

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资
基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	45,692,232.71 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（以下简称“原民生加银品牌蓝筹混合基金”）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	本基金股票投资采取“核心—卫星策略”，即本基金投资于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%；卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。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。具体仓位控制如下：当沪深 300 成份指数的市盈率（PE）处于历史后 20%分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为 60-95%；当沪深 300 成份指数的市盈率（PE）处于历史前 20%分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为 0-50%；除上述两种情况外，本基金的股票资产占基金资产的比例为 50-90%。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。
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	李申
	联系电话	010-68960037	021-60637102
	电子邮箱	liujing@msjyfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	400-8888-388	021-60637111	
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.msjyfund.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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,958,325.40
本期利润	-10,042,506.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2175
本期加权平均净值利润率	-8.15%
本期基金份额净值增长率	-5.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	84,482,259.97
期末可供分配基金份额利润	1.8489
期末基金资产净值	130,174,492.68
期末基金份额净值	2.8489
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.96%

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。

④本基金于 2021 年 3 月 17 日转型。

3.2 基金净值表现

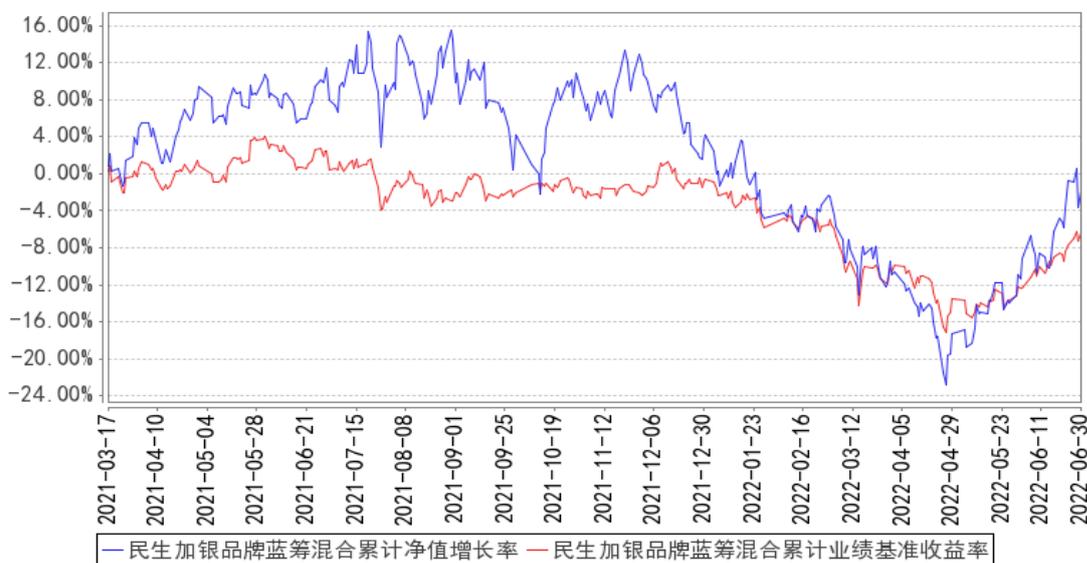
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.11%	1.94%	6.73%	0.75%	3.38%	1.19%
过去三个月	10.12%	1.81%	4.78%	1.00%	5.34%	0.81%
过去六个月	-5.94%	1.75%	-5.73%	1.02%	-0.21%	0.73%
过去一年	-11.30%	1.81%	-8.54%	0.87%	-2.76%	0.94%
自基金合同生效起至今	-1.96%	1.68%	-6.35%	0.84%	4.39%	0.84%

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。

截至2022年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理95只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民

生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银汇鑫一年定期开放债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金、民生加银鑫元纯债债券型证券投资基金、民生加银智造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、民生加银家盈半年定期宝理财债券型证券投资基金、民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银恒益纯债债券型证券投资基金、民生加银新兴成长混合型证券投资基金、民生加银创新成长混合型证券投资基金、民生加银睿通 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银兴盈债券型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、民生加银中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、民生加银聚益纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银新动能一年定期开放混合型证券投资基金、民生加银高等级信用债债券型证券投资基金、民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、民生加银嘉益债券型证券投资基金、民生加银瑞盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银医药健康股票型证券投资基金、民生加银康宁平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新兴产业混合型证券投资基金、民生加银成长优选股票型证券投资基金、民生加银恒泽债券型证券投资基金、民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银质量领先混合型证券投资基金、民生加银汇智 3 个月定期开放债券型证券投资基金、民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金、民生加银瑞利混合型证券投资基金、民生加银内核驱动混合型证券

投资基金、民生加银价值优选 6 个月持有期股票型证券投资基金、民生加银周期优选混合型证券投资基金、民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银康泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银聚优精选混合型证券投资基金、民生加银核心资产股票型证券投资基金、民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF-LOF）、民生加银中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银双核动力混合型证券投资基金、民生加银恒祥债券型证券投资基金、民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
芮定坤	本基金的基金经理	2021 年 12 月 6 日	-	11 年	清华大学经济管理学院国际工商管理专业硕士，11 年证券从业经历。曾在中国中投证券有限责任公司任分析师；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。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年中国经济和股市经历了多个事件冲击，包括全球高通胀、俄乌冲突、国内疫情等，过去的三年股市总体上涨较多，估值总体有所上升，部分股票估值偏高，因此股市一季度以下跌为主。我们主要配置了防御型资产，行业配置较为均衡，精选个股。

4 月底是个转折点，随着疫情得到控制好转，政策刺激从预期到落地，股市大幅反弹。我们认为前期市场对疫情发展和部分行业的长期趋势过于悲观，因此加大了成长板块的配置，积极布局下跌较多的优质公司，获得了一些有效的超额收益。

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 2.8489 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.94%，业绩比较基准收益率为-5.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看，我们对中国经济和股市仍然有信心，中国经济的相对优势会被全球投资人认可。这种相对优势来源于供应链、资源和资本的有效管理。俄乌冲突及制裁加剧了全球通胀，也加剧了逆全球化和供应链紧张，但相对来说中国粮食自给自足，煤、火电、水电占能源的比例高，国内调控能力强，政府企业重视保供受冲击较小，从数据来看中国的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。海外是否从滞涨进入衰退仍然是个风险，现在仍然难以判断，但总的来说影响相对有限，中

国是全球规模最大的资本输出国，有资本管制，只要中国自身经济不出大问题，海外政策收紧很难对中国形成大的冲击。

短期来看年初拥挤的赛道交易经历大幅回落后大幅反弹，回到合理的估值，未来机会更多会出现结构性分化。长期来看，具有全球化可能的制造仍然是我们关注的重点，新技术、新产品也会带来不错的机会。

我们仍然坚持用“GARP”策略来作为我们的方法论，也就是在一个合适的价格买一个合适的增速，考虑到估值和增长的匹配，在成长股投资的基础上更注重“质量”，控制好回撤。

坚持反省和进化，在三思而后行之后，做到不断再行再思、边行边思。

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，对中长期看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牢记着的信念，本基金将继续勤勉努力，注重质量注重长期，控制回撤，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，本基金本报告期可不进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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的真实、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,053,324.51	35,969,926.17
结算备付金		849,967.14	701,611.95
存出保证金		229,364.77	139,927.60
交易性金融资产	6.4.7.2	107,067,673.77	134,722,923.88
其中：股票投资		107,067,673.77	134,722,923.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		14,509,739.75	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,954.32	24,106.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,273.50
资产总计		132,724,024.26	171,561,769.58
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		254,401.61	26,581,089.97
应付赎回款		90,918.27	193,454.82
应付管理人报酬		151,776.49	182,017.01
应付托管费		25,296.09	30,336.18
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	699,805.00	1,098,323.69
负债合计		2,549,531.58	29,412,555.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	45,692,232.71	46,931,031.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	84,482,259.97	95,218,181.87
净资产合计		130,174,492.68	142,149,213.79
负债和净资产总计		132,724,024.26	171,561,769.58

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.8489 元，基金份额总额 45,692,232.71 份。

（2）以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额

合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 17 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-8,892,556.05	29,280,716.42
1. 利息收入		45,148.01	68,875.20
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,148.01	68,599.74
债券利息收入		-	275.46
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）		-7,880,263.36	18,281,193.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,451,031.54	16,842,212.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	293,420.34
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	570,768.18	1,145,561.17
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	-1,084,181.46	10,919,773.88
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	26,740.76	10,873.47
减：二、营业总支出		1,149,950.81	2,118,590.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	916,583.35	1,202,902.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	152,763.91	200,483.77

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.46
8. 其他费用	6.4.7.23	80,603.55	715,204.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,042,506.86	27,162,125.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,042,506.86	27,162,125.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,042,506.86	27,162,125.57

注：（1）本基金于 2021 年 3 月 17 日转型，因此上年度可比期间为 2021 年 3 月 17 日至 2021 年 6 月 30 日。

（2）以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示；上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	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
项目	上年度可比期间			
	2021年3月17日(基金合同生效日)至2021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)	-	-	-	-
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)	97,292,290.51	-	185,403,908.14	282,696,198.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,938,241.22	-	5,608,385.79	-5,329,855.43
(一)、综合收益总额	-	-	27,162,125.57	27,162,125.57
(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)	-10,938,241.22	-	-21,553,739.78	-32,491,981.00
其中:1.	1,529,142.73	-	3,174,862.20	4,704,004.93

基金申购款				
2. 基金赎回款	-12,467,383.95	-	-24,728,601.98	-37,195,985.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	86,354,049.29	-	191,012,293.93	277,366,343.22

注：本基金于 2021 年 3 月 17 日转型，因此上年度可比期间为 2021 年 3 月 17 日至 2021 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张焕南

王国栋

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银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。民生加银新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。民生加银新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 3 号《半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〉》以及中国证监会和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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且

符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统

称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

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

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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、企业所得税

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。金融机构开展的质押式和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。

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，并自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。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。

6.4.6.3 个人所得税

自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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。自 2015 年 9 月 8 日起，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	10,053,324.51
等于：本金	10,051,859.51
加：应计利息	1,465.00

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	10,053,324.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	100,549,856.97	-	107,067,673.77	6,517,816.80
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	100,549,856.97	-	107,067,673.77	6,517,816.80

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
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	620,419.18
其中：交易所市场	620,419.18
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	699,805.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,931,031.92	46,931,031.92
本期申购	5,048,960.35	5,048,960.35
本期赎回（以“-”号填列）	-6,287,759.56	-6,287,759.56
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	45,692,232.71	45,692,232.71

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	112,923,917.86	-17,705,735.99	95,218,181.87
本期利润	-8,958,325.40	-1,084,181.46	-10,042,506.86
本期基金份额交易产生的变动数	-2,813,325.28	2,119,910.24	-693,415.04
其中：基金申购款	10,703,420.24	-2,353,476.07	8,349,944.17
基金赎回款	-13,516,745.52	4,473,386.31	-9,043,359.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,152,267.18	-16,670,007.21	84,482,259.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,222.66
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	13,122.78
其他	1,802.57
合计	45,148.01

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,451,031.54
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	-8,451,031.54

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	939,260,217.06
减：卖出股票成本总额	945,064,523.20
减：交易费用	2,646,725.40
买卖股票差价收入	-8,451,031.54

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

注：本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

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：无。

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：本基金于本期无资产支持证券投资收益。

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：本基金于本期无贵金属投资收益。

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：本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	570,768.18
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	570,768.18

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,084,181.46
股票投资	-1,084,181.46
债券投资	-
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	-1,084,181.46

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	26,725.28
基金转换费收入	15.48
合计	26,740.76

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金于本期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,260.39
合计	80,603.55

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，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	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年3月17日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	916,583.35	1,202,902.35
其中：支付销售机构的客户维护费	197,465.52	92,872.29

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 为每日应支付的基金管理费

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年3月17日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	152,763.91	200,483.77

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 为每日应支付的基金托管费

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无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。

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自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自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：本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年3月17日（基金合同生效日）至2021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	10,053,324.51	30,222.66	52,666,489.15	65,139.18

注：本基金的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：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：（1）本基金于本期未进行利润分配。

（2）本基金资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前的利润分配情况，详见本报告

“6.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	81	4,501.17	2,432.43	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	98	4,586.40	5,335.12	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	153	3,450.15	5,768.10	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	15.64	20.38	227	3,550.28	4,626.26	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	99	3,984.75	3,028.41	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	46	2,947.68	1,725.92	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	80	6,124.80	4,153.60	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	81	5,887.89	5,794.74	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	72.44	45.69	86	6,230.10	3,929.34	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	1,455	5,529.00	9,297.45	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	406	7,011.62	6,020.98	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	121	4,111.58	3,504.16	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	20.08	20.34	253	5,080.24	5,146.02	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	1,163	39,134.95	39,134.95	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	130	4,374.50	4,374.50	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券市值的 10%。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有

限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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以控制相应的信用风险。

于本期末及上年度末，本基金均未持有信用类债券投资，因此，本基金无重大的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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。

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,051,859.51	-	-	-	-	1,465.00	10,053,324.51
结算备付金	849,584.84	-	-	-	-	382.30	849,967.14
存出保证金	229,261.57	-	-	-	-	103.20	229,364.77
交易性金融	-	-	-	-	-	107,067.6	107,067.67

资产						73.77	3.77
应收申购款	-	-	-	-	-	13,954.32	13,954.32
应收清算款	-	-	-	-	-	14,509,739.75	14,509,739.75
资产总计	11,130,705.92	-	-	-	-	121,593,318.34	132,724,024.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	90,918.27	90,918.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	151,776.49	151,776.49
应付托管费	-	-	-	-	-	25,296.09	25,296.09
应付清算款	-	-	-	-	-	254,401.61	254,401.61
应交税费	-	-	-	-	-	1,327,334.12	1,327,334.12
其他负债	-	-	-	-	-	699,805.00	699,805.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,549,531.58	2,549,531.58
利率敏感度缺口	11,130,705.92	-	-	-	-	119,043,786.76	130,174,492.68
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	35,969,926.17	-	-	-	-	-	35,969,926.17
结算备付金	701,611.95	-	-	-	-	-	701,611.95
存出保证金	139,927.60	-	-	-	-	-	139,927.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	134,722,923.88	134,722,923.88
应收申购款	-	-	-	-	-	24,106.48	24,106.48
其他资产	-	-	-	-	-	3,273.50	3,273.50
资产总计	36,811,465.72	-	-	-	-	134,750,303.86	171,561,769.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	193,454.82	193,454.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	182,017.01	182,017.01
应付托管费	-	-	-	-	-	30,336.18	30,336.18
应付证券清算款	-	-	-	-	-	26,581,089.97	26,581,089.97
应交税费	-	-	-	-	-	1,327,334.12	1,327,334.12

						. 12	12
其他负债						1, 098, 323. 69	1, 098, 323. 69
负债总计						29, 412, 555. 79	29, 412, 555. 79
利率敏感度缺口	36, 811, 465. 72					105, 337, 748. 07	142, 149, 213. 79

6. 4. 13. 4. 1. 2 利率风险的敏感性分析

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

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	107, 067, 673. 77	82. 25	134, 722, 923. 88	94. 78
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	107, 067, 673. 77	82. 25	134, 722, 923. 88	94. 78

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他
----	-------------------------------------

	价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	8,895,708.56	9,309,130.45
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-8,895,708.56	-9,309,130.45

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	106,963,401.79	133,144,237.84
第二层次	104,271.98	1,578,686.04
第三层次	-	-
合计	107,067,673.77	134,722,923.88

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

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	107,067,673.77	80.67
	其中：股票	107,067,673.77	80.67
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	10,903,291.65	8.22
8	其他各项资产	14,753,058.84	11.12
9	合计	132,724,024.26	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	-	-
C	制造业	98,489,047.26	75.66
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	4,897.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,422.56	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,608,816.00	2.00
M	科学研究和技术服务业	5,903,516.47	4.54
N	水利、环境和公共设施管理业	5,464.83	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,509.45	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	107,067,673.77	82.25

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	000858	五粮液	34,800	7,027,164.00	5.40
2	601012	隆基绿能	102,360	6,820,246.80	5.24
3	000683	远兴能源	635,900	6,683,309.00	5.13
4	300750	宁德时代	11,800	6,301,200.00	4.84
5	002648	卫星化学	237,471	6,138,625.35	4.72
6	603259	药明康德	56,600	5,885,834.00	4.52
7	002812	恩捷股份	23,400	5,860,530.00	4.50
8	002484	江海股份	245,000	5,718,300.00	4.39
9	600456	宝钛股份	91,800	5,452,920.00	4.19
10	002179	中航光电	84,500	5,350,540.00	4.11
11	603678	火炬电子	110,900	5,191,229.00	3.99
12	300118	东方日升	167,200	4,903,976.00	3.77
13	002709	天赐材料	71,600	4,443,496.00	3.41
14	300775	三角防务	85,300	4,107,195.00	3.16
15	601222	林洋能源	457,700	3,821,795.00	2.94
16	000301	东方盛虹	222,700	3,765,857.00	2.89
17	688388	嘉元科技	38,217	3,243,476.79	2.49
18	603297	永新光学	28,100	3,139,051.00	2.41
19	605111	新洁能	22,300	2,805,563.00	2.16

20	601888	中国中免	11,200	2,608,816.00	2.00
21	000596	古井贡酒	10,400	2,596,464.00	1.99
22	002304	洋河股份	13,900	2,545,785.00	1.96
23	600884	杉杉股份	82,700	2,457,844.00	1.89
24	301239	普瑞眼科	1,293	43,509.45	0.03
25	301029	怡合达	462	37,653.00	0.03
26	301215	中汽股份	1,455	9,297.45	0.01
27	301101	明月镜片	152	7,802.16	0.01
28	301217	铜冠铜箔	406	6,020.98	0.00
29	301201	诚达药业	81	5,794.74	0.00
30	301130	西点药业	153	5,768.10	0.00
31	301158	德石股份	269	5,501.96	0.00
32	301127	天源环保	491	5,464.83	0.00
33	301117	佳缘科技	98	5,335.12	0.00
34	301228	实朴检测	253	5,146.02	0.00
35	301177	迪阿股份	66	4,897.20	0.00
36	301211	亨迪药业	223	4,834.64	0.00
37	301168	通灵股份	102	4,598.16	0.00
38	301138	华研精机	140	4,305.00	0.00
39	301200	大族数控	80	4,153.60	0.00
40	301221	光庭信息	64	4,149.12	0.00
41	301206	三元生物	86	3,929.34	0.00
42	301182	凯旺科技	149	3,540.24	0.00
43	301222	浙江恒威	121	3,504.16	0.00
44	301190	善水科技	142	3,369.66	0.00
45	301096	百诚医药	41	3,239.00	0.00
46	301100	风光股份	146	3,150.68	0.00
47	301181	标榜股份	99	3,028.41	0.00
48	301179	泽宇智能	72	2,938.32	0.00
49	301189	奥尼电子	78	2,598.18	0.00
50	300834	星辉环材	81	2,432.43	0.00
51	301196	唯科科技	46	1,725.92	0.00
52	301199	迈赫股份	24	768.96	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	002179	中航光电	23,740,603.59	16.70
2	002484	江海股份	21,475,998.00	15.11
3	601012	隆基绿能	20,268,845.84	14.26
4	000683	远兴能源	18,196,034.04	12.80

5	600483	福能股份	14,633,942.00	10.29
6	002648	卫星化学	14,334,975.43	10.08
7	600309	万华化学	13,816,588.00	9.72
8	600011	华能国际	13,766,064.78	9.68
9	000539	粤电力 A	13,696,916.40	9.64
10	600021	上海电力	13,355,256.70	9.40
11	688518	联赢激光	12,064,292.93	8.49
12	300750	宁德时代	11,917,448.80	8.38
13	600821	金开新能	11,647,390.00	8.19
14	603259	药明康德	10,472,493.26	7.37
15	300775	三角防务	10,456,853.72	7.36
16	603786	科博达	10,359,019.00	7.29
17	300450	先导智能	10,299,886.76	7.25
18	600456	宝钛股份	9,921,971.00	6.98
19	000591	太阳能	9,220,055.00	6.49
20	601985	中国核电	9,216,037.75	6.48
21	000301	东方盛虹	9,201,187.96	6.47
22	600206	有研新材	9,111,260.00	6.41
23	002241	歌尔股份	9,039,341.58	6.36
24	000422	湖北宣化	8,954,831.00	6.30
25	002493	荣盛石化	8,868,981.50	6.24
26	600141	兴发集团	8,739,628.00	6.15
27	600765	中航重机	8,479,449.80	5.97
28	000537	广宇发展	8,360,445.00	5.88
29	002049	紫光国微	8,080,967.00	5.68
30	000858	五粮液	7,959,655.00	5.60
31	600426	华鲁恒升	7,924,894.00	5.58
32	002895	川恒股份	7,904,387.00	5.56
33	600256	广汇能源	7,865,722.25	5.53
34	600188	兖矿能源	7,707,749.00	5.42
35	002714	牧原股份	7,651,645.00	5.38
36	000768	中航西飞	7,440,284.00	5.23
37	300274	阳光电源	7,420,846.00	5.22
38	002459	晶澳科技	7,363,987.00	5.18
39	002984	森麒麟	7,336,121.00	5.16
40	600745	闻泰科技	7,280,848.80	5.12
41	000887	中鼎股份	7,259,516.12	5.11
42	002483	润邦股份	7,214,288.20	5.08
43	688680	海优新材	7,053,339.23	4.96
44	000893	亚钾国际	6,622,044.00	4.66
45	002812	恩捷股份	6,603,700.76	4.65
46	603707	健友股份	6,557,750.80	4.61

47	002371	北方华创	6,551,226.00	4.61
48	688196	卓越新能	6,532,506.92	4.60
49	000807	云铝股份	6,522,384.00	4.59
50	600346	恒力石化	6,485,033.00	4.56
51	300395	菲利华	6,475,118.00	4.56
52	600230	沧州大化	6,309,119.14	4.44
53	300073	当升科技	6,201,190.00	4.36
54	300118	东方日升	6,185,596.32	4.35
55	300724	捷佳伟创	6,131,040.00	4.31
56	688388	嘉元科技	5,969,408.56	4.20
57	688005	容百科技	5,940,682.08	4.18
58	002938	鹏鼎控股	5,786,991.00	4.07
59	002850	科达利	5,721,098.00	4.02
60	688408	中信博	5,665,218.11	3.99
61	601117	中国化学	5,594,879.00	3.94
62	300223	北京君正	5,562,800.00	3.91
63	000656	金科股份	5,545,939.00	3.90
64	002385	大北农	5,544,109.00	3.90
65	600496	精工钢构	5,525,889.80	3.89
66	002548	金新农	5,513,846.45	3.88
67	600399	抚顺特钢	5,502,226.00	3.87
68	002531	天顺风能	5,416,681.00	3.81
69	603986	兆易创新	5,391,019.43	3.79
70	603977	国泰集团	5,376,470.00	3.78
71	002475	立讯精密	5,364,168.32	3.77
72	603051	鹿山新材	5,300,363.88	3.73
73	600110	诺德股份	5,291,187.00	3.72
74	002532	天山铝业	5,258,048.00	3.70
75	000933	神火股份	5,257,427.00	3.70
76	601601	中国太保	5,241,971.00	3.69
77	600760	中航沈飞	5,234,175.00	3.68
78	603799	华友钴业	5,228,769.00	3.68
79	603297	永新光学	5,222,209.92	3.67
80	603019	中科曙光	5,219,525.00	3.67
81	600967	内蒙一机	5,130,801.00	3.61
82	601865	福莱特	5,101,881.00	3.59
83	300316	晶盛机电	5,014,260.00	3.53
84	300586	美联新材	4,993,277.40	3.51
85	603077	和邦生物	4,808,328.00	3.38
86	000833	粤桂股份	4,796,750.00	3.37
87	688311	盟升电子	4,767,688.51	3.35
88	000830	鲁西化工	4,634,111.00	3.26

89	002709	天赐材料	4,608,717.00	3.24
90	603596	伯特利	4,511,286.00	3.17
91	601222	林洋能源	4,480,259.00	3.15
92	603678	火炬电子	4,450,134.00	3.13
93	300919	中伟股份	4,356,312.00	3.06
94	603985	恒润股份	4,293,835.80	3.02
95	002039	黔源电力	4,286,559.00	3.02
96	002446	盛路通信	4,197,347.50	2.95
97	603338	浙江鼎力	4,196,814.16	2.95
98	600038	中直股份	4,133,803.07	2.91
99	301096	百诚医药	4,106,777.40	2.89
100	600795	国电电力	4,054,133.00	2.85
101	603993	洛阳钼业	3,979,461.00	2.80
102	600362	江西铜业	3,979,295.00	2.80
103	002384	东山精密	3,969,372.00	2.79
104	600328	中盐化工	3,968,548.48	2.79
105	002897	意华股份	3,945,331.00	2.78
106	603693	江苏新能	3,928,790.00	2.76
107	300308	中际旭创	3,910,577.00	2.75
108	300059	东方财富	3,909,211.20	2.75
109	002281	光迅科技	3,904,419.32	2.75
110	000733	振华科技	3,856,236.00	2.71
111	300980	祥源新材	3,837,650.00	2.70
112	000002	万科 A	3,619,848.00	2.55
113	300207	欣旺达	3,492,945.00	2.46
114	000937	冀中能源	3,491,946.00	2.46
115	300443	金雷股份	3,363,914.00	2.37
116	300568	星源材质	3,361,052.08	2.36
117	600063	皖维高新	3,360,519.00	2.36
118	301155	海力风电	3,358,659.00	2.36
119	300850	新强联	3,101,129.00	2.18
120	000875	吉电股份	3,091,962.86	2.18
121	300593	新雷能	3,090,724.00	2.17

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	601012	隆基绿能	24,387,831.80	17.16
2	000683	远兴能源	19,287,072.00	13.57

3	002179	中航光电	18,193,654.70	12.80
4	002648	卫星化学	16,967,104.81	11.94
5	000539	粤电力 A	16,923,492.48	11.91
6	600011	华能国际	16,562,861.64	11.65
7	000893	亚钾国际	15,083,711.00	10.61
8	002484	江海股份	14,977,445.00	10.54
9	002241	歌尔股份	14,800,633.17	10.41
10	000887	中鼎股份	14,085,187.00	9.91
11	600483	福能股份	13,661,187.00	9.61
12	300450	先导智能	13,602,433.00	9.57
13	600309	万华化学	13,296,609.00	9.35
14	600021	上海电力	12,433,966.00	8.75
15	300750	宁德时代	12,171,578.00	8.56
16	688518	联赢激光	11,595,105.66	8.16
17	600821	金开新能	11,385,052.00	8.01
18	002714	牧原股份	10,955,171.00	7.71
19	603786	科博达	10,145,533.64	7.14
20	001205	盛航股份	9,921,364.00	6.98
21	000422	湖北宜化	9,700,390.00	6.82
22	300223	北京君正	9,619,462.00	6.77
23	603259	药明康德	9,491,417.00	6.68
24	000591	太阳能	9,411,083.38	6.62
25	600141	兴发集团	9,337,687.00	6.57
26	002493	荣盛石化	9,266,486.50	6.52
27	601985	中国核电	9,150,488.81	6.44
28	600206	有研新材	8,946,845.00	6.29
29	002371	北方华创	8,752,792.00	6.16
30	600765	中航重机	8,678,980.00	6.11
31	002049	紫光国微	8,645,105.00	6.08
32	600426	华鲁恒升	8,310,061.45	5.85
33	600188	兖矿能源	8,077,124.00	5.68
34	002895	川恒股份	7,904,390.52	5.56
35	600256	广汇能源	7,849,901.84	5.52
36	688680	海优新材	7,819,466.90	5.50
37	603707	健友股份	7,751,440.92	5.45
38	002475	立讯精密	7,517,653.00	5.29
39	002483	润邦股份	7,308,042.00	5.14
40	603985	恒润股份	7,266,951.20	5.11
41	002984	森麒麟	7,197,540.00	5.06
42	002459	晶澳科技	7,147,109.60	5.03
43	000807	云铝股份	6,963,691.00	4.90
44	300274	阳光电源	6,932,322.00	4.88

45	000537	广宇发展	6,880,697.13	4.84
46	002384	东山精密	6,808,192.78	4.79
47	600346	恒力石化	6,708,109.00	4.72
48	002531	天顺风能	6,679,305.00	4.70
49	300775	三角防务	6,491,233.00	4.57
50	600230	沧州大化	6,442,829.40	4.53
51	688196	卓越新能	6,401,563.76	4.50
52	000768	中航西飞	6,362,099.00	4.48
53	300395	菲利华	6,339,965.00	4.46
54	603799	华友钴业	6,308,993.20	4.44
55	600764	中国海防	6,272,361.00	4.41
56	688022	瀚川智能	6,128,499.34	4.31
57	688005	容百科技	6,079,900.28	4.28
58	002850	科达利	6,045,208.00	4.25
59	600496	精工钢构	5,976,738.00	4.20
60	688408	中信博	5,935,935.87	4.18
61	000933	神火股份	5,887,307.00	4.14
62	300073	当升科技	5,808,222.00	4.09
63	002548	金新农	5,777,658.60	4.06
64	603051	鹿山新材	5,693,534.16	4.01
65	300586	美联新材	5,633,762.00	3.96
66	300724	捷佳伟创	5,542,393.00	3.90
67	002532	天山铝业	5,513,904.00	3.88
68	600760	中航沈飞	5,495,158.00	3.87
69	603019	中科曙光	5,458,057.00	3.84
70	603977	国泰集团	5,449,991.00	3.83
71	002938	鹏鼎控股	5,371,068.00	3.78
72	600863	内蒙华电	5,361,331.00	3.77
73	601117	中国化学	5,251,952.00	3.69
74	300776	帝尔激光	5,248,835.00	3.69
75	600110	诺德股份	5,238,196.15	3.68
76	600456	宝钛股份	5,222,899.00	3.67
77	601601	中国太保	5,172,481.88	3.64
78	600399	抚顺特钢	5,101,508.00	3.59
79	002385	大北农	5,056,356.00	3.56
80	300919	中伟股份	4,999,938.66	3.52
81	601865	福莱特	4,971,288.00	3.50
82	000301	东方盛虹	4,948,064.00	3.48
83	300316	晶盛机电	4,944,582.00	3.48
84	000833	粤桂股份	4,884,513.00	3.44
85	603077	和邦生物	4,761,650.00	3.35
86	603986	兆易创新	4,745,136.06	3.34

87	688311	盟升电子	4,679,929.14	3.29
88	600795	国电电力	4,606,180.00	3.24
89	000656	金科股份	4,582,315.00	3.22
90	300443	金雷股份	4,554,673.00	3.20
91	600745	闻泰科技	4,387,456.00	3.09
92	000830	鲁西化工	4,336,176.00	3.05
93	600328	中盐化工	4,286,212.00	3.02
94	600967	内蒙一机	4,201,327.00	2.96
95	300980	祥源新材	4,178,897.00	2.94
96	300568	星源材质	4,068,301.54	2.86
97	300059	东方财富	4,048,065.00	2.85
98	002281	光迅科技	4,015,700.00	2.82
99	002039	黔源电力	4,010,434.00	2.82
100	603338	浙江鼎力	3,924,842.00	2.76
101	002446	盛路通信	3,912,718.50	2.75
102	603993	洛阳钼业	3,877,287.00	2.73
103	603693	江苏新能	3,858,805.00	2.71
104	600362	江西铜业	3,799,243.50	2.67
105	300308	中际旭创	3,785,540.00	2.66
106	000733	振华科技	3,696,781.00	2.60
107	603596	伯特利	3,658,280.00	2.57
108	600038	中直股份	3,653,311.00	2.57
109	300850	新强联	3,461,739.00	2.44
110	300593	新雷能	3,404,232.50	2.39
111	000875	吉电股份	3,355,024.00	2.36
112	301155	海力风电	3,350,424.99	2.36
113	300207	欣旺达	3,332,987.00	2.34
114	600063	皖维高新	3,300,173.00	2.32
115	000002	万科 A	3,290,294.00	2.31
116	000937	冀中能源	3,250,465.00	2.29
117	688355	明志科技	3,238,643.49	2.28
118	301096	百诚医药	3,078,697.00	2.17
119	300861	美畅股份	2,999,101.00	2.11
120	002897	意华股份	2,990,603.00	2.10
121	688116	天奈科技	2,967,132.53	2.09
122	300430	诚益通	2,859,555.00	2.01

注：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	918,493,454.55
卖出股票收入（成交）总额	939,260,217.06

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投资。

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

卫星化学因违法违规被证监会浙江监管局处罚（〔2022〕39 号），作出处罚决定日期：2022 年 4 月 14 日）。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

7.12.2 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

报告期内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	229,364.77
2	应收清算款	14,509,739.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,954.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,753,058.84

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 (%)

4,720	9,680.56	741,106.72	1.62	44,951,125.99	98.38
-------	----------	------------	------	---------------	-------

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	552.02	0.0012

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 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	46,931,031.92
本报告期基金总申购份额	5,048,960.35
减：本报告期基金总赎回份额	6,287,759.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,692,232.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2022 年 3 月 26 日发布公告，自 2022 年 3 月 25 日起李操纲先生不再担任公司总经理、首席信息官，由公司董事长张焕南先生代行总经理职务。

2、本基金管理人于 2022 年 6 月 23 日发布公告，自 2022 年 6 月 22 日起聘任刘静女士担任公司督察长，邢颖女士不再担任公司督察长职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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 (%)	
方正证券	1	374,622,810.87	20.17	270,086.44	17.43	-
招商证券	1	331,982,647.66	17.88	309,176.99	19.96	-
华西证券	1	269,478,434.92	14.51	197,073.88	12.72	-
海通证券	1	267,761,618.13	14.42	249,367.34	16.10	-
长江证券	1	95,636,792.44	5.15	89,066.67	5.75	-
申万宏源	2	93,515,228.76	5.04	87,092.14	5.62	-
开源证券	2	91,496,599.87	4.93	66,911.03	4.32	-
信达证券	2	91,356,621.29	4.92	66,808.65	4.31	-
广发证券	1	76,642,890.88	4.13	71,377.00	4.61	-
兴业证券	1	62,773,501.88	3.38	58,461.98	3.77	-
中信建投	4	52,030,422.23	2.80	48,455.72	3.13	-
国金证券	2	49,597,923.22	2.67	35,278.82	2.28	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
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 (%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
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。

③本基金本期新增华泰证券交易单元一个。

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 2021 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日
2	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日
3	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（2022 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 17 日
4	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	2022 年 3 月 17 日
5	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
6	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
7	关于旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 19 日
8	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
9	民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
10	关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 5 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金变更注册的文件；
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、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日