

# 益民红利成长混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告摘要

2021 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

本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。

本基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 12 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。

本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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 益民红利成长混合         |
| 基金主代码      | 560002           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2006 年 11 月 21 日 |
| 基金管理人      | 益民基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 华夏银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 585,366,763.94 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                         |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金侧重投资于具有持续高成长能力和持续高分红能力的两类公司，并且通过适度的动态资产配置和全程风险控制，为基金份额持有人实现中等风险水平下的资本利得收益和现金分红收益的最大化。                                                                |
| 投资策略   | 通过对宏观经济、政策环境、资金供求和估值水平的研究，综合判断股市和债市中长期运行趋势，确立基金的资产配置策略，决定股票、债券、现金和权证的比例；在此基础上，基金管理人采用系统化、专业化的选股流程和方法，利用益民红利股优选系统和益民成长股优选系统，精选出具有持续高分红能力和持续高成长能力的股票进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×65%+ 中证全债指数收益率×35%                                                                                                                         |
| 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，属于风险和收益中等的证券投资基金品种。                                                                                     |

### 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           | 华夏银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 康健                   | 郑鹏                   |
|         | 联系电话 | 010-63105556         | 010-85238667         |
|         | 电子邮箱 | jianchabu@ymfund.com | zhengpeng@hxb.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-650-8808         | 95577                |
| 传真      |      | 010-63100588         | 010-85238680         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ymfund.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 |

### § 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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 63,015,717.51                          |
| 本期利润          | 38,691,024.47                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0628                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 7.02%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1394                                 |
| 期末基金资产净值      | 518,751,048.09                         |
| 期末基金份额净值      | 0.8862                                 |

注：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。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

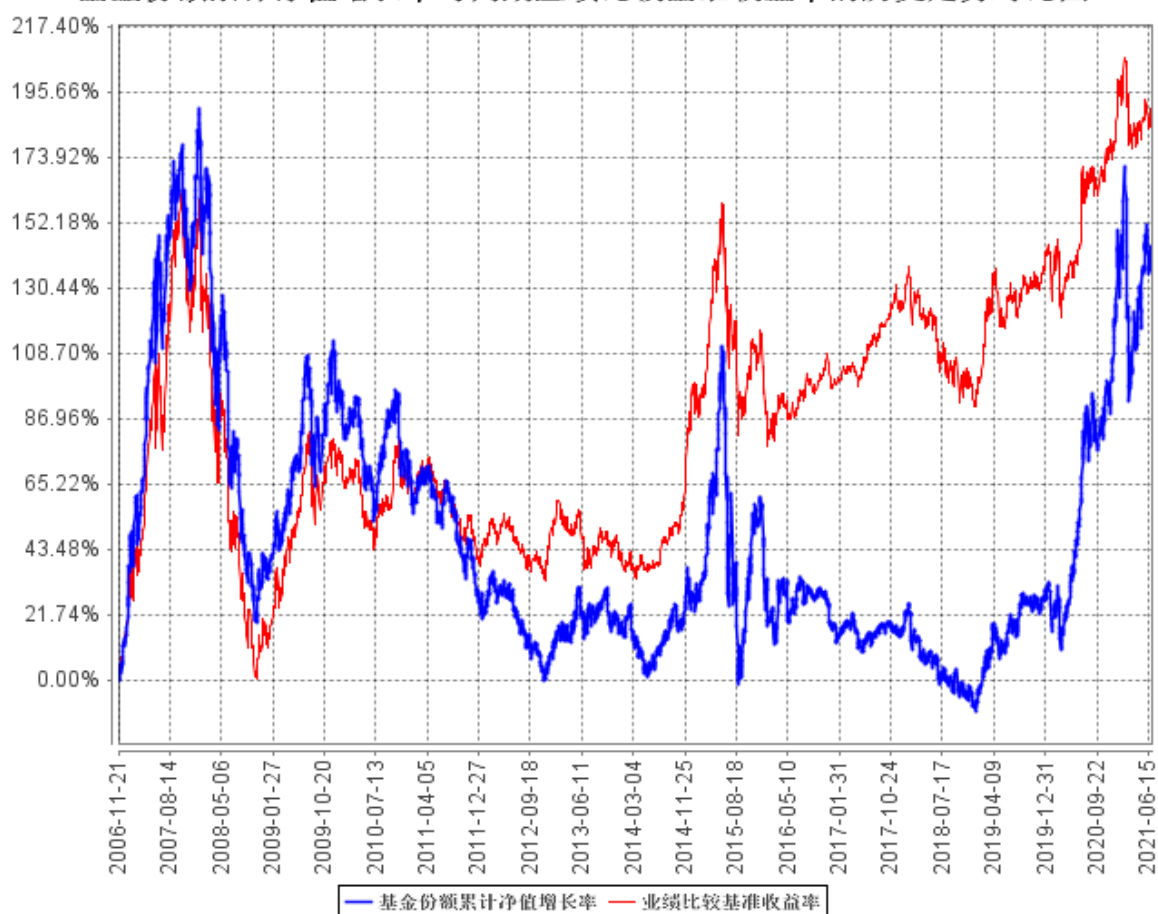
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -0.68%   | 1.57%       | -1.24%     | 0.52%         | 0.56%   | 1.05% |
| 过去三个月      | 14.96%   | 1.63%       | 2.78%      | 0.64%         | 12.18%  | 0.99% |
| 过去六个月      | 7.02%    | 2.18%       | 1.20%      | 0.86%         | 5.82%   | 1.32% |
| 过去一年       | 52.35%   | 1.87%       | 17.61%     | 0.86%         | 34.74%  | 1.01% |
| 过去三年       | 136.89%  | 1.55%       | 38.34%     | 0.88%         | 98.55%  | 0.67% |
| 自基金合同生效起至今 | 142.60%  | 1.61%       | 189.04%    | 1.20%         | -46.44% | 0.41% |

注：自 2009 年 5 月 1 日起益民红利成长混合型证券投资基金的业绩比较基准，由原来的“新华富时 A600 指数收益率×65%+新华巴克莱指数收益率×35%”变更为“沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%”。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



注：根据本基金的基金合同第十一部分“基金投资”中“八、投资组合限制”中规定，本基金自2006年11月21日合同生效之日起六个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2021 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有 6 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 吕伟 | 益民红利成长混合型证券投资基金基金经理、益民创新优势混合型证券投资基金基金经理、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015 年 6 月 25 日 | —    | 14     | 2007 年加入益民基金管理有限公司，历任交易员、研究员、交易部副总经理、交易部总经理，基金经理、主动管理事业部副总经理兼基金经理、公募基金部副总经理兼基金经理。自 2015 年 6 月 25 日起任益民红利成长混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 2 月 24 日起任益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 4 日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 4 日至 2020 年 1 月 6 日任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 理 |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|

注：此处的“任职日期”为基金合同生效日或根据公司决定确定的聘任日期，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

本基金的基金经理吕伟已于 2021 年 7 月 21 日离任，相关情况详见公司发布的临时公告。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末未存在基金经理兼任私募资产管理计划产品投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《益民红利成长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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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

2021 年上半年市场经历了大幅波动。农历春节前，市场延续了前一年的上涨态势，主要投资机会来自于大市值的行业龙头，周期、消费、新能源等领域受到追捧。春节后市场经历了快速回落期，美债收益率上行引发了市场对全球流动性收紧的担忧，对高估值板块形成了一定压制，前

期涨幅较大的龙头公司经历了快速调整。经过两个月左右的震荡调整，市场重拾上涨势头，但内部依旧分化明显。经过调整，“核心资产”交易拥挤的情况得到一定缓解，“核心资产”内部呈分化走势。市场更加青睐业绩增速高的公司，并且高业绩增速偏好进一步扩散到中小市值公司当中。在这段时间里，中小市值公司投资机会要多于大市值公司。从行业表现来看，基础化工、钢铁、电力设备及新能源涨幅领先，非银行金融、农林牧渔、家电跌幅靠前。

基金上半年保持较高仓位，行业配置方面仍以大消费和制造业为主，减持了部分新能源和电子行业持仓，增加了医药行业持仓，更多是在行业内部进行结构调整。我们的思路仍是选择中长期竞争力较强的公司，重视公司的商业模式、护城河，相比去年我们更加关注行业景气度的持续性。我们依旧认可中国消费市场的巨大潜力及制造业在全球的竞争优势，仍会以大消费及制造业为主要的投资方向。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8862 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.02%，业绩比较基准收益率为 1.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新冠疫情爆发已经一年有余，严密防控之下，国内生产生活基本恢复正常，各项经济指标已经接近甚至超过疫情水平。随着疫苗问世和全球接种率增加，即使部分国家和地区疫情仍有反复，我们相信疫情终将过去。为应对疫情全球央行都增加了货币供给，随着疫情影响逐步消退，货币正常化之路也将逐步提上日程。我们判断下半年上市公司盈利增速将逐步回落，但盈利能力还将持续改善。大宗商品价格冲击最猛烈的阶段已经过去，中游、下游行业成本压力将逐步缓解。

部分优质行业龙头个股经过年初下跌后维持横盘震荡，与此同时部分高增速、高景气的中小市值个股表现活跃。我们认为下半年大市值龙头和高景气中小市值个股都有投资机会，双方的表现将趋于平衡。我们仍然看中公司成长的确定性和稳定性，并会更加重视行业景气度，投资仍会聚焦在大消费和制造业领域。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

根据相关规定，本基金管理人成立估值委员会，估值委员会是基金估值的最高决策机构，负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、合规审计部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员应当具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验，熟悉相关法规和估值方法。

研究发展部行业研究员：研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品

种所属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

合规审计部：合规审计部参与估值流程的人员，应当对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等相关事项的合法合规性进行审核和监督，发现问题及时要求整改；参与估值流程的人员必须具有一定的会计核算估值知识和经验，应当具备熟知与估值政策相关的各项法律法规、估值原则和方法的专业能力，并有从事会计、核算、估值等方面业务的经验和工作经历。

金融工程部产品开发人员：产品开发人员负责估值相关数值的处理和计算，并参与公司对基金的估值方法的确定。该成员应当在基金的风险控制与绩效评估工作方面具有较为丰富的经验，具备基金绩效评估专业能力，并熟悉相关法规和估值方法。

运作保障部基金会计：基金会计在估值流程中的相关工作职责是按照基金会计核算准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金拥有的各类有价证券、其他资产和负债进行核算，进而确定基金资产的公允价值。参与基金长期停牌股票估值方法的确定，复核由估值委员会提供的估值价格，并与相关托管行进行核对确认。如有不符合的情况出现，立即向估值委员会反映情况，并提出合理的调整建议。基金会计人员应当与估值相关的外部机构保持良好的沟通，获悉的与基金估值相关的重大信息及时向公司及估值小组反馈。基金会计应当具备多年基金从业经验，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，具备熟悉及了解基金估值法规、政策和方法的专业能力。

## 2、基金经理参与或决定估值的程度：

基金管理公司估值委员会成员中不包括基金经理。基金经理不参与估值工作决策和执行的过程。

## 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

## 4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同所约定的收益分配原则：

#### 1、基金收益分配比例按有关规定制定；

2、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，年度收益分配比例不低于该年度已实现收益的 60%，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、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按红利发放日的基金份额净值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；

- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 6、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 7、每一基金份额享有同等分配权；
- 8、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**

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，益民红利成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2021 年中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：益民红利成长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 58,343,694.87                  | 70,151,910.53                    |
| 结算备付金           |            | 1,793,415.72                   | 1,227,904.81                     |
| 存出保证金           |            | 617,997.08                     | 1,073,435.47                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 459,026,296.34                 | 485,211,128.29                   |
| 其中：股票投资         |            | 434,571,484.34                 | 468,224,925.49                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 24,454,812.00                  | 16,986,202.80                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 3,653,386.09                   | 2,324,751.76                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 436,806.89                     | 290,232.37                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 122,611.99                     | 789,014.15                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 523,994,208.98                 | 561,068,377.38                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 2,523,783.18                   | -                                |
| 应付赎回款           |            | 598,045.62                     | 1,540,604.83                     |
| 应付管理人报酬         |            | 646,199.52                     | 655,754.02                       |
| 应付托管费           |            | 107,699.90                     | 109,292.31                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 828,567.04                     | 1,116,588.83                     |
| 应交税费            |            | 351,701.00                     | 351,701.00                       |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 187,164.63     | 276,933.52     |
| 负债合计          |          | 5,243,160.89   | 4,050,874.51   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 323,931,298.94 | 372,233,439.42 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 194,819,749.15 | 184,784,063.45 |
| 所有者权益合计       |          | 518,751,048.09 | 557,017,502.87 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 523,994,208.98 | 561,068,377.38 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8862 元，基金份额总额 585,366,763.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：益民红利成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 46,336,271.60                            | 91,146,631.45                                 |
| 1.利息收入                |            | 663,045.14                               | 342,504.86                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 353,015.79                               | 246,152.23                                    |
| 债券利息收入                |            | 310,029.35                               | 96,352.63                                     |
| 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）      |            | 69,931,252.68                            | 55,251,203.16                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 68,970,470.41                            | 54,520,109.22                                 |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -32,286.70                               | -                                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 993,068.97                               | 731,093.94                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -24,324,693.04                           | 35,547,018.00                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 66,666.82                                | 5,905.43                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 7,645,247.13                             | 7,151,692.93                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 3,877,647.48                             | 2,777,942.40                                  |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 646,274.55                               | 462,990.40                                    |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19   | 3,014,560.89  | 3,803,749.39  |
| 5. 利息支出             |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             | -             |
| 6. 税金及附加            |            | -             | -             |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20   | 106,764.21    | 107,010.74    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 38,691,024.47 | 83,994,938.52 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 38,691,024.47 | 83,994,938.52 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民红利成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                 |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|-----------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 372,233,439.42                             | 184,784,063.45 | 557,017,502.87  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 38,691,024.47  | 38,691,024.47   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -48,302,140.48                             | -28,655,338.77 | -76,957,479.25  |
| 其中：1.基金申购款                             | 39,325,724.22                              | 22,037,189.35  | 61,362,913.57   |
| 2.基金赎回款                                | -87,627,864.70                             | -50,692,528.12 | -138,320,392.82 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 323,931,298.94                             | 194,819,749.15 | 518,751,048.09  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                 |

|                                        | 实收基金           | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
|----------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 453,067,847.24 | -66,575,844.32 | 386,492,002.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 83,994,938.52  | 83,994,938.52  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -32,118,236.95 | 4,108,999.42   | -28,009,237.53 |
| 其中：1.基金申购款                             | 6,649,114.84   | -747,484.35    | 5,901,630.49   |
| 2.基金赎回款                                | -38,767,351.79 | 4,856,483.77   | -33,910,868.02 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 420,949,610.29 | 21,528,093.62  | 442,477,703.91 |

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：

康健

慕娟

慕娟

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

益民红利成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]199号《关于核准益民红利成长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于2006年10月23日至2006年11月17日向社会公开募集，基金合同于2006年11月21日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为847,591,192.06份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为益民基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

经本基金管理人和本基金托管人协商，本基金管理人于2007年7月16日对登记在册的基金份额持有人进行了基金份额拆分。本基金拆分前基金份额净值为人民币1.8071元。基金拆分日日终清算后，本基金管理人将根据基金份额拆分比例对持有人拆分登记在册的基金份额实施拆分。

拆分后，持有人基金份额数按照基金份额拆分比例相应增加，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.0000 元。拆分结果已于 2007 年 7 月 17 日进行了公告。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若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，并依据有关法律法规进行投资管理。本基金股票资产的配置比例为 40%-85%，债券、央行票据、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产的配置比例为 15%-60%，其中：本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的 3%，现金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%。本基金投资于红利股和成长股的比例不低于股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 65%+中证全债指数收益率 $\times$ 35%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。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于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年中期报告的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上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

本基金本报告期无会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更事项。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

#### 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》、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：

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

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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。

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个

人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

本报告期未有与基金发生关联交易的各关联方。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期无关联方交易。

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,877,647.48                             | 2,777,942.40                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 932,584.71                               | 646,181.84                                 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 646,274.55                            | 462,990.40                                 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

## 6.4.8.3 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。

**6.4.8.4 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****6.4.8.4.1 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**

本报告期内未发生转融通证券出借业务，无重大关联交易事项。

**6.4.8.4.2 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**

本报告期内未发生转融通证券出借业务，无重大关联交易事项。

**6.4.8.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 基金合同生效日（2006 年 11 月 21 日）持有的基金份额 | -                                     | -                                          |
| 报告期初持有的基金份额                      | 15,644,425.42                         | 15,644,425.42                              |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                     | -                                          |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                     | -                                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | -                                     | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额                      | 15,644,425.42                         | 15,644,425.42                              |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 2.6726%                               | 2.0566%                                    |

**6.4.8.5.2 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**

截至本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金份额。

**6.4.8.6 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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     |
| 华夏银行  | 58,343,694.87                         | 333,188.11 | 53,401,513.31                              | 225,462.75 |

**6.4.8.7 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。

**6.4.8.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.9 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期            | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期            | 复牌开盘单价 | 数量（股）     | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|-----------------|--------|-----------|--------------|--------------|----|
| 600811 | 东方集团 | 2021 年 6 月 30 日 | 重大资产重组 | 3.05   | 2021 年 7 月 14 日 | 3.36   | 1,012,800 | 3,773,367.00 | 3,089,040.00 | -  |

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 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。

**6.4.9.3.2 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。

**6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本报告期本基金没有转融通证券出借业务。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****6.4.10.1 以公允价值计量的金融工具****(a) 以公允价值计量的资产和负债**

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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。

本基金于资产负债表日持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 428,393,404.34 元，属于第二层次的余额为 27,543,852.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末 2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 468,224,925.49 元，属于第二层次的余额为 16,986,202.80 元，无属于第三层次的余额）。于本报告期末及上年度末，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为 3,089,040.00 元（2020 年 12 月 31 日：0.00 元）。

#### (b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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

#### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

本基金于资产负债表日未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末 2020 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.10.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.10.3 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。

## § 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              | 434,571,484.34 | 82.93         |
|    | 其中：股票             | 434,571,484.34 | 82.93         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 24,454,812.00  | 4.67          |
|    | 其中：债券             | 24,454,812.00  | 4.67          |
|    | 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      | 60,137,110.59  | 11.48         |
| 8  | 其他各项资产            | 4,830,802.05   | 0.92          |
| 9  | 合计                | 523,994,208.98 | 100.00        |

### 7.2 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         | 1,368.80       | 0.00          |
| B  | 采矿业              | 5,929.76       | 0.00          |
| C  | 制造业              | 319,964,677.34 | 61.68         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -             |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 10,383.14      | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 538.50         | 0.00          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 11,304.30      | 0.00          |
| J  | 金融业              | 39,013.65      | 0.01          |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 25,508.50      | 0.00          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 45,692,179.05  | 8.81          |
| 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   | 68,819,620.90  | 13.27 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 960.40         | 0.00  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 434,571,484.34 | 83.77 |

## 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前十名股票投资明细

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          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 603259 | 药明康德 | 291,795 | 45,692,179.05 | 8.81         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 153,115 | 45,611,427.35 | 8.79         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 21,768  | 44,770,245.60 | 8.63         |
| 4  | 600436 | 片仔癀  | 97,416  | 43,671,592.80 | 8.42         |
| 5  | 300760 | 迈瑞医疗 | 85,900  | 41,236,295.00 | 7.95         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 166,046 | 39,176,893.24 | 7.55         |
| 7  | 300015 | 爱尔眼科 | 547,675 | 38,873,971.50 | 7.49         |
| 8  | 600809 | 山西汾酒 | 86,461  | 38,734,528.00 | 7.47         |
| 9  | 300347 | 泰格医药 | 154,918 | 29,945,649.40 | 5.77         |
| 10 | 000596 | 古井贡酒 | 79,283  | 18,988,278.50 | 3.66         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的中期报告正文。

## 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  | 000799 | 酒鬼酒  | 72,638,899.01 | 13.04          |
| 2  | 002304 | 洋河股份 | 65,065,320.48 | 11.68          |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 53,672,286.76 | 9.64           |
| 4  | 600436 | 片仔癀  | 52,136,445.14 | 9.36           |
| 5  | 000661 | 长春高新 | 51,416,542.88 | 9.23           |
| 6  | 000596 | 古井贡酒 | 49,628,071.83 | 8.91           |
| 7  | 300347 | 泰格医药 | 46,407,769.66 | 8.33           |
| 8  | 603259 | 药明康德 | 45,789,220.35 | 8.22           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9  | 601888 | 中国中免 | 45,467,224.00 | 8.16 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 41,055,107.00 | 7.37 |
| 11 | 688363 | 华熙生物 | 32,047,009.67 | 5.75 |
| 12 | 300014 | 亿纬锂能 | 31,860,982.36 | 5.72 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 31,492,043.42 | 5.65 |
| 14 | 603288 | 海天味业 | 30,206,907.44 | 5.42 |
| 15 | 300015 | 爱尔眼科 | 29,958,450.38 | 5.38 |
| 16 | 300601 | 康泰生物 | 29,743,504.00 | 5.34 |
| 17 | 300999 | 金龙鱼  | 28,075,764.80 | 5.04 |
| 18 | 003022 | 联泓新科 | 21,483,243.58 | 3.86 |
| 19 | 002032 | 苏泊尔  | 19,745,313.44 | 3.54 |
| 20 | 600337 | 美克家居 | 19,388,769.00 | 3.48 |
| 21 | 002460 | 赣锋锂业 | 17,204,562.00 | 3.09 |
| 22 | 000858 | 五粮液  | 14,071,765.10 | 2.53 |
| 23 | 600132 | 重庆啤酒 | 13,485,037.00 | 2.42 |
| 24 | 603589 | 口子窖  | 12,757,438.00 | 2.29 |
| 25 | 000568 | 泸州老窖 | 12,299,159.00 | 2.21 |

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  | 000596 | 古井贡酒 | 70,222,469.71 | 12.61          |
| 2  | 000799 | 酒鬼酒  | 63,224,702.80 | 11.35          |
| 3  | 002304 | 洋河股份 | 58,881,767.55 | 10.57          |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 58,282,425.95 | 10.46          |
| 5  | 603589 | 口子窖  | 51,048,359.35 | 9.16           |
| 6  | 600438 | 通威股份 | 48,425,552.27 | 8.69           |
| 7  | 300274 | 阳光电源 | 47,284,973.73 | 8.49           |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 43,233,534.50 | 7.76           |
| 9  | 601888 | 中国中免 | 40,431,002.00 | 7.26           |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 40,012,423.68 | 7.18           |
| 11 | 603369 | 今世缘  | 39,926,953.97 | 7.17           |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 32,712,271.00 | 5.87           |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 32,290,266.00 | 5.80           |
| 14 | 688363 | 华熙生物 | 31,165,508.35 | 5.60           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 603288 | 海天味业 | 30,102,833.37 | 5.40 |
| 16 | 300014 | 亿纬锂能 | 29,891,778.73 | 5.37 |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 28,754,960.58 | 5.16 |
| 18 | 600436 | 片仔癀  | 22,608,729.00 | 4.06 |
| 19 | 300347 | 泰格医药 | 22,090,213.40 | 3.97 |
| 20 | 003022 | 联泓新科 | 21,618,004.20 | 3.88 |
| 21 | 000858 | 五粮液  | 20,269,091.00 | 3.64 |
| 22 | 002032 | 苏泊尔  | 18,730,597.00 | 3.36 |
| 23 | 300601 | 康泰生物 | 18,166,550.00 | 3.26 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 18,096,414.00 | 3.25 |
| 25 | 600337 | 美克家居 | 16,993,010.16 | 3.05 |
| 26 | 002460 | 赣锋锂业 | 15,273,509.00 | 2.74 |
| 27 | 300999 | 金龙鱼  | 15,086,561.65 | 2.71 |
| 28 | 600132 | 重庆啤酒 | 14,657,132.00 | 2.63 |
| 29 | 603259 | 药明康德 | 12,784,641.00 | 2.30 |

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 | 939,534,398.81   |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,017,916,304.03 |

### 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      | 24,454,812.00 | 4.71         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | —             | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —             | —            |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 24,454,812.00 | 4.71         |

**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  | 010107 | 21 国债(7) | 244,060 | 24,454,812.00 | 4.71         |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**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**

本基金投资的前十名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**

报告期内本基金投资的前十名股票中均在备选股票库内。

**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   | 617,997.08   |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,653,386.09 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 436,806.89   |
| 5  | 应收申购款   | 122,611.99   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 4,830,802.05 |
|---|----|--------------|

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告无处于转股期的可转换债券明细。

#### 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，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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 30,184       | 19,393.28     | 21,435,659.58 | 3.66%      | 563,931,104.36 | 96.34%     |

### 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 | 0.00      | 0.0000%  |

### 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                 |
| 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（ 2006 年 11 月 21 日 ）基金份额总额 | 847,591,192.06 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 672,652,457.68 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 71,064,443.70  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 158,350,137.44 |
| 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                      | 585,366,763.94 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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

基金管理人本报告期内不存在相关重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

### 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，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化。

### 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

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
| 申万宏源 | 2      | 323,551,528.27 | 16.53%       | 301,322.26 | 16.53%     | -  |
| 东吴证券 | 1      | 314,408,074.69 | 16.06%       | 292,808.93 | 16.06%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | 282,677,178.45 | 14.44%       | 263,258.02 | 14.44%     | -  |
| 天风证券 | 2      | 265,607,713.66 | 13.57%       | 247,359.27 | 13.57%     | -  |
| 安信证券 | 2      | 256,211,239.64 | 13.09%       | 238,604.93 | 13.09%     | -  |
| 国信证券 | 1      | 148,428,206.49 | 7.58%        | 138,231.94 | 7.58%      | -  |
| 长江证券 | 1      | 102,732,487.89 | 5.25%        | 95,673.78  | 5.25%      | -  |
| 中信证券 | 1      | 81,161,472.28  | 4.15%        | 75,585.77  | 4.15%      | -  |

|       |   |               |       |           |       |   |
|-------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 新时代证券 | 1 | 74,017,153.80 | 3.78% | 68,932.52 | 3.78% | - |
| 华泰证券  | 1 | 58,345,770.49 | 2.98% | 54,337.53 | 2.98% | - |
| 国盛证券  | 1 | 50,309,877.18 | 2.57% | 46,853.51 | 2.57% | - |
| 渤海证券  | 1 | -             | -     | -         | -     | - |
| 西南证券  | 1 | -             | -     | -         | -     | - |
| 英大证券  | 1 | -             | -     | -         | -     | - |
| 信达证券  | 1 | -             | -     | -         | -     | - |
| 五矿证券  | 1 | -             | -     | -         | -     | - |

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

（1）基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；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的处罚；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

（2）公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

（3）研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强的风险意识和风险测算能力；

（4）服务能力：具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会；或者具备某一区域的调研服务能力的优势；

（5）综合业务能力：在投资银行业务上有较强的实力，能协助本公司投资组合参与股票、债券的发行；在新产品开发方面经验丰富，能帮助公司拓展资产管理业务（如 QDII、专户等集合理财产品）；在证券创新品种开发方面处于行业前列（如交易所固定收益平台、融资融券、金融期货等）；

（6）其他因素（在某一具体方面的特别优势）。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

（1）基金的交易单元选择，投资总监、研究发展部、金融工程部、公募基金部经集体讨论后遵照上述标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的交易单元租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的交易单元以保障交易安全。必要时可要求券商提供相应证明文件；

(2) 投资总监向投资决策委员会上报拟选券商名单、相应的交易单元租用安排以及相关评选材料；

(3) 投资决策委员会审查拟选券商名单及相应的交易单元租用安排，审查通过后由总经理上报董事会，董事会如对公司管理层有相应授权的，由公司管理层依据授权内容办理；

(4) 券商名单及相应的交易单元租用安排确定后，集中交易部参照公司《证券交易单元租用协议》及《综合服务协议》范本负责协调办理正式协议签署等相关事宜。若实际签署协议与协议范本不一致的，由集中交易部将实际签署协议提交合规审计部进行合规性审核。

3、本报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

### 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 |
| 申万宏源  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东吴证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国泰君安  | 24,576,582.60 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 天风证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 新时代证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国盛证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 渤海证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西南证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 英大证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 信达证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 五矿证券  | -             | -            | -      | -              | -    | -            |

## § 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

报告期内未有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。 |
|----|

益民基金管理有限公司

2021 年 8 月 25 日