

民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	12
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	13
§ 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的真实、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	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57

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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银鑫喜混合
基金主代码	002455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 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	697,326,376.36 份
基金合同存续期	不定期

注：民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金于 2016 年 12 月 9 日成立，后经《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1286 号）变更注册，并于 2021 年 6 月 1 日表决通过了《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过基金管理人研究团队深入、系统、科学的研究，挖掘具有长期投资价值的标的构建投资组合，在严格控制下行风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的持续稳健收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、财政政策、货币政策、市场利率以及各行业等方面的深入、系统、科学的研究，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，在严格控制风险和保持充足流动性的基础上，动态调整资产配置比例，力求最大限度降低投资组合的波动性，力争获取持续稳定的绝对收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证国债指数收益率×70%
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，属于证券投资基金中的中高预期风险和中高预期收益基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘静	王小飞
	联系电话	010-68960037	021-60637103
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	021-60637228
传真		0755-23999800	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福中三路	北京市西城区闹市口大街 1 号

	2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-16,027,983.21
本期利润	-12,902,795.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0169
本期加权平均净值利润率	-1.69%
本期基金份额净值增长率	-1.73%
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	-26,633,886.22
期末可供分配基金份额利润	-0.0382
期末基金资产净值	681,506,923.53
期末基金份额净值	0.9773
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	50.01%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

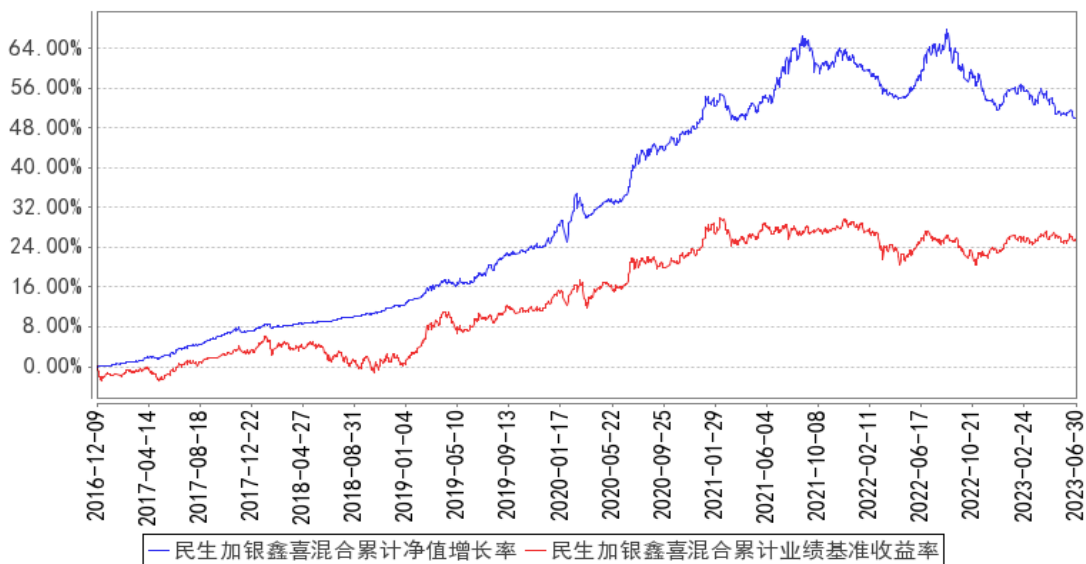
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.63%	0.20%	0.80%	0.24%	-1.43%	-0.04%
过去三个月	-2.78%	0.31%	-0.10%	0.24%	-2.68%	0.07%
过去六个月	-1.73%	0.30%	1.84%	0.24%	-3.57%	0.06%
过去一年	-7.85%	0.39%	-1.16%	0.29%	-6.69%	0.10%
过去三年	10.87%	0.39%	7.30%	0.36%	3.57%	0.03%
自基金合同生效起至今	50.01%	0.30%	25.74%	0.35%	24.27%	-0.05%

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

为保持历史数据的延续性，本部分所涉及自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 9 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

民生加银鑫喜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：①本基金合同于 2016 年 12 月 09 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

②为保持历史数据的延续性，本部分所涉及自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 9 日（初始成立日）为起始日进行编制。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会[2008]1187号文批准，于2008年11月3日在深圳正式成立，2012年注册资本增加至3亿元人民币。

基金管理情况：2023年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理98只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金、民生加银鑫元纯债债券型证券投资基金、民生加银智造2025灵活配置混合型证券投资基金、民生加银家盈半年定期宝理财债券型证券投资基金、民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银恒益纯债债券型证券投资基金、民生加银新兴成长混合型证券投资基金、民生加银创新成长混合型证券投资基金、民生加银睿通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银兴盈债券型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、民生加银中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、民生加银聚益纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深300交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深300交易型开放式指数证券投资基金

联接基金、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银科技创新混合型证券投资基金（LOF）、民生加银新动能一年定期开放混合型证券投资基金、民生加银高等级信用债债券型证券投资基金、民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、民生加银嘉益债券型证券投资基金、民生加银瑞盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银医药健康股票型证券投资基金、民生加银康宁平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新兴产业混合型证券投资基金、民生加银成长优选股票型证券投资基金、民生加银恒泽债券型证券投资基金、民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银质量领先混合型证券投资基金、民生加银汇智 3 个月定期开放债券型证券投资基金、民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金、民生加银瑞利混合型证券投资基金、民生加银内核驱动混合型证券投资基金、民生加银价值优选 6 个月持有期股票型证券投资基金、民生加银周期优选混合型证券投资基金、民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银康泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金、民生加银聚优精选混合型证券投资基金、民生加银核心资产股票型证券投资基金、民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF-LOF）、民生加银中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银双核动力混合型证券投资基金、民生加银恒祥债券型证券投资基金、民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银金融优选混合型证券投资基金、民生加银月月乐 30 天持有期短债债券型证券投资基金、民生加银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金、民生加银瑞丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银恒宁债券型证券投资基金、民生加银瑞华绿色债券一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银均衡优选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

关键	本基金基金经理 (兼任投资经理)	2021年3月16日	-	14年	中央财经大学硕士，14年证券从业经历。自2009年7月至2014年11月在中国农业银行股份有限公司金融市场部担任高级投资经理；2014年11月至2015年8月在中国人寿养老保险股份有限公司投资中心担任固定收益投资经理；自2015年8月至2016年6月，在景顺长城基金管理有限公司专户投资部担任固定收益投资经理。2016年9月加入民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任基金经理兼任投资经理。自2021年2月至今担任民生加银转债优选债券型证券投资基金基金经理；自2021年3月至今担任民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自2021年7月至今担任民生加银家盈6个月持有期债券型证券投资基金基金经理。自2021年4月至2022年6月担任民生加银鹏程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基金经理；自2021年2月至2022年9月担任民生加银信用双利债券型证券投资基金基金经理。
----	---------------------	------------	---	-----	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

③根据2023年7月27日发布的《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2023年7月27日起，夏荣尧先生担任本基金基金经理职务，关键先生不再担任本基金基金经理职务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
关键	公募基金	3	969,423,380.60	2021-2-22
	私募资产管理计划	2	2,402,013,212.86	2018-6-25
	其他组合	-	-	-
	合计	5	3,371,436,593.46	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控

制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，全球经济相对保持平稳，欧美通胀在高位触顶后出现回落，美联储加息仍在继续，全球整体环境较 2022 年有明显改善，仍处于后疫情时代的自我修复中。国内经济在疫情之后开启了稳步复苏，在海外需求较为稳定的情况下，国内中下游也逐步摆脱疫情影响，呈现较为积极的回暖趋势。与此同时，通胀逐步走低，地产销售压力仍然较大等仍受到市场较多关注。货币政策维持中性稳健基调，逐步引导国内利率有序下行。

股市方面，年初受到经济修复的预期驱动，市场沿着经济相关的主线，演绎了一轮较好的反弹行情，春节后随着预期的逐步兑现以及对后续经济分歧的看法加大，市场轮动开始加快。随着人工智能等科技领域的全球趋势逐步形成，市场在二季度逐步转向科技成长为主线的 TMT 方向。但随着 5 月份市场对于经济预期的悲观情绪升温，以及人民币汇率的贬值预期提升，A 股开始了持续的调整，更多以估值压缩为主。

债券方面，利率在上半年始终保持震荡下行趋势，在偏弱的基本面和宽松的流动性环境下，市场对于经济的预期不断弱化，且居民端风险偏好下行背景下，更多利好确定性较高的固定收益类资产。机构持续欠配，由此压低了无风险利率和品种间的利差水平。整体上半年无论是无风险利率或是信用利差，都呈现持续下行的趋势。尽管信用债票息已然较低，但仍是重要的收入来源。

操作方面，一季度进行了较多仓位和持仓品种调整，具体为降低股票仓位，将可转债调整为防守型品种。6 月份之后将股票仓位逐步压缩，同时将转债持仓切换至更多偏债型品种。债券方

面，考虑到全年宽信用、流动性平稳的大环境，年初新增配置了部分中高等级、短久期城投和产业债。组合始终保持一定的长久期利率债仓位，不做过多择时，从结果来看，也取得了一定效果。

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 0.9773 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.73%，业绩比较基准收益率为 1.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，流动性整体仍将维持稳健偏宽松态势，在经济没有强刺激的情况下，融资需求难以大幅反弹，需要防范地产进一步下行带来的非线性风险。外部美联储加息逐步接近尾声，但年内难见降息，全球流动性边际收紧的过程逐步结束。

从大类资产配置上，股票在经历了持续的估值压缩后，是否足够便宜需要思考。下半年面临的压力更多来自于基本面走势和外部风险是否再度上升的不确定性。债券仍是确定性较高，且风险相对可控的品种。可转债整体缺乏明显机会，只能从个券中去挖掘阶段性标的。

股票需要防范系统性估值继续压缩的风险，可能导致风险的因素包括经济数据的进一步下滑，风险事件冲击，居民风险偏好的持续回落等等。在下跌过程中可关注部分超跌的机会，例如与外需相关度较高，或者与国内周期关联度较低的方向。

债券市场慢牛行情可能延续，尽管短期内利率下行受到短端制约，但降准降息仍然可期，且避险情绪下的资金转移也会导致配置力量持续较强，票息和杠杆策略仍然有效。信用债可以底仓配置为主要目的，继续选择部分性价比较好的城投品种。

转债市场估值始终处于历史高位，背后源自配置力量的支撑，但需要防范系统性的估值压缩风险。如果权益市场持续低迷，转债赚钱效应较差，可能导致资金持续流出，从而带来系统性的估值压缩风险。转债选择上，主要以转债绝对价格较低，且正股估值具备较强安全边际，溢价率相对合理的标的为主。

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遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：民生加银鑫喜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	6,806,819.43	2,746,431.76
结算备付金		6,105,237.50	5,244,127.72
存出保证金		253,790.60	328,340.79
交易性金融资产	6.4.7.2	824,975,968.65	916,293,248.65
其中：股票投资		53,083,819.47	195,619,036.78
基金投资		-	-
债券投资		771,892,149.18	720,674,211.87
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	-6,838.35	20,003,581.86
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		51,059,277.80	4,256,291.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	949.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		889,194,255.63	948,872,971.98
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		200,066,617.31	175,066,217.04
应付清算款		6,095,624.74	3,774,749.99
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		343,204.43	391,874.98
应付托管费		85,801.08	97,968.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65,242.31	51,509.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,030,842.23	1,234,676.39
负债合计		207,687,332.10	180,616,997.04

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	697,326,376.36	772,527,308.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-15,819,452.83	-4,271,333.30
净资产合计		681,506,923.53	768,255,974.94
负债和净资产总计		889,194,255.63	948,872,971.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9773，基金份额总额 697,326,376.36 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银鑫喜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		-7,949,971.19	2,618,733.60
1. 利息收入		96,189.43	129,360.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,710.48	61,428.95
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		30,478.95	67,931.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,171,603.61	-11,533,801.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-22,918,056.64	-30,333,540.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	11,124,515.67	17,826,212.32
资产支持证券投资	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	621,937.36	973,526.49
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	3,125,187.31	14,017,946.97

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	255.68	5,227.63
减：二、营业总支出		4,952,824.71	4,398,302.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,269,315.04	2,717,654.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	567,328.74	679,413.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,969,745.37	850,660.72
其中：卖出回购金融资产支出		1,969,745.37	850,660.72
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		48,487.40	52,630.37
8. 其他费用	6.4.7.23	97,948.16	97,943.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,902,795.90	-1,779,569.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,902,795.90	-1,779,569.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,902,795.90	-1,779,569.35

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银鑫喜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）	772,527,308.24	-	-4,271,333.30	768,255,974.94
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	772,527,308.24	-	-4,271,333.30	768,255,974.94

净值)				
三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	-75,200,931.88	-	-11,548,119.53	-86,749,051.41
（一）、综 合收益总 额	-	-	-12,902,795.90	-12,902,795.90
（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）	-75,200,931.88	-	1,354,676.37	-73,846,255.51
其中：1. 基金申购 款	45,938.78	-	-179.40	45,759.38
2. 基金赎回 款	-75,246,870.66	-	1,354,855.77	-73,892,014.89
（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）	697,326,376.36	-	-15,819,452.83	681,506,923.53
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）	805,933,931.06	-	164,840,388.14	970,774,319.20
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）	805,933,931.06	-	164,840,388.14	970,774,319.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,404,498.40	-	-7,254,092.19	-40,658,590.59
（一）、综合收益总额	-	-	-1,779,569.35	-1,779,569.35
（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）	-33,404,498.40	-	-5,474,522.84	-38,879,021.24
其中：1. 基金申购款	83,080.19	-	12,972.39	96,052.58
2. 基金赎回款	-33,487,578.59	-	-5,487,495.23	-38,975,073.82
（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)	772,529,432.66	-	157,586,295.95	930,115,728.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郑智军</u>	<u>王国栋</u>	<u>洪锐珠</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]221号《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]2312号文《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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,基金合同于2016年12月9日正式生效,首次设立募集规模为200,048,869.29份基金份额,其中认购资金利息折合15,003.39份基金份额。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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京01破270号之一及中国证监会指定,建设银行自包商银行股份有限公司(以下简称“包商银行”)被依法宣告破产之日起担任本基金的临时基金托管人。

根据中国证监会《关于准予民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可【2021】1286号)及民生加银鑫喜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6月1日表决通过且自该日起生效的《关于民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》,民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金的基金托管人由包商银行变更为建设银行。经与建设银行协商一致,自上述决议公告之日即2021年6月2

日起，修订后的《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，自该日起原基金合同和托管协议失效。

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（含创业板及其他经中国证监会允许投资的股票等），存托凭证，债券（含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例为 0%-95%。本基金保持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%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证国债指数收益率×70%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增

值税纳税人。

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

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

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	6,806,819.43
等于：本金	6,805,707.43
加：应计利息	1,112.00
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	6,806,819.43

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	52,367,553.59	-	53,083,819.47	716,265.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	248,731,133.40	2,213,702.30	253,363,659.90	2,418,824.20
	银行间市	507,663,670.28	7,725,389.28	518,528,489.28	3,139,429.72

	场				
	合计	756,394,803.68	9,939,091.58	771,892,149.18	5,558,253.92
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		808,762,357.27	9,939,091.58	824,975,968.65	6,274,519.80

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-6,838.35	-
银行间市场	-	-
合计	-6,838.35	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	942,499.07
其中：交易所市场	936,619.57
银行间市场	5,879.50
应付利息	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
预提银行间账户维护费	9,000.00
合计	1,030,842.23

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	772,527,308.24	772,527,308.24
本期申购	45,938.78	45,938.78
本期赎回（以“-”号填列）	-75,246,870.66	-75,246,870.66
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	697,326,376.36	697,326,376.36

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,300,568.01	9,029,234.71	-4,271,333.30
本期利润	-16,027,983.21	3,125,187.31	-12,902,795.90
本期基金份额交易产生的变动数	2,694,665.00	-1,339,988.63	1,354,676.37
其中：基金申购款	-1,032.35	852.95	-179.40
基金赎回款	2,695,697.35	-1,340,841.58	1,354,855.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,633,886.22	10,814,433.39	-15,819,452.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	21,029.96
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	41,984.76
其他	2,695.76
合计	65,710.48

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,918,056.64
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	-22,918,056.64

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,297,349,634.62
减：卖出股票成本总额	1,316,937,329.09
减：交易费用	3,330,362.17
买卖股票差价收入	-22,918,056.64

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	14,546,557.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,422,042.27
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	11,124,515.67

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	414,759,830.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	410,386,680.48
减：应计利息总额	7,781,366.16
减：交易费用	13,826.31
买卖债券差价收入	-3,422,042.27

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	621,937.36
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	621,937.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	3,125,187.31

股票投资	-2,045,504.79
债券投资	5,170,692.10
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	3,125,187.31

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	78.57
基金转换费收入	2.11
其他	175.00
合计	255.68

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5.00
债券账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	97,948.16

6.4.7.24 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期末及上年度末无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,269,315.04	2,717,654.96
其中：支付销售机构的客户维护 费	411.03	9,306.71

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年

费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	567,328.74	679,413.74

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 0.15% 的费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无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固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,806,819.43	21,029.96	6,996,548.95	28,843.56

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	832	9,884.16	17,488.64	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

		日								
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	844	42,200.00	25,919.24	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	1,487	45,873.95	35,137.81	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江	2023年	6个月	新股流	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-

	智能	6月1日		通受限							
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	87.41	53.24	351	30,679.74	18,687.24		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84		-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	859	20,418.43	36,842.51		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96		-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-

301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	2,088	13,739.04	15,827.04	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	780	8,080.80	9,235.20	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	752	27,184.80	28,673.76	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,295	85,298.70	77,567.70	-

		日									
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,019	24,429.90	24,369.33		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	748	17,652.80	48,373.16		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	8,225	46,800.25	44,497.25		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,859	31,734.90	48,717.36		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	733	29,312.67	26,908.43		-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股流通受限	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	166.35	122.11	186	30,940.56	22,712.46		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科	2023年	6个月	新股流	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-

	军工	6月14日		通受限							
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	796	24,086.96	20,162.68		-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62		-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32		-

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

截至本报告期 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,022,524.15 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102100300	21 武金控 MTN001	2023 年 7 月 3 日	102.69	77,000	7,907,351.51
102100770	21 昌吉州 MTN001	2023 年 7 月 3 日	102.06	200,000	20,412,765.03
102100791	21 苏沙钢 MTN001	2023 年 7 月 3 日	101.21	250,000	25,303,360.66
合计				527,000	53,623,477.20

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 150,044,093.16 元，分别于 2023 年 07 月 03 日和 2023 年 07 月 07 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	47,559,983.83	79,463,529.80
合计	47,559,983.83	79,463,529.80

注：未评级债券为国债、政策性金融债、短期融资券及超短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,990,720.00	-
合计	9,990,720.00	-

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	310,230,390.98	421,898,044.27
AAA 以下	239,043,623.65	138,475,564.92
未评级	165,067,430.72	80,837,072.88
合计	714,341,445.35	641,210,682.07

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息

资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,805,707.43	-	-	-	-	1,112.00	6,806,819.43
结算备付金	6,102,491.30	-	-	-	-	2,746.20	6,105,237.50
存出保证金	253,676.50	-	-	-	-	114.10	253,790.60
交易性金融资产	14,980,500.00	14,043,400.00	401,120,100.00	318,919,600.00	12,889,457.60	63,022,911.05	824,975,968.65
买入返	-	-	-	-	-	-6,838.35	-6,838.35

售金融资产							
应收清算款	-	-	-	-	-	51,059,277.80	51,059,277.80
资产总计	28,142,375.23	14,043,400.00	401,120,100.00	318,919,600.00	12,889,457.60	114,079,322.80	889,194,255.63
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	343,204.43	343,204.43
应付托管费	-	-	-	-	-	85,801.08	85,801.08
应付清算款	-	-	-	-	-	6,095,624.74	6,095,624.74
卖出回购金融资产款	199,999,725.00	-	-	-	-	66,892.31	200,066,617.31
应交税	-	-	-	-	-	65,242.31	65,242.31

其他负债	-	-	-	-	-	1,030,842.23	1,030,842.23
负债总计	199,999,725.00	-	-	-	-	7,687,607.10	207,687,332.10
利率敏感度缺口	171,857,349.77	14,043,400.00	401,120,100.00	318,919,600.00	12,889,457.60	106,391,715.70	681,506,923.53
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	2,745,808.42	-	-	-	-	623.34	2,746,431.76
结算备付金	5,241,533.26	-	-	-	-	2,594.46	5,244,127.72
存出保证金	328,178.32	-	-	-	-	162.47	328,340.79
交易	70,378,961.60	50,705,000.00	77,004,600.00	497,915,000.00	9,959,000.00	210,330,687.05	916,293,248.65

性金融资产							
买入返售金融资产	20,000,150.00	-	-	-	-	3,431.86	20,003,581.86
应收申购款	-	-	-	-	-	949.53	949.53
应收清算款	-	-	-	-	-	4,256,291.67	4,256,291.67
资产总计	98,694,631.60	50,705,000.00	77,004,600.00	497,915,000.00	9,959,000.00	214,594,740.38	948,872,971.98
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	391,874.98	391,874.98
应付托管费	-	-	-	-	-	97,968.73	97,968.73
应付清算	-	-	-	-	-	3,774,749.99	3,774,749.99

款							
卖出回购金融资产款	175,000,000.00	-	-	-	-	66,217.04	175,066,217.04
应交税费	-	-	-	-	-	51,509.91	51,509.91
其他负债	-	-	-	-	-	1,234,676.39	1,234,676.39
负债总计	175,000,000.00	-	-	-	-	5,616,997.04	180,616,997.04
利率敏感度缺口	-76,305,368.40	50,705,000.00	77,004,600.00	497,915,000.00	9,959,000.00	208,977,743.34	768,255,974.94

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降25个基点	2,582,690.80	2,640,591.43
	2. 市场利率上升	-2,563,813.71	-2,628,829.76

	25 个基点		
--	--------	--	--

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	53,083,819.47	7.79	195,619,036.78	25.46
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	53,083,819.47	7.79	195,619,036.78	25.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	

分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	8,846,328.49	6,036,196.05
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-8,846,328.49	-6,036,196.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	52,934,113.77	193,318,453.66
第二层次	772,041,854.88	722,974,794.99
第三层次	-	-
合计	824,975,968.65	916,293,248.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,083,819.47	5.97
	其中：股票	53,083,819.47	5.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	771,892,149.18	86.81
	其中：债券	771,892,149.18	86.81
	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	-6,838.35	-0.00
	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	12,912,056.93	1.45
8	其他各项资产	51,313,068.40	5.77
9	合计	889,194,255.63	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	3,114,988.23	0.46
C	制造业	19,200,529.35	2.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,706,726.03	1.57
E	建筑业	12,364.66	0.00
F	批发和零售业	622,301.85	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	13,885,359.27	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,234,239.73	0.77
J	金融业	4,904.30	0.00
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	23,297.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	17,863.29	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	36,016.68	0.01
R	文化、体育和娱乐业	225,228.92	0.03
S	综合	-	-
	合计	53,083,819.47	7.79

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	601333	广深铁路	1,566,600	6,203,736.00	0.91
2	000539	粤电力A	500,100	3,650,730.00	0.54
3	600012	皖通高速	314,100	3,291,768.00	0.48
4	600009	上海机场	69,600	3,161,232.00	0.46
5	600023	浙能电力	607,800	3,081,546.00	0.45
6	002129	TCL 中环	83,300	2,765,560.00	0.41
7	601865	福莱特	69,300	2,668,743.00	0.39
8	601199	江南水务	379,300	2,586,826.00	0.38
9	601899	紫金矿业	209,600	2,383,152.00	0.35
10	300842	帝科股份	22,300	2,039,112.00	0.30
11	300260	新莱应材	42,380	1,674,857.60	0.25
12	600129	太极集团	23,300	1,386,117.00	0.20
13	300308	中际旭创	9,200	1,356,540.00	0.20
14	603806	福斯特	36,400	1,353,716.00	0.20
15	600011	华能国际	145,800	1,350,108.00	0.20
16	002230	科大讯飞	18,800	1,277,648.00	0.19
17	601816	京沪高铁	232,800	1,224,528.00	0.18
18	688111	金山办公	2,498	1,179,605.56	0.17
19	300499	高澜股份	54,400	958,528.00	0.14
20	300496	中科创达	9,405	906,171.75	0.13
21	600941	中国移动	8,400	783,720.00	0.11
22	600547	山东黄金	30,700	720,836.00	0.11

23	300168	万达信息	58,700	665,071.00	0.10
24	000858	五粮液	3,600	588,852.00	0.09
25	000938	紫光股份	18,000	573,300.00	0.08
26	000034	神州数码	21,400	569,026.00	0.08
27	600872	中炬高新	14,500	533,455.00	0.08
28	300502	新易盛	6,300	428,211.00	0.06
29	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
30	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.04
31	300182	捷成股份	35,200	222,112.00	0.03
32	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
33	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.02
34	300454	深信服	1,100	124,575.00	0.02
35	688498	源杰科技	419	119,415.00	0.02
36	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.02
37	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
38	688472	阿特斯	5,433	95,976.00	0.01
39	688249	晶合集成	4,295	77,567.70	0.01
40	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
41	688576	西山科技	440	55,510.40	0.01
42	301310	鑫宏业	789	52,935.27	0.01
43	688361	中科飞测	748	48,373.16	0.01
44	301325	曼恩斯特	436	47,537.80	0.01
45	688469	中芯集成	8,225	44,497.25	0.01
46	688543	国科军工	767	41,796.05	0.01
47	688570	天玛智控	1,501	38,943.88	0.01
48	301383	天键股份	1,025	37,506.76	0.01
49	301260	格力博	1,570	37,177.12	0.01
50	301358	湖南裕能	859	36,842.51	0.01
51	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
52	301293	三博脑科	424	31,526.96	0.00
53	688623	二元科技	337	30,055.95	0.00
54	301246	宏源药业	935	28,771.18	0.00
55	688146	中船特气	752	28,673.76	0.00
56	688593	新相微	1,809	28,535.31	0.00
57	301320	豪江智能	1,216	27,392.88	0.00
58	688484	南芯科技	733	26,908.43	0.00
59	301095	广立微	298	24,629.70	0.00
60	301307	美利信	765	24,525.00	0.00
61	688352	硕中科技	2,019	24,369.33	0.00
62	301303	真兰仪表	1,074	23,980.32	0.00
63	688507	索辰科技	186	22,712.46	0.00
64	688523	航天环宇	890	22,497.22	0.00
65	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00

66	001287	中电港	916	19,822.16	0.00
67	301323	新莱福	477	19,743.33	0.00
68	301355	南王科技	1,124	19,416.05	0.00
69	301317	鑫磊股份	736	19,295.14	0.00
70	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
71	301322	绿通科技	351	18,687.24	0.00
72	301419	阿莱德	392	17,324.36	0.00
73	301387	光大同创	370	17,033.31	0.00
74	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
75	301337	亚华电子	518	16,884.24	0.00
76	301439	泓淋电力	986	16,698.18	0.00
77	301332	德尔玛	1,211	16,676.87	0.00
78	601061	中信金属	2,180	16,634.80	0.00
79	301269	华大九天	135	16,583.40	0.00
80	301345	涛涛车业	352	16,509.30	0.00
81	301305	朗坤环境	823	16,283.27	0.00
82	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
83	301382	蜂助手	480	16,180.80	0.00
84	688535	华海诚科	279	15,461.37	0.00
85	301408	华人健康	884	14,985.85	0.00
86	688143	长盈通	380	14,326.00	0.00
87	301165	锐捷网络	226	13,948.72	0.00
88	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
89	301141	中科磁业	317	13,720.28	0.00
90	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
91	301360	荣旗科技	140	13,034.08	0.00
92	301429	森泰股份	589	12,531.08	0.00
93	603135	中重科技	673	12,152.92	0.00
94	301308	江波龙	119	12,109.44	0.00
95	301373	凌玮科技	364	11,640.38	0.00
96	301368	丰立智能	168	11,623.92	0.00
97	301386	未来电器	476	11,460.26	0.00
98	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
99	688392	骄成超声	88	9,767.12	0.00
100	301357	北方长龙	200	9,714.90	0.00
101	601065	江盐集团	800	9,503.80	0.00
102	688147	微导纳米	178	9,394.84	0.00
103	301281	科源制药	368	9,275.20	0.00
104	601133	柏诚股份	732	9,154.52	0.00
105	301428	世纪恒通	289	9,143.40	0.00
106	688279	峰昭科技	67	8,844.00	0.00
107	688273	麦澜德	229	8,475.29	0.00
108	002463	沪电股份	400	8,376.00	0.00

109	688372	伟测科技	54	8,270.10	0.00
110	688448	磁谷科技	239	8,180.97	0.00
111	688539	高华科技	176	8,166.40	0.00
112	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
113	688401	路维光电	206	7,733.24	0.00
114	688271	联影医疗	55	7,590.55	0.00
115	688410	山外山	139	7,297.50	0.00
116	688326	经纬恒润	50	7,219.50	0.00
117	688275	万润新能	78	7,045.74	0.00
118	688031	星环科技	52	6,928.48	0.00
119	301311	昆船智能	232	6,839.36	0.00
120	301327	华宝新能	85	6,724.35	0.00
121	688114	华大智造	77	6,665.12	0.00
122	688522	纳睿雷达	122	6,529.44	0.00
123	001367	海森药业	149	6,455.92	0.00
124	688486	龙迅股份	56	6,162.80	0.00
125	301290	东星医疗	191	6,121.55	0.00
126	001380	华纬科技	194	6,014.76	0.00
127	301268	铭利达	141	5,903.67	0.00
128	688073	毕得医药	81	5,733.18	0.00
129	603138	海量数据	300	5,712.00	0.00
130	301398	星源卓镁	149	5,587.50	0.00
131	688244	永信至诚	72	5,572.80	0.00
132	688409	富创精密	51	5,559.00	0.00
133	301391	卡莱特	47	5,506.99	0.00
134	688489	三未信安	86	5,439.50	0.00
135	603281	江瀚新材	168	5,187.84	0.00
136	688375	国博电子	65	5,148.00	0.00
137	603125	常青科技	196	4,949.00	0.00
138	001282	三联锻造	145	4,896.15	0.00
139	000603	盛达资源	400	4,836.00	0.00
140	688084	晶品特装	54	4,690.98	0.00
141	688391	钜泉科技	67	4,600.22	0.00
142	001314	亿道信息	108	4,566.24	0.00
143	301121	紫建电子	90	4,557.60	0.00
144	301103	何氏眼科	107	4,489.72	0.00
145	603255	鼎际得	88	4,466.88	0.00
146	301366	一博科技	102	4,431.90	0.00
147	301195	北路智控	95	4,423.20	0.00
148	301096	百诚医药	72	4,363.92	0.00
149	301367	怡和嘉业	29	4,301.86	0.00
150	688132	邦彦技术	157	4,267.26	0.00
151	001360	南矿集团	262	4,108.44	0.00

152	688153	唯捷创芯	55	4,023.80	0.00
153	688237	超卓航科	83	4,007.24	0.00
154	301200	大族数控	100	3,988.00	0.00
155	688297	中无人机	75	3,846.75	0.00
156	688416	恒烁股份	49	3,846.50	0.00
157	688061	灿瑞科技	72	3,803.76	0.00
158	301235	华康医疗	118	3,754.76	0.00
159	301258	富士莱	95	3,735.40	0.00
160	301328	维峰电子	65	3,701.10	0.00
161	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
162	603172	万丰股份	220	3,678.94	0.00
163	688035	德邦科技	61	3,628.28	0.00
164	001301	尚太科技	64	3,603.84	0.00
165	001311	多利科技	59	3,388.37	0.00
166	601136	首创证券	239	3,386.63	0.00
167	688041	海光信息	48	3,276.96	0.00
168	603137	恒尚节能	182	3,210.14	0.00
169	688130	晶华微	71	3,131.10	0.00
170	301338	凯格精机	80	3,112.00	0.00
171	688137	近岸蛋白	59	3,037.32	0.00
172	301396	宏景科技	92	3,003.80	0.00
173	001337	四川黄金	95	2,934.55	0.00
174	301319	唯特偶	49	2,932.65	0.00
175	688302	海创药业	55	2,921.60	0.00
176	301339	通行宝	113	2,839.69	0.00
177	603073	彩蝶实业	130	2,711.80	0.00
178	688420	美腾科技	69	2,672.37	0.00
179	301276	嘉曼服饰	103	2,626.50	0.00
180	001324	长青科技	131	2,594.29	0.00
181	603173	福斯达	88	2,591.60	0.00
182	301356	天振股份	118	2,584.20	0.00
183	688376	美埃科技	65	2,566.85	0.00
184	301265	华新环保	219	2,544.78	0.00
185	001268	联合精密	109	2,529.89	0.00
186	301231	荣信文化	75	2,523.00	0.00
187	603153	上海建科	140	2,485.00	0.00
188	688320	禾川科技	51	2,459.22	0.00
189	301277	新天地	126	2,458.26	0.00
190	301273	瑞晨环保	77	2,414.72	0.00
191	301296	新巨丰	142	2,396.96	0.00
192	301349	信德新材	47	2,356.58	0.00
193	301097	天益医疗	49	2,343.67	0.00
194	301227	森鹰窗业	84	2,329.32	0.00

195	688203	海正生材	165	2,273.70	0.00
196	001366	播恩集团	146	2,251.32	0.00
197	301150	中一科技	45	2,250.45	0.00
198	600925	苏能股份	360	2,221.20	0.00
199	301377	鼎泰高科	95	2,185.00	0.00
200	301223	中荣股份	115	2,152.80	0.00
201	688175	高凌信息	65	2,152.80	0.00
202	688322	奥比中光	51	2,127.72	0.00
203	688349	三一重能	65	2,094.30	0.00
204	603291	联合水务	136	2,068.56	0.00
205	301313	凡拓数创	47	1,989.51	0.00
206	301363	美好医疗	45	1,979.55	0.00
207	002895	川恒股份	100	1,970.00	0.00
208	603282	亚光股份	57	1,967.07	0.00
209	688325	赛微微电	50	1,952.50	0.00
210	301361	众智科技	69	1,945.11	0.00
211	301115	建科股份	85	1,943.10	0.00
212	688231	隆达股份	67	1,911.51	0.00
213	301236	软通动力	70	1,904.70	0.00
214	688381	帝奥微	59	1,904.52	0.00
215	601022	宁波远洋	183	1,901.37	0.00
216	301171	易点天下	85	1,878.50	0.00
217	603130	云中马	80	1,816.80	0.00
218	688362	甬矽电子	54	1,797.66	0.00
219	001238	浙江正特	74	1,741.22	0.00
220	001278	一彬科技	73	1,735.94	0.00
221	688400	凌云光	55	1,676.40	0.00
222	688184	帕瓦股份	53	1,656.78	0.00
223	301335	天元宠物	69	1,644.96	0.00
224	001322	箭牌家居	95	1,590.30	0.00
225	688485	九州一轨	103	1,580.02	0.00
226	688380	中微半导	53	1,573.57	0.00
227	603280	南方路机	63	1,548.54	0.00
228	688291	金橙子	48	1,519.68	0.00
229	001236	弘业期货	99	1,517.67	0.00
230	301365	矩阵股份	90	1,481.40	0.00
231	301152	天力锂能	33	1,473.78	0.00
232	688371	菲沃泰	67	1,449.21	0.00
233	688428	诺诚健华	119	1,374.45	0.00
234	001256	炜冈科技	74	1,361.60	0.00
235	301316	慧博云通	59	1,348.15	0.00
236	603162	海通发展	78	1,329.90	0.00
237	001231	农心科技	55	1,308.45	0.00

238	001368	通达创智	51	1,296.42	0.00
239	688252	天德钰	63	1,278.27	0.00
240	688351	微电生理	64	1,246.08	0.00
241	301283	聚胶股份	35	1,241.80	0.00
242	603057	紫燕食品	49	1,231.37	0.00
243	603065	宿迁联盛	81	1,206.90	0.00
244	688607	康众医疗	61	1,166.32	0.00
245	301161	唯万密封	46	1,063.06	0.00
246	301326	捷邦科技	27	1,026.81	0.00
247	301282	金禄电子	34	1,022.04	0.00
248	601121	宝地矿业	132	1,008.48	0.00
249	301263	泰恩康	48	1,002.24	0.00
250	600973	宝胜股份	200	970.00	0.00
251	688403	汇成股份	78	953.16	0.00
252	688432	有研硅	60	941.40	0.00
253	688455	科捷智能	64	936.32	0.00
254	603170	宝立食品	42	892.92	0.00
255	603565	中谷物流	80	864.00	0.00
256	301126	达嘉维康	62	830.80	0.00
257	001300	三柏硕	63	800.10	0.00
258	301309	万得凯	28	771.12	0.00
259	301176	逸豪新材	44	755.92	0.00
260	001222	源飞宠物	47	711.11	0.00
261	688459	哈铁科技	72	694.08	0.00
262	000951	中国重汽	40	674.00	0.00
263	001333	光华股份	26	653.38	0.00
264	001330	博纳影业	64	593.92	0.00
265	603259	药明康德	8	498.48	0.00
266	688373	盟科药业	55	470.25	0.00
267	301256	华融化学	31	274.66	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	688111	金山办公	34,595,369.35	4.50
2	600009	上海机场	25,483,081.36	3.32
3	002230	科大讯飞	24,861,538.21	3.24
4	601899	紫金矿业	21,222,446.00	2.76
5	600012	皖通高速	20,216,729.57	2.63
6	002463	沪电股份	19,285,118.50	2.51
7	000938	紫光股份	17,850,285.88	2.32
8	601225	陕西煤业	17,555,432.16	2.29

9	301267	华夏眼科	16,199,229.00	2.11
10	300496	中科创达	15,430,877.03	2.01
11	600023	浙能电力	15,411,612.00	2.01
12	601816	京沪高铁	14,849,930.00	1.93
13	300059	东方财富	14,563,175.04	1.90
14	600547	山东黄金	14,444,269.60	1.88
15	300308	中际旭创	14,436,161.43	1.88
16	002459	晶澳科技	14,007,414.40	1.82
17	600011	华能国际	13,523,519.00	1.76
18	301155	海力风电	12,296,962.00	1.60
19	000690	宝新能源	12,223,953.73	1.59
20	300418	昆仑万维	12,123,457.00	1.58

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	688111	金山办公	33,091,688.60	4.31
2	300059	东方财富	30,659,659.70	3.99
3	600009	上海机场	26,581,626.64	3.46
4	002230	科大讯飞	25,116,742.01	3.27
5	002463	沪电股份	19,096,944.80	2.49
6	300443	金雷股份	19,006,591.81	2.47
7	000932	华菱钢铁	18,584,873.00	2.42
8	601899	紫金矿业	18,167,543.13	2.36
9	601225	陕西煤业	17,982,390.00	2.34
10	600012	皖通高速	17,679,593.00	2.30
11	000938	紫光股份	16,679,251.00	2.17
12	000858	五粮液	16,512,499.00	2.15
13	300308	中际旭创	15,587,992.00	2.03
14	301267	华夏眼科	15,314,223.63	1.99
15	300896	爱美客	15,050,002.00	1.96
16	300496	中科创达	14,564,206.36	1.90
17	300856	科思股份	14,181,742.80	1.85
18	601816	京沪高铁	13,118,909.00	1.71
19	600547	山东黄金	12,950,637.00	1.69
20	002459	晶澳科技	12,719,198.00	1.66

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	1,176,447,616.57
卖出股票收入（成交）总额	1,297,349,634.62

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	59,106,210.68	8.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,314,334.25	4.45
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	162,471,255.12	23.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	508,537,769.28	74.62
7	可转债（可交换债）	1,471,859.85	0.22
8	同业存单	9,990,720.00	1.47
9	其他	-	-
10	合计	771,892,149.18	113.26

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019688	22 国债 23	420,000	42,470,089.31	6.23
2	175985	21 国投电	400,000	41,186,531.51	6.04
3	175986	21 财金 02	400,000	40,573,863.01	5.95
4	102102161	21 榆林城投 MTN003	300,000	31,683,715.07	4.65
5	102102098	21 济南高新 MTN003	300,000	31,085,153.42	4.56

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

江苏沙钢集团有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会处罚；

达州市投资有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会四川监管局处罚。

除上述发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	253,790.60
2	应收清算款	51,059,277.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,313,068.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113663	新化转债	1,336,692.30	0.20
2	113064	东材转债	135,167.55	0.02

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 (%)
224	3,113,064.18	696,911,700.13	99.94	414,676.23	0.06

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	17,887.83	0.0026

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	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2016 年 12 月 9 日) 基金份额总额	200,048,869.29
本报告期期初基金份额总额	772,527,308.24
本报告期基金总申购份额	45,938.78
减：本报告期基金总赎回份额	75,246,870.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	697,326,376.36

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	479,281,594.01	19.48	345,705.62	18.83	-

国盛证券	2	468,786,277 .99	19.06	342,825.95	18.67	-
招商证券	1	354,882,010 .39	14.43	255,975.96	13.94	-
民生证券	1	344,220,931 .36	13.99	320,573.88	17.46	-
长江证券	1	225,044,320 .35	9.15	162,325.08	8.84	-
华西证券	1	142,845,103 .69	5.81	104,461.11	5.69	-
中金公司	2	141,150,686 .69	5.74	103,223.59	5.62	-
中泰证券	2	138,731,076 .18	5.64	101,456.07	5.53	-
天风证券	2	100,130,755 .88	4.07	52,197.63	2.84	-
华泰证券	4	33,841,051. 92	1.38	24,747.34	1.35	-
海通证券	1	25,518,166. 07	1.04	18,661.00	1.02	-
国泰君安	1	5,427,412.0 0	0.22	3,969.18	0.22	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东方财富 证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证	2	-	-	-	-	-

券						
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
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(%)
国海证券	43,715,072.52	14.38	-	-	-	-
国盛证券	65,005,072.38	21.39	1,135,000,000.00	27.08	-	-
招商证券	19,668,042.37	6.47	-	-	-	-
民生证券	129,657,610.42	42.66	1,843,000,000.00	43.96	-	-
长江证券	3,867,299.03	1.27	-	-	-	-
华西证券	8,439,893.72	2.78	179,000,000.00	4.27	-	-
中金公司	20,000,000.00	6.58	-	-	-	-
中泰证券	1,999,400.00	0.66	634,000,000.00	15.12	-	-
天风证券	6,166,087.45	2.03	-	-	-	-
华泰证券	3,901,398.42	1.28	341,000,000.00	8.13	-	-
海通证券	1,492,569.19	0.49	60,000,000.00	1.43	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

安信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-

西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	关于旗下部分开放式基金增加杭州银行股份有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 10 日
4	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
5	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
6	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
7	民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101~20230630	597,379,999.12	0.00	0.00	597,379,999.12	85.67

产品特有风险

1、大额赎回风险

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

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

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

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

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

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

2、大额申购风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录**12.1 备查文件目录**

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

民生加银基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日