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.38%，业绩比较基准收益率为 0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场总体上表现并不好，反映了背后对于经济结构性调整的担心，以及中美关系的担心。我们认为要客观的从长期视角看待这些担心，第一个问题关于结构调整，阶段性地产的比重下滑可能会对部分制造业有一定影响，但这个下滑是个长期的过程，不需要长期问题短期化，同时也要看到结构调整中很多地产以外的制造业有升级的空间、走出去出口的空间，优秀的企业有成长的韧性。第二个中美关系其实也是合作和竞争长期共存，彼此都有优势的地方，影响也没有那么大，长期看我们也相信中国在高科技领域的突破和发展。

中国经济仍然是有相对优势的，这种相对优势来源于供应链、资源和资本的有效管理。中国粮食自给自足，煤、火电、水电占能源的比例高，通胀压力远小于海外。中国拥有完整的上中下游产业集群，供应链保障能力也非常强，这是保证我们增长和经济健康的重要基础。展望明年如果美国进入降息周期，从资金面来说也有利于证券市场。

成长的路上总是有困难，但我们对中国经济有信心，对国家强有力的管理能力、效率有信心，对中长期财富转移资本市场壮大做大有信心，把客户利益放在第一位是我们始终牢记的信念。本基金将继续勤勉努力，注重质量注重长期，控制回撤，力争为持有人实现稳定的盈利，谢谢大家的信任。

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，本基金于 2023-03-30 进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 3.9780 元，共计派发红利 69,810,540.78 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本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：民生加银品牌蓝筹灵活配置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	94,184,755.32	11,485,727.45
结算备付金		3,442,468.94	1,058,194.52
存出保证金		405,525.48	195,809.05
交易性金融资产	6.4.7.2	285,303,266.88	109,753,189.92
其中：股票投资		285,303,266.88	109,549,148.00
基金投资		-	-
债券投资		-	204,041.92
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		-	2,450,166.16
应收股利		-	-
应收申购款		10,755.00	6,194.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		383,346,771.62	124,949,281.42
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		22,559,298.41	3,440,956.16
应付赎回款		32,310.34	27,595.87
应付管理人报酬		447,393.29	154,841.89
应付托管费		74,565.54	25,806.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,327,334.12	1,327,334.12
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,420,553.72	708,159.87
负债合计		26,861,455.42	5,684,694.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	175,990,177.84	46,526,266.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	180,495,138.36	72,738,320.51
净资产合计		356,485,316.20	119,264,586.52
负债和净资产总计		383,346,771.62	124,949,281.42

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0256 元，基金份额总额 175,990,177.84 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银品牌蓝筹灵活配置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		-41,144,741.08	-8,892,556.05
1. 利息收入		115,295.76	45,148.01
其中：存款利息收入	6.4.7.13	115,295.76	45,148.01
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）		-42,503,717.04	-7,880,263.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-44,549,940.19	-8,451,031.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-175.92	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,046,399.07	570,768.18
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）	6.4.7.20	1,173,170.72	-1,084,181.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	70,509.48	26,740.76
减：二、营业总支出		2,747,275.03	1,149,950.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,285,523.17	916,583.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	380,920.51	152,763.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	80,831.35	80,603.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-43,892,016.11	-10,042,506.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-43,892,016.11	-10,042,506.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-43,892,016.11	-10,042,506.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银品牌蓝筹灵活配置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）	46,526,266.01	-	72,738,320.51	119,264,586.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期 初 净 资 产(基 金 净 值)	46,526,266.01	-	72,738,320.51	119,264,586.52
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	129,463,911.83	-	107,756,817.85	237,220,729.68
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-43,892,016.11	-43,892,016.11
(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)	129,463,911.83	-	221,459,374.74	350,923,286.57
其中:1. 基 金 申 购 款	137,533,955.64	-	231,746,892.69	369,280,848.33
2 .基 金 赎 回 款	-8,070,043.81	-	-10,287,517.95	-18,357,561.76
(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)	-	-	-69,810,540.78	-69,810,540.78
(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)	175,990,177.84	-	180,495,138.36	356,485,316.20
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)	46,931,031.92	-	95,218,181.87	142,149,213.79
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)	46,931,031.92	-	95,218,181.87	142,149,213.79
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-1,238,799.21	-	-10,735,921.90	-11,974,721.11
(一)、 综合收 益总额	-	-	-10,042,506.86	-10,042,506.86
(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)	-1,238,799.21	-	-693,415.04	-1,932,214.25

其中:1. 基金申购款	5,048,960.35	-	8,349,944.17	13,398,904.52
2 .基金赎回款	-6,287,759.56	-	-9,043,359.21	-15,331,118.77
(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)	45,692,232.71	-	84,482,259.97	130,174,492.68

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：

郑智军

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

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金（股票资产占基金资产的比例为 0%-95%）（以下简称“本基金”），由民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金（股票资产占基金资产的比例为 30%-80%）转型而来。民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]76 号《关于准予民生加银新品牌蓝筹灵活

配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开发行募集，首次设立募集规模为 2,718,576,495.31 份基金份额。原《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 27 日生效。转型后的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定。转型后的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2021 年 3 月 16 日表决通过了《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据中国证监会 2020 年 11 月 17 日证监许可[2020]3089 号文《关于准予民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》及民生加银基金管理有限公司 2021 年 3 月 17 日发布的《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2021 年 3 月 17 日起，“民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金”（股票资产占基金资产的比例为 30%-80%）正式转型为“民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金”（股票资产占基金资产的比例为 0%-95%），转型后的《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、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、分离交易可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的 80%，本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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×70%+上证国债指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 经国务院批准, 自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定, 本基金运营过程中发生的增值税应税行为, 以本基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	94,184,755.32

等于：本金	94,176,809.52
加：应计利息	7,945.80
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	94,184,755.32

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	286,561,405.12	-	285,303,266.88	-1,258,138.24
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	286,561,405.12	-	285,303,266.88	-1,258,138.24

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：本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,341,201.50
其中：交易所市场	2,341,201.50
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	2,420,553.72

6.4.7.10 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	46,526,266.01	46,526,266.01
本期申购	137,533,955.64	137,533,955.64
本期赎回（以“-”号填列）	-8,070,043.81	-8,070,043.81
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	175,990,177.84	175,990,177.84

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

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
上年度末	98,825,369.38	-26,087,048.87	72,738,320.51
本期利润	-45,065,186.83	1,173,170.72	-43,892,016.11
本期基金份额交易产生的变动数	282,125,259.40	-60,665,884.66	221,459,374.74
其中：基金申购款	296,074,501.51	-64,327,608.82	231,746,892.69
基金赎回款	-13,949,242.11	3,661,724.16	-10,287,517.95
本期已分配利润	-69,810,540.78	-	-69,810,540.78
本期末	266,074,901.17	-85,579,762.81	180,495,138.36

6.4.7.13 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
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	20,667.75
其他	2,097.85
合计	115,295.76

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 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	-44,549,940.19
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	-44,549,940.19

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	2,164,268,671.73
减：卖出股票成本总额	2,202,870,883.97
减：交易费用	5,947,727.95
买卖股票差价收入	-44,549,940.19

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 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	138.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-314.00
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	-175.92

6.4.7.15.2 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	204,200.00

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,314.00
减：应计利息总额	4,200.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-314.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 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	2,046,399.07
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	2,046,399.07

6.4.7.20 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	1,173,170.72
股票投资	1,172,836.72
债券投资	334.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,173,170.72

6.4.7.21 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	70,492.77
基金转换费收入	16.71
合计	70,509.48

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,488.19
合计	80,831.35

6.4.7.24 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 权证交易

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

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本期及上年度可比期间均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 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	2,285,523.17	916,583.35
其中：支付销售机构的客户维护费	191,162.42	197,465.52

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	380,920.51	152,763.91

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均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及上年度可比期间均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：本基金于本期及上年度可比期间均无基金管理人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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方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 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
	中国建设银行	94,184,755.32	92,530.16	10,053,324.51

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金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

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023年3月30日	-	2023年3月30日	3.9780	56,246,136.64	13,564,404.14	69,810,540.78	-
合计	-	-	-	3.9780	56,246,136.64	13,564,404.14	69,810,540.78	-

注：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（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

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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	188	2,233.44	3,951.76	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	67	1,385.56	1,707.83	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	92	1,414.96	1,368.04	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	32	1,423.36	1,263.36	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	145	5,974.00	6,190.05	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	54	3,051.00	2,858.22	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	244	8,296.00	8,522.92	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,730	70,488.60	70,488.60	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	304	7,849.28	7,849.28	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	215	12,444.20	10,571.55	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	161	11,672.50	9,405.62	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	155	7,750.00	4,760.05	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	233	7,188.05	5,505.79	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	471	14,233.62	12,010.50	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.48	25.10	174	5,478.32	4,367.40	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	426	16,243.38	13,218.78	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

		日									
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-	
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	222	5,949.60	4,955.04	-	
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	544	13,736.00	10,711.36	-	
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	202	6,532.68	6,435.72	-	
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	282	18,972.96	18,451.26	-	
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	278	5,746.26	7,275.26	-	
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	87.41	53.24	54	4,719.96	2,874.96	-	
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	214	8,358.84	8,423.04	-	
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	223	17,126.40	24,072.85	-	
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	821	12,159.01	11,272.33	-	
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	50	3,672.50	2,332.00	-	
301355	南王	2023年	6个月	新股流	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-	

	科技	6月2日		通受限							
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	95	4,750.00	4,597.05		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	134	3,185.18	5,747.26		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	67	4,815.96	6,204.20		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	104	3,507.92	3,312.40		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	400	18,464.00	14,288.00		-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	176	5,278.24	4,187.04		-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	137	7,989.84	6,214.32		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	4,325	115,391.00	115,391.00		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	481	12,833.08	12,833.08		-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	240	12,784.80	9,648.00		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	259	4,206.16	4,390.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	167	4,141.60	7,322.95		-

301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	294	8,452.50	6,179.88	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	181	3,618.19	3,058.90	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	2,208	127,313.28	127,313.28	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	246	14,184.36	14,184.36	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	471	3,099.18	3,570.18	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	175	1,813.00	2,072.00	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	155	1,807.30	1,900.30	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	56	1,454.88	1,373.68	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	159	2,830.20	2,844.51	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	120	1,908.00	2,050.80	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	167	6,037.05	6,367.71	-

		日									
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	2,394	47,544.84	43,235.64		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	706	9,996.96	11,444.26		-
688343	云天励飞	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	43.92	50.67	2,745	120,560.40	139,089.15		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	453	5,481.30	5,467.71		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	379	8,944.40	24,509.93		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	152	4,052.32	4,788.00		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	4,527	25,758.63	24,491.07		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,399	15,528.90	23,838.96		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	185	6,016.20	7,838.45		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	271	9,211.29	7,991.79		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	165	6,598.35	6,057.15		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	566	11,840.72	10,844.56		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688535	华海	2023年	6个月	新股流	35.00	51.23	105	3,675.00	5,379.15		-

	诚科	3月28日		通受限							
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	246	10,742.82	13,050.30		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	536	11,347.12	12,596.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	396	11,982.96	10,030.68		-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	137	18,604.60	16,496.17		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	89	11,196.20	10,504.67		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	375	10,027.50	15,255.00		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	884	9,883.12	12,897.56		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	95	11,958.60	8,245.05		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	269	6,800.32	8,035.03		-

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 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 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 2023 年 6 月 30 日，本基金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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均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，不得超过该证券市值的 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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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	-	204,041.92
合计	-	204,041.92

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资债券及超短期融资债券。

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不能以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产

的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及交易性债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。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 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	94,176,809.52	-	-	-	-	7,945.80	94,184,755.32
结算备付金	3,440,920.54	-	-	-	-	1,548.40	3,442,468.94
存出保证金	405,343.08	-	-	-	-	182.40	405,525.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-285,303,266.88	285,303,266.88
应收申购款	-	-	-	-	-	10,755.00	10,755.00
资产总计	98,023,073.14	-	-	-	-	-285,323,698.48	383,346,771.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,310.34	32,310.34

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	447,393.29	447,393.29
应付托管费	-	-	-	-	-	74,565.54	74,565.54
应付清算款	-	-	-	-	-	22,559,298.41	22,559,298.41
应交税费	-	-	-	-	-	1,327,334.12	1,327,334.12
其他负债	-	-	-	-	-	2,420,553.72	2,420,553.72
负债总计	-	-	-	-	-	26,861,455.42	26,861,455.42
利率敏感度缺口	98,023,073.14	-	-	-	-	-258,462,243.06	356,485,316.20
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	11,484,167.10	-	-	-	-	1,560.35	11,485,727.45
结算备付金	1,057,670.92	-	-	-	-	523.60	1,058,194.52
存出保证金	195,712.14	-	-	-	-	96.91	195,809.05
交易性金融资产	199,980.00	-	-	-	-	-109,553,209.92	109,753,189.92
应收申购款	-	-	-	-	-	6,194.32	6,194.32
应收清算款	-	-	-	-	-	2,450,166.16	2,450,166.16
资产总计	12,937,530.16	-	-	-	-	-112,011,751.26	124,949,281.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,595.87	27,595.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	154,841.89	154,841.89
应付托管费	-	-	-	-	-	25,806.99	25,806.99
应付清算款	-	-	-	-	-	3,440,956.16	3,440,956.16
应交税费	-	-	-	-	-	1,327,334.12	1,327,334.12
其他负债	-	-	-	-	-	708,159.87	708,159.87
负债总计	-	-	-	-	-	5,684,694.90	5,684,694.90
利率敏感度缺口	12,937,530.16	-	-	-	-	-106,327,056.36	119,264,586.52

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	-	18.76
	2. 市场利率上升 25 个基点	-	-18.74

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	285,303,266.88	80.03	109,549,148.00	91.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	285,303,266.88	80.03	109,549,148.00	91.85

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	21,591,016.53	7,096,550.68

	2. 本基金业绩比较 基准下降 5%	-21,591,016.53	-7,096,550.68
--	-----------------------	----------------	---------------

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	283,653,882.02	109,428,514.25
第二层次	1,649,384.86	324,675.67
第三层次	-	-
合计	285,303,266.88	109,753,189.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

§ 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	285,303,266.88	74.42
	其中：股票	285,303,266.88	74.42
2	基金投资	-	-
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	97,627,224.26	25.47
8	其他各项资产	416,280.48	0.11
9	合计	383,346,771.62	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	60,964,048.23	17.10
C	制造业	207,873,128.32	58.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	418,792.12	0.12
E	建筑业	45,629.80	0.01
F	批发和零售业	10,773,775.49	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,563,591.52	1.28
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	190,849.26	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	169,188.08	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	291,067.36	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	285,303,266.88	80.03

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	603993	洛阳钼业	4,487,700	23,919,441.00	6.71
2	600309	万华化学	221,900	19,491,696.00	5.47
3	600522	中天科技	1,108,900	17,642,599.00	4.95
4	000683	远兴能源	2,098,500	15,088,215.00	4.23
5	603979	金诚信	478,400	14,878,240.00	4.17
6	601899	紫金矿业	1,303,200	14,817,384.00	4.16
7	300443	金雷股份	412,800	14,633,760.00	4.11
8	300124	汇川技术	227,300	14,594,933.00	4.09
9	000630	铜陵有色	5,042,600	14,573,114.00	4.09
10	000960	锡业股份	936,100	14,556,355.00	4.08
11	603606	东方电缆	294,946	14,461,202.38	4.06
12	600301	华锡有色	801,100	14,379,745.00	4.03
13	600519	贵州茅台	6,400	10,822,400.00	3.04
14	000034	神州数码	395,700	10,521,663.00	2.95
15	600584	长电科技	327,600	10,211,292.00	2.86
16	688981	中芯国际	197,668	9,986,187.36	2.80
17	601168	西部矿业	689,800	7,249,798.00	2.03
18	002179	中航光电	155,800	7,065,530.00	1.98
19	688409	富创精密	64,737	7,056,333.00	1.98
20	600760	中航沈飞	116,520	5,243,400.00	1.47
21	002572	索菲亚	199,200	3,470,064.00	0.97
22	603345	安井食品	23,000	3,376,400.00	0.95
23	688099	晶晨股份	38,227	3,223,300.64	0.90
24	688383	新益昌	10,078	1,403,059.16	0.39
25	002371	北方华创	2,500	794,125.00	0.22
26	688249	晶合集成	23,940	449,808.66	0.13
27	001282	三联锻造	12,145	433,296.15	0.12

28	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.11
29	603198	迎驾贡酒	5,700	363,660.00	0.10
30	301013	利和兴	24,900	356,070.00	0.10
31	688361	中科飞测	3,786	307,325.00	0.09
32	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.08
33	688469	中芯集成	45,262	255,458.52	0.07
34	688472	阿特斯	13,981	254,844.48	0.07
35	301325	曼恩斯特	2,227	253,530.85	0.07
36	688562	航天软件	7,254	195,390.66	0.05
37	301310	鑫宏业	2,811	192,648.78	0.05
38	688576	西山科技	1,368	180,293.03	0.05
39	688582	芯动联科	3,749	173,326.90	0.05
40	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.05
41	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.04
42	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.04
43	688593	新相微	8,834	148,922.06	0.04
44	301383	天键股份	3,998	148,853.20	0.04
45	301486	致尚科技	2,454	141,497.64	0.04
46	688343	云天励飞	2,745	139,089.15	0.04
47	301291	明阳电气	4,257	138,109.38	0.04
48	688543	国科军工	2,456	137,141.80	0.04
49	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.04
50	688552	航天南湖	5,358	134,544.38	0.04
51	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.04
52	301262	海看股份	4,704	129,476.25	0.04
53	301395	仁信新材	4,806	128,224.08	0.04
54	688334	西高院	7,056	125,490.26	0.04
55	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.04
56	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.03
57	301332	德尔玛	8,202	116,746.82	0.03
58	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
59	688512	慧智微	5,659	116,167.80	0.03
60	301305	朗坤环境	5,433	112,451.45	0.03
61	301210	金杨股份	2,147	109,741.11	0.03
62	688581	安杰思	885	108,006.71	0.03
63	688570	天玛智控	3,957	104,895.72	0.03
64	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
65	301397	溯联股份	2,397	101,104.80	0.03
66	002230	科大讯飞	1,484	100,852.64	0.03
67	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.03
68	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.03
69	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.03
70	301232	飞沃科技	1,602	96,859.91	0.03

71	688539	高华科技	2,080	96,512.00	0.03
72	301323	新莱福	2,135	91,506.29	0.03
73	301170	锡南科技	2,433	89,953.72	0.03
74	688631	莱斯信息	2,686	86,732.55	0.02
75	688478	晶升股份	1,845	86,705.05	0.02
76	688623	二元科技	947	86,518.29	0.02
77	688479	友车科技	2,710	84,747.12	0.02
78	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.02
79	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.02
80	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.02
81	301202	朗威股份	3,034	78,337.88	0.02
82	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.02
83	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
84	301419	阿莱德	1,666	76,321.92	0.02
85	301317	鑫磊股份	2,775	74,644.32	0.02
86	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
87	688146	中船特气	1,670	69,794.31	0.02
88	301360	荣旗科技	670	69,085.04	0.02
89	301307	美利信	2,013	67,665.63	0.02
90	301387	光大同创	1,370	67,038.21	0.02
91	301141	中科磁业	1,449	66,304.45	0.02
92	301429	森泰股份	2,938	66,172.24	0.02
93	688535	华海诚科	1,044	62,780.22	0.02
94	688352	颀中科技	4,525	60,195.39	0.02
95	301358	湖南裕能	1,335	58,603.27	0.02
96	301260	格力博	2,323	56,857.09	0.02
97	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
98	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.02
99	688111	金山办公	113	53,360.86	0.01
100	688480	赛恩斯	1,677	51,919.92	0.01
101	688433	华曙高科	1,519	51,266.00	0.01
102	001287	中电港	1,876	50,844.40	0.01
103	301357	北方长龙	950	49,125.45	0.01
104	301246	宏源药业	1,550	48,479.35	0.01
105	301281	科源制药	1,736	45,572.96	0.01
106	688376	美埃科技	1,147	45,295.03	0.01
107	301408	华人健康	2,581	44,699.97	0.01
108	301132	满坤科技	1,518	44,614.02	0.01
109	301386	未来电器	1,751	43,845.54	0.01
110	301171	易点天下	1,936	42,785.60	0.01
111	601061	中信金属	4,703	40,727.14	0.01
112	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
113	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01

114	301306	西测测试	944	36,674.40	0.01
115	301373	凌玮科技	1,036	33,499.88	0.01
116	603135	中重科技	1,589	32,016.51	0.01
117	301439	泓淋电力	1,802	31,977.54	0.01
118	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.01
119	301322	绿通科技	539	30,107.71	0.01
120	301157	华塑科技	539	30,037.62	0.01
121	688575	亚辉龙	1,494	27,564.30	0.01
122	301318	维海德	810	27,175.50	0.01
123	603255	鼎际得	488	24,770.88	0.01
124	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
125	001339	智微智能	812	24,092.04	0.01
126	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
127	301345	涛涛车业	497	23,658.37	0.01
128	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.01
129	601065	江盐集团	1,749	23,210.82	0.01
130	603137	恒尚节能	1,198	22,974.78	0.01
131	601133	柏诚股份	1,547	22,655.02	0.01
132	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.01
133	001328	登康口腔	661	21,185.09	0.01
134	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
135	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
136	600941	中国移动	200	18,660.00	0.01
137	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
138	001360	南矿集团	914	15,646.18	0.00
139	603125	常青科技	553	15,513.33	0.00
140	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
141	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
142	001367	海森药业	318	14,299.24	0.00
143	301269	华大九天	115	14,126.60	0.00
144	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.00
145	603057	紫燕食品	549	13,796.37	0.00
146	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
147	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
148	301308	江波龙	126	12,821.76	0.00
149	301239	普瑞眼科	130	12,750.40	0.00
150	603282	亚光股份	354	12,216.54	0.00
151	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
152	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
153	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
154	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
155	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
156	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00

157	001366	播恩集团	646	9,961.32	0.00
158	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
159	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
160	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
161	301101	明月镜片	228	9,354.84	0.00
162	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
163	301215	中汽股份	1,455	9,122.85	0.00
164	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
165	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
166	300223	北京君正	100	8,831.00	0.00
167	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
168	603151	邦基科技	535	8,741.90	0.00
169	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
170	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
171	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
172	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
173	001322	箭牌家居	478	8,001.72	0.00
174	301095	广立微	96	7,934.40	0.00
175	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
176	301330	熵基科技	206	7,370.68	0.00
177	301303	真兰仪表	320	7,195.32	0.00
178	301211	亨迪药业	268	6,673.20	0.00
179	301168	通灵股份	102	6,354.60	0.00
180	301117	佳缘科技	98	6,332.76	0.00
181	688484	南芯科技	165	6,057.15	0.00
182	301217	铜冠铜箔	406	5,777.38	0.00
183	301338	凯格精机	144	5,601.60	0.00
184	301195	北路智控	120	5,587.20	0.00
185	301138	华研精机	140	5,093.20	0.00
186	301127	天源环保	491	4,816.71	0.00
187	301158	德石股份	269	4,656.39	0.00
188	301121	紫建电子	87	4,405.68	0.00
189	301179	泽宇智能	130	4,381.00	0.00
190	301130	西点药业	153	4,204.44	0.00
191	301228	实朴检测	253	3,941.74	0.00
192	301181	标榜股份	129	3,881.61	0.00
193	301221	光庭信息	64	3,573.12	0.00
194	301222	浙江恒威	121	3,563.45	0.00
195	301182	凯旺科技	149	3,422.53	0.00
196	301201	诚达药业	81	3,337.20	0.00
197	301200	大族数控	80	3,190.40	0.00
198	301100	风光股份	146	3,016.36	0.00
199	301206	三元生物	86	3,009.14	0.00

200	301190	善水科技	142	2,668.18	0.00
201	301177	迪阿股份	66	2,536.38	0.00
202	301096	百诚医药	41	2,485.01	0.00
203	301189	奥尼电子	78	2,386.02	0.00
204	300834	星辉环材	81	1,976.40	0.00
205	301196	唯科科技	46	1,561.70	0.00
206	300696	爱乐达	40	984.00	0.00
207	301199	迈赫股份	24	764.16	0.00
208	688200	华峰测控	2	306.00	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	600301	华锡有色	52,919,043.79	44.37
2	603993	洛阳钼业	51,460,021.00	43.15
3	601899	紫金矿业	50,865,002.88	42.65
4	000034	神州数码	47,413,019.58	39.75
5	601857	中国石油	46,257,881.95	38.79
6	000683	远兴能源	38,716,246.34	32.46
7	603606	东方电缆	37,756,272.04	31.66
8	002532	天山铝业	35,959,390.00	30.15
9	002179	中航光电	33,648,728.59	28.21
10	002371	北方华创	31,031,603.00	26.02
11	000063	中兴通讯	30,788,330.76	25.82
12	002100	天康生物	30,769,850.31	25.80
13	600519	贵州茅台	30,438,080.00	25.52
14	002517	恺英网络	30,078,933.28	25.22
15	000807	云铝股份	29,298,483.00	24.57
16	300124	汇川技术	28,489,443.00	23.89
17	600309	万华化学	28,033,025.00	23.50
18	300474	景嘉微	27,792,485.15	23.30
19	000960	锡业股份	27,628,521.27	23.17
20	600522	中天科技	27,618,985.00	23.16
21	600845	宝信软件	27,127,105.80	22.75
22	000733	振华科技	26,833,498.90	22.50
23	600988	赤峰黄金	26,396,926.00	22.13
24	002567	唐人神	26,086,703.82	21.87
25	603979	金诚信	25,735,041.29	21.58
26	300260	新莱应材	25,187,806.00	21.12
27	300443	金雷股份	24,685,325.00	20.70
28	002230	科大讯飞	23,423,739.76	19.64
29	300413	芒果超媒	23,094,941.00	19.36

30	000603	盛达资源	22,868,618.86	19.17
31	300604	长川科技	22,808,297.02	19.12
32	603477	巨星农牧	22,264,023.00	18.67
33	300613	富瀚微	22,135,006.70	18.56
34	002155	湖南黄金	22,024,114.56	18.47
35	000977	浪潮信息	21,660,412.00	18.16
36	000858	五粮液	21,496,150.00	18.02
37	000426	兴业银锡	20,619,315.00	17.29
38	000630	铜陵有色	19,808,414.00	16.61
39	688111	金山办公	19,682,897.32	16.50
40	601288	农业银行	19,557,497.00	16.40
41	603019	中科曙光	19,034,419.14	15.96
42	688012	中微公司	19,000,713.72	15.93
43	000568	泸州老窖	18,301,059.00	15.34
44	600547	山东黄金	17,690,515.20	14.83
45	688508	芯朋微	17,678,653.15	14.82
46	688981	中芯国际	17,456,796.00	14.64
47	002092	中泰化学	16,438,870.29	13.78
48	600705	中航产融	15,791,351.15	13.24
49	601336	新华保险	15,749,394.87	13.21
50	300031	宝通科技	15,674,774.00	13.14
51	301155	海力风电	15,555,715.00	13.04
52	603986	兆易创新	15,517,490.06	13.01
53	002555	三七互娱	15,177,856.00	12.73
54	688331	荣昌生物	14,533,655.12	12.19
55	600584	长电科技	14,481,723.25	12.14
56	300308	中际旭创	14,112,850.31	11.83
57	300379	东方通	13,848,200.00	11.61
58	300496	中科创达	13,796,270.00	11.57
59	002602	世纪华通	13,662,221.00	11.46
60	000519	中兵红箭	13,511,782.00	11.33
61	000021	深科技	13,214,251.00	11.08
62	688369	致远互联	13,097,576.44	10.98
63	600085	同仁堂	13,020,416.00	10.92
64	002223	鱼跃医疗	13,007,578.00	10.91
65	002409	雅克科技	12,869,448.43	10.79
66	603501	韦尔股份	12,798,211.15	10.73
67	002459	晶澳科技	12,709,176.20	10.66
68	600821	金开新能	12,165,722.18	10.20
69	603227	雪峰科技	11,860,152.00	9.94
70	601333	广深铁路	11,839,797.00	9.93
71	688008	澜起科技	11,532,166.63	9.67
72	001330	博纳影业	11,471,332.00	9.62

73	603000	人民网	11,371,039.00	9.53
74	301165	锐捷网络	11,156,211.28	9.35
75	300570	太辰光	11,147,978.00	9.35
76	603918	金桥信息	11,141,075.00	9.34
77	300666	江丰电子	10,997,608.00	9.22
78	301013	利和兴	10,996,442.45	9.22
79	002237	恒邦股份	10,808,960.00	9.06
80	688383	新益昌	10,589,976.80	8.88
81	601137	博威合金	9,592,905.00	8.04
82	300773	拉卡拉	9,232,485.00	7.74
83	000768	中航西飞	9,220,392.00	7.73
84	300451	创业慧康	9,105,506.16	7.63
85	601689	拓普集团	9,096,185.00	7.63
86	603259	药明康德	8,932,030.76	7.49
87	688041	海光信息	8,927,516.44	7.49
88	000596	古井贡酒	8,902,935.00	7.46
89	601360	三六零	8,849,914.00	7.42
90	603690	至纯科技	8,823,442.90	7.40
91	002916	深南电路	8,649,833.00	7.25
92	688484	南芯科技	8,628,156.60	7.23
93	603039	泛微网络	8,590,938.00	7.20
94	688292	浩瀚深度	8,586,381.31	7.20
95	688045	必易微	8,565,473.10	7.18
96	002122	汇洲智能	8,557,154.00	7.17
97	002821	凯莱英	8,334,872.04	6.99
98	600435	北方导航	7,982,538.03	6.69
99	601328	交通银行	7,901,938.00	6.63
100	601601	中国太保	7,841,860.00	6.58
101	300347	泰格医药	7,681,450.00	6.44
102	601728	中国电信	7,675,839.00	6.44
103	002343	慈文传媒	7,672,388.00	6.43
104	002603	以岭药业	7,658,947.00	6.42
105	600028	中国石化	7,632,062.00	6.40
106	300442	润泽科技	7,494,529.00	6.28
107	300990	同飞股份	7,429,618.00	6.23
108	002174	游族网络	7,410,085.00	6.21
109	601628	中国人寿	7,406,720.00	6.21
110	601168	西部矿业	7,380,292.00	6.19
111	688308	欧科亿	7,377,391.59	6.19
112	688059	华锐精密	7,376,628.22	6.19
113	688037	芯源微	7,375,234.00	6.18
114	002531	天顺风能	7,370,171.00	6.18
115	688172	燕东微	7,358,813.75	6.17

116	001282	三联锻造	7,308,046.42	6.13
117	002050	三花智控	7,299,032.00	6.12
118	688458	美芯晟	7,292,381.06	6.11
119	002919	名臣健康	7,271,801.10	6.10
120	600373	中文传媒	7,248,131.00	6.08
121	688409	富创精密	7,063,513.16	5.92
122	002938	鹏鼎控股	6,976,649.00	5.85
123	600446	金证股份	6,865,468.32	5.76
124	002558	巨人网络	6,844,491.30	5.74
125	001269	欧晶科技	6,841,727.75	5.74
126	300494	盛天网络	6,837,993.00	5.73
127	300395	菲利华	6,813,842.00	5.71
128	300738	奥飞数据	6,688,948.20	5.61
129	300133	华策影视	6,675,640.00	5.60
130	600160	巨化股份	6,662,483.00	5.59
131	002236	大华股份	6,647,040.00	5.57
132	688326	经纬恒润	6,639,008.16	5.57
133	002648	卫星化学	6,299,209.31	5.28
134	000333	美的集团	6,020,152.00	5.05
135	603198	迎驾贡酒	5,986,640.32	5.02
136	601988	中国银行	5,922,803.14	4.97
137	688256	寒武纪	5,727,808.75	4.80
138	000938	紫光股份	5,457,780.44	4.58
139	002261	拓维信息	5,354,652.00	4.49
140	600760	中航沈飞	5,274,473.00	4.42
141	300558	贝达药业	5,163,399.00	4.33
142	002643	万润股份	5,114,489.00	4.29
143	300936	中英科技	4,965,450.00	4.16
144	600141	兴发集团	4,701,238.00	3.94
145	002123	梦网科技	4,697,524.00	3.94
146	300502	新易盛	4,616,777.00	3.87
147	603496	恒为科技	4,304,839.00	3.61
148	002624	完美世界	4,286,299.00	3.59
149	601818	光大银行	3,928,392.00	3.29
150	300927	江天化学	3,849,055.80	3.23
151	300129	泰胜风能	3,836,519.00	3.22
152	601020	华钰矿业	3,795,799.00	3.18
153	603213	镇洋发展	3,787,715.25	3.18
154	605389	长龄液压	3,768,105.20	3.16
155	688366	昊海生科	3,746,735.54	3.14
156	603051	鹿山新材	3,741,466.00	3.14
157	000776	广发证券	3,698,115.00	3.10
158	300750	宁德时代	3,677,970.00	3.08

159	002304	洋河股份	3,676,259.00	3.08
160	002939	长城证券	3,673,890.00	3.08
161	601138	工业富联	3,662,846.00	3.07
162	300274	阳光电源	3,656,810.00	3.07
163	603345	安井食品	3,646,398.00	3.06
164	688291	金橙子	3,645,407.12	3.06
165	601800	中国交建	3,642,888.00	3.05
166	688112	鼎阳科技	3,630,535.82	3.04
167	688099	晶晨股份	3,615,466.20	3.03
168	002156	通富微电	3,593,503.00	3.01
169	603893	瑞芯微	3,589,553.00	3.01
170	301191	菲菱科思	3,587,681.00	3.01
171	002572	索菲亚	3,512,870.03	2.95
172	605020	永和股份	2,883,076.00	2.42
173	688235	百济神州	2,586,624.70	2.17
174	688110	东芯股份	2,574,510.95	2.16
175	600475	华光环能	2,565,921.04	2.15
176	600277	亿利洁能	2,554,784.00	2.14
177	600502	安徽建工	2,552,774.00	2.14
178	300476	胜宏科技	2,549,370.00	2.14
179	300229	拓尔思	2,538,364.00	2.13
180	300394	天孚通信	2,536,793.00	2.13
181	300003	乐普医疗	2,472,878.00	2.07
182	601377	兴业证券	2,465,120.00	2.07
183	601633	长城汽车	2,462,661.00	2.06
184	688680	海优新材	2,459,693.52	2.06
185	688599	天合光能	2,457,335.54	2.06
186	002709	天赐材料	2,454,037.00	2.06
187	300775	三角防务	2,452,873.00	2.06
188	300696	爱乐达	2,448,826.00	2.05
189	300566	激智科技	2,431,134.00	2.04
190	688141	杰华特	2,398,062.80	2.01
191	603138	海量数据	2,388,002.88	2.00

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	601857	中国石油	49,092,401.00	41.16
2	601899	紫金矿业	42,082,024.72	35.28
3	600301	华锡有色	36,149,500.57	30.31

4	000034	神州数码	35,782,124.65	30.00
5	000063	中兴通讯	34,531,454.68	28.95
6	002532	天山铝业	32,473,931.80	27.23
7	002371	北方华创	31,545,818.00	26.45
8	000733	振华科技	29,665,639.32	24.87
9	002517	恺英网络	28,968,827.80	24.29
10	000807	云铝股份	28,858,247.32	24.20
11	002100	天康生物	28,217,578.07	23.66
12	600845	宝信软件	27,813,479.00	23.32
13	603993	洛阳钼业	27,777,035.68	23.29
14	603477	巨星农牧	27,775,840.84	23.29
15	000603	盛达资源	27,342,237.15	22.93
16	300474	景嘉微	27,119,551.55	22.74
17	600988	赤峰黄金	25,737,351.00	21.58
18	002230	科大讯飞	25,405,943.63	21.30
19	300260	新莱应材	25,306,231.53	21.22
20	002179	中航光电	24,855,245.60	20.84
21	002567	唐人神	24,623,240.00	20.65
22	688012	中微公司	24,576,032.94	20.61
23	300413	芒果超媒	24,186,737.04	20.28
24	603606	东方电缆	23,342,186.00	19.57
25	000683	远兴能源	23,251,210.44	19.50
26	688111	金山办公	22,320,470.42	18.72
27	000426	兴业银锡	21,790,662.00	18.27
28	002155	湖南黄金	21,569,064.00	18.09
29	000977	浪潮信息	21,373,213.24	17.92
30	000568	泸州老窖	21,316,784.88	17.87
31	000858	五粮液	20,713,254.00	17.37
32	300604	长川科技	20,210,709.39	16.95
33	600547	山东黄金	19,089,210.60	16.01
34	603019	中科曙光	18,995,161.00	15.93
35	601288	农业银行	18,914,095.00	15.86
36	600519	贵州茅台	18,740,919.00	15.71
37	603986	兆易创新	17,027,322.00	14.28
38	600705	中航产融	16,809,140.92	14.09
39	688508	芯朋微	16,764,712.34	14.06
40	002555	三七互娱	16,593,271.00	13.91
41	300613	富瀚微	16,538,905.30	13.87
42	002602	世纪华通	16,347,622.48	13.71
43	301155	海力风电	16,028,068.14	13.44
44	600821	金开新能	15,560,299.98	13.05
45	300031	宝通科技	15,301,379.00	12.83
46	002092	中泰化学	14,927,567.00	12.52

47	600085	同仁堂	14,890,147.00	12.48
48	000960	锡业股份	14,556,499.00	12.21
49	601336	新华保险	14,346,125.00	12.03
50	300379	东方通	14,066,735.00	11.79
51	000519	中兵红箭	13,836,622.00	11.60
52	688331	荣昌生物	13,642,465.48	11.44
53	000021	深科技	13,353,008.97	11.20
54	603979	金诚信	13,161,802.00	11.04
55	300308	中际旭创	12,728,819.64	10.67
56	603918	金桥信息	12,647,129.00	10.60
57	688369	致远互联	12,445,849.66	10.44
58	002223	鱼跃医疗	12,409,510.00	10.41
59	300443	金雷股份	12,360,072.91	10.36
60	002459	晶澳科技	12,275,109.00	10.29
61	002409	雅克科技	12,016,571.44	10.08
62	300496	中科创达	11,856,616.84	9.94
63	002237	恒邦股份	11,482,794.00	9.63
64	600522	中天科技	11,454,044.00	9.60
65	300124	汇川技术	11,445,334.00	9.60
66	300570	太辰光	11,378,695.30	9.54
67	301165	锐捷网络	11,254,803.49	9.44
68	688008	澜起科技	11,251,835.21	9.43
69	601333	广深铁路	11,057,117.00	9.27
70	603227	雪峰科技	10,915,025.83	9.15
71	603501	韦尔股份	10,695,271.00	8.97
72	002648	卫星化学	10,505,322.60	8.81
73	001330	博纳影业	10,400,927.00	8.72
74	301013	利和兴	10,259,220.00	8.60
75	603259	药明康德	10,061,103.00	8.44
76	002821	凯莱英	9,948,988.60	8.34
77	300666	江丰电子	9,869,357.00	8.28
78	603000	人民网	9,830,451.54	8.24
79	300451	创业慧康	9,091,021.50	7.62
80	000768	中航西飞	8,986,668.00	7.54
81	300494	盛天网络	8,980,910.00	7.53
82	603039	泛微网络	8,899,187.00	7.46
83	601137	博威合金	8,654,111.36	7.26
84	300773	拉卡拉	8,622,621.00	7.23
85	601360	三六零	8,603,520.00	7.21
86	688383	新益昌	8,571,840.59	7.19
87	300442	润泽科技	8,470,359.00	7.10
88	688041	海光信息	8,437,603.94	7.07
89	000596	古井贡酒	8,272,779.43	6.94

90	601689	拓普集团	8,129,201.00	6.82
91	688292	浩瀚深度	7,934,067.63	6.65
92	002919	名臣健康	7,924,084.40	6.64
93	002916	深南电路	7,904,564.00	6.63
94	600309	万华化学	7,895,136.00	6.62
95	300558	贝达药业	7,895,034.46	6.62
96	001282	三联锻造	7,886,683.00	6.61
97	002558	巨人网络	7,731,177.00	6.48
98	600435	北方导航	7,671,860.30	6.43
99	002122	汇洲智能	7,643,956.00	6.41
100	002603	以岭药业	7,629,209.00	6.40
101	603690	至纯科技	7,580,207.80	6.36
102	688981	中芯国际	7,529,144.48	6.31
103	001269	欧晶科技	7,512,187.58	6.30
104	600028	中国石化	7,510,394.00	6.30
105	601628	中国人寿	7,296,785.00	6.12
106	600446	金证股份	7,269,279.07	6.10
107	002531	天顺风能	7,259,714.00	6.09
108	000630	铜陵有色	7,249,784.00	6.08
109	688059	华锐精密	7,203,111.85	6.04
110	300990	同飞股份	7,184,320.00	6.02
111	601328	交通银行	7,136,227.00	5.98
112	688037	芯源微	7,094,719.82	5.95
113	688172	燕东微	7,090,456.83	5.95
114	002343	慈文传媒	6,977,893.00	5.85
115	688484	南芯科技	6,957,684.54	5.83
116	688308	欧科亿	6,936,152.59	5.82
117	601728	中国电信	6,911,484.00	5.80
118	688458	美芯晟	6,780,395.84	5.69
119	002050	三花智控	6,731,857.00	5.64
120	600160	巨化股份	6,686,837.00	5.61
121	300395	菲利华	6,630,606.00	5.56
122	300738	奥飞数据	6,566,883.76	5.51
123	601601	中国太保	6,542,546.00	5.49
124	688045	必易微	6,507,099.76	5.46
125	300347	泰格医药	6,437,160.90	5.40
126	600487	亨通光电	6,384,487.00	5.35
127	002174	游族网络	6,356,637.00	5.33
128	002938	鹏鼎控股	6,222,071.00	5.22
129	601988	中国银行	6,181,985.20	5.18
130	300133	华策影视	5,990,417.38	5.02
131	002304	洋河股份	5,988,484.00	5.02
132	600373	中文传媒	5,979,583.00	5.01

133	688326	经纬恒润	5,938,380.60	4.98
134	002236	大华股份	5,793,503.00	4.86
135	000333	美的集团	5,614,478.84	4.71
136	300936	中英科技	5,555,294.00	4.66
137	688256	寒武纪	5,278,905.96	4.43
138	002643	万润股份	5,276,121.00	4.42
139	002261	拓维信息	5,181,428.00	4.34
140	000938	紫光股份	5,163,134.00	4.33
141	603198	迎驾贡酒	5,035,373.95	4.22
142	002917	金奥博	4,900,194.00	4.11
143	301099	雅创电子	4,812,525.00	4.04
144	300502	新易盛	4,536,758.00	3.80
145	600141	兴发集团	4,482,776.00	3.76
146	603267	鸿远电子	4,413,337.60	3.70
147	600456	宝钛股份	4,404,028.00	3.69
148	002123	梦网科技	4,365,631.00	3.66
149	002624	完美世界	4,285,658.00	3.59
150	603496	恒为科技	4,239,800.00	3.55
151	601020	华钰矿业	4,070,941.00	3.41
152	300499	高澜股份	4,051,905.46	3.40
153	300129	泰胜风能	4,012,857.00	3.36
154	002737	葵花药业	3,982,959.00	3.34
155	002939	长城证券	3,898,169.00	3.27
156	000002	万科 A	3,864,677.00	3.24
157	300750	宁德时代	3,842,000.00	3.22
158	300927	江天化学	3,816,739.60	3.20
159	603213	镇洋发展	3,707,330.00	3.11
160	605389	长龄液压	3,703,964.00	3.11
161	002156	通富微电	3,688,318.00	3.09
162	300274	阳光电源	3,684,876.72	3.09
163	601800	中国交建	3,666,646.00	3.07
164	601818	光大银行	3,648,799.00	3.06
165	688112	鼎阳科技	3,633,386.48	3.05
166	000776	广发证券	3,608,654.00	3.03
167	603893	瑞芯微	3,519,604.00	2.95
168	688366	昊海生科	3,489,015.67	2.93
169	002180	纳思达	3,476,939.51	2.92
170	301191	菲菱科思	3,458,186.00	2.90
171	688291	金橙子	3,457,604.54	2.90
172	600584	长电科技	3,402,725.00	2.85
173	601138	工业富联	3,246,391.00	2.72
174	000933	神火股份	3,160,551.50	2.65
175	603051	鹿山新材	3,089,087.00	2.59

176	300696	爱乐达	2,947,085.00	2.47
177	300394	天孚通信	2,905,643.00	2.44
178	000636	风华高科	2,775,123.00	2.33
179	605020	永和股份	2,774,377.00	2.33
180	600502	安徽建工	2,768,060.00	2.32
181	600475	华光环能	2,732,702.60	2.29
182	601377	兴业证券	2,661,152.10	2.23
183	300229	拓尔思	2,632,919.00	2.21
184	600277	亿利洁能	2,617,436.00	2.19
185	603138	海量数据	2,572,443.03	2.16
186	002080	中材科技	2,568,923.00	2.15
187	688110	东芯股份	2,548,582.62	2.14
188	600905	三峡能源	2,465,020.00	2.07
189	688680	海优新材	2,449,941.60	2.05
190	688235	百济神州	2,446,165.91	2.05
191	600536	中国软件	2,443,245.00	2.05
192	300775	三角防务	2,436,525.00	2.04
193	002709	天赐材料	2,435,054.00	2.04
194	300003	乐普医疗	2,430,735.00	2.04
195	300476	胜宏科技	2,410,394.00	2.02
196	002046	国机精工	2,406,950.00	2.02
197	601633	长城汽车	2,399,826.00	2.01
198	688599	天合光能	2,392,236.12	2.01

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	2,377,452,166.13
卖出股票收入（成交）总额	2,164,268,671.73

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

云南锡业股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会云南监管局处罚；

除上述发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	405,525.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,755.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	416,280.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,587	38,367.16	129,563,720.86	73.62	46,426,456.98	26.38

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	47,645.70	0.0271

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 17 日） 基金份额总额	97,292,290.51
本报告期期初基金份额总额	46,526,266.01
本报告期基金总申购份额	137,533,955.64
减：本报告期基金总赎回份额	8,070,043.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	175,990,177.84

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 11 日发布公告，自 2023 年 4 月 10 日起于善辉先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其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

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	4	1,183,256,920.58	26.10	853,480.85	24.91	-
民生证券	1	1,001,756,431.77	22.10	932,953.18	27.23	-
中泰证券	2	734,712,021.58	16.21	537,298.94	15.68	-
招商证券	1	629,524,879.92	13.89	454,076.32	13.25	-
天风证券	2	317,931,555.67	7.01	166,075.13	4.85	-
申万宏源	2	248,952,139.88	5.49	179,568.65	5.24	-
中金公司	2	175,378,448.82	3.87	128,252.13	3.74	-
中信证券	3	122,530,982.93	2.70	88,381.55	2.58	-
广发证券	1	66,081,028.74	1.46	48,324.52	1.41	-
华泰证券	4	52,995,578.38	1.17	38,225.84	1.12	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证	-	-	-	-	-	-

券						
财达证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 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	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 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	-	-	-	-	-	-
平安证	-	-	-	-	-	-

券						
申港证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	关于旗下部分开放式基金增加东方证券股份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	2023 年 3 月 4 日
4	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 8 日
5	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 17 日
6	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 17 日
7	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 次分红公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 29 日
8	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
9	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
10	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 4 日

11	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
12	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
13	关于旗下部分开放式基金增加上海陆享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	2023 年 6 月 8 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230306~20230630	0.00	73,936,783.73	0.00	73,936,783.73	42.01
	2	20230302~20230305	0.00	25,791,820.19	0.00	25,791,820.19	14.66

产品特有风险

1、大额赎回风险

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

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

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

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

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

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

2、大额申购风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予基金变更注册的文件；
- (2) 《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 法律意见书；
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (7) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

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和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日