

民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基  
金中基金（FOF）  
2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 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>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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遵规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49

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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 本报告期投资基金情况 .....	50
7.13 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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.....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 本报告期持有的基金发生的主要影响事件 .....	62
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.9 其他重大事件 .....	67
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</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 .....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	民生加银卓越配置 6 个月混合型 FOF
基金主代码	008886
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 20 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	6,020,936,282.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在经济运行中，经济增长速度、经济周期循环、货币政策、财政政策等宏观经济因素会给不同资产、行业带来不同投资机会。本基金在严格控制风险的前提下，通过有效的动态资产配置策略，发掘不同时期不同资产类别、行业的投资机会和超额收益，追求基金资产的长期稳健增值。
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收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 30% + 中债综合指数收益率 $\times$ 65% + 一年期定期存款基准利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	邢颖
	联系电话	010-88566571
	电子邮箱	xingying@ms jyfund. com. cn
客户服务电话	400-8888-388	021-60637111
传真	0755-23999800	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	518038	100033
法定代表人	张焕南	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjyfund.com.cn">http://www.msjyfund.com.cn</a>
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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	295,900,142.86
本期利润	168,477,873.25
加权平均基金份额本期利润	0.0214
本期加权平均净值利润率	1.87%
本期基金份额净值增长率	1.95%
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	498,600,181.45
期末可供分配基金份额利润	0.0828
期末基金资产净值	6,980,464,040.25
期末基金份额净值	1.1594
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	15.94%

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

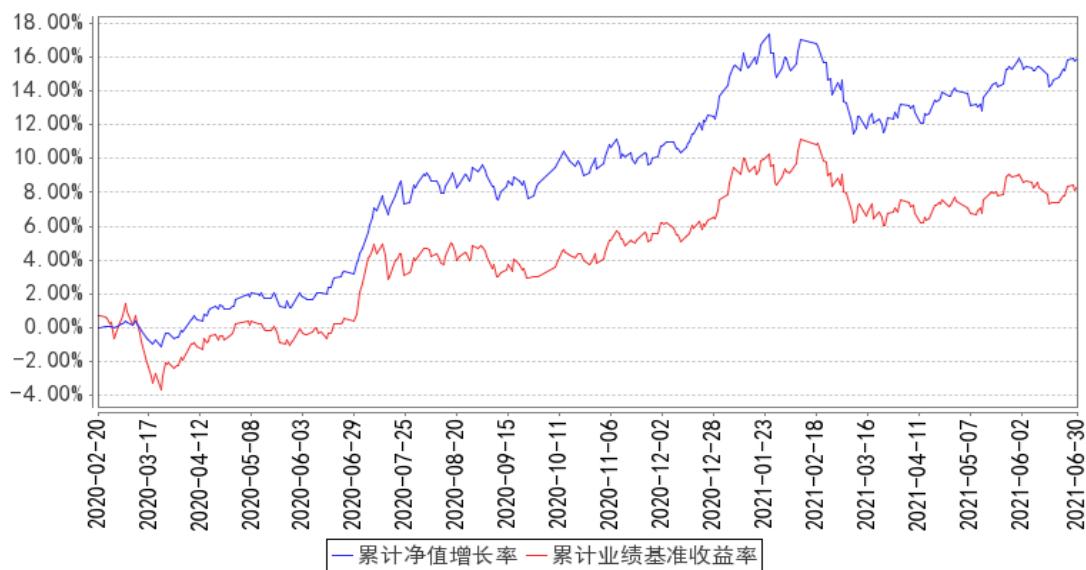
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.15%	0.27%	-0.62%	0.24%	0.77%	0.03%
过去三个月	3.14%	0.30%	1.41%	0.29%	1.73%	0.01%
过去六个月	1.95%	0.40%	0.75%	0.40%	1.20%	0.00%
过去一年	11.68%	0.39%	7.48%	0.39%	4.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.94%	0.35%	8.34%	0.40%	7.60%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中债综合指数收益率×65%+一年期定期存款基准利率（税后）×5%

#### 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

民生加银卓越配置 6 个月混合型 FOF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2020 年 2 月 20 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

建仓期结束及本报告期末，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。

### 3.3 其他指标

注：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

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

截至2021年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理88只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银汇鑫一年定期开放债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数型证券投资基金、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、民生加银添鑫纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银新动能一年定期开放混合型证券投资基金、民生加银高等级信用债债券型证券投资基金、民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、民生加银嘉益债券型证券投资基金、民生加银瑞盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银医药健康股票型证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、民生加银康利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、民生加银汇利混合型证券投资基金、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、民生加银润利混合型证券投资基金、民生加银兴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。

#### 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		

于善辉	本基金基金经理、公司副总经理	2020 年 2 月 20 日	-	20.0 年	北京大学数学科学学院理学硕士，20 年证券从业经历。曾任职于天相投资顾问有限公司，任分析师、金融创新部经理、总裁助理、副总经理等职。2012 年加入民生加银基金管理有限公司，现任公司副总经理、基金经理、公司投资决策委员会成员、权益资产条线投资决策委员会成员、固收资产条线投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员。自 2019 年 4 月至今担任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）基金经理，自 2020 年 2 月至今担任民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；自 2020 年 9 月至今担任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）基金经理；自 2021 年 2 月至今担任民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。
-----	----------------	-----------------	---	--------	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公

司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

根据本基金的合同约束和产品定位，秉承配置决定风险和收益的理念，本基金采用稳健的风险收益配置策略，有效控制组合回撤水平的前提下，积极把握债券和股票市场的投资机会，在获取固收类资产平稳收益的同时，积极把握权益类资产超额收益的机会，利用固收类资产和权益类资产的不相关属性，适度降低组合的回撤水平，基本实现了组合平稳增值的目标，核心资产“抱团瓦解”导致的急剧下跌让本基金的投资策略承受了前所未有的挑战，回撤水平也一度上升至较高的水平，让持有人承担了较大的波动，本基金深感不安。2021年上半年实现了 1.95%的净值增长率，略跑赢同期业绩比较基准，但最大回撤达到 4.99%，超出了我们的预期，我们将认真反思和进一步完善我们的投资框架，进一步提升回撤控制水平，审慎管好投资组合，不负持有人的信任。整体而言，过去 1 年多的投资管理实践表明，本基金的风险收益特征与本基金“固收+”的定位相匹配，较好地符合了理财类客户平稳增值的要求。

#### 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 1.1594 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.95%，业绩比较基准收益率为 0.75%。

### 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 2021 年下半年，我们认为在全面降准政策落地之后，标志着政策将恢复到疫情前的常态化水平，仍然以稳为主，经济将更加着重于实体的稳定性和持续性。市场之前担心的信用收缩、估值抑制将得到缓解，风险偏好也得到了一定程度的缓解。伴随着中报的披露，业绩高增长是大概率事件，“业绩兑现”将在一定程度上降低市场对于估值的担心。A 股有望在业绩超预期和流动性中性偏宽松的驱动下继续提供个股挖掘的机会，权益类资产尤其是主动权益基金值得重点配置，我们将结合市场时机，有效控制回撤的前提下，进行细分资产的优选和再配置。债券市场仍然处

于可配置区域，适合于稳定收益的投资者适当配置，我们将维持基本的配置。细分资产选择上，我们将围绕高景气度和中报业绩超预期的主线进行配置，顺周期、半导体、新能源（车）、军工、医药、新消费、非银金融等板块均是大概率获得超额收益的投资方向。本基金将坚持相对中性的大类资产配置策略，在有效控制风险的前提下，继续坚持固定收益类产品平稳收益的属性定位，将其做为核心配置；同时，加大挖掘权益类资产的超额收益机会，通过对细分资产的结构优化获取稳定的超额收益，在有效控制风险的前提下，努力实现本基金平稳较高增值的目标定位。

#### 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、固定收益部、监察稽核部、风险管理部等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用评级人员。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《中华人民共和国证券投资基金法》、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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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	153,642,314.03	115,767,981.00
结算备付金		762,481.75	2,619,921.02
存出保证金		507,876.58	318,838.56
交易性金融资产	6.4.7.2	7,065,735,697.32	9,556,544,519.22
其中：股票投资		605,132,369.67	1,159,865,747.58
基金投资		6,140,766,908.15	7,892,246,842.78
债券投资		319,836,419.50	504,431,928.86
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		36,910,752.20	303,703,485.44
应收利息	6.4.7.5	6,200,998.87	10,128,117.50
应收股利		295,926.24	—
应收申购款		1,667,338.30	240,910,545.46
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		7,265,723,385.29	10,229,993,408.20
<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		-	71, 463, 120. 52
应付赎回款		280, 881, 640. 35	53, 354, 004. 16
应付管理人报酬		2, 918, 385. 29	3, 148, 559. 08
应付托管费		689, 059. 91	735, 481. 78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6. 4. 7. 7	496, 870. 97	374, 193. 61
应交税费		169, 250. 17	16. 92
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 8	104, 138. 35	30, 000. 00
负债合计		285, 259, 345. 04	129, 105, 376. 07
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6. 4. 7. 9	6, 020, 936, 282. 16	8, 882, 033, 357. 59
未分配利润	6. 4. 7. 10	959, 527, 758. 09	1, 218, 854, 674. 54
所有者权益合计		6, 980, 464, 040. 25	10, 100, 888, 032. 13
负债和所有者权益总计		7, 265, 723, 385. 29	10, 229, 993, 408. 20

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1594 元，基金份额总额 6,020,936,282.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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 2 月 20 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		197, 110, 274. 57	133, 377, 251. 75
1. 利息收入		6, 246, 383. 64	293, 981. 48
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 11	180, 361. 93	134, 169. 13
债券利息收入		6, 066, 021. 71	9, 995. 16
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	149, 817. 19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”）		318, 286, 160. 54	50, 967, 391. 05

填列)			
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 12	246,131,363.75	11,817,162.51
基金投资收益	6. 4. 7. 13	17,262,422.55	45,233.08
债券投资收益	6. 4. 7. 14	2,007,423.39	212,626.46
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 14. 5	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 15	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 16	-	-
股利收益	6. 4. 7. 17	52,884,950.85	38,892,369.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 18	-127,422,269.61	82,046,281.19
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. 19	-	69,598.03
减：二、费用		28,632,401.32	6,826,406.16
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	20,160,489.32	4,906,177.36
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	4,874,172.51	1,083,169.66
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 20	3,361,986.40	803,980.16
5. 利息支出		1,689.19	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,689.19	-
6. 税金及附加		94,998.55	0.96
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	139,065.35	33,078.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		168,477,873.25	126,550,845.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		168,477,873.25	126,550,845.59

注：上年度可比期间财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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）	8,882,033,357.59	1,218,854,674.54	10,100,888,032.13

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,477,873.25	168,477,873.25
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)	-2,861,097,075.43	-427,804,789.70	-3,288,901,865.13
其中：1. 基金申购款	1,607,306,336.07	213,236,043.80	1,820,542,379.87
2. 基金赎回款	-4,468,403,411.50	-641,040,833.50	-5,109,444,245.00
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)	6,020,936,282.16	959,527,758.09	6,980,464,040.25
项目	上年度可比期间 2020 年 2 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,982,103,499.05	-	2,982,103,499.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	126,550,845.59	126,550,845.59
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)	675,113,300.72	12,641,132.41	687,754,433.13
其中：1. 基金申购款	675,113,300.72	12,641,132.41	687,754,433.13
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	3,657,216,799.77	139,191,978.00	3,796,408,777.77

注：上年度可比期间财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

李操纲

朱永明

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）《关于准予民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可〔2019〕2710 号文）核准，由民生加银基金管理有限公司依照国家相关法律法规的规定、《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》、《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告》的规定发售，基金合同于 2020 年 2 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,982,103,499.05 份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司（以下简称“民生加银基金公司”），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》和《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（含 QDII 基金、香港互认基金）、股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及港股通标的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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）。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。

本基金的投资组合比例为：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含

QDII 基金、香港互认基金) 的比例不低于 80%。其中投资于股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 10%—50%。投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产 50%。基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*30%+中债综合指数收益率\*65%+一年期定期存款基准利率(税后)\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况、2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国

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

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

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

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 6.4.7 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	153,642,314.03
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	153,642,314.03

### 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	526,693,972.64	605,132,369.67	78,438,397.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	320,694,717.06	-858,297.56
	银行间市场	-	-
	合计	320,694,717.06	-858,297.56
资产支持证券	-	-	-
基金	5,856,010,194.61	6,140,766,908.15	284,756,713.54
其他	-	-	-

合计	6,703,398,884.31	7,065,735,697.32	362,336,813.01
----	------------------	------------------	----------------

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末无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	5,520.95
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	522.09
应收债券利息	6,194,727.14
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	228.69
合计	6,200,998.87

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末无其他资产。

#### 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	496,870.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	496,870.97

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	59,507.37
合计	104,138.35

#### 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	账面金额
上年度末	8,882,033,357.59	8,882,033,357.59
本期申购	1,607,306,336.07	1,607,306,336.07
本期赎回（以“-”号填列）	-4,468,403,411.50	-4,468,403,411.50
- 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	6,020,936,282.16	6,020,936,282.16

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	407,317,967.34	811,536,707.20	1,218,854,674.54
本期利润	295,900,142.86	-127,422,269.61	168,477,873.25
本期基金份额交易产生的变动数	-204,617,928.75	-223,186,860.95	-427,804,789.70
其中：基金申购款	100,885,225.04	112,350,818.76	213,236,043.80
基金赎回款	-305,503,153.79	-335,537,679.71	-641,040,833.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	498,600,181.45	460,927,576.64	959,527,758.09

#### 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		148,882.30
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		26,065.34
其他		5,414.29
合计		180,361.93

## 6.4.7.12 股票投资收益

### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元	
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	246,131,363.75
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	246,131,363.75

### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元	
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,082,546,205.48
减：卖出股票成本总额	836,414,841.73
买卖股票差价收入	246,131,363.75

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	3,281,319,103.39
减：卖出/赎回基金成本总额	3,264,056,680.84
基金投资收益	17,262,422.55

## 6.4.7.14 债券投资收益

### 6.4.7.14.1 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	2,007,423.39
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	2,007,423.39

#### 6.4.7.14.2 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	704,728,053.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	689,736,650.54
减：应收利息总额	12,983,979.51
买卖债券差价收入	2,007,423.39

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内无衍生工具投资收益。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.17 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	5,030,995.03
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	47,853,955.82
合计	52,884,950.85

#### 6.4.7.18 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	-127,422,269.61
股票投资	-181,384,765.65
债券投资	-2,229,642.52
资产支持证券投资	—
基金投资	56,192,138.56
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	-127,422,269.61

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金于本期无其他收入。

### 6.4.7.20 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	2,302,002.37
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	1,059,984.03
其中：申购费	23,000.00
赎回费	850,811.94
交易费	96,328.21
转换费	89,843.88
合计	3,361,986.40

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	223,822.40
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	23,365,451.69
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	5,830,820.01

注：期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

### 6.4.7.21 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	34,927.00
合计	139,065.35

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
民生加银基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 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均无通过关联方的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均无通过关联方的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均无通过关联方的交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方的交易单元进行过基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内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。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,160,489.32	4,906,177.36
其中：支付销售机构的客户维护费	13,354,780.39	3,384,236.03

注：①支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.60% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理费计算公式为：日基金管理费 = 前一日的基金资产净值扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分 × 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,874,172.51	1,083,169.66

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.15% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日的基金资产净值扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均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：基金管理人本报告期内及上年度可比期间均无运用固有资金投资本基金。

#### 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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	期末余额	2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	当期利息收入
中国建设银行	153,642,314.03	148,882.30	5,944,411.83	112,398.10

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 762,481.75 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 2,384,208.86 元）。

### 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：本基金在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

#### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人民生加银基金公司的公开募集证券投资基金管理费 1,690,308,510.19 元，占本基金资产净值的比例为 24.21%。

#### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	15,336.83	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	69,598.03
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	8,232,258.30	2,012,341.45

当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,685,793.63	416,879.63
当期交易基金产生的交易费（元）	886.96	-
当期交易基金产生的转换费（元）	27,068.88	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 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

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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

			日								
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	—	
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	—	
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	—	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	—	
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	—	
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	—	
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	—	
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	—	
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	—	
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 08 月 25 日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	—	
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	—	
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	—	
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	—	
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	—	

300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

			日								
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93		-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95		-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48		-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54		-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90		-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12		-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43		-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28		-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32		-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89		-

			日								
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	—	
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	—	
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	—	
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	—	
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	—	
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	—	
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	—	
688059	华锐精密	2021 年 2 月 1 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	—	
688070	纵横股份	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	—	
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	—	
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	—	
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	—	
688314	康拓	2021 年	2021	新股流	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	—	

	医疗	5月11日	年11月18日	通受限							
688355	明志科技	2021年4月30日	2021年11月12日	新股流通受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	—	
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	—	
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	—	
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	新股流通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	—	
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年09月30日	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	—	
688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	—	
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	—	

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	—

注：①根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定

的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。  
②上述流通受限证券的“可流通日”是根据证券上市公告书估算的流通日期，最终可流通日期以证券解禁上市流通的公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2021 年 06 月 30 日，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因：风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会合规与风险管理委员会制定的各项风险管理及内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负

责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以合规与风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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发行的证券，不得超过该证券的 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；本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并采用券款对付交割方式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	—	—	—
A-1 以下	—	—	—
未评级	270,837,000.00	483,879,600.00	
合计	270,837,000.00	483,879,600.00	

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 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	上年度末
	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
AAA	872,000.00	3,111,227.60
AAA 以下	-	2,316,601.26
未评级	48,127,419.50	15,124,500.00
合计	48,999,419.50	20,552,328.86

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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，除附注 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下，其余金融资产均能及时变现。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	153,642,314 .03	-	-	-	-	-	153,642,31 4.03
结算备付金	762,481.75	-	-	-	-	-	762,481.75
存出保证金	507,876.58	-	-	-	-	-	507,876.58
交易性金融资 产	28,073,419. 50	20,054,00 0.00	270,837,000 .00	872,000.0 0	6,745,899 ,277.82	7,065,735, 697.32	
应收利息	-	-	-	-	-	6,200,998 .87	6,200,998. 87
应收股利	-	-	-	-	-	295,926.2 4	295,926.24

应收申购款	-	-	-	-	-	1,667,338	1,667,338.
						.30	.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	36,910,75	36,910,752
						2.20	.20
资产总计	182,986,091	20,054,00	270,837,000	-	872,000.0	6,790,974	7,265,723,
	.86	0.00	.00		0	,293.43	385.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	280,881,6	280,881,64
						40.35	0.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,918,385	2,918,385.
						.29	.29
应付托管费	-	-	-	-	-	689,059.9	689,059.91
						1	
应付交易费用	-	-	-	-	-	496,870.9	496,870.97
						7	
应交税费	-	-	-	-	-	169,250.1	169,250.17
						7	
其他负债	-	-	-	-	-	104,138.3	104,138.35
						5	
负债总计	-	-	-	-	-	285,259,3	285,259,34
						45.04	5.04
利率敏感度缺口	182,986,091	20,054,00	270,837,000	-	872,000.0	6,505,714	6,980,464,
	.86	0.00	.00		0	,948.39	040.25
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	115,767,981	-	-	-	-	-	115,767,98
	.00						1.00
结算备付金	2,619,921.0	-	-	-	-	-	2,619,921.
	2						02
存出保证金	318,838.56	-	-	-	-	-	318,838.56
交易性金融资产	423,957,600	-	75,046,500.	1,416,22	4,011,601	9,052,112	9,556,544,
	.00		00	7.60	.26	,590.36	519.22
应收利息	-	-	-	-	-	10,128,11	10,128,117
						7.50	.50
应收申购款	-	-	-	-	-	240,910,5	240,910,54
						45.46	5.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	303,703,4	303,703,48
						85.44	5.44
资产总计	542,664,340	-	75,046,500.	1,416,22	4,011,601	9,606,854	10,229,993
	.58		00	7.60	.26	,738.76	,408.20
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,354,00	53,354,004

						4.16	.16
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	3,148,559. .08	3,148,559. 08
应付托管费	-	-	-	-	-	735,481.7 8	735,481.78
应付证券清算 款	-	-	-	-	-	71,463,12 0.52	71,463,120 .52
应付交易费用	-	-	-	-	-	374,193.6 1	374,193.61
应交税费	-	-	-	-	-	16.92	16.92
其他负债	-	-	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	129,105,3 76.07	129,105,37 6.07
利率敏感度缺 口	542,664,340 .58	75,046,500. 00	1,416,22 7.60	4,011,601 .26	9,477,749 ,362.69	10,100,888 ,032.13	

#### 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)	
分析		本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月 31日)
1. 市场利率下降25 个基点	269,695.00	129,061.63	
	2. 市场利率上升25 个基点	-269,240.06	-128,831.50

#### 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

本基金承受的其他价格风险,主要是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。本基金的其他价格风险,主要受到

证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 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	605,132,369.67	8.67	1,159,865,747.58	11.48
交易性金融资产 —基金投资	6,140,766,908.15	87.97	7,892,246,842.78	78.13
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	6,745,899,277.82	96.64	9,052,112,590.36	89.62

#### 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）	
分析		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
1. 沪深 300 指数上升 5%	101,782,918.94	13,130,384.25	
2. 沪深 300 指数下降 5%	-101,782,918.90	-13,130,384.25	

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 6,742,818,766.63 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 9,025,300,659.25 元），划分为第二层次的余额为人民币 322,916,930.69 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 531,243,859.97 元），无划分为第三层次余额（2020 年 12 月 31 日：无）。

#### (a) 第二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。

#### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（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）

其他金融工具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。

## § 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	605,132,369.67	8.33
	其中：股票	605,132,369.67	8.33
2	基金投资	6,140,766,908.15	84.52
3	固定收益投资	319,836,419.50	4.40
	其中：债券	319,836,419.50	4.40
	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	154,404,795.78	2.13
8	其他各项资产	45,582,892.19	0.63
9	合计	7,265,723,385.29	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 163,257,008.28 元，占基金资产净值比例 2.34%。

## 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	5,439.50	0.00
B	采矿业	11,628,000.00	0.17
C	制造业	258,055,774.11	3.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	26,888.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,372,000.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,406,429.11	1.24
J	金融业	19,284,000.00	0.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	42,014,000.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	441,875,361.39	6.33

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	-	-
非日常生活消费品	34,745,164.56	0.50
日常消费品	-	-

能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	21,312,897.12	0.31
工业	12,830,673.60	0.18
信息科技	34,202,232.36	0.49
电信业务	50,174,424.00	0.72
公用事业	-	-
房地产	9,991,616.64	0.14
合计	163,257,008.28	2.34

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	601888	中国中免	140,000	42,014,000.00	0.60
2	600845	宝信软件	800,000	40,720,000.00	0.58
3	000725	京东方A	6,000,000	37,440,000.00	0.54
4	00700	腾讯控股	70,000	34,015,430.40	0.49
5	688111	金山办公	80,000	31,584,000.00	0.45
6	600486	扬农化工	250,000	27,942,500.00	0.40
7	002352	顺丰控股	360,000	24,372,000.00	0.35
8	002460	赣锋锂业	200,000	24,218,000.00	0.35
9	00981	中芯国际	1,155,000	22,969,152.36	0.33
10	300750	宁德时代	40,000	21,392,000.00	0.31
11	02269	药明生物	180,000	21,312,897.12	0.31
12	601318	中国平安	300,000	19,284,000.00	0.28
13	300463	迈克生物	450,000	18,940,500.00	0.27
14	00175	吉利汽车	900,000	18,309,920.40	0.26
15	002601	龙佰集团	500,000	17,290,000.00	0.25
16	600309	万华化学	150,000	16,323,000.00	0.23
17	00941	中国移动	400,000	16,158,993.60	0.23
18	600176	中国巨石	1,000,000	15,510,000.00	0.22
19	600570	恒生电子	150,000	13,987,500.00	0.20
20	000661	长春高新	35,000	13,545,000.00	0.19
21	03690	美团-W	50,000	13,329,921.60	0.19
22	02357	中航科工	3,000,000	12,830,673.60	0.18
23	688006	杭可科技	150,000	12,750,000.00	0.18
24	300601	康泰生物	80,000	11,920,000.00	0.17
25	601899	紫金矿业	1,200,000	11,628,000.00	0.17
26	01810	小米集团-W	500,000	11,233,080.00	0.16
27	300122	智飞生物	60,000	11,203,800.00	0.16

28	06098	碧桂园服务	100,000	6,981,151.20	0.10
29	002110	三钢闽光	1,000,000	6,740,000.00	0.10
30	603501	韦尔股份	20,000	6,440,000.00	0.09
31	603338	浙江鼎力	100,000	5,869,000.00	0.08
32	300776	帝尔激光	24,100	3,599,576.00	0.05
33	01999	敏华控股	200,000	3,105,322.56	0.04
34	02869	绿城服务	300,000	3,010,465.44	0.04
35	688383	新益昌	19,736	2,782,973.36	0.04
36	688538	和辉光电	375,156	1,268,027.28	0.02
37	688575	亚辉龙	15,435	685,314.00	0.01
38	688606	奥泰生物	2,703	402,747.00	0.01
39	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
40	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
41	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.00
42	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
43	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
44	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.00
45	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
46	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
47	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
48	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
49	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
50	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
51	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
52	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
53	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
54	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
55	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
56	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
57	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
58	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
59	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
60	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
61	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
62	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
63	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
64	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
65	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
66	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
67	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
68	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
69	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00

70	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
71	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
72	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
73	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
74	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
75	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
76	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
77	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
78	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
79	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
80	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
81	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
82	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
83	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
84	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
85	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
86	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
87	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
88	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
89	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
90	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
91	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
92	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
93	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
94	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
95	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
96	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
97	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
98	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
99	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
100	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
101	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
102	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
103	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
104	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
105	301012	扬电科技	170	4,124.20	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	000725	京东方 A	39,224,556.00	0.39

2	300750	宁德时代	24,904,361.22	0.25
3	002601	龙佰集团	24,061,898.00	0.24
4	00981	中芯国际	23,550,511.53	0.23
5	600176	中国巨石	20,675,212.00	0.20
6	601888	中国中免	20,028,730.00	0.20
7	00941	中国移动	17,058,084.23	0.17
8	600309	万华化学	16,430,133.35	0.16
9	600486	扬农化工	15,004,436.47	0.15
10	600845	宝信软件	13,347,519.51	0.13
11	603520	司太立	11,799,378.06	0.12
12	00175	吉利汽车	11,758,371.89	0.12
13	000538	云南白药	11,606,878.58	0.11
14	01810	小米集团-W	10,825,425.73	0.11
15	603690	至纯科技	10,536,836.81	0.10
16	01919	中远海控	9,711,281.11	0.10
17	01797	新东方在线	9,707,560.77	0.10
18	600900	长江电力	9,399,494.98	0.09
19	600570	恒生电子	8,903,843.00	0.09
20	300463	迈克生物	8,832,919.00	0.09

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	002460	赣锋锂业	62,355,644.26	0.62
2	600031	三一重工	43,800,318.01	0.43
3	000725	京东方 A	43,629,854.00	0.43
4	000157	中联重科	38,361,656.23	0.38
5	600276	恒瑞医药	37,176,015.15	0.37
6	000100	TCL 科技	37,024,088.00	0.37
7	002648	卫星石化	36,860,391.72	0.36
8	002475	立讯精密	36,248,892.30	0.36
9	002601	龙佰集团	35,897,389.02	0.36
10	600760	中航沈飞	32,986,093.79	0.33
11	600585	海螺水泥	32,112,941.24	0.32
12	603882	金域医学	30,982,663.40	0.31
13	600900	长江电力	30,334,205.00	0.30
14	600600	青岛啤酒	24,853,159.20	0.25
15	603520	司太立	24,536,003.00	0.24
16	603690	至纯科技	24,226,977.26	0.24
17	002241	歌尔股份	22,653,737.00	0.22
18	688122	西部超导	21,629,250.90	0.21

19	00981	中芯国际	21,605,293.93	0.21
20	01919	中远海控	19,939,331.69	0.20

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	463,066,229.47
卖出股票收入（成交）总额	1,082,546,205.48

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	270,837,000.00	3.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	48,127,419.50	0.69
	其中：政策性金融债	48,127,419.50	0.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	872,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	319,836,419.50	4.58

#### 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	019645	20 国债 15	2,700,000	270,837,000.00	3.88
2	108802	进出 1902	280,650	28,073,419.50	0.40
3	108604	国开 1805	200,000	20,054,000.00	0.29
4	113050	南银转债	8,720	872,000.00	0.01

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

报告期内，本基金投资的子基金整体运作情况稳定。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	003382	民生加银 鑫享债券 A	契约型 开放式	474,771,217.76	568,491,056.15	8.14	是
2	100058	富国产业 债债券 A	契约型 开放式	271,208,214.38	311,374,150.93	4.46	否

			放 式				
3	000563	南方通利 债券 A	契 约 型 开 放 式	254,042,342.67	286,432,741.36	4.10	否
4	519718	交银纯债 债券发起 A/B	契 约 型 开 放 式	238,048,666.65	256,259,389.65	3.67	否
5	100018	富国天利 增长债券	契 约 型 开 放 式	191,312,049.61	254,980,699.72	3.65	否
6	003949	兴全稳泰 债券 A	契 约 型 开 放 式	226,078,249.35	241,948,942.45	3.47	否
7	690002	民生增强 收益债券 A	契 约 型 开 放 式	148,195,331.12	239,335,459.76	3.43	是
8	003847	华安鼎丰 债券	契 约 型 开 放	209,884,702.64	224,177,850.89	3.21	否

			式				
9	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	194,750,088.29	216,328,398.07	3.10	否
10	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	180,609,725.54	205,895,087.12	2.95	否
11	380005	中银纯债债券 A	契约型开放式	183,056,212.25	194,039,584.99	2.78	否
12	003349	长信稳益纯债债券	契约型开放式	179,254,308.15	193,415,398.49	2.77	否
13	000015	华夏纯债债券 A	契约型开放式	153,971,262.89	188,460,825.78	2.70	否
14	005354	富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式 A	契约型开放式	96,751,095.09	167,350,369.18	2.40	否

			式				
15	000355	南方丰元 信用增强 债券 A	契 约 型 开 放 式	124,722,174.77	158,546,828.57	2.27	否
16	690007	民生加银 景气行业 混合 A	契 约 型 开 放 式	26,005,493.59	147,893,242.05	2.12	是
17	340009	兴全磐稳 增利债券 A	契 约 型 开 放 式	99,902,138.42	147,055,947.75	2.11	否
18	006058	民生加银 新兴成长 混合	契 约 型 开 放 式	52,036,070.97	135,715,276.70	1.94	是
19	007102	民生加银 添鑫纯债 债券 A	契 约 型 开 放 式	125,052,745.27	133,743,911.07	1.92	是
20	163806	中银增利 债券	契 约 型 开 放	117,875,626.28	128,366,557.02	1.84	否

			式				
21	164902	交银信用 添利债券 (LOF)	契 约 型 开 放 式	94,590,649.61	113,158,794.13	1.62	否
22	518880	华安黄金 易(ETF)	契 约 型 开 放 式	29,000,000.00	103,936,000.00	1.49	否
23	510500	南方中证 500ETF	契 约 型 开 放 式	13,000,000.00	98,774,000.00	1.42	否
24	530021	建信纯债 债券 A	契 约 型 开 放 式	62,831,679.93	91,759,385.37	1.31	否
25	512880	国泰中证 全指证券 公司 ETF	契 约 型 开 放 式	69,000,000.00	76,521,000.00	1.10	否
26	166904	民生加银 平稳添利 债券 A	契 约 型 开 放 式	65,862,888.18	67,970,500.60	0.97	是

			式				
27	510900	易方达恒生中国企业 ETF (QDII)	契 约 型 开 放 式	58,000,000.00	67,048,000.00	0.96	否
28	512000	华宝中证全指证券 公司 ETF	契 约 型 开 放 式	61,000,000.00	64,782,000.00	0.93	否
29	004224	南方军工改革灵活 配置混合 A	契 约 型 开 放 式	45,812,130.17	64,297,324.69	0.92	否
30	000408	民生加银 城镇化混合 A	契 约 型 开 放 式	22,691,872.62	58,613,106.98	0.84	是
31	675111	西部利得 汇享债券 A	契 约 型 开 放 式	45,657,017.62	51,469,155.96	0.74	否
32	001235	中银国有 企业债 A	契 约 型 开 放	48,638,612.55	50,875,988.73	0.73	否

			式				
33	002650	东方红稳健 添利纯债 债券	契 约 型 开 放 式	46,529,721.21	50,359,117.27	0.72	否
34	002245	泰康稳健 增利债券 A	契 约 型 开 放 式	40,002,400.19	50,215,012.96	0.72	否
35	000024	大摩双利 增强债券 A	契 约 型 开 放 式	42,880,789.02	50,170,523.15	0.72	否
36	040040	华安纯债 债券 A	契 约 型 开 放 式	46,619,114.22	50,152,843.08	0.72	否
37	159915	创业板	契 约 型 开 放 式	14,000,000.00	47,222,000.00	0.68	否
38	000136	民生加银 策略精选 混合 A	契 约 型 开 放	9,154,714.68	46,835,520.30	0.67	是

			式				
39	690005	民生加银 内需增长 混合	契 约 型 开 放 式	16,362,259.17	43,654,507.47	0.63	是
40	009580	招商双债 增强 (LOF)D	契 约 型 开 放 式	30,074,436.09	41,171,903.01	0.59	否
41	512800	华宝中证 银行 ETF	契 约 型 开 放 式	33,000,000.00	40,590,000.00	0.58	否
42	000884	民生加银 优选股票	契 约 型 开 放 式	16,039,883.46	40,516,745.62	0.58	是
43	159919	300ETF	契 约 型 开 放 式	7,500,000.00	39,322,500.00	0.56	否
44	001220	民生加银 研究精选 混合	契 约 型 开 放	21,961,932.65	39,245,973.65	0.56	是

			式				
45	006072	民生加银 创新成长 混合	契 约 型 开 放 式	16,314,988.04	38,146,073.54	0.55	是
46	690011	民生加银 积极成长 混合	契 约 型 开 放 式	10,928,410.45	34,260,566.76	0.49	是
47	512400	南方中证 申万有色 金属 ETF	契 约 型 开 放 式	25,000,000.00	28,250,000.00	0.40	否
48	690004	民生加银 稳健成长 混合	契 约 型 开 放 式	6,009,757.25	22,644,765.32	0.32	是
49	510300	华泰柏瑞 沪深 300ETF	契 约 型 开 放 式	4,000,000.00	21,024,000.00	0.30	否
50	008383	招商安心 收益债券 A	契 约 型 开 放	12,300,785.18	20,601,355.02	0.30	否

			式				
51	002683	民生加银 前沿科技 混合	契 约 型 开 放 式	9,451,795.84	20,066,162.57	0.29	是
52	002649	民生加银 智造 2025 混合	契 约 型 开 放 式	7,538,067.24	19,096,939.55	0.27	是
53	510330	华夏沪深 300ETF	契 约 型 开 放 式	3,000,000.00	15,765,000.00	0.23	否
54	159902	中小 100	契 约 型 开 放 式	3,000,000.00	14,700,000.00	0.21	否
55	002547	民生加银 养老服务 混合	契 约 型 开 放 式	4,626,665.79	12,783,477.58	0.18	是
56	002684	民生加银 鑫安纯债 债券 A	契 约 型 开 放	10,239,590.26	10,393,184.11	0.15	是

			式				
57	217022	招商产业 债券 A	契 约 型 开 放 式	6,556,721.31	10,313,722.62	0.15	否
58	512660	国泰中证 军工 ETF	契 约 型 开 放 式	8,000,000.00	9,216,000.00	0.13	否
59	007731	民生加银 持续成长 混合 A	契 约 型 开 放 式	4,781,481.46	8,073,531.45	0.12	是
60	159901	深 100ETF	契 约 型 开 放 式	1,000,000.00	4,130,000.00	0.06	否
61	166904	民生添利	契 约 型 开 放 式	2,773,048.00	2,828,508.96	0.04	是

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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

腾讯控股因违法违规被国家市场监督管理总局处罚（国市监处〔2021〕31号，作出处罚决定

日期：2021 年 4 月 28 日)

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.13.3 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	507,876.58
2	应收证券清算款	36,910,752.20
3	应收股利	295,926.24
4	应收利息	6,200,998.87
5	应收申购款	1,667,338.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,582,892.19

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 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。

### 7.13.6 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 (%)
142,868	42,143.35	263,950.03	0.00	6,020,672,332.13	100.00

### 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	584,463.87	0.0097

### 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	0

门负责人持有本开放式基金	
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（2020 年 2 月 20 日） 基金份额总额	2,982,103,499.05
本报告期期初基金份额总额	8,882,033,357.59
本报告期基金总申购份额	1,607,306,336.07
减：本报告期基金总赎回份额	4,468,403,411.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	6,020,936,282.16

## § 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

本报告期内，基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略中增加了存托凭证投资策略。

### 10.5 本报告期持有的基金发生重大影响事件

无

### 10.6 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。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚的情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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	
华泰证券	3	594,870,077.51	38.75%	304,735.02	30.87%	-
国盛证券	2	236,950,347.11	15.44%	173,281.58	17.55%	-
中信建投	4	218,509,439.14	14.23%	167,446.18	16.96%	-
华西证券	1	197,492,780.01	12.87%	144,425.19	14.63%	-
浙商证券	2	90,394,835.55	5.89%	66,108.38	6.70%	-
长江证券	1	82,972,396.73	5.41%	58,080.22	5.88%	-
东北证券	3	63,278,786.01	4.12%	46,272.82	4.69%	-
天风证券	2	50,615,625.53	3.30%	26,894.05	2.72%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	-	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-	-

### 10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比 例

华泰证券	45,330,712.89	5.87%	-	-	-	-	170,977,658.00	19.01%
国盛证券	480,938,453.00	62.23%	-	-	-	-	140,190,501.34	15.58%
中信建投	24,972,500.00	3.23%	-	-	-	-	57,434,046.10	6.38%
华西证券	130,712,158.60	16.91%	-	-	-	-	198,742,395.30	22.09%
浙商证券	63,162,484.70	8.17%	29,500,000.00	100.00%	-	-	120,159,843.20	13.36%
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	27,663,577.90	3.58%	-	-	-	-	178,628,117.80	19.86%
天风证券	-	-	-	-	-	-	33,449,192.10	3.72%
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，

并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商评价表》；

ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案；

iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见；

iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议；

v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计；

vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续；

vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试；

viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息；

ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金本期新增英大证券上海及深圳交易单元各一个作为本基金的交易单元。

## 10.9 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	关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	上海证券报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 4 日
2	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 15 日
3	民生加银基金管理有限公司关于暂停	中国证券报、上海证券	2021 年 1 月 20 日

	使用招商银行卡办理网上直销部分业务的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	
4	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 21 日
5	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年第四季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 21 日
6	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）更新招募说明书（2021 年第 1 号）	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 22 日
7	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要（更新）	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 22 日
8	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东方财富证券股份有限公司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	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 19 日
9	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）恢复大额申购、大额定期定额投资的公告	证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 26 日
10	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
11	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年年度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
12	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）暂停大额申购、大额定期定额投资的公告	证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 9 日
13	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
14	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年第一季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
15	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份资料信息的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会	2021 年 4 月 30 日

		基金电子披露网站	
16	关于调整民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 申购最低金额、最低赎回份额和最低持有份额数额限制的公告	证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 9 日
17	关于民生加银基金管理有限公司旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站、深圳证券交易所网站、上海证券交易所网站	2021 年 6 月 30 日
18	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 30 日
19	民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准基金募集的文件；
2. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
3. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
4. 《民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
5. 法律意见书；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日