

益民品质升级灵活配置混合型证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36

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	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
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	42
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	42
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	42
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
§ 8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
§ 9	开放式基金份额变动	44
§ 10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12	备查文件目录	48
12.1	备查文件目录	48
12.2	存放地点	48
12.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	益民品质升级混合
基金主代码	001135
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	63,245,625.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极把握企业在居民生活品质提升过程中带来的投资机会，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	通过益民经济周期模型与分析家的审慎研究相结合的方式判断证券市场总体变动趋势，结合对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。在此基础上重点分析、挖掘在宏观经济转型升级的过程中引领生活品质升级的行业，结合基本面研究进行行业配置。进而，通过对上市公司进行企业生命周期、公司竞争力、成长模式和动力、价值评估等定性或定量分析、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组合。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。

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		益民基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	闫峥	陆志俊
	联系电话	010-63105556	95559
	电子邮箱	ymxxpl@ymfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006508808	95559
传真		010-63100608	021-62701216
注册地址		重庆市渝中区上清寺路 110 号	中国(上海)自由贸易试验区银

		城中路 188 号
办公地址	北京市西城区宣武门外大街 10 号 庄胜广场中央办公楼南翼 13A 层	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100052	200336
法定代表人	党均章	任德奇

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.yfund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A

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

2.5 其他相关资料

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

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,643,734.42
本期利润	-1,894,110.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0294
本期加权平均净值利润率	-3.90%
本期基金份额净值增长率	-4.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-18,263,141.37
期末可供分配基金份额利润	-0.2888
期末基金资产净值	44,982,483.78
期末基金份额净值	0.711

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-28.90%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.80%	0.99%	0.96%	0.56%	-2.76%	0.43%
过去三个月	-7.06%	0.79%	-2.66%	0.54%	-4.40%	0.25%
过去六个月	-4.05%	0.74%	0.63%	0.55%	-4.68%	0.19%
过去一年	-22.30%	0.98%	-7.88%	0.64%	-14.42%	0.34%
过去三年	-16.74%	1.62%	0.32%	0.78%	-17.06%	0.84%
自基金合同生效起至今	-28.90%	1.71%	5.69%	0.91%	-34.59%	0.80%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 65%、35%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年5月6日至2023年6月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
马泉林	本基金 基金经 理	2022 年 9 月 5 日	-	11	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任瑞萨集成电路设计有限公司工程师、中国银河投资管理有限公司投资经理、昆仑健康保险股份有限公司投资经理。2022 年 8 月加入益民基金，自 2022 年 9 月 5 日起任益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王勇	本基金 基金经 理	2023 年 2 月 28 日	-	9	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任北京弘酬投资管理有限公司投资经理、北京艾亿新融资本管理有限公司交易员、中融国际信托有限公司量化研究主管、太平洋证券股份有限公司投资经理。2022 年 6 月加入益民基金，自 2023 年 2 月 28 日起任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
关旭	本基金 基金经 理助理	2022 年 9 月 1 日	-	7	中国国籍，理学硕士，具有基金从业资格。2016 年 5 月至 2019 年 12 月于方正富邦基金管理有限公司任研究员；2020 年 1 月至 2022 年 7 月于南华基金管理有限公司任基金经理助理；2022 年 7 月加入益民基金管理有限公司，自 2022 年 9 月 1 日起任益民红利成长混合型证券投资

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

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民品质升级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，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为，不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易，不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，权益市场先超跌反弹，后震荡下跌。主要股票指数在 6 月初，点位都接近了 2022 年 4 月份的低点。虽然股票指数表现不佳，但是以 AI 为代表的 TMT 板块却维持了比较高的热度。如我们在 2022 年年度报告中的判断，“科技硬核”相关的板块也涨幅较为明显。春节过后，各地陆续开始复工复产，但是春节期间的消费数据以及春节后复工复产的情况却低于此前的预期。因此，春节过后，市场整体呈现震荡下跌的态势。由于新能源板块过去两年中涨幅较多，同时行业增速预期放缓，因此以新能源为代表的赛道股领跌市场。与此相反，由于 openAI 推出的 chatgpt 模型的使用效果超乎全球人民的预料，因此与之相关的 TMT 板块逐渐被市场所发现，相关个股表现较好。在经过 2 月末短暂的调整后，TMT 板块在 3 月初开始走出了波澜壮阔的结构性牛市行情，多只个股短时间内股价翻倍。在低估值方面，“中国特色估值体系”为代表的估值较低的央企国企也走出阶段性行情。但是进入 5 月份，TMT 板块内部也出现了分化，呈现出子版块轮动走势。截至 6 月末，万得全 A 指数季度上涨 3.06%，主要宽基指数普遍呈现上涨的态势，但二季度较一季度明显回调。其中，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板指数下跌 5.61%，科创 50 指数上涨 4.71%，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 指数下跌 0.75%。纵观整个上半年，风格和板块分化较为明显，科技硬核板块上涨较多。分

行业看，申万一级行业中(共 31 个)，仅有 12 个行业下跌，涨幅前 5 的行业有通信、传媒、计算机、电子和石油石化，行业涨幅均超过 30%，其特点均是持续下跌 2 年以上，而在春节后出现催化。表现靠后的五个行业分别是美容护理、商贸零售、房地产、综合和农林牧渔，其共同特点是经济复苏的情况低于此前预期。

我们在一季度对持仓进行了调整，虽然新能源、军工等行业仍然景气度较高，但是未来增速出现下滑的可能性较大，因此春节之后我们逐步降低了新能源和军工的仓位，而对计算机、电子、通信、传媒这四个 TMT 行业进行了逐步的增加配置。在二季度，TMT 行业快速上涨之后，我们逐步将收益兑现，逐步降低 TMT 的持仓比例，而将跌幅较多新能源、军工等景气度较高的板块重新作为重点方向，逐渐增加仓位。

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 0.711 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.05%；同期业绩比较基准收益率为 0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，我们维持此前的判断。首先，新能源汽车、风电、光伏等赛道行业的景气度依然很高，但是行业已经进入增速放缓的阶段，投资机会将从板块性全面机会缩小至细分行业乃至个股，需要更精细化的筛选；其次，我国经济仍将面临较为复杂的内外部形势，经济复苏之路并不平坦。再次，与 AI 相关的板块在上半年涨幅明显，而上市公司业绩真正兑现可能还需要时日。从基本面看，宏观经济正处于修复状态，但是恢复的速度目前还略显缓慢。房地产开工和销售数据不及此前的预期，市场期盼的刺激政策也停留在想象阶段，因此其对下游的拉动作用减弱。同时，国内经济将迎来库存周期见底的阶段，A 股盈利增速与 ROE 可能将在下半年双双开启新一轮上行周期。历史数据显示，A 股盈利增速及 ROE 见底回升区间，A 股往往同样将见底回升，整体表现较好；从估值角度来看，全部 A 股市盈率处于过去十年的较低位置，均值回归动力较强，中长期投资性价比凸显；从流动性角度看，流动性将维持合理充裕，剩余流动性利好 A 股。但是，未来国际环节仍然有较大的不确定性，欧美经济是否衰退、地缘政治危机是否会引发全面的经济危机，以及这些可能引致的我国出口增速下滑，都对未来的经济恢复造成阻碍。综上，当前 A 股市场整体估值已处于较低水平，结合基本面、企业盈利、流动性等角度看，市场长期配置价值已逐步显现。

配置上，具体可关注三条主线：一是经济逐渐转好，经济出清在逐步进行当中，库存周期可能在下半年见底。同时新疆等与中亚接壤地区也会伴随“中亚铁路”建设同步的进行基础设施建设，因此可以关注与之高度相关的行业，包括消费建材、家居、家电、银行等；

二是“硬核科技”。科技创新已经成为我国经济转型的必由之路，也是国家层面进行竞争的最核心变量。国家“十四五规划”将科技创新的地位提到了历史的新高度，把科技自立自强作为国家战略。科技进步是加快产业转型升级、推动经济高质量发展的重要引擎。可关注两大方向，一是自主可控、国产替代方向，二是产业趋势明确、业绩增速高、确定性高的细分板块。行业主要包括信创、军工、半导体，以及储能、工业母机、机器人等；

三是看好在“中国特色估值体系”下具备价值重估的投资机会。从经营业绩、科技创新以及事件驱动等视角，来观察潜在变化所能带来的估值以业绩上的爆发力。选股上，综合考量企业的经营质量、估值和分红等因素，重视投资的性价比与稳定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配原则：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金从 2023 年 2 月 16 日-2023 年 5 月 12 日连续五十八个工作日，2023 年 5 月 29 日-2023 年 6 月 30 日连续二十三个工作日出现资产净值低于五千万的情形；未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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持有人利益的行为。

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

本报告期，益民基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期，由益民基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,909,778.90	12,216,667.51
结算备付金		332,166.11	186,206.62
存出保证金		37,008.78	36,444.30
交易性金融资产	6.4.7.2	32,828,102.05	35,009,937.58

其中：股票投资		32,828,102.05	35,009,937.58
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	-	-
应收清算款		1,015,981.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,369.99	3,268.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		47,126,407.39	47,452,524.80
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,787,484.65	-
应付赎回款		64.33	95.77
应付管理人报酬		57,906.04	61,351.31
应付托管费		9,651.01	10,225.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	288,817.58	183,941.62
负债合计		2,143,923.61	255,613.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	63,245,625.15	63,706,307.41
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-18,263,141.37	-16,509,396.57
净资产合计		44,982,483.78	47,196,910.84
负债和净资产总计		47,126,407.39	47,452,524.80

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.711 元，基金份额总额 63,245,625.15 份。

6.2 利润表

会计主体：益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,406,753.44	-14,994,630.77
1. 利息收入		59,313.57	35,475.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	59,313.57	35,475.15
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）		-2,258,882.96	-20,823,115.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,386,641.99	-21,291,050.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	127,759.03	467,934.98
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）	6.4.7.14	749,623.69	5,783,255.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	43,192.26	9,754.64
减：二、营业总支出		487,357.29	585,941.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	360,925.91	438,491.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,154.33	73,081.99

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	66,277.05	74,368.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,894,110.73	-15,580,572.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,894,110.73	-15,580,572.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,894,110.73	-15,580,572.65

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	63,706,307.41	-	-16,509,396.57	47,196,910.84
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）	63,706,307.41	-	-16,509,396.57	47,196,910.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-460,682.26	-	-1,753,744.80	-2,214,427.06
（一）、综合收益总额	-	-	-1,894,110.73	-1,894,110.73

(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)	-460,682.26	-	140,365.93	-320,316.33
其中: 1. 基金申购款	10,019,379.83	-	-2,708,965.53	7,310,414.30
2. 基金赎回款	-10,480,062.09	-	2,849,331.46	-7,630,730.63
(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)	63,245,625.15	-	-18,263,141.37	44,982,483.78
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	67,330,117.89	-	9,923,760.89	77,253,878.78
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)	67,330,117.89	-	9,923,760.89	77,253,878.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,282,101.00	-	-15,259,026.28	-19,541,127.28
(一)、综合收益总额	-	-	-15,580,572.65	-15,580,572.65
(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)	-4,282,101.00	-	321,546.37	-3,960,554.63
其中: 1. 基金申购款	2,663,020.18	-	-223,519.46	2,439,500.72
2. 基金赎回款	-6,945,121.18	-	545,065.83	-6,400,055.35

(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)	63,048,016.89	-	-5,335,265.39	57,712,751.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王明德	樊振华	肖军
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

益民品质升级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 2015 年 3 月 9 日证监基金字(2015)362 号《关于准予益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的批准,由益民基金管理有限公司(以下简称“益民基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》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,托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

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 2015 年 4 月 7 日起至 2015 年 5 月 6 日。经向中国证监会备案,《益民品质升级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 2015 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 1,376,765,778.44 份(含利息转份额 242,279.03 份),发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由安永华明会计师事务所(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《益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(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、权证、货币市场工具、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:本基金的股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%;固定收益类资产(包括货币市场工具)合计市值占基金资产总值的比例为 0%-100%;本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。固定收益类资产主要包括国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券、中期票据、央票、债券回购、可转换债券、资产支持证券、货币市场工具等。本基金的业绩比较基准为: $65\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 35\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1-6 月的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称“管理人”)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(4)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴

20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(6)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	12,909,778.90
等于：本金	12,906,776.39
加：应计利息	3,002.51
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	12,909,778.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		34,186,726.87	-	32,828,102.05	-1,358,624.82
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		34,186,726.87	-	32,828,102.05	-1,358,624.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	232,249.31
其中：交易所市场	232,249.31

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	56,568.27
合计	288,817.58

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,706,307.41	63,706,307.41
本期申购	10,019,379.83	10,019,379.83
本期赎回(以“-”号填列)	-10,480,062.09	-10,480,062.09
本期末	63,245,625.15	63,245,625.15

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,557,184.13	-14,952,212.44	-16,509,396.57
本期利润	-2,643,734.42	749,623.69	-1,894,110.73
本期基金份额交易产生的变动数	88,677.82	51,688.11	140,365.93
其中：基金申购款	-499,341.70	-2,209,623.83	-2,708,965.53
基金赎回款	588,019.52	2,261,311.94	2,849,331.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,112,240.73	-14,150,900.64	-18,263,141.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
活期存款利息收入	56,774.03
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	2,232.74
其他	306.80
合计	59,313.57

注：其他为存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,386,641.99
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	-2,386,641.99

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
卖出股票成交总额	233,237,677.45
减：卖出股票成本总额	234,933,660.93
减：交易费用	690,658.51
买卖股票差价收入	-2,386,641.99

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	127,759.03
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	127,759.03

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	749,623.69
——股票投资	749,623.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	749,623.69

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
基金赎回费收入	42,816.09
基金转出费收入	376.17
合计	43,192.26

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00

银行费用	708.78
合计	66,277.05

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内无控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
益民基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期及上年度均未通过关联方的交易单元进行过交易。

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

本基金在本报告期及上年度均未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度均没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	360,925.91	438,491.69
其中：支付销售机构的客户维护费	141,101.02	177,751.27

注：支付的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日 至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日 至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,154.33	73,081.99

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

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

本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间无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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年末均未投资过本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	12,909,778.90	56,774.03	17,192,437.85	30,192.35

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行；其他定期存款存放在资信状况良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，且基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证

监会认定的特殊投资组合不受该比例的限制), 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。

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

本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12 外, 本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。于本报告期末, 本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(净资产) 无固定到期日且不计息, 因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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, 导致基金收益的不确定性。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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,909,778.90	-	-	-	-	-	12,909,778.90
结算备付金	332,166.11	-	-	-	-	-	332,166.11
存出保证金	37,008.78	-	-	-	-	-	37,008.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	32,828,102.05	32,828,102.05
应收清算款	-	-	-	-	-	1,015,981.56	1,015,981.56
应收申购款	-	-	-	-	-	3,369.99	3,369.99
资产总计	13,278,953.79	-	-	-	-	33,847,453.60	47,126,407.39
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,787,484.65	1,787,484.65
应付赎回款	-	-	-	-	-	64.33	64.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	57,906.04	57,906.04
应付托管费	-	-	-	-	-	9,651.01	9,651.01
其他负债	-	-	-	-	-	288,817.58	288,817.58
负债总计	-	-	-	-	-	2,143,923.61	2,143,923.61
利率敏感度缺口	13,278,953.79	-	-	-	-	31,703,529.99	44,982,483.78
上年度末 2022年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,213,850.31	-	-	-	-	2,817.20	12,216,667.51
结算备付金	186,114.44	-	-	-	-	92.18	186,206.62
存出保证金	36,426.26	-	-	-	-	18.04	36,444.30
交易性金融资产	-	-	-	-	-	35,009,937.58	35,009,937.58
应收申购款	-	-	-	-	-	3,268.79	3,268.79
资产总计	12,436,391.01	-	-	-	-	35,016,133.79	47,452,524.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	95.77	95.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	61,351.31	61,351.31
应付托管费	-	-	-	-	-	10,225.26	10,225.26

其他负债	-	-	-	-	183,941.62	183,941.62
负债总计	-	-	-	-	255,613.96	255,613.96
利率敏感度缺口	12,436,391.01	-	-	-	34,760,519.83	47,196,910.84

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有对利率敏感的交易性债券投资和资产支持证券投资。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	32,828,102.05	72.98	35,009,937.58	74.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,828,102.05	72.98	35,009,937.58	74.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,792,146.43	3,065,272.71
	业绩比较基准下降 5%	-2,792,146.43	-3,065,272.71

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的公开报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	32,828,102.05	35,009,937.58
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	32,828,102.05	35,009,937.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,828,102.05	69.66
	其中：股票	32,828,102.05	69.66
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	13,241,945.01	28.10
8	其他各项资产	1,056,360.33	2.24
9	合计	47,126,407.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	962,465.00	2.14
B	采矿业	1,313,761.00	2.92
C	制造业	18,651,320.87	41.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	432,999.00	0.96
E	建筑业	3,317,340.00	7.37

F	批发和零售业	455,805.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,509.00	0.01
H	住宿和餐饮业	425,295.00	0.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,396,143.18	14.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	460,728.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	407,736.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	32,828,102.05	72.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002230	科大讯飞	15,700	1,066,972.00	2.37
2	300474	景嘉微	10,900	980,891.00	2.18
3	300274	阳光电源	8,200	956,366.00	2.13
4	600131	国网信通	45,500	918,645.00	2.04
5	603187	海容冷链	45,700	913,543.00	2.03
6	688630	芯碁微装	10,832	910,104.64	2.02
7	688390	固德威	5,448	909,053.28	2.02
8	000555	神州信息	72,500	891,750.00	1.98
9	601800	中国交建	81,700	891,347.00	1.98
10	600502	安徽建工	166,600	879,648.00	1.96
11	688229	博睿数据	13,981	698,211.14	1.55
12	300502	新易盛	8,700	591,339.00	1.31
13	002708	光洋股份	67,400	516,284.00	1.15
14	688305	科德数控	5,140	515,336.40	1.15
15	300036	超图软件	21,500	509,765.00	1.13
16	603477	巨星农牧	15,100	503,585.00	1.12
17	003025	思进智能	30,100	486,115.00	1.08
18	002929	润建股份	11,000	477,510.00	1.06

19	688392	骄成超声	4,302	477,478.98	1.06
20	688558	国盛智科	13,233	473,212.08	1.05
21	601882	海天精工	14,200	472,860.00	1.05
22	301117	佳缘科技	7,300	471,726.00	1.05
23	002941	新疆交建	30,400	470,592.00	1.05
24	601890	亚星锚链	40,400	467,832.00	1.04
25	688017	绿的谐波	2,880	467,712.00	1.04
26	600111	北方稀土	19,500	467,610.00	1.04
27	600197	伊力特	17,200	467,324.00	1.04
28	688680	海优新材	3,818	465,108.76	1.03
29	688348	昱能科技	2,459	461,873.97	1.03
30	002044	美年健康	64,800	460,728.00	1.02
31	600975	新五丰	48,000	458,880.00	1.02
32	688195	腾景科技	8,565	457,627.95	1.02
33	600546	山煤国际	31,500	455,805.00	1.01
34	002903	宇环数控	17,700	453,474.00	1.01
35	002415	海康威视	13,600	450,296.00	1.00
36	600262	北方股份	21,000	450,030.00	1.00
37	600547	山东黄金	19,100	448,468.00	1.00
38	688408	中信博	5,292	446,274.36	0.99
39	300118	东方日升	17,400	445,962.00	0.99
40	000975	银泰黄金	38,100	445,770.00	0.99
41	002658	雪迪龙	54,800	445,524.00	0.99
42	000032	深桑达 A	13,500	444,150.00	0.99
43	002051	中工国际	37,100	442,603.00	0.98
44	000568	泸州老窖	2,100	440,097.00	0.98
45	301266	宇邦新材	6,200	435,922.00	0.97
46	300161	华中数控	8,100	433,512.00	0.96
47	000543	皖能电力	65,500	432,300.00	0.96
48	301073	君亭酒店	11,700	425,295.00	0.95
49	000603	盛达资源	34,700	419,523.00	0.93
50	000021	深科技	20,900	417,791.00	0.93
51	688798	艾为电子	7,049	416,948.35	0.93
52	300212	易华录	12,400	412,052.00	0.92
53	600425	青松建化	93,100	411,502.00	0.91
54	300226	上海钢联	12,700	411,480.00	0.91
55	300580	贝斯特	16,900	410,501.00	0.91
56	300251	光线传媒	50,400	407,736.00	0.91
57	300260	新莱应材	10,080	398,361.60	0.89
58	003043	华亚智能	6,700	378,349.00	0.84
59	688256	寒武纪	1,859	349,492.00	0.78
60	000733	振华科技	2,500	239,625.00	0.53
61	002182	云海金属	9,400	206,706.00	0.46

62	688041	海光信息	2,950	201,396.50	0.45
63	002307	北新路桥	37,800	189,000.00	0.42
64	688343	云天励飞	2,964	188,540.04	0.42
65	600559	老白干酒	4,400	107,844.00	0.24
66	002352	顺丰控股	100	4,509.00	0.01
67	600587	新华医疗	100	3,533.00	0.01
68	600642	申能股份	100	699.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	2,377,331.00	5.04
2	688390	固德威	2,323,097.40	4.92
3	600975	新五丰	2,060,831.00	4.37
4	603477	巨星农牧	2,004,357.00	4.25
5	000739	普洛药业	1,907,360.00	4.04
6	601390	中国中铁	1,870,893.00	3.96
7	300474	景嘉微	1,852,335.00	3.92
8	601800	中国交建	1,765,880.00	3.74
9	688063	派能科技	1,676,864.98	3.55
10	688041	海光信息	1,610,321.76	3.41
11	002881	美格智能	1,533,881.00	3.25
12	688630	芯碁微装	1,514,545.50	3.21
13	002487	大金重工	1,479,313.00	3.13
14	000975	银泰黄金	1,470,866.00	3.12
15	600425	青松建化	1,444,705.00	3.06
16	688111	金山办公	1,355,253.01	2.87
17	300896	爱美客	1,346,669.00	2.85
18	002230	科大讯飞	1,342,086.00	2.84
19	300636	同和药业	1,277,272.00	2.71
20	688037	芯源微	1,275,987.00	2.70
21	688099	晶晨股份	1,249,906.88	2.65
22	688498	源杰科技	1,207,959.60	2.56
23	000928	中钢国际	1,207,832.00	2.56
24	002415	海康威视	1,196,142.80	2.53
25	300481	濮阳惠成	1,194,791.00	2.53
26	300315	掌趣科技	1,189,931.00	2.52
27	688232	新点软件	1,189,903.04	2.52
28	600276	恒瑞医药	1,184,461.00	2.51

29	300031	宝通科技	1,167,328.00	2.47
30	300624	万兴科技	1,150,897.00	2.44
31	603867	新化股份	1,143,616.00	2.42
32	000516	国际医学	1,138,847.00	2.41
33	002223	鱼跃医疗	1,133,089.00	2.40
34	601360	三六零	1,132,620.00	2.40
35	300308	中际旭创	1,105,174.00	2.34
36	600941	中国移动	1,036,863.54	2.20
37	688521	芯原股份	1,034,713.50	2.19
38	300558	贝达药业	1,034,695.00	2.19
39	002756	永兴材料	1,033,705.00	2.19
40	605133	嵘泰股份	1,032,528.00	2.19
41	300627	华测导航	1,008,758.00	2.14
42	301378	通达海	996,269.00	2.11
43	002941	新疆交建	994,678.00	2.11
44	000603	盛达资源	987,862.00	2.09
45	000683	远兴能源	987,075.00	2.09
46	600298	安琪酵母	986,720.00	2.09
47	605377	华旺科技	984,195.00	2.09
48	600111	北方稀土	976,008.50	2.07
49	688018	乐鑫科技	975,227.00	2.07
50	000021	深科技	973,330.00	2.06
51	300260	新莱应材	971,626.00	2.06
52	600037	歌华有线	966,329.00	2.05
53	600547	山东黄金	964,305.00	2.04
54	600502	安徽建工	963,370.00	2.04
55	300274	阳光电源	961,974.00	2.04
56	300394	天孚通信	957,966.00	2.03
57	300831	派瑞股份	957,717.00	2.03
58	688017	绿的谐波	955,959.07	2.03
59	688229	博睿数据	949,901.00	2.01
60	000555	神州信息	948,722.00	2.01
61	600011	华能国际	946,970.00	2.01
62	688195	腾景科技	946,011.77	2.00
63	300737	科顺股份	944,040.00	2.00

注：本项“买入金额”均按买入成交金额(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	300750	宁德时代	2,922,920.00	6.19

2	002594	比亚迪	2,695,650.00	5.71
3	600276	恒瑞医药	2,457,349.40	5.21
4	600011	华能国际	2,259,854.00	4.79
5	300558	贝达药业	2,134,193.00	4.52
6	300502	新易盛	2,123,029.20	4.50
7	688041	海光信息	1,984,911.21	4.21
8	601390	中国中铁	1,960,507.00	4.15
9	688390	固德威	1,884,082.81	3.99
10	000739	普洛药业	1,847,394.20	3.91
11	300474	景嘉微	1,846,043.00	3.91
12	600975	新五丰	1,677,900.00	3.56
13	002881	美格智能	1,659,464.00	3.52
14	605377	华旺科技	1,636,075.00	3.47
15	688498	源杰科技	1,527,123.50	3.24
16	300624	万兴科技	1,500,346.00	3.18
17	688063	派能科技	1,492,504.09	3.16
18	603477	巨星农牧	1,451,776.00	3.08
19	300308	中际旭创	1,402,201.92	2.97
20	300315	掌趣科技	1,401,243.00	2.97
21	002487	大金重工	1,380,653.00	2.93
22	688111	金山办公	1,355,002.32	2.87
23	688037	芯源微	1,349,874.39	2.86
24	300896	爱美客	1,290,048.00	2.73
25	300031	宝通科技	1,283,492.00	2.72
26	000928	中钢国际	1,229,461.00	2.60
27	601360	三六零	1,189,570.00	2.52
28	688099	晶晨股份	1,174,669.23	2.49
29	002223	鱼跃医疗	1,161,935.00	2.46
30	002352	顺丰控股	1,159,192.00	2.46
31	688232	新点软件	1,157,644.79	2.45
32	300636	同和药业	1,150,794.00	2.44
33	300394	天孚通信	1,146,170.00	2.43
34	300831	派瑞股份	1,135,808.00	2.41
35	600941	中国移动	1,081,494.00	2.29
36	000516	国际医学	1,080,586.00	2.29
37	600425	青松建化	1,078,434.00	2.28
38	000975	银泰黄金	1,069,483.00	2.27
39	605133	嵘泰股份	1,069,347.00	2.27
40	688521	芯原股份	1,059,277.50	2.24
41	600519	贵州茅台	1,053,211.00	2.23
42	603867	新化股份	1,043,835.00	2.21
43	300481	濮阳惠成	1,036,433.00	2.20
44	301378	通达海	1,026,386.00	2.17

45	688120	华海清科	977,307.58	2.07
46	301050	雷电微力	969,173.18	2.05
47	300627	华测导航	964,913.00	2.04
48	600037	歌华有线	958,108.00	2.03

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额(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	232,002,201.71
卖出股票收入（成交）总额	233,237,677.45

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券中的发行主体本期末未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,008.78
2	应收清算款	1,015,981.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,369.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,056,360.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	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
2,051	30,836.48	4,696,525.15	7.43%	58,549,100.00	92.57%

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	186,162.45	0.2943%

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	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月6日）基金份额总额	1,376,765,778.44
本报告期期初基金份额总额	63,706,307.41
本报告期基金总申购份额	10,019,379.83
减：本报告期基金总赎回份额	10,480,062.09
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	63,245,625.15

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人

公司总经理助理发生变更：

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

公司财务负责人发生变更：

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

公司董事长发生变更：

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

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

基金托管人

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，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	147,447,145.89	31.69%	137,318.88	32.63%	

国金证券	1	86,649,500.10	18.62%	80,703.35	19.18%	-
东北证券	2	85,981,896.21	18.48%	80,078.32	19.03%	-
东方财富	2	62,456,921.80	13.42%	45,674.71	10.85%	-
东吴证券	2	43,154,490.41	9.28%	40,187.82	9.55%	-
中信建投	1	30,476,881.90	6.55%	28,382.84	6.75%	-
川财证券	1	9,073,042.85	1.95%	8,449.61	2.01%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

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

(二)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；

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

(四)具备较强的服务意识，能够主动提供市场信息、路演、外部专家交流、联合调研机会等，并根据公司特点要求，提供专题研究报告。

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(一)根据上述选择标准，确定选用其交易单元的券商。

(二)本公司与被选用的券商签订交易单元租用协议。

3、停止租用宏信证券交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	益民基金管理有限公司 2022 年 12 月 31 日基金净值公告	公司官网	2023 年 1 月 1 日

2	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》、公司官网	2023 年 1 月 20 日
3	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
4	益民基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份基本信息的公告	公司官网	2023 年 2 月 10 日
5	益民基金管理有限公司公募基金风险等级划分结果说明	公司官网	2023 年 2 月 28 日
6	益民基金管理有限公司关于变更益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 1 日
7	益民基金管理有限公司关于旗下基金招募说明书及产品资料概要(更新)的提示性公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 3 日
8	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 3 日
9	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 3 日
10	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	《上海证券报》、公司官网	2023 年 3 月 30 日
11	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
12	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》、公司官网	2023 年 4 月 21 日
13	益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
14	益民基金管理关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
15	益民基金管理关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 6 日
16	益民基金管理关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 30 日
17	益民基金管理有限公司关于旗下基金泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 12 日
18	益民基金管理有限公司关于旗下基金济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 13 日

19	益民基金管理有限公司关于终止爱建证券有限责任公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》、公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 日
----	--	----------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人益民基金管理有限公司。

咨询电话：(86)010-63105559 4006508808

传真：(86)010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日