

# 益民创新优势混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：益民基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 12 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>

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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	益民创新优势混合型证券投资基金
基金简称	益民创新优势混合
基金主代码	560003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 11 日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	444,815,849.39 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有持续创新能力的优势企业和潜在优势企业，为基金份额持有人实现较高风险水平下的较高收益。
投资策略	本基金着眼于全球视野，遵循从全球到国内的分析思路，从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出能够分享全球经济增长的创新行业或主题。本基金对于企业创新特性的定义将主要包括四大方面：技术创新，产品及服务创新、制度创新和商业模式创新。本基金将以寻求创新溢价为目标，来综合构建基金组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金产品定位于偏股型的混合型基金。风险和收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		益民基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康健	秦一楠
	联系电话	010-63105556	010-66060069
	电子邮箱	jianchabu@ymfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-650-8808	95599
传真		010-63100588	010-68121816
注册地址		重庆市渝中区上清寺路 110	北京市东城区建国门内大街 69

	号	号
办公地址	北京市西城区宣外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100052	100031
法定代表人	纪小龙	谷澍

## 2.4 信息披露方式

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

## 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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	106,309,626.07
本期利润	61,024,494.38
加权平均基金份额本期利润	0.1294
本期加权平均净值利润率	7.89%
本期基金份额净值增长率	7.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	328,768,561.80
期末可供分配基金份额利润	0.7391
期末基金资产净值	773,584,411.19
期末基金份额净值	1.7391
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	76.59%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

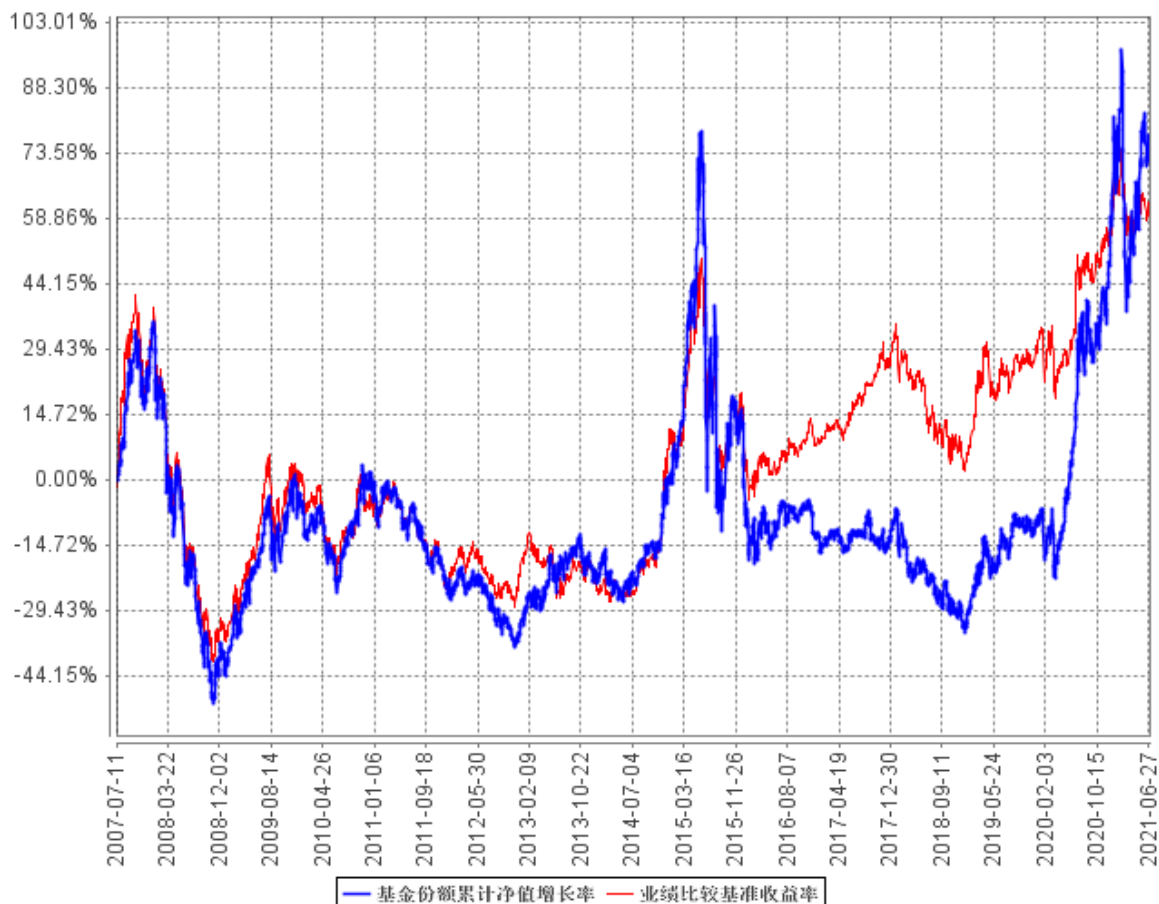
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.47%	1.66%	-1.46%	0.60%	0.99%	1.06%
过去三个月	16.40%	1.72%	2.99%	0.73%	13.41%	0.99%
过去六个月	7.64%	2.30%	1.25%	0.99%	6.39%	1.31%
过去一年	55.49%	1.98%	20.62%	1.00%	34.87%	0.98%
过去三年	126.47%	1.61%	41.14%	1.03%	85.33%	0.58%
自基金合同生效起至今	76.59%	1.64%	62.00%	1.24%	14.59%	0.40%

注：自 2009 年 5 月 1 日起益民创新优势混合型证券投资基金的业绩比较基准，由原来的“沪深

300 指数收益率×75%+新华巴克莱指数收益率×25%”变更为“沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%”。

### 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



注：按照本基金的基金合同约定，本基金自 2007 年 7 月 11 日合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 12 月 12 日正式成立。公司股东由重庆国际信托股份有限公司（出资比例 65%）、中国新纪元有限公司（出资比例 35%）组成，注册资本为 1 亿元人民币，注册地：重庆，主要办公地点：北京。截至 2021 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有 6 只，均为开放式基金。其中，益民红利成长混合型证券投资基金于 2006 年 11 月 21 日成立，首发规模近 9 亿份；益民创新优势混合型证券投资基金于 2007 年 7 月 11 日成立，首发规模近 73 亿份；益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于 2012 年 8 月 16 日成立，首发规模超过 11 亿份；益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于 2013 年 12 月 13 日成立，首发规模超过 10 亿份；益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 5 月 6 日成立，首发规模近 14 亿份。益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 4 月 23 日成立，首发规模超过 2 亿份。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕伟	益民红利成长混合型证券投资基金基金经理、益民创新优势混合型证券投资基金基金经理、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016 年 7 月 4 日	-	14	2007 年加入益民基金管理有限公司，历任交易员、研究员、交易部副总经理、交易部总经理，基金经理、主动管理事业部副总经理兼基金经理、公募基金部副总经理兼基金经理。自 2015 年 6 月 25 日起任益民红利成长混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 2 月 24 日起任益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 4 日起任益民创新优势混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 4 日至 2020 年 1 月 6 日任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

	理				
--	---	--	--	--	--

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

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

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

本报告期末未存在基金经理兼任私募资产管理计划产品投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民创新优势混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，并建立了有效的公平交易行为日常监控和事后分析评估体系，确保公平对待所有投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

本基金管理人通过统计检验的方法，对管理的投资组合在不同时间窗口下（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易行为进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年市场经历了大幅波动。农历春节前，市场延续了前一年的上涨态势，主要投资机会来自于大市值的行业龙头，周期、消费、新能源等领域受到追捧。春节后市场经历了快速回

落期，美债收益率上行引发了市场对全球流动性收紧的担忧，对高估值板块形成了一定压制，前期涨幅较大的龙头公司经历了快速调整。经过两个月左右的震荡调整，市场重拾上涨势头，但内部依旧分化明显。经过调整，“核心资产”交易拥挤的情况得到一定缓解，“核心资产”内部呈分化走势。市场更加青睐业绩增速高的公司，并且高业绩增速偏好进一步扩散到中小市值公司当中。在这段时间里，中小市值公司投资机会要多于大市值公司。从行业表现来看，基础化工、钢铁、电力设备及新能源涨幅领先，非银行金融、农林牧渔、家电跌幅靠前。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7391 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.64%，业绩比较基准收益率为 1.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

研究发展部行业研究员：研究部负责人及行业研究员负责长期停牌股票等没有市价的投资品种所属行业的专业研究，参与基金组合停牌股票行业属性和重估方法的确定，并在估值讨论中承担确定参考行业指数的职责；相关参与人员应当具有多年的行业研究经验，能够较好的对行业发展趋势做出判断，熟悉相关法规和估值方法。

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

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

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

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度：

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

#### 3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；
- 4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金

红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

5、在符合有关基金分红条件的情况下，本基金收益分配每季度不超过三次，每年不超过十二次。基金合同生效不满三个月，收益可不分配。每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一益民基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，益民基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认为，益民基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：益民创新优势混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	42,712,245.50	43,446,282.50
结算备付金		2,689,078.28	2,221,420.94
存出保证金		380,802.75	788,079.96
交易性金融资产	6.4.7.2	732,089,656.50	814,093,358.24
其中：股票投资		688,005,762.50	762,812,956.54
基金投资		-	-
债券投资		44,083,894.00	51,280,401.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,448,279.61	8,048,024.72
应收利息	6.4.7.5	645,021.80	905,094.13
应收股利		-	-
应收申购款		221,139.99	571,817.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		784,186,224.43	870,074,078.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,805,624.18	-
应付赎回款		1,383,058.36	2,449,185.93
应付管理人报酬		961,177.25	1,032,372.92
应付托管费		160,196.22	172,062.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,270,434.78	1,942,869.84
应交税费		2,520,454.02	2,520,454.02

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	500,868.43	594,823.66
负债合计		10,601,813.24	8,711,768.51
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	444,815,849.39	533,123,486.89
未分配利润	6.4.7.10	328,768,561.80	328,238,822.60
所有者权益合计		773,584,411.19	861,362,309.49
负债和所有者权益总计		784,186,224.43	870,074,078.00

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7391 元，基金份额总额 444,815,849.39 份。

## 6.2 利润表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		72,777,741.45	169,180,953.37
1.利息收入		1,063,874.64	980,366.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	182,820.96	215,199.71
债券利息收入		881,053.68	765,167.17
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）		116,839,691.59	98,470,374.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	115,385,218.76	96,819,498.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-88,131.80	13,580.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,542,604.63	1,637,295.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-45,285,131.69	69,720,527.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	159,306.91	9,684.42
<b>减：二、费用</b>		11,753,247.07	13,162,527.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,798,209.44	5,033,540.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	966,368.28	838,923.37

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,875,892.16	7,164,384.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	120.00
7. 其他费用	6.4.7.20	112,777.19	125,558.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		61,024,494.38	156,018,426.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		61,024,494.38	156,018,426.36

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	533,123,486.89	328,238,822.60	861,362,309.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,024,494.38	61,024,494.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-88,307,637.50	-60,494,755.18	-148,802,392.68
其中：1.基金申购款	53,743,578.38	36,072,764.40	89,816,342.78
2.基金赎回款	-142,051,215.88	-96,567,519.58	-238,618,735.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	444,815,849.39	328,768,561.80	773,584,411.19
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		



例为：股票资产为基金资产的 40%-90%，债券资产为基金资产的 5%-55%，权证为基金资产净值的 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，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×75%+中证全债指数收益率×25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年中期报告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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更事项。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更事项。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错更正事项。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年

9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 6.4.7 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	42,712,245.50
定期存款	-
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	-
合计：	42,712,245.50

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	526,769,745.10	688,005,762.50	161,236,017.40	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	44,685,807.20	44,083,894.00	-601,913.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	44,685,807.20	44,083,894.00	-601,913.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	571,455,552.30	732,089,656.50	160,634,104.20	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	8,584.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,210.10
应收债券利息	635,056.09
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	171.40
合计	645,021.80

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,270,434.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,270,434.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,076.39
应付证券出借违约金	-
其他	404,564.37
预提费用	93,227.67
合计	500,868.43

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	533,123,486.89	533,123,486.89
本期申购	53,743,578.38	53,743,578.38
本期赎回(以“-”号填列)	-142,051,215.88	-142,051,215.88
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	444,815,849.39	444,815,849.39

#### 6.4.7.10 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	294,720,266.74	33,518,555.86	328,238,822.60
本期利润	106,309,626.07	-45,285,131.69	61,024,494.38
本期基金份额交易产生的变动数	-58,694,082.08	-1,800,673.10	-60,494,755.18
其中：基金申购款	36,420,149.42	-347,385.02	36,072,764.40
基金赎回款	-95,114,231.50	-1,453,288.08	-96,567,519.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	342,335,810.73	-13,567,248.93	328,768,561.80

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	156,491.59
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	22,229.30
其他	4,100.07
合计	182,820.96

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,652,574,334.88
减：卖出股票成本总额	1,537,189,116.12
买卖股票差价收入	115,385,218.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-88,131.80
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	-88,131.80

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,021,680.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	21,680,131.80

成本总额	
减：应收利息总额	429,680.80
买卖债券差价收入	-88,131.80

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末持有贵金属。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,542,604.63
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	1,542,604.63

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-45,285,131.69
——股票投资	-45,109,880.29
——债券投资	-175,251.40
——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	-45,285,131.69

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	159,093.06
转换费收入	213.85
合计	159,306.91

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,875,892.16
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,875,892.16

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	33,720.30
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
银行费用	10,549.52
合计	112,777.19

**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**

本基金本报告期不存在应披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金本报告期不存在应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**

本报告期未有与基金发生关联交易的各关联方。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

本报告期无关联方交易。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,798,209.44	5,033,540.53
其中：支付销售机构的客	1,189,113.31	935,740.06

户维护费		
------	--	--

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	966,368.28	838,923.37

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本报告期内未发生转融通证券出借业务，无重大关联交易事项。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期内未发生转融通证券出借业务，无重大关联交易事项。

**6.4.10.5 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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2007 年 7 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	8,426,308.25
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	8,426,308.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.1826%

注：无。

**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**

无。

**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	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	42,712,245.50	156,491.59	51,271,503.42	184,173.72

**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**

无。

**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（2021 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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021 年 6 月 30 日	重大资 产重组	3.05	2021 年 7 月 14 日	3.36	1,486,700	5,538,965.00	4,534,435.00	-

**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**

本报告期本基金没有转融通证券出借业务。

**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金融工程部完成，负责产品运行中的动态风险控制（事中）、以及业绩归因（事后）；独立于公司

管理层和其他业务部门的合规审计部对公司合规风险状况及风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	21,583,363.20
合计	0.00	21,583,363.20

注：表中列示的未评级债券投资为国家债券及国家政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	10,069,000.00	10,051,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	34,014,894.00	19,646,038.50
合计	44,083,894.00	29,697,038.50

注：表中所列示的未评级债券投资为国家债券及政策性金融债。

### 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、流动性资产比例及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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的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，不得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限制），本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得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。

同时，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。

本基金所持大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。因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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）将在一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（所有者权益）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。

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公允价值和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 2021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	42,712,245.50	-	-	-	-	-	42,712,245.50
结算备付金	2,689,078.28	-	-	-	-	-	2,689,078.28
存出保证金	380,802.75	-	-	-	-	-	380,802.75
交易性金融资产	34,014,894.00	-	-10,069,000.00	-	-	-688,005,762.50	732,089,656.50

应收证券清算款						5,448,279.61	5,448,279.61
应收利息						645,021.80	645,021.80
应收申购款						221,139.99	221,139.99
资产总计	79,797,020.53		-10,069,000.00			-694,320,203.90	784,186,224.43
负债							
应付证券清算款						3,805,624.18	3,805,624.18
应付赎回款						1,383,058.36	1,383,058.36
应付管理人报酬						961,177.25	961,177.25
应付托管费						160,196.22	160,196.22
应付交易费用						1,270,434.78	1,270,434.78
应交税费						2,520,454.02	2,520,454.02
其他负债						500,868.43	500,868.43
负债总计						-10,601,813.24	10,601,813.24
利率敏感度缺口	79,797,020.53		-10,069,000.00			-683,718,390.66	773,584,411.19
上年度末 2020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	43,446,282.50						43,446,282.50
结算备付金	2,221,420.94						2,221,420.94
存出保证金	788,079.96						788,079.96
交易性金融资产		-21,583,363.20	19,646,038.50	10,051,000.00		-762,812,956.54	814,093,358.24
应收证券清算款						8,048,024.72	8,048,024.72
应收利息						905,094.13	905,094.13
应收申购款						571,817.51	571,817.51
资产总计	46,455,783.40	21,583,363.20	19,646,038.50	10,051,000.00		-772,337,892.90	870,074,078.00
负债							
应付赎回款						2,449,185.93	2,449,185.93
应付管理						1,032,372.92	1,032,372.92

人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	172,062.14	172,062.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,942,869.84	1,942,869.84
应交税费	-	-	-	-	-	2,520,454.02	2,520,454.02
其他负债	-	-	-	-	-	594,823.66	594,823.66
负债总计	-	-	-	-	-	8,711,768.51	8,711,768.51
利率敏感度缺口	46,455,783.40	21,583,363.20	19,646,038.50	10,051,000.00	-	-763,626,124.39	861,362,309.49

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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。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 2021年6月30日		上年度末 2020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	688,005,762.50	88.94	762,812,956.54	88.56
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	44,083,894.00	5.70	51,280,401.70	5.95
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	732,089,656.50	94.64	814,093,358.24	94.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较标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（2021年6月30日）			上年度末（2020年12月31日）
业绩比较基准上升 5%		48,694,078.21	51,796,540.40
业绩比较基准下降 5%		-48,694,078.21	-51,796,540.40

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 以公允价值计量的金融工具

##### (a) 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金于资产负债表日持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 678,936,892.50 元，属于第二层次的余额为 48,618,329.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末 2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 761,594,360.11 元，属于第二层次的余额为 52,498,998.13 元，属于第三层次的余额为 0.00 元）。于本报告期末及上年度末，本基金持有的流通受限的证券由于公开价格无法正常获取而列入第二层次或第三层次，账面价值为

4,534,435.00 元（2020 年 12 月 31 日：1,218,596.43 元）。于本报告期末，本基金于 2020 年 12 月 31 日所持有的全部流通受限股票已正常流通，由第二层次或第三层次转换为第一层次。除上述转换外，于 2021 年，本基金以公允价值计量的资产和负债的各个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次及第三层次的公允价值计量

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

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

6.4.14.3 承诺事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的承诺事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	688,005,762.50	87.73
	其中：股票	688,005,762.50	87.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,083,894.00	5.62
	其中：债券	44,083,894.00	5.62
	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	45,401,323.78	5.79
8	其他各项资产	6,695,244.15	0.85
9	合计	784,186,224.43	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,797.30	0.00
B	采矿业	2,687.32	0.00
C	制造业	503,355,895.48	65.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,295.91	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,801.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	937,032.48	0.12
J	金融业	100,641.86	0.01
K	房地产业	952.40	0.00
L	租赁和商务服务业	18,306.10	0.00
M	科学研究和技术服务业	63,612,182.06	8.22
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	119,952,584.10	15.51
R	文化、体育和娱乐业	6,585.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	688,005,762.50	88.94

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	229,950	68,499,805.50	8.85
2	600436	片仔癀	152,585	68,403,855.50	8.84
3	600519	贵州茅台	33,230	68,344,141.00	8.83
4	300015	爱尔眼科	947,280	67,237,934.40	8.69
5	300760	迈瑞医疗	136,474	65,514,343.70	8.47
6	603259	药明康德	406,234	63,612,182.06	8.22
7	000568	泸州老窖	248,947	58,736,555.18	7.59
8	600809	山西汾酒	127,015	56,902,720.00	7.36
9	300347	泰格医药	272,709	52,714,649.70	6.81
10	000596	古井贡酒	128,000	30,656,000.00	3.96
11	300999	金龙鱼	263,000	22,344,480.00	2.89
12	300601	康泰生物	108,148	16,114,052.00	2.08
13	000661	长春高新	32,238	12,476,106.00	1.61
14	688363	华熙生物	39,812	11,062,162.32	1.43
15	000799	酒鬼酒	37,494	9,583,466.40	1.24
16	002304	洋河股份	31,451	6,516,647.20	0.84
17	600811	东方集团	1,486,700	4,534,435.00	0.59
18	000333	美的集团	25,771	1,839,276.27	0.24
19	688561	奇安信	9,921	915,807.51	0.12
20	002007	华兰生物	17,914	657,085.52	0.08
21	600309	万华化学	4,074	443,332.68	0.06
22	000651	格力电器	3,465	180,526.50	0.02
23	600298	安琪酵母	2,950	160,421.00	0.02
24	688696	极米科技	143	118,976.00	0.02
25	600015	华夏银行	7,439	46,047.41	0.01

26	002142	宁波银行	1,113	43,373.61	0.01
27	000538	云南白药	321	37,146.12	0.00
28	601633	长城汽车	646	28,159.14	0.00
29	002080	中材科技	1,005	26,300.85	0.00
30	600031	三一重工	675	19,622.25	0.00
31	601888	中国中免	61	18,306.10	0.00
32	688521	芯原股份	204	15,905.88	0.00
33	002508	老板电器	319	14,833.50	0.00
34	300750	宁德时代	27	14,439.60	0.00
35	300274	阳光电源	108	12,426.48	0.00
36	003021	兆威机电	200	12,216.00	0.00
37	600779	水井坊	93	11,750.55	0.00
38	300122	智飞生物	52	9,709.96	0.00
39	600276	恒瑞医药	115	7,816.55	0.00
40	603939	益丰药房	130	7,291.70	0.00
41	002271	东方雨虹	129	7,136.28	0.00
42	002594	比亚迪	27	6,777.00	0.00
43	300413	芒果超媒	96	6,585.60	0.00
44	002714	牧原股份	91	5,534.62	0.00
45	601766	中国中车	900	5,472.00	0.00
46	688095	福昕软件	21	5,319.09	0.00
47	603589	口子窖	69	4,670.61	0.00
48	603369	今世缘	84	4,549.44	0.00
49	601336	新华保险	86	3,948.26	0.00
50	600426	华鲁恒升	126	3,899.70	0.00
51	000860	顺鑫农业	90	3,796.20	0.00
52	600438	通威股份	72	3,115.44	0.00
53	601012	隆基股份	35	3,109.40	0.00
54	002475	立讯精密	64	2,944.00	0.00
55	300059	东方财富	83	2,721.57	0.00
56	601857	中国石油	508	2,687.32	0.00
57	600009	上海机场	52	2,502.76	0.00
58	600690	海尔智家	93	2,409.63	0.00
59	688116	天奈科技	18	2,124.00	0.00
60	600104	上汽集团	95	2,087.15	0.00
61	600741	华域汽车	79	2,075.33	0.00
62	002032	苏泊尔	27	1,722.33	0.00
63	002415	海康威视	26	1,677.00	0.00
64	300755	华致酒行	40	1,632.40	0.00

65	600176	中国巨石	98	1,519.98	0.00
66	000001	平安银行	67	1,515.54	0.00
67	002384	东山精密	71	1,479.64	0.00
68	003022	联泓新科	47	1,442.90	0.00
69	002798	帝欧家居	86	1,339.88	0.00
70	601318	中国平安	20	1,285.60	0.00
71	600199	金种子酒	75	1,224.75	0.00
72	600529	山东药玻	36	1,222.20	0.00
73	300014	亿纬锂能	11	1,143.23	0.00
74	600585	海螺水泥	27	1,108.35	0.00
75	600183	生益科技	44	1,030.04	0.00
76	000002	万科 A	40	952.40	0.00
77	601988	中国银行	300	924.00	0.00
78	603309	维力医疗	65	906.75	0.00
79	601138	工业富联	67	831.47	0.00
80	600004	白云机场	74	827.32	0.00
81	600036	招商银行	14	758.66	0.00
82	002626	金达威	14	625.80	0.00
83	603288	海天味业	3	386.85	0.00
84	601933	永辉超市	67	316.91	0.00
85	601816	京沪高铁	51	269.79	0.00
86	002299	圣农发展	11	262.68	0.00
87	600305	恒顺醋业	13	248.56	0.00
88	300285	国瓷材料	5	243.75	0.00
89	000089	深圳机场	26	202.02	0.00
90	600498	烽火通信	9	167.67	0.00
91	000703	恒逸石化	14	167.30	0.00
92	002641	永高股份	20	138.00	0.00
93	002773	康弘药业	4	92.52	0.00
94	600197	伊力特	3	91.98	0.00
95	002035	华帝股份	11	79.42	0.00
96	601398	工商银行	13	67.21	0.00
97	600729	重庆百货	2	54.90	0.00
98	000725	京东方 A	3	18.72	0.00
99	000789	万年青	1	11.44	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	000799	酒鬼酒	115,053,274.01	13.36
2	002304	洋河股份	102,355,325.57	11.88
3	000596	古井贡酒	85,479,818.60	9.92
4	300274	阳光电源	81,666,430.49	9.48
5	600436	片仔癀	80,188,011.60	9.31
6	300347	泰格医药	78,177,653.62	9.08
7	000661	长春高新	77,762,796.29	9.03
8	601888	中国中免	75,531,856.44	8.77
9	300014	亿纬锂能	66,888,860.19	7.77
10	603259	药明康德	64,777,597.38	7.52
11	300760	迈瑞医疗	63,769,342.00	7.40
12	688363	华熙生物	51,968,498.23	6.03
13	300015	爱尔眼科	51,455,743.57	5.97
14	300601	康泰生物	43,852,305.68	5.09
15	003022	联泓新科	43,626,773.18	5.06
16	000333	美的集团	43,234,961.78	5.02
17	603288	海天味业	43,048,480.52	5.00
18	300999	金龙鱼	42,960,957.69	4.99
19	002032	苏泊尔	33,178,641.94	3.85
20	002460	赣锋锂业	33,156,700.44	3.85
21	600337	美克家居	29,120,157.16	3.38
22	600132	重庆啤酒	25,484,396.29	2.96
23	603589	口子窖	18,988,751.00	2.20
24	000568	泸州老窖	18,135,082.00	2.11

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000596	古井贡酒	116,644,123.26	13.54

2	000799	酒鬼酒	99,434,878.56	11.54
3	603589	口子窖	94,119,524.84	10.93
4	601012	隆基股份	91,621,023.54	10.64
5	002304	洋河股份	88,695,173.76	10.30
6	600438	通威股份	82,555,617.18	9.58
7	002475	立讯精密	72,542,411.27	8.42
8	300274	阳光电源	71,852,242.49	8.34
9	601888	中国中免	65,425,783.00	7.60
10	603369	今世缘	64,275,373.13	7.46
11	300014	亿纬锂能	63,004,665.60	7.31
12	000661	长春高新	59,640,252.06	6.92
13	600809	山西汾酒	52,265,981.00	6.07
14	000568	泸州老窖	51,536,223.40	5.98
15	688363	华熙生物	46,022,560.50	5.34
16	003022	联泓新科	44,968,700.94	5.22
17	603288	海天味业	42,973,283.00	4.99
18	000333	美的集团	39,175,444.95	4.55
19	300347	泰格医药	38,984,117.44	4.53
20	600519	贵州茅台	35,325,357.00	4.10
21	600436	片仔癀	33,337,809.00	3.87
22	000858	五粮液	31,556,267.62	3.66
23	002032	苏泊尔	30,988,558.24	3.60
24	002460	赣锋锂业	28,898,302.26	3.35
25	600132	重庆啤酒	27,592,813.00	3.20
26	600337	美克家居	25,484,932.26	2.96
27	300601	康泰生物	25,334,428.00	2.94
28	300999	金龙鱼	22,503,493.15	2.61
29	603259	药明康德	18,971,362.00	2.20

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,507,491,802.37
卖出股票收入（成交）总额	1,652,574,334.88

### 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	34,014,894.00	4.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,069,000.00	1.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,083,894.00	5.70

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	010107	21 国债(7)	339,470	34,014,894.00	4.40
2	155415	19 中银 01	100,000	10,069,000.00	1.30

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名股票中均在备选股票库内。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	380,802.75
2	应收证券清算款	5,448,279.61
3	应收股利	-
4	应收利息	645,021.80
5	应收申购款	221,139.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,695,244.15

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告无处于转股期的可转换债券明细。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
30,453	14,606.63	953,733.12	0.21%	443,862,116.27	99.79%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2007 年 7 月 11 日 ) 基金份额总额	7,238,122,974.81
本报告期期初基金份额总额	533,123,486.89
本报告期基金总申购份额	53,743,578.38
减:本报告期基金总赎回份额	142,051,215.88
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	444,815,849.39

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内不存在相关重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所未发生变化。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	516,719,731.67	16.35%	481,223.02	16.35%	-
东北证券	1	415,682,851.93	13.15%	387,125.32	13.15%	-
中银国际	1	379,279,812.20	12.00%	353,222.19	12.00%	-
海通证券	2	344,044,244.16	10.89%	320,407.84	10.89%	-
广发证券	1	252,302,255.35	7.98%	234,969.14	7.98%	-
国金证券（沪深）	2	235,735,098.71	7.46%	219,539.74	7.46%	-
民生证券（沪深）	2	230,505,834.64	7.29%	214,670.73	7.29%	-

中信证券（沪深）	2	200,805,525.64	6.35%	187,003.72	6.35%	-
东兴证券	1	157,225,601.72	4.98%	146,423.79	4.98%	-
太平洋证券	1	136,746,407.85	4.33%	127,352.09	4.33%	-
中金沪市	1	119,192,387.77	3.77%	111,003.36	3.77%	-
中信建投（沪深）	2	64,953,449.44	2.06%	60,490.41	2.06%	-
中金公司	1	62,642,027.60	1.98%	58,338.88	1.98%	-
东方证券	1	44,230,908.57	1.40%	41,192.24	1.40%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

（1）基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机构的处罚；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

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

（3）研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符

合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强的风险意识和风险测算能力；

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

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

(6) 其他因素（在某一具体方面的特别优势）。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序：

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

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

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

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

3、本报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	11,529,263.48	78.14%	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券(沪 深)	-	-	-	-	-	-
民生证券(沪 深)	-	-	-	-	-	-
中信证券(沪 深)	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1,204,647.34	8.16%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中金沪市	2,020,588.46	13.69%	-	-	-	-
中信建投(沪 深)	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

## 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 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	《证券时报》及公司网站	2021 年 1 月 1 日
2	益民基金管理有限公司旗下全部	《证券时报》及公司	2021 年 1 月 21 日

	基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	网站	
3	益民创新优势混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	《证券时报》及公司网站	2021 年 1 月 21 日
4	益民基金管理有限公司公募基金产品风险等级划分结果说明	《证券时报》及公司网站	2021 年 3 月 9 日
5	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	《证券时报》及公司网站	2021 年 3 月 30 日
6	益民创新优势混合型证券投资基金 2020 年年度报告摘要	《证券时报》及公司网站	2021 年 3 月 30 日
7	益民创新优势混合型证券投资基金 2020 年年度报告	《证券时报》及公司网站	2021 年 3 月 30 日
8	益民基金管理有限公司关于终止和耕传承基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》及公司网站	2021 年 4 月 19 日
9	益民基金管理有限公司关于终止上海云湾基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《证券时报》及公司网站	2021 年 4 月 19 日
10	益民基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》及公司网站	2021 年 4 月 21 日
11	益民创新优势混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《证券时报》及公司网站	2021 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

本基金本报告期内未出现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创新优势混合型证券投资基金的文件；
- 2、益民创新优势混合型证券投资基金基金合同；
- 3、益民创新优势混合型证券投资基金托管协议；
- 4、中国证监会批准设立益民基金管理有限公司的文件；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的公告。

### 12.2 存放地点

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。

### 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

公司传真：(86) 010-63100608

公司网址：<http://www.ymfund.com>

益民基金管理有限公司

2021 年 8 月 25 日