

# 民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59

8.3 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 .....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
8.6 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 .....	69
8.7 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 .....	69
8.8 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 .....	69
8.9 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 .....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
9.3 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 .....	71
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
11.2 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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	78
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>79</b>
12.1 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 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	民生加银城镇化混合	
基金主代码	000408	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 12 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	280,513,922.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
下属分级基金的交易代码	000408	009706
报告期末下属分级基金的份额总额	277,668,258.17 份	2,845,664.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于在城镇化建设过程中将有突出贡献并因此受益的上市公司，在充分控制基金资产风险和保持基金资产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略、债券投资策略、其他金融工具投资策略、风险管理、收益锁定策略等，详见基金合同或招募说明书。 本基金的大类资产配置将在对股票、债券等资产的预期收益率及风险水平进行充分评估的基础上进行；本基金在进行股票配置时，将重点考虑城镇化建设所处的阶段，筛选出在所处阶段对城镇化建设贡献更为突出的上市公司进行重点配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘静	王小飞
	联系电话	010-68960037	021-60637103
	电子邮箱	liujing@msjyfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	021-60637228
传真		0755-23999800	021-60635778

注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjfund.com.cn">http://www.msjfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2022 年		2021 年		2020 年	
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
本期已实现收益	-177,554,691.53	-6,590,452.03	169,142,875.37	-927,137.61	250,902,684.92	1,110.08
本期利润	-241,991,848.64	-11,791,173.61	-99,146,950.38	-249,628.19	509,923,794.15	2,614.19
加权平均基金份额本期	-0.7537	-1.0774	-0.2309	-0.0529	1.4052	0.3851

利润						
本期加权平均净值利润率	-37.50%	-52.44%	-8.66%	-2.10%	61.21%	15.27%
本期基金份额净值增长率	-29.58%	-29.93%	-8.19%	-8.64%	74.35%	18.37%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	115,507,192.00	2,132,420.27	326,457,712.54	22,573,181.40	327,952,385.11	20,695.17
期末可供分配基金份额利润	0.4160	0.7494	0.9676	1.4963	0.6652	1.4513
期末基金资产净值	491,109,971.19	4,978,084.54	847,419,019.02	37,659,461.48	1,348,719,200.27	38,957.41
期末基金份额净值	1.769	1.749	2.512	2.496	2.736	2.732
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值	282.43%	-24.22%	443.06%	8.15%	491.49%	18.37%

增长率						
-----	--	--	--	--	--	--

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

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

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

④本基金自 2020 年 9 月 10 日起增设 C 类基金份额。

## 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

民生加银城镇化混合 A

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
过去三个月	-5.20%	1.28%	1.22%	0.76%	-6.42%	0.52%
过去六个月	-16.36%	1.25%	-7.61%	0.66%	-8.75%	0.59%
过去一年	-29.58%	1.30%	-12.02%	0.77%	-17.56%	0.53%
过去三年	12.73%	1.33%	2.89%	0.77%	9.84%	0.56%
过去五年	43.31%	1.38%	10.36%	0.77%	32.95%	0.61%
自基金合同生效起至今	282.43%	1.49%	67.12%	0.85%	215.31%	0.64%

民生加银城镇化混合 C

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
过去三个月	-5.31%	1.28%	1.22%	0.76%	-6.53%	0.52%
过去六个月	-16.60%	1.25%	-7.61%	0.66%	-8.99%	0.59%
过去一年	-29.93%	1.30%	-12.02%	0.77%	-17.91%	0.53%
自基金合同生效	-24.22%	1.25%	-4.91%	0.72%	-19.31%	0.53%

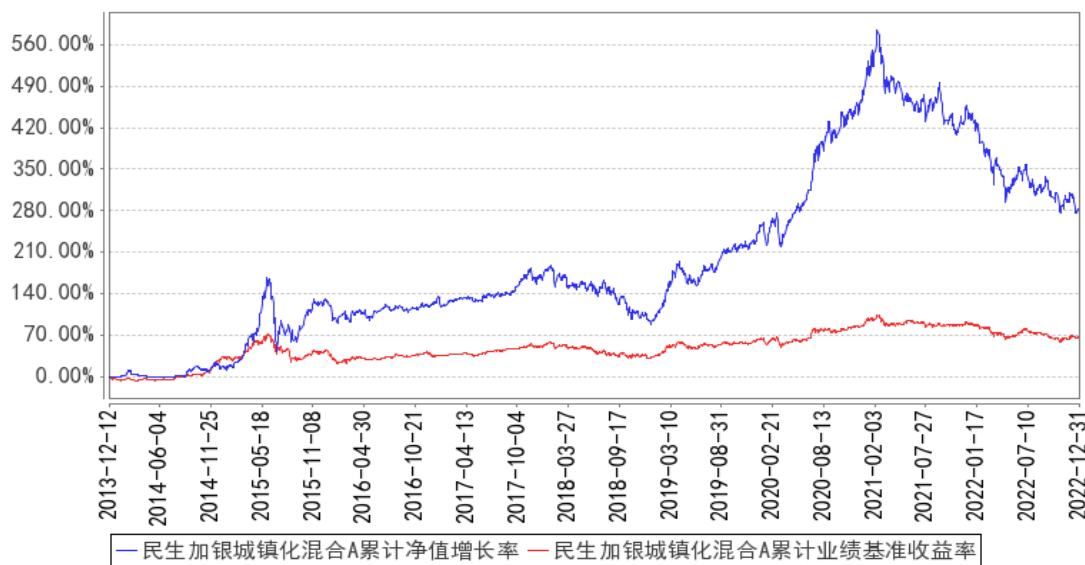


起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

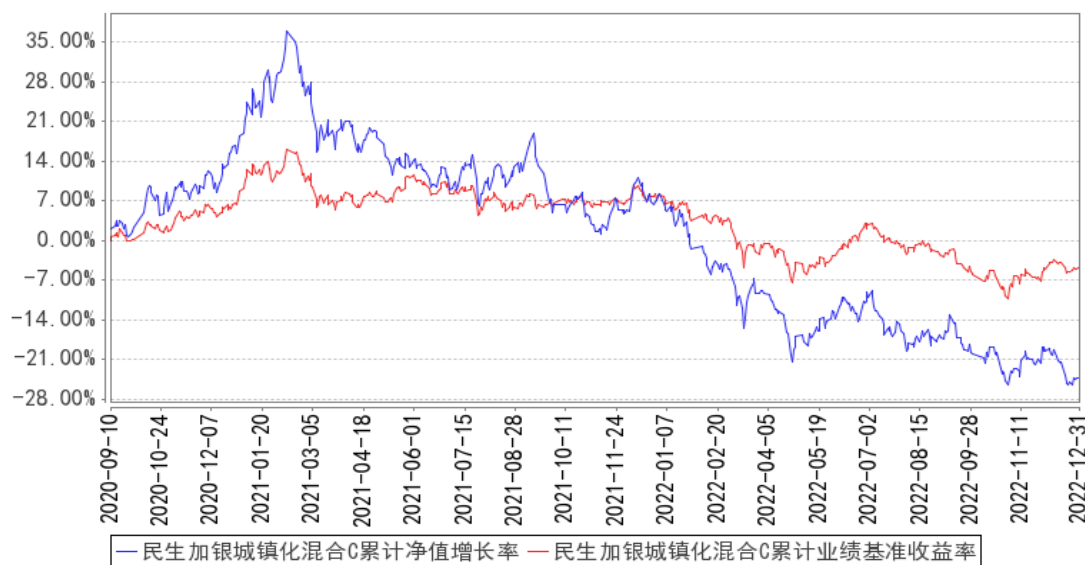
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%

### 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

**民生加银城镇化混合A 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**



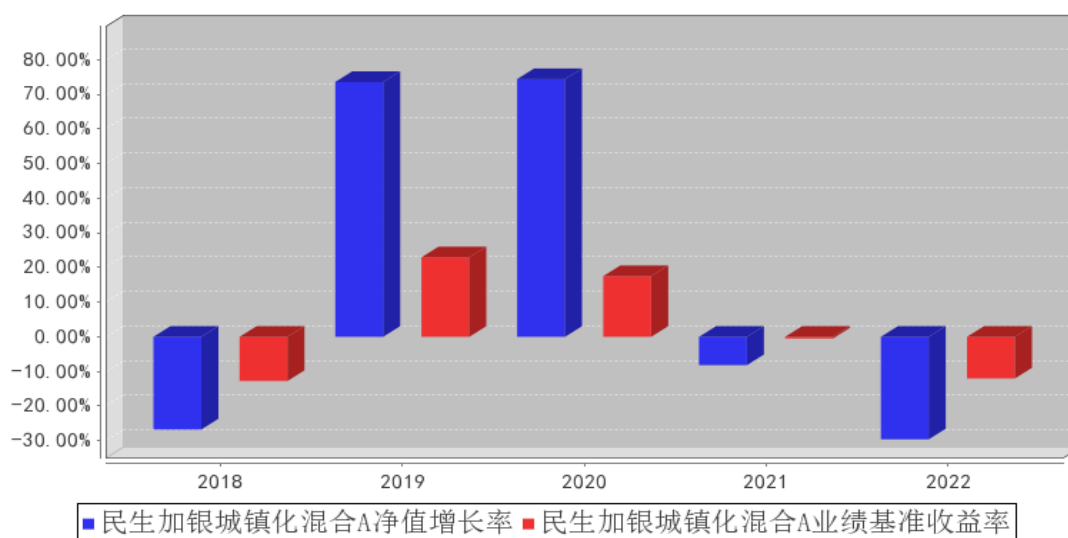
**民生加银城镇化混合C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



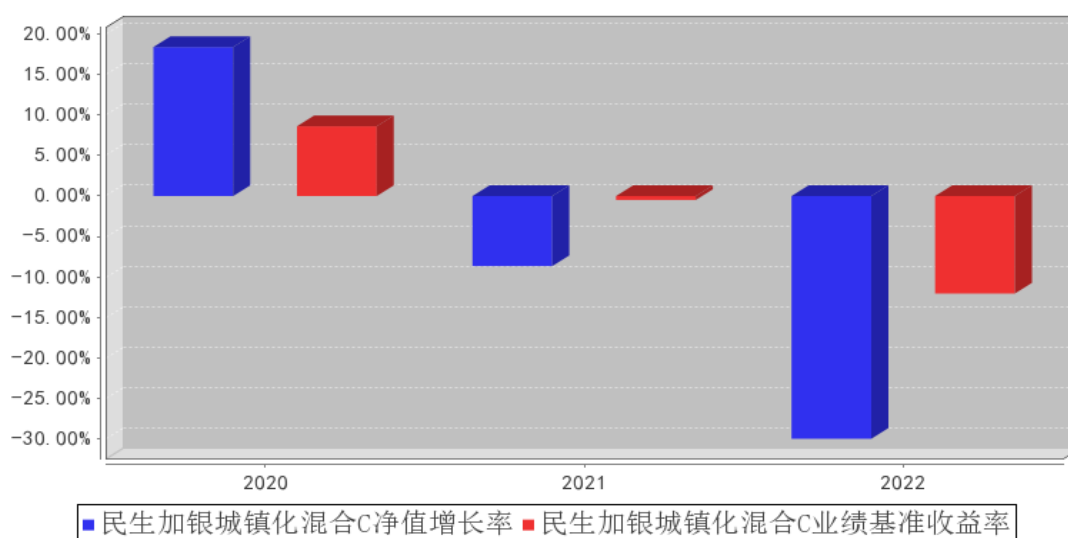
注：本基金合同于 2013 年 12 月 12 日生效,本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。本基金于 2020 年 9 月 10 日增加 C 类份额。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**民生加银城镇化混合A 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**民生加银城镇化混合C 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：本基金合同于2013年12月12日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金于2020年9月10日增加C类份额。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

民生加银城镇化混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	4.700	144,751,526.76	50,221,396.08	194,972,922.84	-

合计	4.700	144,751,526.76	50,221,396.08	194,972,922.84	-
----	-------	----------------	---------------	----------------	---

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

基金管理情况：2022年12月31日，民生加银基金管理有限公司管理96只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金、民生加银鑫元纯债债券型证券投资基金、民生加银智造2025灵活配置混合型证券投资基金、民生加银家盈半年定期宝理财债券型证券投资基金、民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银恒益纯债债券型证券投资基金、民生加银新兴成长混合型证券投资基金、民生加银创新成长混合型证券投资基金、民生加银睿通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银兴盈债券型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、民生加银中债1-3年农发行债券指数证券投资基金、民生加银聚益纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型

证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银科技创新 3 年封闭运作灵活配置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、民生加银康宁平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新兴产业混合型证券投资基金、民生加银成长优选股票型证券投资基金、民生加银恒泽债券型证券投资基金、民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银质量领先混合型证券投资基金、民生加银汇智 3 个月定期开放债券型证券投资基金、民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金、民生加银瑞利混合型证券投资基金、民生加银内核驱动混合型证券投资基金、民生加银价值优选 6 个月持有期股票型证券投资基金、民生加银周期优选混合型证券投资基金、民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银康泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金、民生加银聚优精选混合型证券投资基金、民生加银核心资产股票型证券投资基金、民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF-LOF）、民生加银中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银双核动力混合型证券投资基金、民生加银恒祥债券型证券投资基金、民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银金融优选混合型证券投资基金、民生加银月月乐 30 天持有期短债债券型证券投资基金、民生加银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金、民生加银瑞丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银恒宁债券型证券投资基金。

#### 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		
柳世庆	本基金基金经理、投资部总监	2017年3月31日	-	15年	北京大学金融学硕士,15年证券从业经历,曾就职于安信证券,北京鸿道投资,担任宏观、金融及地产研究员。2013年加入民生加银基金管理有限公司,曾任地产及家电行业研究员、基金经理助理,现担任投资部总监、权益资产条线投资决策委员会联席主席、公司投资决策委员会成员、基金经理。自2016年11月至今担任民生加银内需增长混合型证券投资基金基金经理;自2017年3月至今担任民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金经理;自2020年12月至今担任民生加银质量领先混合型证券投资基金基金经理;自2021年3月至今担任民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金基金经理;自2021年5月至今担任民生加银内核驱动混合型证券投资基金基金经理;自2022年1月至今担任民生加银双核动力混合型证券投资基金基金经理;自2022年8月至今担任民生加银金融优选混合型证券投资基金基金经理。自2016年8月至2018年4月担任民生加银鑫瑞债券型证券投资基金基金经理;自2019年9月至2021年12月担任民生加银持续成长混合型证券投资基金基金经理;自2021年4月至2022年5月担任民生加银鹏程混合型证券投资基金基金经理;自2016年8月至2022年9月担任民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 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

2022 年是曲折的一年。世界经济政治局势变化剧烈，股票市场在各种风险事件交织之下回撤巨大。从国内来看，年初制定的 GDP 增长 5.5% 的目标受到各种因素影响，远未达到。其中，疫情对经济的影响首当其冲。二季度华东发达城市的疫情冲击，导致当季度增长仅 0.4%；年末防疫措施的动态优化，疫情对经济又不可避免地在短期内再次产生冲击。除了疫情对经济的影响，房地产等领域的疲软也是拖累经济的重要因素。2021 年下半年以来数个大型地产公司的违约，不仅仅影响购房者信心，也影响了相关产业链景气，甚至有传染金融体系的风险。考虑到房地产相关领域在经济中占比较大，以及行业周期调整往往历时较长，估计其对经济的压力可能会在未来较长时间内延续下去。

本基金在年初主要配置需求相对稳定的医药和部分消费，同时也阶段性配置与大宗商品价格相关的周期领域；进入下半年，随着稳增长政策的推出，本基金也开始增配房地产、金融等相对

经济敏感的领域。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银城镇化混合 A 的基金份额净值为 1.769 元，本报告期基金份额净值增长率为-29.58%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%；截至本报告期末民生加银城镇化混合 C 的基金份额净值为 1.749 元，本报告期基金份额净值增长率为-29.93%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，尽管存在一系列不确定性，但疫情管控优化后经济大概率呈现逐步回升的趋势。就疫情而言，参考海外经验，站在目前判断其就此结束为时尚早，甚至不排除未来依然会不断冲击我们的生活。经济增长有望随着内生力量的推动以及稳增长政策的支撑逐步回升。

因此，整体来看，2023 年经济增长恢复，企业盈利趋势向上是大概率事件，只是变化的幅度与节奏依然不明朗。但是结合 A 股较低估值，这有望支撑市场重新向上。我们认为 2023 年股票市场有望获得相对不错的收益。同时我们在现阶段依然积极配置与稳定经济增长相关的领域，以及疫情稳定后需求相对较确定性恢复的消费领域；同时，也积极关注受益于产业政策，同时增长潜力依然较大的成长板块，如高端制造领域。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人内部对本基金的监察稽核工作主要针对本基金投资运作的合法、合规性，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部进行监察，通过实时监控、定期检查、专项检查、不定期抽查等方式，及时发现问题，提出整改意见并跟踪改进落实情况，并按照中国证监会的要求将《季度监察稽核报告》和《年度监察稽核报告》提交给公司全体董事审阅。

#### 4.7 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。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究各部门参加人员应包含相关行业研究员及固定收益信评人员。分管运营的公司领导任估值委员会主席。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格

的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期可不进行利润分配。

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

报告期内本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60950520_H10 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度



	<p>的利润表及净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴翠蓉 邓雯
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2023 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	30,132,601.53	98,926,760.88
结算备付金		1,581,500.26	740,606.44
存出保证金		245,935.93	251,857.20
交易性金融资产	7.4.7.2	466,338,848.38	787,946,489.64
其中：股票投资		461,274,644.27	787,946,489.64

基金投资		-	-
债券投资		5,064,204.11	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		265,620.63	413,044.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	11,908.11
资产总计		498,564,506.73	888,290,666.49
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		320,553.23	1,012.50
应付赎回款		367,137.94	1,114,186.30
应付管理人报酬		696,894.12	1,174,056.64
应付托管费		116,149.02	195,676.09
应付销售服务费		2,112.02	13,900.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	973,604.67	713,353.61
负债合计		2,476,451.00	3,212,185.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	280,513,922.44	352,467,778.85
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	215,574,133.29	532,610,701.65
净资产合计		496,088,055.73	885,078,480.50
负债和净资产总计		498,564,506.73	888,290,666.49

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 280,513,922.44 份；其中民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.769 元，基金份额 277,668,258.17 份；民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.749 元，基金份额 2,845,664.27 份。

（2）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：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-241,717,161.37	-72,185,774.16
1. 利息收入		342,730.48	608,900.94
其中：存款利息收入	7.4.7.13	342,730.48	607,723.73
债券利息收入		-	1,177.21
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）		-172,603,790.45	193,019,053.23
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-185,304,038.07	181,156,332.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	256,512.15	1,193,513.85
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	12,443,735.47	10,669,206.67
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）	7.4.7.20	-69,637,878.69	-267,612,316.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	181,777.29	1,798,588.00
<b>减：二、营业总支出</b>		12,065,860.88	27,210,804.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,077,073.01	17,464,319.34
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,679,512.15	2,910,719.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	116,132.31	58,055.62
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.96	4.29
8. 其他费用	7.4.7.23	193,142.45	6,777,705.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-253,783,022.25	-99,396,578.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-253,783,022.25	-99,396,578.57
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-253,783,022.25	-99,396,578.57

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：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	352,467,778.85	-	532,610,701.65	885,078,480.50

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	352,467,778.85	-	532,610,701.65	885,078,480.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-71,953,856.41	-	-317,036,568.36	-388,990,424.77
(一)、综合收益总额	-	-	-253,783,022.25	-253,783,022.25
(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)	-71,953,856.41	-	-63,253,546.11	-135,207,402.52
其中:1.基金申购款	66,750,151.79	-	70,261,246.90	137,011,398.69
2.基金赎回款	-138,704,008.20	-	-133,514,793.01	-272,218,801.21
(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、本期末净资产(基金净值)	280,513,922.44	-	215,574,133.29	496,088,055.73
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	493,011,977.23	-	855,746,180.45	1,348,758,157.68
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)	493,011,977.23	-	855,746,180.45	1,348,758,157.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-140,544,198.38	-	-323,135,478.80	-463,679,677.18
(一)、综合收益总额	-	-	-99,396,578.57	-99,396,578.57
(二)、本期基金份额	-140,544,198.38	-	-223,738,900.23	-364,283,098.61

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	402,178,958.15	-	721,896,264.32	1,124,075,222.47
2. 基金赎回款	-542,723,156.53	-	-945,635,164.55	-1,488,358,321.08
（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）	352,467,778.85	-	532,610,701.65	885,078,480.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郑智军

基金管理人负责人

王国栋

主管会计工作负责人

洪锐珠

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]第 929 号《关于核准民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2013 年 12 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 235,923,426.05 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据基金管理人民生加银基金管理有限公司于 2020 年 9 月 9 日发布的《关于民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金将于 2020 年 9 月 10 日起增加 C 类基金份额类别，原份额转为 A 类份额。已有的 A 类基金份额类别业务规则保持不变。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。在投资人申购时收取申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、在投资人申购时不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、股指期货、中期票据、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。

基金的投资组合比例为：股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的 0%-95%；债券、货币市场工具、现金、中期票据、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移

也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 40%，若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(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相应类别的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某一类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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——套期会计》、《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。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

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。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债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和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 98,926,760.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 11,416.85 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 98,938,177.73 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 740,606.44 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 366.63 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 740,973.07 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 251,857.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 124.63 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 251,981.83 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,908.11 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 11,416.85 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 366.63 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 124.63 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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



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

#### 7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 7.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	30,132,601.53	98,926,760.88

等于：本金	30,128,480.00	98,926,760.88
加：应计利息	4,121.53	-
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	30,132,601.53	98,926,760.88

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	463,275,652.44	-	461,274,644.27	-2,001,008.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	66,704.11	5,064,204.11	-3,420.37
	银行间市场	-	-	-
	合计	66,704.11	5,064,204.11	-3,420.37
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	468,276,572.81	66,704.11	466,338,848.38	-2,004,428.54
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	720,313,039.49	-	787,946,489.64	67,633,450.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	720,313,039.49	-	787,946,489.64	67,633,450.15
----	----------------	---	----------------	---------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	11,908.11
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	11,908.11

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	634.92	3,275.58
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	798,469.75	535,578.03
其中：交易所市场	798,469.75	535,578.03
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提银行间账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	973,604.67	713,353.61

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银城镇化混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	337,381,498.77	337,381,498.77
本期申购	44,297,516.33	44,297,516.33
本期赎回（以“-”号填列）	-104,010,756.93	-104,010,756.93
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	277,668,258.17	277,668,258.17

## 民生加银城镇化混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,086,280.08	15,086,280.08
本期申购	22,452,635.46	22,452,635.46
本期赎回（以“-”号填列）	-34,693,251.27	-34,693,251.27
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	2,845,664.27	2,845,664.27

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 民生加银城镇化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	326,457,712.54	183,579,807.71	510,037,520.25
本期利润	-177,554,691.53	-64,437,157.11	-241,991,848.64
本期基金份额交易产生的变动数	-33,395,829.01	-21,208,129.58	-54,603,958.59
其中：基金申购款	30,624,246.76	15,299,152.97	45,923,399.73
基金赎回款	-64,020,075.77	-36,507,282.55	-100,527,358.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,507,192.00	97,934,521.02	213,441,713.02

## 民生加银城镇化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	26,264,172.23	-3,690,990.83	22,573,181.40
本期利润	-6,590,452.03	-5,200,721.58	-11,791,173.61
本期基金份额交易产生	-16,303,411.91	7,653,824.39	-8,649,587.52

的变动数			
其中：基金申购款	33,660,511.89	-9,322,664.72	24,337,847.17
基金赎回款	-49,963,923.80	16,976,489.11	-32,987,434.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,370,308.29	-1,237,888.02	2,132,420.27

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	312,087.51	575,067.34
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	25,713.83	27,365.29
其他	4,929.14	5,291.10
合计	342,730.48	607,723.73

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-185,304,038.07	181,156,332.71
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	-185,304,038.07	181,156,332.71

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	2,554,965,461.40	2,476,336,685.85

减：卖出股票成本总额	2,733,438,288.54	2,295,180,353.14
减：交易费用	6,831,210.93	-
买卖股票差价收入	-185,304,038.07	181,156,332.71

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	50,855.28	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	205,656.87	1,193,513.85
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	256,512.15	1,193,513.85

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,233,406.38	4,607,626.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,023,073.63	3,412,900.00
减：应计利息总额	4,643.46	1,212.95
减：交易费用	32.42	-
买卖债券差价收入	205,656.87	1,193,513.85

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。



7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,443,735.47	10,669,206.67
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	12,443,735.47	10,669,206.67

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-69,637,878.69	-267,612,316.33
股票投资	-69,634,458.32	-267,612,316.33
债券投资	-3,420.37	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-69,637,878.69	-267,612,316.33

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	178,415.81	1,779,945.96
基金转换费收入	3,361.48	18,642.04
合计	181,777.29	1,798,588.00

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,142.45	17,401.74
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
交易费用	-	6,572,303.47
合计	193,142.45	6,777,705.21

#### 7.4.7.24 分部报告

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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司（“民生加银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的股东
三峡财务有限责任公司	基金管理人的股东

民生加银资产管理有限公司

基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,077,073.01	17,464,319.34
其中：支付销售机构的客户维护费	2,535,072.07	3,900,374.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,679,512.15	2,910,719.95

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	合计
民生加银基金公司	-	34,910.31	34,910.31
中国建设银行	-	-	-
中国民生银行	-	1,840.63	1,840.63
合计	-	36,750.94	36,750.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	合计
民生加银基金公司	-	24,651.37	24,651.37
中国建设银行	-	-	-
中国民生银行	-	2,570.08	2,570.08
合计	-	27,221.45	27,221.45

注：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。销售服务费每日计提，按月支付。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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：本基金于本期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。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金于本期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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况，于本期末及上年度末亦未持有本基金份额。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	30,132,601.53	312,087.51	98,926,760.88	575,067.34

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：1) 本基金于本期末未进行利润分配。

2) 本基金资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前的利润分配情况，详见本报告“7.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股流通受限	58.00	86.49	481	27,898.00	41,601.69	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股流通受限	42.05	24.04	625	26,281.25	15,025.00	-
301121	紫建电子	2022年8月1日	6个月	新股流通受限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	423	24,111.00	19,728.72	-
301161	唯万密封	2022年9月6日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	32.38	31.61	668	21,629.84	21,115.48	-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	942	17,125.56	16,692.24	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-

301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股流通受限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	432	21,980.16	28,598.40	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	594	19,417.86	52,236.36	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-



		日									
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35		-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00		-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90		-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95		-
301308	江波龙	2022年7月27日	6个月	新股流通受限	55.67	56.72	617	34,348.39	34,996.24		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股流通受限	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74		-
301327	华宝	2022年	6个月	新股流	237.50	176.97	218	51,775.00	38,579.46		-

	新能	9月8日		通受限							
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36		-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14		-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	128	17,776.64	13,250.56		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	424	26,712.00	18,371.92		-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25		-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	177	21,218.76	31,113.06		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-

301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	1,232	27,720.00	21,141.12	-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688031	星环科技	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	47.34	78.80	12,047	570,304.98	949,303.60	-
688061	灿瑞科技	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	112.69	87.17	2,979	335,703.51	259,679.43	-
688147	微导纳米	2022年12月16日	6个月	新股流通受限	24.21	23.91	6,293	152,353.53	150,465.63	-
688244	永信至诚	2022年10月12日	6个月	新股流通受限	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
688275	万润新能	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	299.88	168.85	1,151	345,161.88	194,346.35	-
688376	美埃科技	2022年11月10日	6个月	新股流通受限	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-
688420	美腾科技	2022年12月1日	6个月	新股流通受限	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32	-
688459	哈铁科技	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	13.58	8.27	17,259	234,377.22	142,731.93	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截止本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的

证券，不得超过该证券市值的 10%。

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

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,064,204.11	-
合计	5,064,204.11	-

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

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及交易性债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,128,480.00	-	-	-	-	4,121.53	30,132,601.53
结算备付金	1,580,717.83	-	-	-	-	782.43	1,581,500.26
存出保证金	245,814.16	-	-	-	-	121.77	245,935.93
交易性金融资产	-	-	4,997,500.00	-	-	461,341,348.38	466,338,848.38
应收申购款	-	-	-	-	-	265,620.63	265,620.63
资产总计	31,955,011.99	-	4,997,500.00	-	-	461,611,994.74	498,564,506.73

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	367,137.94	367,137.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	696,894.12	696,894.12
应付托管费	-	-	-	-	-	116,149.02	116,149.02
应付清算款	-	-	-	-	-	320,553.23	320,553.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,112.02	2,112.02
其他负债	-	-	-	-	-	973,604.67	973,604.67
负债总计	-	-	-	-	-	2,476,451.00	2,476,451.00
利率敏感度缺口	31,955,011.99	-	4,997,500.00	-	-	-459,135,543.74	496,088,055.73
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	98,926,760.88	-	-	-	-	-	98,926,760.88
结算备付金	740,606.44	-	-	-	-	-	740,606.44
存出保证金	251,857.20	-	-	-	-	-	251,857.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-787,946,489.64	787,946,489.64
应收申购款	-	-	-	-	-	413,044.22	413,044.22
其他资产	-	-	-	-	-	11,908.11	11,908.11
资产总计	99,919,224.52	-	-	-	-	-788,371,441.97	888,290,666.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,114,186.30	1,114,186.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,174,056.64	1,174,056.64
应付托管费	-	-	-	-	-	195,676.09	195,676.09
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,012.50	1,012.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,900.85	13,900.85
其他负债	-	-	-	-	-	713,353.61	713,353.61
负债总计	-	-	-	-	-	3,212,185.99	3,212,185.99
利率敏感度缺口	99,919,224.52	-	-	-	-	-785,159,255.98	885,078,480.50

#### 7.4.13.4.1.2 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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	3,893.69	-
	2. 市场利率上升 25 个基点	-3,887.41	-

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	461,274,644.27	92.98	787,946,489.64	89.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	461,274,644.27	92.98	787,946,489.64	89.03

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合
----	--



	理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	34,520,539.71	64,320,078.67
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-34,520,539.71	-64,320,078.67

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	458,349,063.07	783,134,680.71
第二层次	7,989,785.31	4,811,808.93
第三层次	-	-
合计	466,338,848.38	787,946,489.64

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	461,274,644.27	92.52
	其中：股票	461,274,644.27	92.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,064,204.11	1.02
	其中：债券	5,064,204.11	1.02
	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	31,714,101.79	6.36
8	其他各项资产	511,556.56	0.10

9	合计	498,564,506.73	100.00
---	----	----------------	--------

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	11,892.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	160,778,625.82	32.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,330.55	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,091,393.19	10.30
G	交通运输、仓储和邮政业	9,636,034.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,002,572.89	0.40
J	金融业	95,492,461.23	19.25
K	房地产业	90,905,430.76	18.32
L	租赁和商务服务业	23,593.50	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,002,728.37	5.24
N	水利、环境和公共设施管理业	164,484.42	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,148,493.04	5.07
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	461,274,644.27	92.98

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 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	601567	三星医疗	1,978,522	26,670,476.56	5.38
2	600153	建发股份	1,937,203	26,442,820.95	5.33
3	600048	保利发展	1,737,400	26,286,862.00	5.30
4	603338	浙江鼎力	546,947	26,171,413.95	5.28
5	603259	药明康德	318,640	25,809,840.00	5.20
6	001979	招商蛇口	1,988,700	25,117,281.00	5.06
7	000516	国际医学	2,047,700	25,063,848.00	5.05

8	300760	迈瑞医疗	79,245	25,039,042.65	5.05
9	600383	金地集团	2,025,100	20,716,773.00	4.18
10	601456	国联证券	1,827,543	20,559,858.75	4.14
11	600325	华发股份	2,073,346	18,784,514.76	3.79
12	300033	同花顺	167,808	16,547,546.88	3.34
13	600435	北方导航	1,386,600	16,084,560.00	3.24
14	300122	智飞生物	176,293	15,483,814.19	3.12
15	603939	益丰药房	221,900	14,166,096.00	2.86
16	600030	中信证券	681,360	13,565,877.60	2.73
17	000935	四川双马	629,639	13,222,419.00	2.67
18	000776	广发证券	809,700	12,542,253.00	2.53
19	601066	中信建投	521,300	12,380,875.00	2.50
20	300059	东方财富	530,200	10,285,880.00	2.07
21	603883	老百姓	251,950	10,196,416.50	2.06
22	601878	浙商证券	957,569	9,508,660.17	1.92
23	002648	卫星化学	591,013	9,160,701.50	1.85
24	002917	金奥博	457,800	5,571,426.00	1.12
25	002352	顺丰控股	84,700	4,892,272.00	0.99
26	600009	上海机场	82,200	4,743,762.00	0.96
27	688383	新益昌	47,974	4,551,773.12	0.92
28	603833	欧派家居	30,590	3,717,602.70	0.75
29	000519	中兵红箭	112,400	2,207,536.00	0.44
30	688235	百济神州	8,786	1,163,705.70	0.23
31	688031	星环科技	12,047	949,303.60	0.19
32	600519	贵州茅台	432	746,064.00	0.15
33	002475	立讯精密	18,400	584,200.00	0.12
34	300604	长川科技	11,400	508,212.00	0.10
35	002487	大金重工	11,500	475,755.00	0.10
36	688270	臻镭科技	3,705	429,668.85	0.09
37	688439	振华风光	3,595	427,373.60	0.09
38	300776	帝尔激光	3,252	409,752.00	0.08
39	688392	骄成超声	2,745	397,228.95	0.08
40	301367	怡和嘉业	1,766	380,009.79	0.08
41	603486	科沃斯	4,805	350,476.70	0.07
42	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.06
43	603218	日月股份	12,987	263,636.10	0.05
44	688061	灿瑞科技	2,979	259,679.43	0.05
45	688290	景业智能	3,040	219,123.20	0.04
46	301165	锐捷网络	6,277	212,438.47	0.04
47	301391	卡莱特	2,470	210,066.09	0.04
48	688152	麒麟信安	1,189	203,200.10	0.04
49	688489	三未信安	1,995	202,153.35	0.04
50	601933	永辉超市	54,967	200,629.55	0.04

51	688275	万润新能	1,151	194,346.35	0.04
52	301356	天振股份	4,031	181,841.16	0.04
53	688325	赛微微电	4,039	164,548.86	0.03
54	688362	甬矽电子	7,145	155,689.55	0.03
55	688147	微导纳米	6,293	150,465.63	0.03
56	301223	中荣股份	7,648	143,236.35	0.03
57	688459	哈铁科技	17,259	142,731.93	0.03
58	603589	口子窖	2,468	142,329.56	0.03
59	301377	鼎泰高科	7,295	141,921.85	0.03
60	301335	天元宠物	3,964	139,803.76	0.03
61	301311	昆船智能	7,720	135,319.76	0.03
62	688426	康为世纪	3,776	133,821.44	0.03
63	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.03
64	688553	汇宇制药	8,220	128,149.80	0.03
65	301365	矩阵股份	4,960	124,572.36	0.03
66	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.02
67	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.02
68	688625	呈和科技	2,472	120,930.24	0.02
69	301277	新天地	4,184	119,435.57	0.02
70	688132	邦彦技术	4,643	113,289.20	0.02
71	301361	众智科技	4,969	110,650.16	0.02
72	688247	宣泰医药	6,589	110,365.75	0.02
73	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.02
74	688682	霍莱沃	1,324	105,205.04	0.02
75	688291	金橙子	3,961	103,619.76	0.02
76	688420	美腾科技	2,408	94,008.32	0.02
77	301265	华新环保	7,681	93,121.62	0.02
78	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.02
79	688203	海正生材	5,305	83,023.25	0.02
80	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.02
81	301398	星源卓镁	2,449	75,722.80	0.02
82	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.02
83	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.01
84	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
85	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.01
86	688455	科捷智能	4,859	66,130.99	0.01
87	688786	悦安新材	1,513	62,744.11	0.01
88	301368	丰立智能	3,168	62,578.14	0.01
89	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.01
90	301269	华大九天	594	52,236.36	0.01
91	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.01
92	301238	瑞泰新材	2,018	45,384.82	0.01
93	301153	中科江南	398	42,363.12	0.01

94	301095	广立微	481	41,601.69	0.01
95	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
96	688501	青达环保	1,541	39,834.85	0.01
97	301266	宇邦新材	517	39,085.20	0.01
98	301327	华宝新能	218	38,579.46	0.01
99	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
100	301029	怡合达	554	36,419.96	0.01
101	301308	江波龙	617	34,996.24	0.01
102	301211	亨迪药业	967	33,506.55	0.01
103	301268	铭利达	641	32,184.61	0.01
104	301236	软通动力	903	31,767.54	0.01
105	301217	铜冠铜箔	2,536	31,421.04	0.01
106	301302	华如科技	466	29,837.98	0.01
107	301162	国能日新	334	29,331.88	0.01
108	301267	华夏眼科	432	28,598.40	0.01
109	301087	可孚医疗	763	27,834.24	0.01
110	301177	迪阿股份	436	27,459.28	0.01
111	002594	比亚迪	100	25,697.00	0.01
112	301389	隆扬电子	1,432	24,801.12	0.00
113	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
114	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
115	301168	通灵股份	329	23,809.73	0.00
116	301102	兆讯传媒	642	23,593.50	0.00
117	301101	明月镜片	371	23,380.42	0.00
118	301263	泰恩康	682	22,165.00	0.00
119	301109	军信股份	1,388	21,958.16	0.00
120	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.00
121	603255	鼎际得	488	21,911.20	0.00
122	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
123	301206	三元生物	549	21,411.00	0.00
124	301117	佳缘科技	262	20,776.60	0.00
125	301216	万凯新材	705	20,219.40	0.00
126	301200	大族数控	509	19,952.80	0.00
127	301152	天力锂能	423	19,728.72	0.00
128	301120	新特电气	1,032	19,205.52	0.00
129	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
130	688122	西部超导	200	18,938.00	0.00
131	301096	百诚医药	272	18,580.32	0.00
132	301201	诚达药业	353	17,932.40	0.00
133	301150	中一科技	275	17,740.25	0.00
134	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
135	301171	易点天下	942	16,692.24	0.00
136	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00

137	301256	华融化学	1,831	16,332.52	0.00
138	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
139	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
140	301127	天源环保	1,685	16,091.75	0.00
141	301103	何氏眼科	507	15,980.64	0.00
142	301089	拓新药业	220	15,840.00	0.00
143	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
144	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
145	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
146	301115	建科股份	625	15,025.00	0.00
147	301235	华康医疗	418	14,951.86	0.00
148	301219	腾远钴业	216	14,888.88	0.00
149	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.00
150	301187	欧圣电气	876	14,821.92	0.00
151	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
152	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
153	301248	杰创智能	472	14,386.56	0.00
154	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
155	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
156	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
157	301097	天益医疗	249	14,063.52	0.00
158	301212	联盛化学	416	13,823.68	0.00
159	301100	风光股份	599	13,273.84	0.00
160	300834	星辉环材	534	13,264.56	0.00
161	301349	信德新材	128	13,250.56	0.00
162	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
163	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
164	301189	奥尼电子	435	12,432.30	0.00
165	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
166	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
167	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
168	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
169	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
170	301151	冠龙节能	703	11,958.03	0.00
171	002041	登海种业	600	11,892.00	0.00
172	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
173	301258	富士莱	295	11,578.75	0.00
174	301166	优宁维	253	11,569.69	0.00
175	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
176	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
177	301179	泽宇智能	295	11,260.15	0.00
178	301148	嘉戎技术	516	11,150.76	0.00
179	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00

180	301221	光庭信息	280	10,894.80	0.00
181	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
182	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
183	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
184	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
185	301180	万祥科技	654	10,758.30	0.00
186	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
187	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
188	301190	善水科技	575	10,338.50	0.00
189	301030	仕净科技	242	10,093.82	0.00
190	301116	益客食品	577	9,860.93	0.00
191	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
192	301126	达嘉维康	662	9,857.18	0.00
193	301193	家联科技	297	9,833.67	0.00
194	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
195	002460	赣锋锂业	140	9,731.40	0.00
196	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
197	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
198	301298	东利机械	634	9,605.10	0.00
199	301108	洁雅股份	280	9,452.80	0.00
200	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
201	301181	标榜股份	257	9,190.32	0.00
202	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
203	301259	艾布鲁	483	9,177.00	0.00
204	301196	唯科科技	271	9,100.18	0.00
205	301185	鸥玛软件	578	8,797.16	0.00
206	301092	争光股份	323	8,701.62	0.00
207	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
208	301137	哈焊华通	644	8,571.64	0.00
209	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
210	301222	浙江恒威	332	8,373.04	0.00
211	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
212	301198	喜悦智行	341	8,265.84	0.00
213	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
214	301199	迈赫股份	402	8,003.82	0.00
215	301125	腾亚精工	327	7,877.43	0.00
216	301135	瑞德智能	338	7,740.20	0.00
217	301237	和顺科技	261	7,707.33	0.00
218	301110	青木股份	202	7,647.72	0.00
219	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
220	301288	清研环境	452	7,525.80	0.00
221	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
222	301111	粤万年青	379	7,435.98	0.00



223	301163	宏德股份	277	7,282.33	0.00
224	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
225	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
226	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
227	301130	西点药业	237	6,842.19	0.00
228	301138	华研精机	285	6,774.45	0.00
229	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
230	301279	金道科技	296	6,517.92	0.00
231	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
232	301158	德石股份	379	6,007.15	0.00
233	301133	金钟股份	286	5,988.84	0.00
234	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
235	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
236	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
237	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
238	301182	凯旺科技	294	5,533.08	0.00
239	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
240	301055	张小泉	355	5,403.10	0.00
241	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
242	301038	深水规院	346	5,113.88	0.00
243	301059	金三江	259	4,791.50	0.00
244	301081	严牌股份	403	4,650.62	0.00
245	301040	中环海陆	241	4,607.92	0.00
246	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
247	301057	汇隆新材	218	4,388.34	0.00
248	301056	森赫股份	572	4,352.92	0.00
249	301049	超越科技	196	4,129.72	0.00
250	301041	金百泽	215	4,112.95	0.00
251	301062	上海艾录	523	4,079.40	0.00
252	301027	华蓝集团	286	3,861.00	0.00
253	301072	中捷精工	181	3,710.50	0.00
254	301037	保立佳	212	3,406.84	0.00
255	301053	远信工业	155	3,144.95	0.00
256	300854	中兰环保	203	3,101.84	0.00
257	300748	金力永磁	100	2,926.00	0.00
258	301079	邵阳液压	140	2,563.40	0.00
259	002635	安洁科技	100	1,235.00	0.00
260	688172	燕东微	24	455.52	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601155	新城控股	72,719,301.05	8.22
2	300122	智飞生物	61,341,889.77	6.93
3	002244	滨江集团	57,898,297.79	6.54
4	603259	药明康德	57,709,176.29	6.52
5	002241	歌尔股份	55,118,224.20	6.23
6	600383	金地集团	53,370,833.66	6.03
7	000933	神火股份	49,098,776.65	5.55
8	600188	兖矿能源	48,748,645.98	5.51
9	603392	万泰生物	47,737,365.11	5.39
10	603338	浙江鼎力	47,623,026.25	5.38
11	603486	科沃斯	45,843,585.68	5.18
12	000983	山西焦煤	45,100,032.86	5.10
13	600309	万华化学	44,785,353.37	5.06
14	601666	平煤股份	41,181,493.31	4.65
15	600426	华鲁恒升	40,222,270.18	4.54
16	300760	迈瑞医疗	39,043,896.00	4.41
17	002142	宁波银行	38,864,773.77	4.39
18	603520	司太立	37,305,493.60	4.21
19	600048	保利发展	35,922,889.00	4.06
20	601567	三星医疗	35,552,416.09	4.02
21	000002	万 科 A	35,546,744.80	4.02
22	600919	江苏银行	35,326,960.24	3.99
23	002821	凯莱英	35,176,028.06	3.97
24	600256	广汇能源	33,684,439.38	3.81
25	002475	立讯精密	32,665,832.43	3.69
26	002384	东山精密	31,305,688.00	3.54
27	600546	山煤国际	31,151,762.17	3.52
28	603816	顾家家居	31,106,639.75	3.51
29	601857	中国石油	31,013,814.44	3.50
30	001979	招商蛇口	29,824,972.82	3.37
31	000516	国际医学	28,713,473.43	3.24
32	603833	欧派家居	28,583,341.89	3.23
33	601288	农业银行	28,495,080.00	3.22
34	300450	先导智能	28,336,045.70	3.20
35	603345	安井食品	27,037,631.00	3.05
36	600153	建发股份	26,762,893.37	3.02
37	002353	杰瑞股份	26,398,921.76	2.98
38	601456	国联证券	26,146,803.55	2.95
39	600276	恒瑞医药	26,122,860.30	2.95
40	600900	长江电力	25,697,998.23	2.90
41	000333	美的集团	25,590,286.36	2.89
42	601398	工商银行	25,131,153.00	2.84
43	601658	邮储银行	24,730,675.00	2.79

44	600325	华发股份	24,709,357.29	2.79
45	002507	涪陵榨菜	24,424,489.44	2.76
46	300033	同花顺	24,221,702.60	2.74
47	002385	大北农	23,513,717.57	2.66
48	002532	天山铝业	23,026,776.17	2.60
49	601328	交通银行	22,500,361.00	2.54
50	603501	韦尔股份	21,869,002.20	2.47
51	002317	众生药业	21,556,126.82	2.44
52	601985	中国核电	21,411,555.00	2.42
53	000786	北新建材	21,094,650.40	2.38
54	000935	四川双马	20,381,062.97	2.30
55	600036	招商银行	20,223,712.00	2.28
56	300776	帝尔激光	19,763,209.00	2.23
57	600435	北方导航	19,263,643.00	2.18
58	600030	中信证券	18,377,069.55	2.08
59	000776	广发证券	17,976,559.10	2.03
60	300604	长川科技	17,805,283.99	2.01

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

#### 8.4.2 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	300776	帝尔激光	84,020,607.73	9.49
2	600309	万华化学	81,691,481.17	9.23
3	603833	欧派家居	78,774,954.19	8.90
4	002142	宁波银行	74,345,630.05	8.40
5	002244	滨江集团	68,561,729.61	7.75
6	300122	智飞生物	66,431,402.02	7.51
7	300450	先导智能	65,208,166.66	7.37
8	603338	浙江鼎力	62,290,253.54	7.04
9	603816	顾家家居	58,448,742.48	6.60
10	603259	药明康德	56,927,678.34	6.43
11	600188	兖矿能源	56,446,356.20	6.38
12	601155	新城控股	54,980,659.07	6.21
13	000933	神火股份	52,731,705.90	5.96
14	002648	卫星化学	51,248,595.56	5.79
15	002532	天山铝业	48,974,088.68	5.53
16	000983	山西焦煤	48,287,548.08	5.46
17	603392	万泰生物	47,747,286.70	5.39
18	002241	歌尔股份	45,709,177.67	5.16
19	000807	云铝股份	42,222,732.80	4.77
20	601666	平煤股份	41,536,998.02	4.69
21	000661	长春高新	41,244,198.31	4.66

22	600570	恒生电子	39,773,257.22	4.49
23	600546	山煤国际	39,615,678.00	4.48
24	603486	科沃斯	38,433,888.56	4.34
25	002384	东山精密	37,259,645.03	4.21
26	600426	华鲁恒升	36,869,314.20	4.17
27	603501	韦尔股份	35,990,133.99	4.07
28	600256	广汇能源	35,784,525.40	4.04
29	600919	江苏银行	35,163,726.00	3.97
30	603520	司太立	33,291,661.07	3.76
31	002475	立讯精密	31,049,679.50	3.51
32	600438	通威股份	30,533,497.80	3.45
33	000002	万 科 A	29,488,577.00	3.33
34	603345	安井食品	28,980,388.80	3.27
35	601288	农业银行	28,566,697.00	3.23
36	600276	恒瑞医药	28,544,868.35	3.23
37	601857	中国石油	27,113,239.00	3.06
38	600900	长江电力	27,042,796.00	3.06
39	600036	招商银行	25,542,703.16	2.89
40	601398	工商银行	25,474,128.00	2.88
41	002821	凯莱英	24,861,545.77	2.81
42	601658	邮储银行	23,945,898.28	2.71
43	002353	杰瑞股份	23,470,692.39	2.65
44	000333	美的集团	22,733,019.63	2.57
45	601328	交通银行	22,634,597.00	2.56
46	002507	涪陵榨菜	21,795,236.88	2.46
47	300415	伊之密	21,298,710.00	2.41
48	002385	大北农	21,013,820.63	2.37
49	600383	金地集团	20,967,499.72	2.37
50	601985	中国核电	19,886,538.00	2.25
51	002317	众生药业	18,819,541.17	2.13

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

#### 8.4.3 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	2,476,400,901.49
卖出股票收入（成交）总额	2,554,965,461.40

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

#### 8.5 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	5,064,204.11	1.02

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	5,064,204.11	1.02

## 8.6 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	019674	22 国债 09	50,000	5,064,204.11	1.02

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	245,935.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	265,620.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	511,556.56

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
民生加银城镇化混	474,442	585.25	58,585,186.96	21.10	219,083,071.21	78.90

合 A						
民生加银 城镇化混 合 C	3,605	789.37	-	-	2,845,664.27	100.00
合计	478,047	586.79	58,585,186.96	20.88	221,928,735.48	79.12

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	民生加银城镇化混合 A	1,223,163.47	0.4405
	民生加银城镇化混合 C	1,550.75	0.0545
	合计	1,224,714.22	0.4366

## 9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	民生加银城镇化混合 A	10~50
	民生加银城镇化混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银城镇化混合 A	10~50
	民生加银城镇化混合 C	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
基金合同生效日 （2013 年 12 月 12 日）基金份额总额	235,923,426.05	-
本报告期期初基金份 额总额	337,381,498.77	15,086,280.08
本报告期基金总申购 份额	44,297,516.33	22,452,635.46
减：本报告期基金总 赎回份额	104,010,756.93	34,693,251.27
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份	277,668,258.17	2,845,664.27

额总额		
-----	--	--

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

1、本基金管理人于 2022 年 3 月 26 日发布公告，自 2022 年 3 月 25 日起李操纲先生不再担任公司总经理、首席信息官，由公司董事长张焕南先生代行总经理职务。

2、本基金管理人于 2022 年 6 月 23 日发布公告，自 2022 年 6 月 22 日起聘任刘静女士担任公司督察长，邢颖女士不再担任公司督察长职务。

3、本基金管理人于 2022 年 12 月 1 日发布公告，自 2022 年 11 月 30 日起聘任郑智军先生担任公司总经理，张焕南先生不再代行总经理职务。

4、本基金管理人于 2022 年 12 月 16 日发布公告，自 2022 年 12 月 15 日起聘任王国栋先生担任公司财务负责人。

5、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 9 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	民生加银基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 9 月 15 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	出具警示函（行政监管措施）
受到稽查或处罚等措施的原因	公司在管理过程中违反了《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第 120 号）第七条第一项及《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第十五条的规定。



管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至本报告期末公司已经采取整改措施，完成整改工作，并于 2022 年 10 月向深圳证监局提交了整改报告。
其他	-

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
中信建投	4	688,780,643.51	13.82	501,057.91	13.46	-
开源证券	2	634,688,182.62	12.73	461,957.39	12.41	-
招商证券	1	580,911,653.68	11.66	449,407.08	12.07	-
浙商证券	2	481,224,933.32	9.66	348,056.46	9.35	-
西部证券	1	392,297,442.11	7.87	282,578.39	7.59	-
信达证券	2	325,342,996.80	6.53	237,913.16	6.39	-
中金公司	2	219,899,965.30	4.41	204,801.27	5.50	-
西南证券	1	212,849,826.34	4.27	151,400.28	4.07	-
中泰证券	2	208,788,418.72	4.19	183,196.60	4.92	-
天风证券	2	195,273,293.60	3.92	103,107.53	2.77	-
申万宏源	2	151,945,910.43	3.05	111,117.88	2.98	-
安信证券	2	136,872,133.92	2.75	100,100.01	2.69	-
海通证券	1	122,811,011.78	2.46	111,271.84	2.99	-
诚通证券	3	109,150,183.16	2.19	79,817.81	2.14	-

华西证券	1	100,355,566.53	2.01	73,391.84	1.97	-
国盛证券	2	98,054,874.68	1.97	70,123.64	1.88	-
东兴证券	1	93,633,955.85	1.88	66,603.21	1.79	-
中信证券	3	91,519,247.03	1.84	85,236.27	2.29	-
东方证券	1	57,112,121.98	1.15	41,757.41	1.12	-
国泰君安	1	52,026,967.73	1.04	38,047.90	1.02	-
财达证券	2	19,468,501.77	0.39	14,236.72	0.38	-
华泰证券	4	7,328,165.30	0.15	5,352.64	0.14	-
长江证券	1	3,785,547.59	0.08	2,730.52	0.07	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	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	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	5,400,994.00	81.46	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	200,271.00	3.02	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	199,702.00	3.01	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	829,064.38	12.50	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

华泰证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 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	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 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本基金本期新增华泰证券股份有限公司北京一个交易单元，减少渤海证券股份有限公司深圳一个交易单元作为本基金交易单元。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 1 月 24 日
3	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
4	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 30 日
5	关于旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 19 日
6	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
7	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日
8	关于旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 5 月 28 日
9	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 21 日
10	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 21 日
11	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 27 日
12	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 27 日
13	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2022 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 27 日
14	关于旗下部分开放式基金增加济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 28 日
15	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会规定媒介	2022 年 8 月 30 日
16	民生加银基金管理有限公司旗下部分	中国证监会规定媒介	2022 年 8 月 30 日

	基金 2022 年中期报告提示性公告		
17	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 10 月 26 日
18	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 10 月 26 日
19	关于终止深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 12 月 13 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 法律意见书；
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (7) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

民生加银基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日