

益民创新优势混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：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：2022 年 8 月 26 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 38 |

| | | |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |
| 7.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 | 43 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 43 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 43 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 44 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 44 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 44 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 45 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 45 |
| 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 | 45 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 45 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 46 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 48 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| 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 | 49 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| § 12 | 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 | 存放地点 | 49 |
| 12.3 | 查阅方式 | 49 |

§ 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 | 389,651,499.34 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 | 王明德 | 秦一楠 |
| | 联系电话 | 010-63105556-501 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | wangmd@ymfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4006508808 | 95599 |
| 传真 | | 010-63100608 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 重庆市渝中区上清寺路 110 号 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |

| | | |
|-------|------------------------------------|------------------------------|
| 办公地址 | 北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼南翼 13A 层 | 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 | 党均章 | 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -109,257,889.26 |
| 本期利润 | -92,906,564.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2343 |
| 本期加权平均净值利润率 | -18.11% |
| 本期基金份额净值增长率 | -14.59% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2022 年 6 月 30 日） |
| 期末可供分配利润 | 130,887,827.20 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3359 |
| 期末基金资产净值 | 520,539,326.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.3359 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2022 年 6 月 30 日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 35.65% |

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 | 9.04% | 0.73% | 7.15% | 0.80% | 1.89% | -0.07% |
| 过去三个月 | 6.30% | 1.23% | 5.04% | 1.07% | 1.26% | 0.16% |
| 过去六个月 | -14.59% | 1.29% | -6.34% | 1.09% | -8.25% | 0.20% |
| 过去一年 | -23.18% | 1.38% | -9.34% | 0.93% | -13.84% | 0.45% |
| 过去三年 | 57.28% | 1.60% | 18.11% | 0.95% | 39.17% | 0.65% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.65% | 1.64% | 46.87% | 1.22% | -11.22% | 0.42% |

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
(2007年7月11日至2022年6月30日)



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 2022 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 200 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 | | |
| 赵若琼 | 本基金 基金经 理 | 2021 年 7 月 21 日 | - | 14 | 中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任民生证券研究院行业研究员，方正证券研究所行业研究员。2015 年 6 月加入益民基金管理有限公司，曾任研究部研究员，现任权益投资部副总经理。自 2017 年 2 月 28 日起任益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 4 月 23 日起任益民优势安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自 2021 年 7 月 21 日起任益民创新优势混合型证券投资基金、益民红利成长混合型证券投资基金基金经理。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 理。自 2022 年 5 月 13 日起任益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民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

报告期内上证指数总体呈“V”型走势。一季度 A 股市场出现了大规模的系统性下跌。市场调整开始于年初对国内信用扩张的担忧，以及美联储加息节奏超预期。后续俄乌冲突加剧通胀预期，中美竞争下中概股问题的爆发，以及国内疫情反复等因素导致市场风险偏好进一步下降。二季度由于国内疫情形势缓解以及国外风险因素影响边际趋弱，A 股主要指数呈现出先抑后扬式反弹。4 月末中

央政治局会议重磅发声，明确了全年的经济发展目标，提振了市场信心，A 股也迎来了触底反弹。5、6 月份，A 股主要指数均迎来了不同程度的上涨，由于市场情绪的修复，前期受累于风险偏好下行导致跌幅较大的景气成长板块快速反弹。分行业看，报告期内只有煤炭行业取得了正向收益，上涨 31.4%。其余行业全部下跌，其中跌幅最大的三个行业分别为电子、计算机和传媒，跌幅分别为-24.5%、-23.6%和-22.3%。

投资操作上，一季度为应对市场下跌，基金阶段性减仓，且持仓趋向于均衡，二季度基金提升了新能源相关行业的持仓占比，相比较之下新能源行业景气的确定性最强。此外，持仓配置了疫情修复链条相关的非必选消费、消费建材和消费医疗板块。

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 1.3359 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.59%；同期业绩比较基准收益率为-6.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综合来看，经济最艰难的时期已经过去，二季度开始触底反弹，三季度经济活跃度回升，根据《中国宏观经济论坛中期报告》预测，2022 年 GDP 增速为 4.7%~5%，有望达到年初制定的 5.5%目标区间。疫情复工后，投资增速预计率先起来，消费缓慢复苏，而出口稍有拖累，整体经济基本面不差。但需要关注两个风险，一是俄乌冲突导致的能源结构性失衡和日益突出的全球粮食安全问题，叠加国内猪周期价格上行、居民消费复苏等因素，三季度 CPI 存在破 3%的可能，对货币政策形成制约；二是违约房企停工项目形成的按揭不良资产，若政策不力可能产生金融风险，但目前看概率不大。

站在当下展望，A 股市场仍然处在由估值修复和基本面因素改善所推动的反弹进程中。未来市场主线有可能会围绕着后疫情时期的经济深度复苏以及海外通胀缓解所带来的生产成本下降展开。与之对应的，新能源、消费复苏以及制造业将会充分收益。我们依然看好我国制造业的全球比较优势，俄乌战争后国内外能源价格差异可能导致优势更加凸显，长期视角看高端制造和消费升级将成为未来拉动我国经济的主导力量，我们将在这些领域精选个股，力争超额收益。

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、产品研发部、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：研究发展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。

产品研发部产品开发人员：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参与基金组合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

基金收益分配原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每

单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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《中华人民共和国证券投资基金法》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《公开募集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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 174,711,825.99 | 57,694,635.35 |
| 结算备付金 | | 1,662,467.54 | 2,817,829.31 |
| 存出保证金 | | 317,900.13 | 269,802.49 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 373,309,660.16 | 575,724,399.82 |
| 其中：股票投资 | | 342,992,350.57 | 536,023,502.72 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 30,317,309.59 | 39,700,897.10 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | 3,189,391.25 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 16,571.35 | 14,606.82 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 688,038.03 |
| 资产总计 | | 550,018,425.17 | 640,398,703.07 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 24,320,433.16 | - |
| 应付赎回款 | | 70,013.62 | 382,731.08 |
| 应付管理人报酬 | | 617,548.50 | 824,517.29 |
| 应付托管费 | | 102,924.73 | 137,419.56 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 2,520,454.02 | 2,520,454.02 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,847,724.60 | 2,179,723.25 |
| 负债合计 | | 29,479,098.63 | 6,044,845.20 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 389,651,499.34 | 405,560,617.96 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 130,887,827.20 | 228,793,239.91 |
| 净资产合计 | | 520,539,326.54 | 634,353,857.87 |
| 负债和净资产总计 | | 550,018,425.17 | 640,398,703.07 |

注：(1) 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3359 元，基金份额总额 389,651,499.34 份。

(2) 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|---------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -88,312,009.34 | 72,777,741.45 |
| 1. 利息收入 | | 361,719.24 | 1,063,874.64 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 361,719.24 | 182,820.96 |
| 债券利息收入 | | - | 881,053.68 |
| 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） | | -105,032,879.24 | 116,839,691.59 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -108,033,526.49 | 115,385,218.76 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 427,559.04 | -88,131.80 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 2,573,088.21 | 1,542,604.63 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 16,351,324.67 | -45,285,131.69 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 7,825.99 | 159,306.91 |
| 减：二、营业总支出 | | 4,594,555.25 | 11,753,247.07 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,824,457.62 | 5,798,209.44 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 637,409.55 | 966,368.28 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 132,688.08 | 4,988,669.35 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -92,906,564.59 | 61,024,494.38 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -92,906,564.59 | 61,024,494.38 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -92,906,564.59 | 61,024,494.38 |

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：益民创新优势混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|--|---------------------------------------|--------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 405,560,617.96 | - | 228,793,239.91 | 634,353,857.87 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 405,560,617.96 | - | 228,793,239.91 | 634,353,857.87 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -15,909,118.62 | - | -97,905,412.71 | -113,814,531.33 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -92,906,564.59 | -92,906,564.59 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -15,909,118.62 | - | -4,998,848.12 | -20,907,966.74 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,528,192.17 | - | 1,129,596.09 | 4,657,788.26 |
| 2. 基金赎回款 | -19,437,310.79 | - | -6,128,444.21 | -25,565,755.00 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|----------------|-----------------|
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 389,651,499.34 | - | 130,887,827.20 | 520,539,326.54 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 533,123,486.89 | - | 328,238,822.60 | 861,362,309.49 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 533,123,486.89 | - | 328,238,822.60 | 861,362,309.49 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -88,307,637.50 | - | 529,739.20 | -87,777,898.30 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 61,024,494.38 | 61,024,494.38 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -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 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 444,815,849.39 | - | 328,768,561.80 | 773,584,411.19 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王明德

樊振华

樊振华

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

益民创新优势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]157号文《关于同意益民创新优势混合型证券投资基金募集的批复》的批准,由益民基金管理有限公司于2007年6月18日至2007年7月8日向社会公开募集,基金合同于2007年7月11日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次募集规模为7,238,122,974.81份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为益民基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为监管机构允许投资的具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市 的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金80%以上的股票资产 将投资于具有持续创新能力的优势企业以及潜在的优势企业。本基金投资组合的资产配置比例为: 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 \times 75%+中证全债指数收益率 \times 25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会 计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估 值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导 意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编 制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和 中国证券基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务 状况以及2022年中期报告的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期保值》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求,本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润【或其他综合收益】。

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

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

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

在首次执行日,原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节表:

| | 账面价值 |
|--------------------------------|---------------|
| 银行存款 | |
| 2021 年 12 月 31 日,按原金融工具准则列示的余额 | 57,694,635.35 |
| 重分类:转入自应收利息 | 12,236.92 |
| 重新计量:预期信用损失准备 | |
| 2022 年 1 月 1 日,按新金融工具准则列示的余额 | 57,706,872.27 |

结算备付金

| | |
|--------------------------------|--------------|
| 2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 | 2,817,829.31 |
| 重分类：转入自应收利息 | 1,394.91 |
| 重新计量：预期信用损失准备 | |
| 2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 | 2,819,224.22 |

存出保证金

| | |
|--------------------------------|------------|
| 2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 | 269,802.49 |
| 重分类：转入自应收利息 | 133.54 |
| 重新计量：预期信用损失准备 | |
| 2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 | 269,936.03 |

债券投资-交易性金融资产

| | |
|--------------------------------|---------------|
| 2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 | 39,700,897.10 |
| 重分类：转入自应收利息 | 674,272.66 |
| 重新计量：预期信用损失准备 | |
| 2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 | 40,375,169.76 |

应收利息

| | |
|--------------------------------|------------|
| 2021 年 12 月 31 日，按原金融工具准则列示的余额 | 688,038.03 |
| 重分类：转出至银行存款 | 12,236.92 |
| 重分类：转出至结算备付金 | 1,394.91 |
| 重分类：转出至存出保证金 | 133.54 |
| 重分类：转出至交易性金融资产 | 674,272.66 |
| 重分类：转出至买入返售金融资产 | |
| 重分类：转出至应收申购款 | |
| 重分类：转出至其他资产 | |
| 2022 年 1 月 1 日，按新金融工具准则列示的余额 | 0.00 |

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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

印花税

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

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

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

增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

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

城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

企业所得税

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

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

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

个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳

税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 174,711,825.99 |
| 等于：本金 | 174,667,275.57 |
| 加：应计利息 | 44,550.42 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 174,711,825.99 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|----------------|------------------------|----------------|----------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 公允价值变动 |
| 股票 | 332,905,551.33 | - | 342,992,350.57 | 10,086,799.24 |
| 贵金属投资-金交所黄金 合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | 29,986,560.00 | 290,309.59 | 30,317,309.59 |

| | | | | | |
|--------|----|----------------|------------|----------------|---------------|
| | 合计 | 29,986,560.00 | 290,309.59 | 30,317,309.59 | 40,440.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 362,892,111.33 | 290,309.59 | 373,309,660.16 | 10,127,239.24 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 182.35 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 1,341,319.23 |
| 其中：交易所市场 | 1,341,094.23 |
| 银行间市场 | 225.00 |
| 应付利息 | - |
| 其他应付款_其他 | 404,564.37 |
| 预提费用 | 101,658.65 |
| 合计 | 1,847,724.60 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 405,560,617.96 | 405,560,617.96 |
| 本期申购 | 3,528,192.17 | 3,528,192.17 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -19,437,310.79 | -19,437,310.79 |
| 本期末 | 389,651,499.34 | 389,651,499.34 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 本期期初 | 398,256,487.04 | -169,463,247.13 | 228,793,239.91 |
| 本期利润 | -109,257,889.26 | 16,351,324.67 | -92,906,564.59 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -12,576,010.88 | 7,577,162.76 | -4,998,848.12 |
| 其中：基金申购款 | 2,830,118.57 | -1,700,522.48 | 1,129,596.09 |
| 基金赎回款 | -15,406,129.45 | 9,277,685.24 | -6,128,444.21 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 276,422,586.90 | -145,534,759.70 | 130,887,827.20 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|-----------|--------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 341,732.62 |
| 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 | 17,324.52 |
| 其他 | 2,662.10 |
| 合计 | 361,719.24 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|------------------|--------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -108,033,526.49 |
| 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 | -108,033,526.49 |
|----|-----------------|

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|------------|--------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,539,373,582.64 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,642,845,636.05 |
| 减：交易费用 | 4,561,473.08 |
| 买卖股票差价收入 | -108,033,526.49 |

6.4.7.11 基金投资收益

本基金无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|----------------------------------|--------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 524,032.54 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入 | -96,473.50 |
| 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 | 427,559.04 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|-------------------------|--------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 40,655,305.20 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 39,753,248.50 |
| 减：应计利息总额 | 998,305.20 |
| 减：交易费用 | 225.00 |

| | |
|----------|------------|
| 买卖债券差价收入 | -96,473.50 |
|----------|------------|

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期末持有贵金属。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|---------------|--------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,573,088.21 |
| 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 | 2,573,088.21 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 16,351,324.67 |
| ——股票投资 | 16,258,533.27 |
| ——债券投资 | 92,791.40 |
| ——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 | 16,351,324.67 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 7,805.89 |
| 基金转出费 | 20.10 |
| 合计 | 7,825.99 |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---|
| 审计费用 | 42,151.28 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行费用 | 13,029.43 |
| 合计 | 132,688.08 |

6.4.7.19 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内无控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期及上年度均未通过关联方的交易单元进行过交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度均未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金在本报告期内及上年度均未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度均没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日 至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日 至2021年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,824,457.62 | 5,798,209.44 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,287,136.15 | 1,189,113.31 |

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 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 637,409.55 | 966,368.28 |

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

本基金本报告期无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金在本期及上年度均未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|--------------|---------------------------------------|------------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 174,711,825.99 | 341,732.62 | 42,712,245.50 | 156,491.59 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设合规审查与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理主要由风险管理部完成，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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | 0.00 |
| A-1 以下 | - | 0.00 |
| 未评级 | 30,027,000.00 | 29,665,897.10 |
| 合计 | 30,027,000.00 | 29,665,897.10 |

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | 10,035,000.00 |
| AAA 以下 | - | 0.00 |
| 未评级 | - | 0.00 |
| 合计 | - | 10,035,000.00 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例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票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票，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 2022年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------|-------|---------------|------|------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 174,711,825.99 | - | - | - | - | - | 174,711,825.99 |
| 结算备付金 | 1,662,467.54 | - | - | - | - | - | 1,662,467.54 |
| 存出保证金 | 317,900.13 | - | - | - | - | - | 317,900.13 |
| 交易性金融资产 | - | - | 30,317,309.59 | - | - | -342,992,350.57 | 373,309,660.16 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 16,571.35 | 16,571.35 |
| 资产总计 | 176,692,193.66 | - | 30,317,309.59 | - | - | -343,008,921.92 | 550,018,425.17 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 24,320,433.16 | 24,320,433.16 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 70,013.62 | 70,013.62 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 617,548.50 | 617,548.50 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 102,924.73 | 102,924.73 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 2,520,454.02 | 2,520,454.02 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,847,724.60 | 1,847,724.60 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 29,479,098.63 | 29,479,098.63 |
| 利率敏感度缺口 | 176,692,193.66 | - | 30,317,309.59 | - | - | -313,529,823.29 | 520,539,326.54 |
| 上年度末 2021年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 57,694,635.35 | - | - | - | - | - | 57,694,635.35 |
| 结算备付金 | 2,817,829.31 | - | - | - | - | - | 2,817,829.31 |
| 存出保证金 | 269,802.49 | - | - | - | - | - | 269,802.49 |
| 交易性金融资产 | - | - | 39,700,897.10 | - | - | -536,023,502.72 | 575,724,399.82 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,189,391.25 | 3,189,391.25 |

| | | | | | | |
|---------|---------------|---|---------------|---|-----------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | - | 14,606.82 | 14,606.82 |
| 其他资产 | - | - | - | - | 688,038.03 | 688,038.03 |
| 资产总计 | 60,782,267.15 | - | 39,700,897.10 | - | 539,915,538.82 | 640,398,703.07 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 382,731.08 | 382,731.08 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 824,517.29 | 824,517.29 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 137,419.56 | 137,419.56 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 2,520,454.02 | 2,520,454.02 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 2,179,723.25 | 2,179,723.25 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 6,044,845.20 | 6,044,845.20 |
| 利率敏感度缺口 | 60,782,267.15 | - | 39,700,897.10 | - | -533,870,693.62 | 634,353,857.87 |

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 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|----|-------------------|----------|---------------------|----------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比 | 公允价值 | 占基金资产净值比 |
| | | | | |

| | | 例 (%) | | 例 (%) |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 342,992,350.57 | 65.89 | 536,023,502.72 | 84.50 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 30,027,000.00 | 5.77 | 39,700,897.10 | 6.26 |
| 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 | 373,019,350.57 | 71.66 | 575,724,399.82 | 90.76 |

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（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 27,565,008.68 | 53,136,650.90 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -27,565,008.68 | -53,136,650.90 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 342,992,350.57 | 536,023,502.72 |
| 第二层次 | 30,317,309.59 | 39,700,897.10 |

| | | |
|------|----------------|----------------|
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 373,309,660.16 | 575,724,399.82 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金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 2021 年 12 月 31: 无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 342,992,350.57 | 62.36 |
| | 其中：股票 | 342,992,350.57 | 62.36 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 30,317,309.59 | 5.51 |
| | 其中：债券 | 30,317,309.59 | 5.51 |
| | 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 | 176,374,293.53 | 32.07 |
| 8 | 其他各项资产 | 334,471.48 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 550,018,425.17 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 223,350,234.41 | 42.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 9,786,140.00 | 1.88 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,623,070.00 | 0.50 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 30,954,840.16 | 5.95 |
| J | 金融业 | 23,653,050.00 | 4.54 |
| K | 房地产业 | 52,625,016.00 | 10.11 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 342,992,350.57 | 65.89 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600048 | 保利发展 | 1,376,300 | 24,030,198.00 | 4.62 |
| 2 | 600383 | 金地集团 | 1,674,700 | 22,507,968.00 | 4.32 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 604,200 | 20,373,624.00 | 3.91 |
| 4 | 600104 | 上汽集团 | 972,400 | 17,318,444.00 | 3.33 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 80,999 | 16,356,128.07 | 3.14 |
| 6 | 600588 | 用友网络 | 716,300 | 15,550,873.00 | 2.99 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 7,600 | 15,542,000.00 | 2.99 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 374,300 | 13,882,787.00 | 2.67 |
| 9 | 002459 | 晶澳科技 | 173,940 | 13,723,866.00 | 2.64 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 655,900 | 13,052,410.00 | 2.51 |
| 11 | 002932 | 明德生物 | 173,015 | 11,861,908.40 | 2.28 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 251,200 | 10,600,640.00 | 2.04 |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 41,900 | 10,330,026.00 | 1.98 |
| 14 | 600398 | 海澜之家 | 2,147,500 | 10,200,625.00 | 1.96 |
| 15 | 601668 | 中国建筑 | 1,839,500 | 9,786,140.00 | 1.88 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 352,400 | 9,652,236.00 | 1.85 |
| 17 | 600309 | 万华化学 | 97,774 | 9,483,100.26 | 1.82 |
| 18 | 603345 | 安井食品 | 49,300 | 8,275,991.00 | 1.59 |
| 19 | 600584 | 长电科技 | 300,800 | 8,121,600.00 | 1.56 |
| 20 | 600887 | 伊利股份 | 201,600 | 7,852,320.00 | 1.51 |
| 21 | 002008 | 大族激光 | 237,000 | 7,851,810.00 | 1.51 |
| 22 | 002241 | 歌尔股份 | 209,100 | 7,025,760.00 | 1.35 |
| 23 | 000402 | 金融街 | 1,023,000 | 6,086,850.00 | 1.17 |
| 24 | 300274 | 阳光电源 | 57,900 | 5,688,675.00 | 1.09 |
| 25 | 002202 | 金风科技 | 365,400 | 5,407,920.00 | 1.04 |
| 26 | 002156 | 通富微电 | 346,000 | 5,328,400.00 | 1.02 |
| 27 | 688303 | 大全能源 | 77,024 | 5,262,279.68 | 1.01 |
| 28 | 688126 | 沪硅产业 | 227,350 | 5,224,503.00 | 1.00 |
| 29 | 688023 | 安恒信息 | 35,359 | 5,221,109.94 | 1.00 |
| 30 | 688111 | 金山办公 | 21,916 | 4,320,081.92 | 0.83 |
| 31 | 688256 | 寒武纪 | 50,663 | 3,277,896.10 | 0.63 |
| 32 | 600438 | 通威股份 | 52,400 | 3,136,664.00 | 0.60 |
| 33 | 002271 | 东方雨虹 | 54,500 | 2,805,115.00 | 0.54 |
| 34 | 000860 | 顺鑫农业 | 98,600 | 2,644,452.00 | 0.51 |
| 35 | 002352 | 顺丰控股 | 47,000 | 2,623,070.00 | 0.50 |
| 36 | 688561 | 奇安信 | 46,324 | 2,584,879.20 | 0.50 |

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 | 600383 | 金地集团 | 50,064,110.00 | 7.89 |
| 2 | 600048 | 保利发展 | 30,119,495.00 | 4.75 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 21,419,249.02 | 3.38 |
| 4 | 600782 | 新钢股份 | 21,398,382.00 | 3.37 |
| 5 | 601668 | 中国建筑 | 21,248,796.20 | 3.35 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 20,385,814.00 | 3.21 |
| 7 | 600438 | 通威股份 | 18,733,419.58 | 2.95 |
| 8 | 300274 | 阳光电源 | 18,613,502.01 | 2.93 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9 | 600104 | 上汽集团 | 17,918,923.12 | 2.82 |
| 10 | 601865 | 福莱特 | 17,807,343.80 | 2.81 |
| 11 | 000999 | 华润三九 | 17,746,311.00 | 2.80 |
| 12 | 603218 | 日月股份 | 17,574,342.83 | 2.77 |
| 13 | 601012 | 隆基绿能 | 17,509,422.42 | 2.76 |
| 14 | 300014 | 亿纬锂能 | 16,982,244.02 | 2.68 |
| 15 | 688116 | 天奈科技 | 16,862,088.79 | 2.66 |
| 16 | 300363 | 博腾股份 | 16,681,372.00 | 2.63 |
| 17 | 300750 | 宁德时代 | 16,531,125.00 | 2.61 |
| 18 | 000400 | 许继电气 | 16,308,424.45 | 2.57 |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 16,185,327.60 | 2.55 |
| 20 | 600588 | 用友网络 | 15,528,983.53 | 2.45 |
| 21 | 000858 | 五粮液 | 15,251,074.12 | 2.40 |
| 22 | 002594 | 比亚迪 | 15,247,272.67 | 2.40 |
| 23 | 300724 | 捷佳伟创 | 15,230,725.00 | 2.40 |
| 24 | 002932 | 明德生物 | 15,170,643.94 | 2.39 |
| 25 | 601390 | 中国中铁 | 14,324,012.00 | 2.26 |
| 26 | 600519 | 贵州茅台 | 14,093,083.00 | 2.22 |
| 27 | 000002 | 万科 A | 13,967,896.99 | 2.20 |
| 28 | 600132 | 重庆啤酒 | 13,376,947.00 | 2.11 |
| 29 | 002459 | 晶澳科技 | 13,141,340.00 | 2.07 |
| 30 | 603985 | 恒润股份 | 13,092,208.00 | 2.06 |
| 31 | 600276 | 恒瑞医药 | 12,742,306.00 | 2.01 |

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 | 300014 | 亿纬锂能 | 38,126,144.33 | 6.01 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 36,356,005.67 | 5.73 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 34,715,861.38 | 5.47 |
| 4 | 600383 | 金地集团 | 30,663,489.00 | 4.83 |
| 5 | 600438 | 通威股份 | 28,725,222.16 | 4.53 |
| 6 | 300498 | 温氏股份 | 28,636,466.88 | 4.51 |
| 7 | 300274 | 阳光电源 | 26,403,870.07 | 4.16 |
| 8 | 603985 | 恒润股份 | 25,519,866.28 | 4.02 |
| 9 | 601669 | 中国电建 | 21,904,827.11 | 3.45 |
| 10 | 600782 | 新钢股份 | 20,709,156.00 | 3.26 |
| 11 | 000999 | 华润三九 | 19,444,435.00 | 3.07 |
| 12 | 603218 | 日月股份 | 19,219,926.46 | 3.03 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 18,875,365.47 | 2.98 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 601012 | 隆基绿能 | 17,163,485.83 | 2.71 |
| 15 | 688116 | 天奈科技 | 16,944,733.37 | 2.67 |
| 16 | 300363 | 博腾股份 | 15,668,881.00 | 2.47 |
| 17 | 002938 | 鹏鼎控股 | 15,320,857.00 | 2.42 |
| 18 | 601865 | 福莱特 | 14,729,519.58 | 2.32 |
| 19 | 300724 | 捷佳伟创 | 14,644,694.00 | 2.31 |
| 20 | 000002 | 万科 A | 14,516,301.97 | 2.29 |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 14,286,665.00 | 2.25 |
| 22 | 603893 | 瑞芯微 | 14,252,512.00 | 2.25 |
| 23 | 688390 | 固德威 | 13,947,511.97 | 2.20 |
| 24 | 600132 | 重庆啤酒 | 13,910,221.40 | 2.19 |
| 25 | 601390 | 中国中铁 | 13,759,285.00 | 2.17 |
| 26 | 688122 | 西部超导 | 13,712,983.20 | 2.16 |
| 27 | 300384 | 三联虹普 | 13,607,946.00 | 2.15 |
| 28 | 688550 | 瑞联新材 | 13,406,582.38 | 2.11 |
| 29 | 688303 | 大全能源 | 12,772,673.01 | 2.01 |
| 30 | 002487 | 大金重工 | 12,702,047.00 | 2.00 |

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 | 1,433,555,950.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,539,373,582.64 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,317,309.59 | 5.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,317,309.59 | 5.82 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 30,317,309.59 | 5.82 |

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 | 220201 | 22 国开 01 | 300,000 | 30,317,309.59 | 5.82 |

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的兴业银行（占本基金资产净值的比例为 2.51%），其发行主体于 2022 年 3 月 21 日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银保监会的银保监罚决字（2022）22 号罚款 350 万元。于 2021 年 08 月 13 日因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，受到央行的银罚字（2021）26 号罚款 5 万元。

公司将持续关注上述公司的动态，积极维护基金份额持有人利益。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 317,900.13 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 16,571.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 334,471.48 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------|--------|----------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 25,601 | 15,220.17 | 953,733.12 | 0.24% | 388,697,766.22 | 99.76% |

§ 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 | 405,560,617.96 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,528,192.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 19,437,310.79 |
| 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 | 389,651,499.34 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

公司副总经理发生变更：

经益民基金管理有限公司第四届董事会第五次会议审议通过，赵恒毅先生于 2022 年 1 月 24 日正式担任公司副总经理职务。

经益民基金管理有限公司第四届董事会第九次会议审议通过，赵恒毅先生于 2022 年 5 月 9 日辞去公司副总经理职务。

经益民基金管理有限公司第四届董事会第九次会议审议通过，樊振华先生于 2022 年 5 月 9 日正式担任公司首席信息官兼首席运营官职务。

经益民基金管理有限公司第四届董事会第十次会议审议通过，王健先生于 2022 年 6 月 17 日正式担任公司副总经理职务。

公司总经理发生变更：

经益民基金管理有限公司第四届董事会第十一次会议审议通过，王明德先生于 2022 年 6 月 28 日正式担任公司总经理职务。

基金托管人：

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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

因 2018 年公司未及时披露高级管理人员变更事项、未及时报送高级管理人员离任审计报告，中国证监会于 2021 年 8 月 31 日决定对公司立案调查，调查事项不涉及基金财产和基金管理业务。

本报告期内，本基金高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无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 | 437,224,517.18 | 14.71% | 407,186.84 | 14.71% | |
| 海通证券 | 2 | 390,546,033.19 | 13.14% | 363,716.88 | 13.14% | |
| 东兴证券 | 1 | 375,533,556.72 | 12.63% | 349,731.11 | 12.63% | |
| 东北证券 | 1 | 323,367,512.83 | 10.88% | 301,152.88 | 10.88% | |
| 中银国际 | 1 | 312,604,800.38 | 10.52% | 291,125.36 | 10.51% | |
| 银河证券 | 2 | 216,279,426.49 | 7.27% | 201,420.54 | 7.27% | |
| 国金证券 (沪深) | 2 | 136,312,708.50 | 4.59% | 126,945.96 | 4.59% | |
| 民生证券 (沪深) | 2 | 122,122,979.78 | 4.11% | 113,732.41 | 4.11% | |
| 中金公司 | 1 | 114,561,946.03 | 3.85% | 106,691.53 | 3.85% | |
| 东方证券 | 1 | 113,158,090.56 | 3.81% | 105,384.77 | 3.81% | |
| 广发证券 | 1 | 104,487,398.37 | 3.51% | 97,308.57 | 3.51% | |
| 申万宏源 | 1 | 91,864,917.36 | 3.09% | 85,554.58 | 3.09% | |
| 西南证券 | 1 | 84,669,261.82 | 2.85% | 78,852.31 | 2.85% | |
| 光大证券 | 2 | 83,423,990.84 | 2.81% | 77,691.75 | 2.81% | |
| 国都证券 | 1 | 38,845,806.38 | 1.31% | 36,177.34 | 1.31% | |

| | | | | | | |
|--------------|---|---------------|-------|-----------|-------|--|
| 中信建投 (沪深) | 2 | 27,926,586.84 | 0.94% | 26,007.40 | 0.94% | |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 中信证券 (沪深) | 2 | - | - | - | - | |
| 太平洋证 券 | 1 | - | - | - | - | |
| 民族证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | |

注：1、本公司租用券商交易单元的选择标准：

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

(二)内部管理规范、严格，具备健全的内控制度；

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序：

(一)根据上述选择标准，确定选用其交易单元的券商。

(二)本公司与被选用的券商签订交易单元租用协议。

3、停止租用中信证券(华南)交易单元 1 个

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------|-----------------|
| 1 | 益民基金管理有限公司 2021 年 12 月 31 日基金净值公告 | 公司官网 | 2022 年 1 月 1 日 |
| 2 | 益民基金管理有限公司关于旗下基金新增联储证券有限责任公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 1 月 13 日 |
| 3 | 益民创新优势混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 公司官网 | 2022 年 1 月 20 日 |
| 4 | 益民基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 1 月 20 日 |
| 5 | 益民基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 1 月 25 日 |
| 6 | 益民基金管理有限公司关于旗下基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 3 月 3 日 |
| 7 | 益民基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金相关事项的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 3 月 21 日 |
| 8 | 益民基金管理有限公司关于持续完善客户身份基本信息的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 3 月 24 日 |
| 9 | 益民创新优势混合型证券投资基金 2021 年年度报告 | 公司官网 | 2022 年 3 月 25 日 |
| 10 | 益民基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 3 月 25 日 |
| 11 | 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》及公司官网 | 2022 年 4 月 1 日 |
| 12 | 益民基金管理有限公司关于旗下基金新增财咨道信息技术有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 4 月 8 日 |
| 13 | 益民创新优势混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 公司官网 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 14 | 益民基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 15 | 益民基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 4 月 28 日 |
| 16 | 益民基金管理有限公司关于高级管理人员的变更公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 5 月 10 日 |
| 17 | 益民基金管理有限公司关于高级管理人员的变更公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 5 月 10 日 |
| 18 | 益民基金管理有限公司关于暂停北京钱景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》及公司官网 | 2022 年 5 月 14 日 |

| | | | |
|----|--|-------------|-----------------|
| 19 | 益民基金管理有限公司关于暂停北京中期时代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》及公司官网 | 2022 年 5 月 26 日 |
| 20 | 益民基金管理有限公司关于高级管理人员的变更公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 6 月 18 日 |
| 21 | 益民基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 6 月 21 日 |
| 22 | 益民基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 6 月 22 日 |
| 23 | 益民基金管理有限公司关于高级管理人员的变更公告 | 《证券时报》及公司官网 | 2022 年 6 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立益民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

2022 年 8 月 26 日