

益民核心增长灵活配置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：中国光大银行股份有限公司

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。

本基金托管人中国光大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	益民核心增长混合
基金主代码	560006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 16 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,974,934.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点挖掘在中国经济增长的宏观环境下的优势行业及具有可持续盈利能力的和增长潜力的优质上市公司，通过灵活的资产配置，在分享企业成长性的同时合理控制组合风险，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人以中国经济增长为主线，从中国宏观经济、国家政策、市场资金面和流动性、经济和产业周期、海外市场环境等各个方面展开深入研究，结合对证券市场各资产类别中长期运行趋势、风险收益特征的分析比较，确定基金大类资产配置比例和变动原则。从产业政策、行业比较、市场估值等几个方面重点分析、挖掘在中国经济发展阶段处于核心增长地位的行业，综合对行业基本面以及对符合本基金定义的增长类上市公司的研究，积极进行行业配置。自上而下同自下而上相结合，通过定性、定量分析、考虑市场情绪因素、结合研究团队的实地调研、精选具有增长潜力的个股构建股票投资组合。并通过对收益水平、信用状况和流动性风险的分析来精选个券纳入债券投资组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康健	石立平

	联系电话	010-63105556	010-63639180
	电子邮箱	jianchabu@ymfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-650-8808	95595
传真		010-63100588	010-63639132

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	2,500,543.72
本期利润	10,035,830.74
加权平均基金份额本期利润	0.3140
本期基金份额净值增长率	18.35%
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	0.8842
期末基金资产净值	67,126,461.53
期末基金份额净值	2.167

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。

3.2 基金净值表现

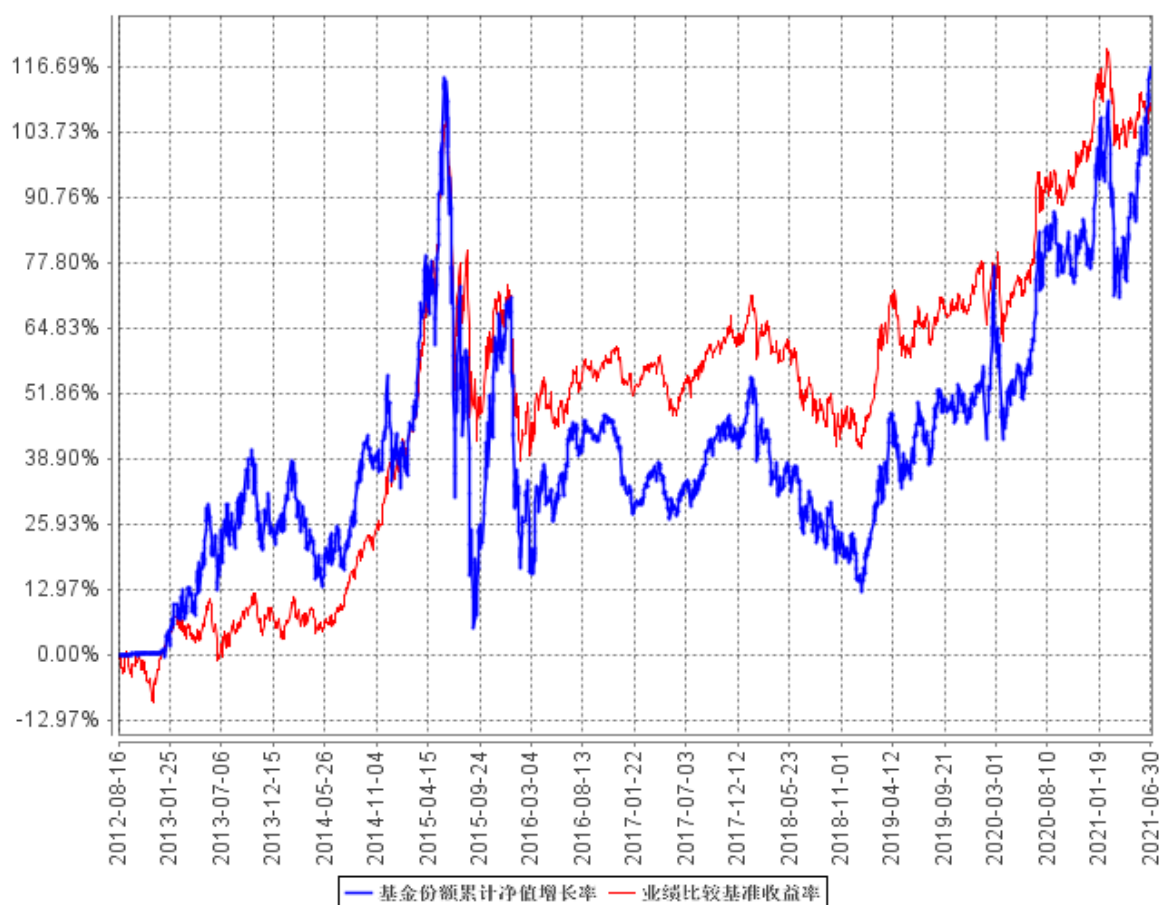
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.64%	1.32%	-1.13%	0.48%	7.77%	0.84%
过去三个月	22.15%	1.26%	2.68%	0.59%	19.47%	0.67%
过去六个月	18.35%	1.62%	1.31%	0.79%	17.04%	0.83%
过去一年	31.57%	1.39%	16.48%	0.80%	15.09%	0.59%
过去三年	67.59%	1.34%	36.72%	0.81%	30.87%	0.53%
自基金合同生效起至今	116.70%	1.53%	108.76%	0.95%	7.94%	0.58%

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证全债指数收益率”作为本基金的比较基准。

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变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 按照本基金的基金合同约定，本基金自 2012 年 8 月 16 日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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		
牛永涛	益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2020 年 1 月 2 日	-	6	曾任哈尔滨铁路局工程师，从事铁路货运编组站调速系统及信息化研究、并先后于宏源证券研究所、国家铁路局规划与标准研究院、联讯证券研究所担任交通运输行业分析师。2018 年 1 月加入益民基金管理有限公司任研究部总经理助理，2020 年 3 月起担任研究发展部副总经理兼基金经理。自 2020 年 1 月 2 日起担任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民核心增长灵活配置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

一、2021 年半年度操作总结：

2021 年上半年上证综指呈现震荡走势，最终收官 3591 点，较季初上涨 3.40%。沪深 300 指数涨幅 0.24%，创业板指涨幅 17.22%。涨幅居前的行业分别为钢铁、采掘、电力设备及新能源、电子、有色金属、化工等。核心增长基金配置较为均衡，主要围绕周期、科技、医药几个方向进行重点配置。上半年顺周期板块，重点加仓了海运、汽车、稀土、电解铝、CXO、半导体龙头、新能源车上游的钴、锂等。二季度市场顺周期有所分化，海运、钴和锂等板块继续强势。益民核心增长基金 2021 年上半年实现收益 18.35%。

二、2021 年下半年市场展望：

展望 2021 年下半年，市场仍然是结构性行情。权益市场依旧会得到重视，在改革红利、创新、全球流动性等因素的催化下，我们预计 A 股仍将整体保持长牛趋势。

从基本面来看，疫情末期的全球经济在恢复中，价格层面 PPI 等预计将在高位震荡。A 股一轮盈利周期约 13~15 个季度，归母净利增速上升时间约 5 个季度。本轮盈利周期从 2019Q1 开始，已有 6 个季度累计净利增速环比上行。疫情可能导致顺延 1~2 个季度。A 股非金融板块 21 年整体盈利有望实现 40%左右的同比增长，这是股市正收益的有力保障。

从流动性来看，各国债务高企，因此易松难紧，流动性难以实质性收缩。从全球资金流动性来看，2020 年 11 月资金开始回流风险资产。回顾历史，从时间维度来看，回流时间持续 20~30 个月。从资金量维度来看，2020 年 3 月 1.2 万亿美元进入货币基金，目前 3000 亿美元回流风险资产。展望未来，全球资金流动还在进行中，预计将成为股市上行的驱动因素。

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 2.167 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.35%，业绩比较基准收益率为 1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金合同规定，本基金重点投资方向为当前经济环境下的优势行业及具有可持续盈利能力和增长潜力的优质上市公司，侧重于投资具有垄断资源优势、规模经济、品牌、核心技术、产业整合等相关因素的持续高成长公司。结合基金合同、当前经济环境、市场投资风格，29 个一级行业的盈利增速及估值情况，筛选出如下行业作为 2021 年下半年重点投资方向：

1) 工业机器人：制造业 PMI 已连续 10 个月位于荣枯线之上，制造业景气度持续回升。疫情影响下自动化、智能化生产重要性得到凸显，去年 3 月以来工业机器人需求持续提升。长期来看，在产业升级叠加人口红利消退背景下，国内工业机器人市场潜力较大，同时工业机器人向一般工业领域渗透，产业链迎来国产化良机。

2) CXO：2021 上半年，CXO 公司股价普遍表现出色，这一轮 CXO 的上涨，内因在于国内医药审批和融资环境鼓励创新，企业研发持续高强度投入，外因是去年海外疫情严重，订单向中国加速转移。从在手订单、在建工程/固定资产/人员扩张、投融资额指标看，CXO 行业仍处于非常强劲的增长阶段。龙头公司在在手订单保障未来 3 年收入复合增速 30%以上。

我们认为，尽管上半年 CXO 公司估值提升较快，高行业景气度和业绩确定性能够消化估值因素，CXO 在医药内部细分赛道中的比较优势突出，预计会持续创出新高，我们继续看好此板块。

3) 半导体。新能源、5G、家电变频化、消费电子快充化驱动半导体市场规模持续增长。宅经

济开启线上办公以及 5G 应用。物联网应用逐渐渗透。供给端海外产能因疫情受限，同时也延缓新产能开出。8 寸晶圆产能紧张并率先开启涨价趋势，并向下游传导。旺盛的需求逐渐提升，带动晶圆代工、封测厂稼动率持续维持高位。代工、封测、存储、功率、硅片等各环节龙头厂商单月营收同比增速高企，并屡创历史同期新高，半导体行业景气度全面高涨。供应链多环节产能紧张，订单价格大多全面上涨，缺货涨价潮在全产业链已经成为普遍现象，大陆地区由于疫情控制较好，承接更多转移订单，景气度整体相对更高。年内新增产能有限，供不应求在年底之前难以看到有效缓解。明年新增产能开出可以有效缓解目前的供给紧张，但是预计仍将是供不应求，半导体仍将维持高景气度。

半导体国产替代势在必行并加速推进。设备、材料等环节国产化持续进行中，未来有望组建去美化产线。即使先进制程受限，大多数芯片基于成熟制程，成熟制程也有广阔的发展空间。国内下游厂商为了保证自身供应安全主动加入国产替代行列，为芯片厂商打开了国产替代大门，经过近两年的研发与验证，国产芯片将开始放量。后续还将加速迭代，扩大国产替代的范围。国产替代将是未来十年半导体厂商成长的强劲动力。

综上所述，2021 年下半年，继续关注顺周期板块中的军工、工业机器人、医药、半导体等业绩确定性强的龙头公司，在震荡行情中寻找确定性机会。

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：研究发展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参与基金组合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

基金收益分配原则：

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

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

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：益民核心增长灵活配置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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	14,096,253.29	14,004,405.64
结算备付金		93,725.40	401,279.50
存出保证金		23,364.32	31,466.62
交易性金融资产	6.4.7.2	53,067,919.05	43,475,949.90
其中：股票投资		53,067,919.05	43,475,949.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,846.48	3,248.13
应收股利		-	-
应收申购款		499.25	890.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		67,284,607.79	57,917,240.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	36,138.31
应付管理人报酬		47,344.85	43,283.29
应付托管费		13,151.37	12,023.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,126.43	156,564.51
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	57,523.61	36,001.91
负债合计		158,146.26	284,011.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	30,974,934.41	31,468,215.45
未分配利润	6.4.7.10	36,151,527.12	26,165,013.98
所有者权益合计		67,126,461.53	57,633,229.43
负债和所有者权益总计		67,284,607.79	57,917,240.59

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.167 元，基金份额总额 30,974,934.41 份。

6.2 利润表

会计主体：益民核心增长灵活配置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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		10,649,044.52	3,990,493.48
1.利息收入		50,493.34	54,891.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	50,493.34	54,891.21
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）		3,057,855.13	2,007,361.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,537,578.66	1,787,024.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	520,276.47	220,337.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,535,287.02	1,927,302.83
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	5,409.03	937.71
减：二、费用		613,213.78	553,814.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	274,983.83	205,464.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	76,384.39	57,073.49

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	186,321.95	255,374.76
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	75,523.61	35,901.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,035,830.74	3,436,679.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,035,830.74	3,436,679.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民核心增长灵活配置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 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）	31,468,215.45	26,165,013.98	57,633,229.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,035,830.74	10,035,830.74
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）	-493,281.04	-49,317.60	-542,598.64
其中：1.基金申购款	2,349,132.65	2,354,736.86	4,703,869.51
2.基金赎回款	-2,842,413.69	-2,404,054.46	-5,246,468.15
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）	30,974,934.41	36,151,527.12	67,126,461.53
项目	上年度可比期间 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)	3,794,517.32	2,027,856.75	5,822,374.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,436,679.33	3,436,679.33
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)	29,476,955.04	16,056,062.72	45,533,017.76
其中：1.基金申购款	30,383,542.77	16,526,779.73	46,910,322.50
2.基金赎回款	-906,587.73	-470,717.01	-1,377,304.74
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)	33,271,472.36	21,520,598.80	54,792,071.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康健</u>	<u>慕娟</u>	<u>慕娟</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2012年5月24日证监基金字[2012]698号文《关于同意益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由益民基金管理有限公司(以下简称“益民基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为益民基金,托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)。

本基金通过益民基金直销柜台、益民基金网上直销平台等共同销售,募集期为2012年7月9日起至2012年8月10日。经向中国证监会备案,《益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基

金合同》(以下简称“基金合同”)于 2012 年 8 月 16 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 1,155,951,715.80 份(含利息转份额 80,417.38 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 30% - 80%,其中投资于增长类企业和上市公司的比例不低于股票资产的 80%;现金、债券、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20% - 70%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 60%×沪深 300 指数收益率+ 40%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于人民币 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

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报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	274,983.83	205,464.38
其中：支付销售机构的客户维护费	8,754.35	11,656.96

注：支付基金管理人益民基金的基金管理费按前一日基金资产净值乘以约定的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×管理费率 / 当年天数

2019 年 9 月 19 日前，本基金管理费率为 1.50%。本基金管理人自 2019 年 9 月 19 日起对本基金实施调整后的基金管理费率，调整后的基金管理费率为 0.90%。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 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	76,384.39	57,073.49

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

日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期无销售服务费。

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**

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.8.4.2 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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.8.5 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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2012年8月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,816,956.76	-
报告期间申购/买入总份额	-	13,816,956.76
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	13,816,956.76	13,816,956.76
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	44.6069%	41.5279%

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

份额单位：份

关联 方名 称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
国 泓 资 产 管 理 有 限 公 司	13,873,874.08	44.7906%	13,873,874.08	44.0885%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
光大银行	14,096,253.29	49,184.53	15,154,044.96	53,458.14

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 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

于 2021 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。

6.4.10 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 53,067,919.05 元，无属于第二、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 43,475,949.90 元，无属于第二、三层次的余额）。于 2021 年，本基金以公允价值计量的资产和负债的各个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(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: 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	53,067,919.05	78.87
	其中：股票	53,067,919.05	78.87
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	14,189,978.69	21.09
8	其他各项资产	26,710.05	0.04
9	合计	67,284,607.79	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	-	-
B	采矿业	1,553,307.00	2.31
C	制造业	30,617,986.45	45.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	966,226.00	1.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,079,890.00	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	6,572,269.08	9.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,560,520.00	2.32
M	科学研究和技术服务业	2,837,410.80	4.23
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	5,880,309.72	8.76
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,067,919.05	79.06

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	601919	中远海控	215,202	6,572,269.08	9.79
2	002747	埃斯顿	91,885	3,588,109.25	5.35
3	300015	爱尔眼科	47,714	3,386,739.72	5.05
4	600729	重庆百货	112,200	3,079,890.00	4.59
5	300760	迈瑞医疗	6,000	2,880,300.00	4.29
6	603259	药明康德	18,120	2,837,410.80	4.23
7	002594	比亚迪	10,600	2,660,600.00	3.96
8	002271	东方雨虹	46,600	2,577,912.00	3.84
9	300347	泰格医药	12,900	2,493,570.00	3.71
10	300363	博腾股份	29,000	2,439,480.00	3.63

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	600111	北方稀土	3,578,685.00	6.21
2	002594	比亚迪	2,543,785.00	4.41
3	300760	迈瑞医疗	2,534,933.00	4.40
4	002371	北方华创	2,342,579.00	4.06
5	603259	药明康德	2,319,486.00	4.02
6	000933	神火股份	2,288,348.29	3.97
7	600926	杭州银行	2,252,404.00	3.91
8	600438	通威股份	2,010,898.00	3.49

9	300347	泰格医药	1,984,814.00	3.44
10	600486	扬农化工	1,941,558.00	3.37
11	600729	重庆百货	1,859,083.00	3.23
12	300751	迈为股份	1,841,009.56	3.19
13	300363	博腾股份	1,771,939.25	3.07
14	603005	晶方科技	1,755,349.00	3.05
15	600167	联美控股	1,743,837.00	3.03
16	601919	中远海控	1,720,627.00	2.99
17	600893	航发动力	1,691,365.00	2.93
18	601888	中国中免	1,679,154.00	2.91
19	688017	绿的谐波	1,616,845.49	2.81
20	002460	赣锋锂业	1,613,348.00	2.80
21	603298	杭叉集团	1,554,055.00	2.70
22	601600	中国铝业	1,494,382.00	2.59
23	603885	吉祥航空	1,493,160.00	2.59
24	600660	福耀玻璃	1,421,308.00	2.47
25	000039	中集集团	1,359,906.00	2.36
26	300213	佳讯飞鸿	1,358,550.00	2.36
27	601012	隆基股份	1,309,559.00	2.27
28	300037	新宙邦	1,227,807.00	2.13
29	002271	东方雨虹	1,219,282.81	2.12
30	002747	埃斯顿	1,211,212.00	2.10
31	601595	上海电影	1,182,125.60	2.05

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	601012	隆基股份	4,478,436.00	7.77
2	600111	北方稀土	4,021,116.00	6.98
3	600031	三一重工	3,520,551.00	6.11
4	601166	兴业银行	3,032,058.00	5.26
5	000933	神火股份	2,879,970.00	5.00
6	603799	华友钴业	2,864,046.00	4.97
7	600036	招商银行	2,843,167.00	4.93
8	601100	恒立液压	2,788,696.00	4.84

9	002371	北方华创	2,692,053.00	4.67
10	600486	扬农化工	2,424,215.00	4.21
11	600926	杭州银行	2,224,900.00	3.86
12	603005	晶方科技	2,213,250.00	3.84
13	300751	迈为股份	2,027,280.30	3.52
14	601318	中国平安	1,890,110.00	3.28
15	300607	拓斯达	1,870,333.00	3.25
16	603885	吉祥航空	1,675,831.00	2.91
17	688017	绿的谐波	1,630,172.73	2.83
18	002600	领益智造	1,623,974.20	2.82
19	601919	中远海控	1,494,369.00	2.59
20	002460	赣锋锂业	1,483,557.00	2.57
21	600030	中信证券	1,379,220.00	2.39
22	600048	保利地产	1,369,732.00	2.38
23	300213	佳讯飞鸿	1,286,006.00	2.23
24	000039	中集集团	1,223,573.00	2.12

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	60,970,406.70
卖出股票收入（成交）总额	61,451,303.23

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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	23,364.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,846.48
5	应收申购款	499.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,710.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资的前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1. 报告期内，本基金未运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或进行其他关联交易。

2. 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
421	73,574.67	28,632,661.05	92.44%	2,342,273.36	7.56%

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	26,154.52	0.0844%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2012 年 8 月 16 日 ）基金份额总额	1,155,951,715.80
本报告期期初基金份额总额	31,468,215.45
本报告期基金总申购份额	2,349,132.65
减：本报告期基金总赎回份额	2,842,413.69
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	30,974,934.41

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内不存在相关重大人事变动。

本报告期内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

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	
民生证券	1	80,983,439.82	66.15%	75,419.80	66.15%	-
长江证券	1	41,438,270.11	33.85%	38,591.48	33.85%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	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
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

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	2021. 01. 01-2021. 06. 30	13, 816, 956. 76	-	-	13, 816, 956. 76	44. 61%
	2	2021. 01. 01-2021. 06. 30	13, 873, 874. 08	-	-	13, 873, 874. 08	44. 79%
产品特有风险							
本基金为混合型基金，为中风险等级基金产品，单一投资者持有的份额比例过于集中达到或超过 20%，存在潜在的流动性风险和集中赎回风险。但公司对该基金拥有完全自主投资决策权，报告期间严格按照法规和基金合同规定合规运作，严控流动性风险，单一投资者赎回本基金不会给本基金带来显著的流动性风险。因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。							

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