

民生加银价值发现一年持有期混合型证券 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。

毕马威华振会计师事务所（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

§ 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
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	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
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	24
§ 8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61

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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	72
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	72
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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	73
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
§ 10 开放式基金份额变动	74
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	81
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	82
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	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§ 13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	民生加银价值发现一年持有期混合	
基金主代码	010795	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年3月5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	780,316,897.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	民生加银价值发现一年持有期混合 A	民生加银价值发现一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010795	010796
报告期末下属分级基金的份额总额	728,342,695.28份	51,974,201.88份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，力争获取超额收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置的基础上，本基金将贯彻价值投资的理念，采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过分析行业前景、行业结构、企业的核心竞争力、管理层、治理结构等把握其投资机会，在深入的基本面分析和估值研判的基础上，精选具备核心竞争优势和持续发展潜力的企业，分享企业成长的成果，以期获得超越业绩比较基准的回报。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福中三路 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	http://www.msjyfund.com.cn
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	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层
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 3 月 5 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	民生加银价值发现一年持有期混合 A	民生加银价值发现一年持有期混合 C	民生加银价值发现一年持有期混合 A	民生加银价值发现一年持有期混合 C
本期已实现收益	-206,628,799.74	-17,305,366.49	-53,285,901.83	-5,326,432.47
本期利润	-232,201,290.84	-20,417,379.45	-32,993,618.41	-3,375,361.64
加权平均基金份额本期利润	-0.2952	-0.3332	-0.0385	-0.0415
本期加权平均净值利润率	-38.30%	-43.06%	-3.94%	-4.25%
本期基金份额净值增长率	-29.43%	-29.70%	-3.86%	-4.18%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-234,156,718.61	-16,965,997.09	-53,354,164.18	-5,374,000.98
期末可供分配基金份额利润	-0.3215	-0.3264	-0.0622	-0.0653

期末基金资产净值	494,185,976.67	35,008,204.79	824,778,939.67	78,889,253.33
期末基金份额净值	0.6785	0.6736	0.9614	0.9582
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-32.15%	-32.64%	-3.86%	-4.18%

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。

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

民生加银价值发现一年持有期混合 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	-4.50%	1.29%	4.11%	1.11%	-8.61%	0.18%
过去六个月	-17.04%	1.26%	-8.61%	0.94%	-8.43%	0.32%
过去一年	-29.43%	1.35%	-14.60%	1.09%	-14.83%	0.26%
自基金合同生效起至今	-32.15%	1.10%	-19.21%	0.96%	-12.94%	0.14%

民生加银价值发现一年持有期混合 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	-4.60%	1.29%	4.11%	1.11%	-8.71%	0.18%
过去六个月	-17.21%	1.26%	-8.61%	0.94%	-8.60%	0.32%
过去一年	-29.70%	1.35%	-14.60%	1.09%	-	0.26%
自基金合同生效起至今	-32.64%	1.10%	-19.21%	0.96%	-	0.14%
					15.10%	
					13.43%	

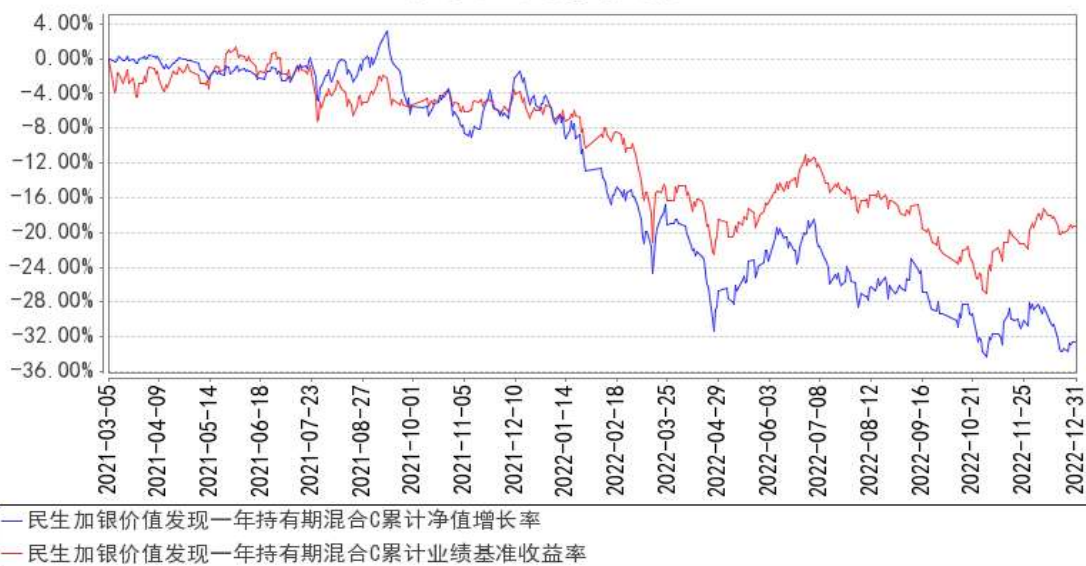
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+恒生综合指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合指数收益率×20%。

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

民生加银价值发现一年持有期混合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



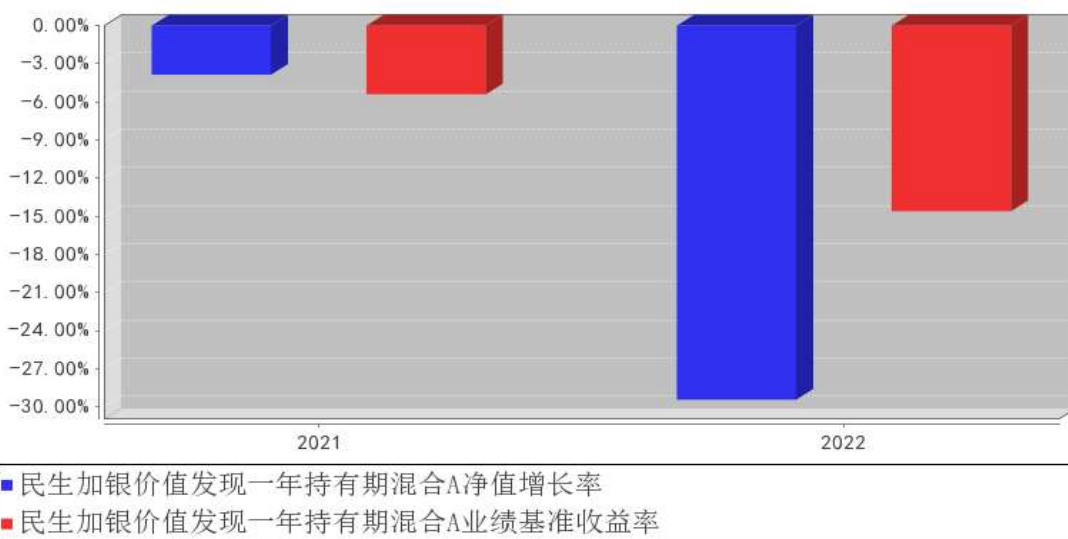
民生加银价值发现一年持有期混合C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



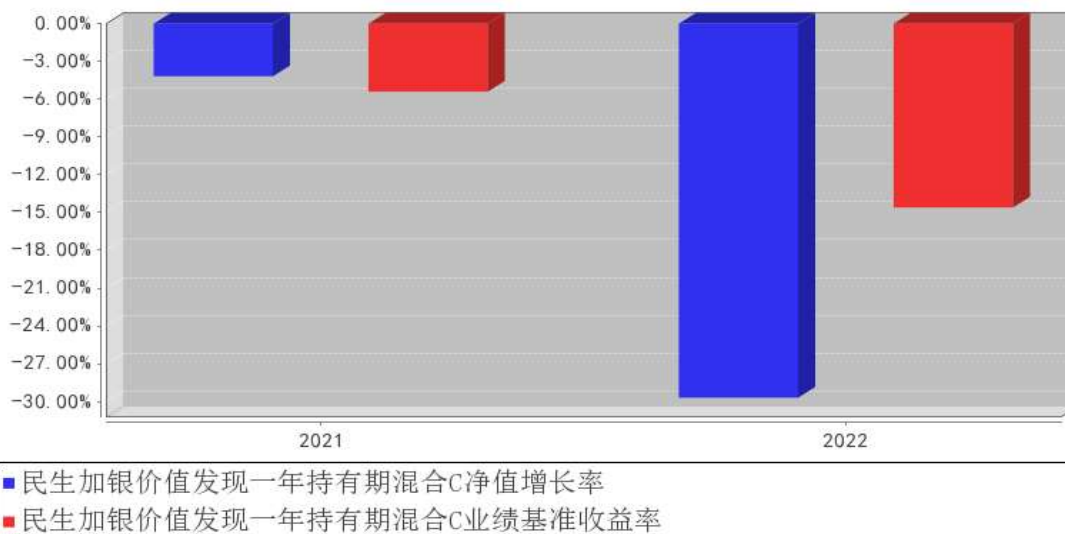
注：本基金合同于2021年03月05日生效。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

民生加银价值发现一年持有期混合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



民生加银价值发现一年持有期混合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2021年3月5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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自2021年03月05日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

§ 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	2021 年 3 月 5 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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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内的公平交易程序，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有所回撤。

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延续下去。海外局势的动荡对于国内经济和资本市场在今年以来不断产生冲击。“俄乌冲突”导致全球风险提升，推高大宗商品价格。进而抬高国内中下游制造业企业成本，压缩其利润。此外，发达国家高通胀带来的激进加息也在全球资本市场，包括中国资本市场上产生阶段性冲击。

受此影响，全年仅反映能源价格高升的煤炭板块获得较好收益，绝大部分板块均出现下跌。

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价值发现一年持有期混合 A 的基金份额净值为 0.6785 元，本报告期基金份额净值增长率为-29.43%，同期业绩比较基准收益率为-14.60%；截至本报告期末民生加银价值发现一年持有期混合 C 的基金份额净值为 0.6736 元，本报告期基金份额净值增长率为-29.70%，同期业绩比较基准收益率为-14.60%。

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。而就稳增长政策来看，2022 年无论是房地产还是其他产业均出台了不同程度的支持性政策。但是也都不同程度受制于疫情无法正常展开。进入 2023 年，这些政策的细则如何落地，发力点更多在哪些领域也同样有待观察。

因此，整体来看，2023 年经济增长恢复，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托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本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	毕马威华振审字第 2301402 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	民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“民生加银价值发现一年持有期混合”基金）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、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，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了民生加银价值发现一年持有期混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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

	<p>银价值发现一年持有期混合基金，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>民生加银价值发现一年持有期混合基金管理人民生加银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括民生加银价值发现一年持有期混合基金 2022 年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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估民生加银价值发现一年持有期混合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，除非民生加银价值发现一年持有期混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督民生加银价值发现一年持有期混合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</p>

	<p>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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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，就可能导致对民生加银价值发现一年持有期混合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价值发现一年持有期混合基金不能持续经营。</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>我们与基金管理人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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶云晖	吴巧莉
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：民生加银价值发现一年持有期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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	30,668,538.22	80,761,735.91
结算备付金		1,494,433.77	70,881,702.66
存出保证金		237,965.47	176,363.39
交易性金融资产	7.4.7.2	499,286,755.19	753,727,676.39
其中：股票投资		493,817,414.75	753,727,676.39
基金投资		-	-
债券投资		5,469,340.44	-
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		3,543.51	13,429.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	15,534.40
资产总计		531,691,236.16	905,576,442.58
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		74,158.59	978.46
应付赎回款		707,483.31	-
应付管理人报酬		694,970.38	1,148,534.53
应付托管费		115,828.40	191,422.44
应付销售服务费		12,224.91	26,729.08
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	892,389.11	540,585.07
负债合计		2,497,054.70	1,908,249.58
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	780,316,897.16	940,222,233.53
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-251,122,715.70	-36,554,040.53
净资产合计		529,194,181.46	903,668,193.00
负债和净资产总计		531,691,236.16	905,576,442.58

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 780,316,897.16 份，其中民生加银价值发现一年持有期混合 A 的基金份额净值为 0.6785 元，份额总额为 728,342,695.28 份；其中民

生加银价值发现一年持有期混合 C 的基金份额净值为 0.6736 元，份额总额为 51,974,201.88 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：民生加银价值发现一年持有期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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 5 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-240,734,750.82	-20,083,744.40
1. 利息收入		297,870.34	1,453,754.40
其中：存款利息收入	7.4.7.13	297,870.34	1,305,681.47
债券利息收入		-	586.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	147,486.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-212,348,117.10	-43,780,853.05
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-225,098,829.55	-49,526,392.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	279,165.24	609,943.53
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
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	12,471,547.21	5,135,596.05
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	-28,684,504.06	22,243,354.25
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	-	-
减：二、营业总支出		11,883,919.47	16,285,235.65
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,864,881.65	11,334,937.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,644,146.93	1,889,156.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	191,620.24	261,844.32
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		1.06	2.08
8. 其他费用	7.4.7.23	183,269.59	2,799,295.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-252,618,670.29	-36,368,980.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-252,618,670.29	-36,368,980.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-252,618,670.29	-36,368,980.05

注：(1)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。

(2)本基金合同生效日为2021年3月5日，上年度可比期间为2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银价值发现一年持有期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（基金净值）	940,222,233.53	-	-36,554,040.53	903,668,193.00
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）	940,222,233.53	-	-36,554,040.53	903,668,193.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-159,905,336.37	-	-214,568,675.17	-374,474,011.54
（一）、综合收益总额	-	-	-252,618,670.29	-252,618,670.29
（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）	-159,905,336.37	-	38,049,995.12	-121,855,341.25
其中：1. 基金申购款	4,840,840.60	-	-1,097,788.64	3,743,051.96
2. 基金赎回款	-164,746,176.97	-	39,147,783.76	-125,598,393.21
（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、本期期末净资产(基金净值)	780,316,897.16	-	-251,122,715.70	529,194,181.46
项目	上年度可比期间			
	2021年3月5日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
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)	936,069,535.15	-	-	936,069,535.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,152,698.38	-	-36,554,040.53	-32,401,342.15
(一)、综合收益总额	-	-	-36,368,980.05	-36,368,980.05
(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)	4,152,698.38	-	-185,060.48	3,967,637.90

其中：1. 基金申购款	4,152,698.38	-	-185,060.48	3,967,637.90
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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）	940,222,233.53	-	-36,554,040.53	903,668,193.00

注：本基金合同生效日为 2021 年 3 月 5 日，上年度可比期间为 2021 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

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

王国栋

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）《关于准予民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可 [2020] 2975 号文）核准，由民生加银基金管理有限公司依照国家相关法律法规的规定、《民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《民生加银价值发

现一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告》的规定发售，基金合同于 2021 年 3 月 5 日生效。本基金为契约型开放式、最短持有期为一年的单笔锁定持续运作，存续期限不定，首次设立募集规模为 936,069,535.15 份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司（以下简称“民生加银基金公司”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准或注册发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券））、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产的比例为基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 \times 60% + 恒生综合指数收益率（使用估值汇率折算） \times 20% + 中债综合指数收益率 \times 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基

金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产

在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a) 初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产

或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式为：现金分红；

(c) 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；

(d) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 80,761,735.91 元、人民币 70,881,702.66 元、人民币 176,363.39 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 15,534.40 元、人民币 0.00 元、人民币 13,429.83 元和人民币 0.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资、应收清算款、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 80,774,950.00 元、人民币 70,883,935.63 元、人民币 176,450.73 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 0.00 元、人民币 13,429.83 元和人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 753,727,676.39 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 753,727,676.39 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 0.00 元、人民币 978.46 元、人

人民币 0.00 元、人民币 1,148,534.53 元、人民币 191,422.44 元、人民币 26,729.08 元、人民币 506,085.07 元、人民币 0.00 元和人民币 34,500.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 0.00 元、人民币 978.46 元、人民币 0.00 元、人民币 1,148,534.53 元、人民币 191,422.44 元、人民币 26,729.08 元和人民币 540,585.07 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金和交易性金融资产等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金和交易性金融资产等科目项下列示，无期初留存收益影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于

租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴

20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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	30,668,538.22	80,761,735.91
等于：本金	30,663,915.13	80,761,735.91
加：应计利息	4,623.09	-
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	30,668,538.22	80,761,735.91

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	500,254,869.56	-	493,817,414.75	-6,437,454.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	72,040.44	5,469,340.44	-3,695.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	72,040.44	5,469,340.44	-3,695.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	505,655,864.56	72,040.44	499,286,755.19	-6,441,149.81
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	731,484,322.14	-	753,727,676.39	22,243,354.25
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	731,484,322.14	-	753,727,676.39	22,243,354.25

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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何债权投资。

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	-	15,534.40
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	15,534.40

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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	727,889.11	506,085.07
其中：交易所市场	727,889.11	506,085.07
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	30,000.00
预提信息披露费	120,000.00	-
预提银行间账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	892,389.11	540,585.07

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银价值发现一年持有期混合 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	857,894,459.31	857,894,459.31
本期申购	1,981,760.93	1,981,760.93
本期赎回（以“-”号填列）	-131,533,524.96	-131,533,524.96
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	728,342,695.28	728,342,695.28

民生加银价值发现一年持有期混合 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	82,327,774.22	82,327,774.22
本期申购	2,859,079.67	2,859,079.67
本期赎回（以“-”号填列）	-33,212,652.01	-33,212,652.01
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	51,974,201.88	51,974,201.88

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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

民生加银价值发现一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-53,354,164.18	20,238,644.54	-33,115,519.64
本期利润	-206,628,799.74	-25,572,491.10	-232,201,290.84
本期基金份额交易产生的变动数	27,317,474.69	3,842,617.18	31,160,091.87
其中：基金申购款	-390,034.66	-49,637.80	-439,672.46
基金赎回款	27,707,509.35	3,892,254.98	31,599,764.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-232,665,489.23	-1,491,229.38	-234,156,718.61

民生加银价值发现一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,374,000.98	1,935,480.09	-3,438,520.89
本期利润	-17,305,366.49	-3,112,012.96	-20,417,379.45
本期基金份额交易产生的变动数	5,823,125.25	1,066,778.00	6,889,903.25
其中：基金申购款	-591,954.82	-66,161.36	-658,116.18
基金赎回款	6,415,080.07	1,132,939.36	7,548,019.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,856,242.22	-109,754.87	-16,965,997.09

7.4.7.13 存款利息收入

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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	248,511.07	1,267,041.41
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	44,448.27	36,612.68
其他	4,911.00	2,027.38
合计	297,870.34	1,305,681.47

注：其他为保证金利息收入和深港通风控资金利息收入。

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3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-225,098,829.55	-49,526,392.63
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	-225,098,829.55	-49,526,392.63

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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,487,659,270.68	711,578,914.36
减：卖出股票成本总额	2,706,165,790.40	761,105,306.99
减：交易费用	6,592,309.83	-
买卖股票差价收入	-225,098,829.55	-49,526,392.63

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资证券出借差价收入。

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3月5日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	51,850.58	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	227,314.66	609,943.53
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	279,165.24	609,943.53

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3月5日（基金合同生效 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	915,653.51	2,336,346.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	688,000.00	1,725,800.00
减：应计利息总额	303.10	603.41
减：交易费用	35.75	-
买卖债券差价收入	227,314.66	609,943.53

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,471,547.21	5,135,596.05
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	12,471,547.21	5,135,596.05

7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-28,684,504.06	22,243,354.25
股票投资	-28,680,809.06	22,243,354.25
债券投资	-3,695.00	-
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	-28,684,504.06	22,243,354.25

7.4.7.21 其他收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

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3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	40,000.00	30,000.00

信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,673.89	15,295.50
债券账户维护费	18,000.00	13,500.00
其他费用	-	400.00
深港通证券组合费	595.70	-
交易费用	-	2,740,100.31
合计	183,269.59	2,799,295.81

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

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	基金管理人的子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

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3月5日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,864,881.65	11,334,937.19
其中：支付销售机构的客户维护 费	4,744,801.83	5,443,049.80

注：支付基金管理人民生加银基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年3月5日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,644,146.93	1,889,156.25

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

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		
	民生加银价值发现一年 持有期混合 A	民生加银价值发现一年 持有期混合 C	合计
民生加银基金公司	-	176.39	176.39
中国建设银行	-	31,089.28	31,089.28
中国民生银行	-	14,757.81	14,757.81

合计	-	46,023.48	46,023.48
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021年3月5日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银价值发现一年 持有期混合 A	民生加银价值发现一年 持有期混合 C	合计
民生加银基金公司	-	321.99	321.99
中国建设银行	-	35,410.58	35,410.58
中国民生银行	-	16,274.49	16,274.49
合计	-	52,007.06	52,007.06

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

民生加银价值发现一年持有期混合基金 C 日基金销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数

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

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

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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：本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未持有本基金。

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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期内及上年度可比期间均未持有本基金。

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3月5日（基金合同生效日）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	30,668,538.22	248,511.07	80,761,735.91	1,267,041.41

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：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内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	465	26,970.00	40,217.85	-
301115	建科股份	2022年8月23日	6个月	新股流通受限	42.05	24.04	600	25,230.00	14,424.00	-
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	2022年	6个月	新股流	57.00	46.64	414	23,598.00	19,308.96	-

	锂能	8月19日		通受限							
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	642	20,787.96	20,293.62		-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	916	16,652.88	16,231.52		-
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	419	21,318.72	27,737.80		-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	582	19,025.58	51,181.08		-

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	-
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	605	33,680.35	34,315.60	-
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	6个月	新股流 通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-

		23 日									
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	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	206	48,925.00	36,455.82		-
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	121	16,804.48	12,525.92		-
301356	天振股份	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股流通受限	63.00	43.33	405	25,515.00	17,548.65		-
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	2022 年	6 个月	新股流	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-

	科技	11月8日		通受限							
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	169	20,259.72	29,706.82		-
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	1,140	25,650.00	19,562.40		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	238	22,848.00	19,270.86		-
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		-
688152	麒麟信安	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	68.89	130.72	1,189	81,910.21	155,426.08		-
688332	中科蓝讯	2022年7月8日	6个月	新股流通受限	91.66	50.21	3,639	333,550.74	182,714.19		-
688375	国博电子	2022年7月13日	6个月	新股流通受限	70.88	94.20	3,854	273,171.52	363,046.80		-

688391	钜泉科技	2022年9月5日	6个月	新股流通受限	115.00	95.83	1,335	153,525.00	127,933.05	-
688416	恒烁股份	2022年8月22日	6个月	新股流通受限	65.11	37.01	2,147	139,791.17	79,460.47	-
688428	诺诚健华	2022年9月14日	6个月	新股流通受限	11.03	12.83	64,337	709,637.11	825,443.71	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金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：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

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

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

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	5,469,340.44	-
合计	5,469,340.44	-

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

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因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 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，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个
月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为
未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很
大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期
等方法对上述利率风险进行管理。

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

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	30,663,915.13	-	-	-	-	4,623.09	30,668,538.22
结算备付金	1,493,694.35	-	-	-	-	739.42	1,494,433.77
存出保证金	237,847.77	-	-	-	-	117.70	237,965.47
交易性金融资 产	-	-	5,397,300.00	-	-	493,889,455.19	499,286,755.19
应收申购款	-	-	-	-	-	3,543.51	3,543.51
资产总计	32,395,457.25	-	5,397,300.00	-	-	493,898,478.91	531,691,236.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	707,483.31	707,483.31
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	694,970.38	694,970.38
应付托管费	-	-	-	-	-	115,828.40	115,828.40
应付清算款	-	-	-	-	-	74,158.59	74,158.59
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	12,224.91	12,224.91
其他负债	-	-	-	-	-	892,389.11	892,389.11
负债总计	-	-	-	-	-	2,497,054.70	2,497,054.70

利率敏感度缺口	32,395,457.25		-5,397,300.00			-491,401,424.21	529,194,181.46
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	80,761,735.91	-	-	-	-	-	80,761,735.91
结算备付金	70,881,702.66	-	-	-	-	-	70,881,702.66
存出保证金	176,363.39	-	-	-	-	-	176,363.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-753,727,676.39	753,727,676.39
应收申购款	-	-	-	-	-	13,429.83	13,429.83
其他资产	-	-	-	-	-	15,534.40	15,534.40
资产总计	151,819,801.96	-	-	-	-	-753,756,640.62	905,576,442.58
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,148,534.53	1,148,534.53
应付托管费	-	-	-	-	-	191,422.44	191,422.44
应付证券清算款	-	-	-	-	-	978.46	978.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,729.08	26,729.08
其他负债	-	-	-	-	-	540,585.07	540,585.07
负债总计	-	-	-	-	-	1,908,249.58	1,908,249.58
利率敏感度缺口	151,819,801.96	-	-	-	-	-751,848,391.04	903,668,193.00

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. 市场利率下降25个基点	4,205.19	-
	2. 市场利率上升25个基点	-4,198.41	-

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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	493,817,414.75	93.31	753,727,676.39	83.41
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	493,817,414.75	93.31	753,727,676.39	83.41

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	26,785,122.45	27,850,562.18

	基准上升 5%		
	2. 本基金业绩比较 基准下降 5%	-26,785,122.45	-27,850,562.18

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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	491,143,307.66	749,500,219.41
第二层次	8,143,447.53	4,227,456.98
第三层次	-	-
合计	499,286,755.19	753,727,676.39

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

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：于本报告期间，本基金无第三层公允价值余额及变动情况。

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31

日：无)。

7.4.14.4 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表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	493,817,414.75	92.88
	其中：股票	493,817,414.75	92.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,469,340.44	1.03
	其中：债券	5,469,340.44	1.03
	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	32,162,971.99	6.05
8	其他各项资产	241,508.98	0.05
9	合计	531,691,236.16	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 3,470,782.72 元，占基金资产净值比例 0.66%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	171,428,507.90	32.39
D	电力、热力、燃气及水生产和	11,330.55	0.00

	供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	54,440,955.74	10.29
G	交通运输、仓储和邮政业	10,294,218.00	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	954,335.54	0.18
J	金融业	103,897,704.83	19.63
K	房地产业	94,297,534.32	17.82
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	28,001,702.87	5.29
N	水利、环境和公共设施管理业	164,183.84	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	26,826,960.44	5.07
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	490,346,632.03	92.66

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	3,470,782.72	0.66
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	3,470,782.72	0.66

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600153	建发股份	2,131,600	29,096,340.00	5.50
2	601567	三星医疗	2,113,300	28,487,284.00	5.38
3	603259	药明康德	339,680	27,514,080.00	5.20
4	603338	浙江鼎力	571,796	27,360,438.60	5.17

5	600048	保利发展	1,799,100	27,220,383.00	5.14
6	000516	国际医学	2,184,900	26,743,176.00	5.05
7	300760	迈瑞医疗	83,800	26,478,286.00	5.00
8	001979	招商蛇口	2,035,400	25,707,102.00	4.86
9	600383	金地集团	2,134,200	21,832,866.00	4.13
10	601456	国联证券	1,924,500	21,650,625.00	4.09
11	600325	华发股份	2,156,422	19,537,183.32	3.69
12	300122	智飞生物	205,800	18,075,414.00	3.42
13	300033	同花顺	176,800	17,434,248.00	3.29
14	600435	北方导航	1,479,400	17,161,040.00	3.24
15	300059	东方财富	789,220	15,310,868.00	2.89
16	603939	益丰药房	229,900	14,676,816.00	2.77
17	600030	中信证券	717,900	14,293,389.00	2.70
18	000935	四川双马	674,444	14,163,324.00	2.68
19	601066	中信建投	552,000	13,110,000.00	2.48
20	000776	广发证券	782,100	12,114,729.00	2.29
21	603883	老百姓	261,507	10,583,188.29	2.00
22	601878	浙商证券	995,200	9,882,336.00	1.87
23	002648	卫星化学	592,034	9,176,527.00	1.73
24	002917	金奥博	588,100	7,157,177.00	1.35
25	002352	顺丰控股	90,500	5,227,280.00	0.99
26	600009	上海机场	87,800	5,066,938.00	0.96
27	688383	新益昌	51,176	4,855,578.88	0.92
28	603833	欧派家居	31,600	3,840,348.00	0.73
29	02150	奈雪的茶	516,000	3,470,782.72	0.66
30	000519	中兵红箭	117,000	2,297,880.00	0.43
31	688303	大全能源	21,463	1,023,355.84	0.19
32	688428	诺诚健华	64,337	825,443.71	0.16
33	002475	立讯精密	19,200	609,600.00	0.12
34	300604	长川科技	11,900	530,502.00	0.10
35	002487	大金重工	11,800	488,166.00	0.09
36	603486	科沃斯	5,828	425,094.32	0.08
37	688439	振华风光	3,453	410,492.64	0.08
38	688392	骄成超声	2,745	397,228.95	0.08
39	300776	帝尔激光	2,980	375,480.00	0.07
40	688375	国博电子	3,854	363,046.80	0.07
41	301367	怡和嘉业	1,682	361,916.23	0.07
42	301301	川宁生物	35,740	314,797.92	0.06
43	688046	药康生物	12,070	290,283.50	0.05
44	688711	宏微科技	2,611	242,300.80	0.05
45	301165	锐捷网络	6,418	217,312.98	0.04
46	688489	三未信安	1,995	202,153.35	0.04
47	301391	卡莱特	2,372	201,727.86	0.04

48	688332	中科蓝讯	3,639	182,714.19	0.03
49	301356	天振股份	4,047	182,604.09	0.03
50	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.03
51	688206	概伦电子	6,000	168,720.00	0.03
52	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.03
53	688152	麒麟信安	1,189	155,426.08	0.03
54	688459	哈铁科技	16,884	152,969.04	0.03
55	301223	中荣股份	8,148	152,636.35	0.03
56	301377	鼎泰高科	7,695	149,789.85	0.03
57	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.03
58	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.03
59	688426	康为世纪	3,776	133,821.44	0.03
60	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.02
61	301365	矩阵股份	5,160	129,624.36	0.02
62	688391	钜泉科技	1,335	127,933.05	0.02
63	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.02
64	688410	山外山	4,853	122,635.31	0.02
65	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.02
66	688247	宣泰医药	7,155	119,846.25	0.02
67	688132	邦彦技术	4,844	118,193.60	0.02
68	688376	美埃科技	3,713	116,142.64	0.02
69	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.02
70	688257	新锐股份	2,899	113,292.92	0.02
71	688291	金橙子	3,961	103,619.76	0.02
72	301265	华新环保	8,181	99,226.62	0.02
73	688420	美腾科技	2,408	98,294.56	0.02
74	603218	日月股份	4,605	93,481.50	0.02
75	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.02
76	688203	海正生材	5,761	90,159.65	0.02
77	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.02
78	688416	恒烁股份	2,147	79,460.47	0.02
79	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.01
80	688163	赛伦生物	3,607	76,071.63	0.01
81	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.01
82	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.01
83	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
84	301388	欣灵电气	2,920	67,802.40	0.01
85	688722	同益中	3,687	66,587.22	0.01
86	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.01
87	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.01
88	301269	华大九天	582	51,181.08	0.01
89	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.01
90	301238	瑞泰新材	1,937	43,563.13	0.01

91	301153	中科江南	398	42,363.12	0.01
92	301095	广立微	465	40,217.85	0.01
93	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
94	301266	宇邦新材	517	39,085.20	0.01
95	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
96	301327	华宝新能	206	36,455.82	0.01
97	301029	怡合达	554	36,419.96	0.01
98	301308	江波龙	605	34,315.60	0.01
99	301211	亨迪药业	967	33,506.55	0.01
100	301268	铭利达	641	32,184.61	0.01
101	301236	软通动力	913	32,119.34	0.01
102	301217	铜冠铜箔	2,582	31,990.98	0.01
103	301302	华如科技	466	29,837.98	0.01
104	301162	国能日新	334	29,331.88	0.01
105	301267	华夏眼科	419	27,737.80	0.01
106	301177	迪阿股份	423	26,640.54	0.01
107	301087	可孚医疗	712	25,973.76	0.00
108	002594	比亚迪	100	25,697.00	0.00
109	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
110	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
111	301168	通灵股份	329	23,809.73	0.00
112	301102	兆讯传媒	642	23,593.50	0.00
113	301101	明月镜片	371	23,380.42	0.00
114	301263	泰恩康	682	22,165.00	0.00
115	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.00
116	603255	鼎际得	488	21,911.20	0.00
117	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
118	301206	三元生物	556	21,684.00	0.00
119	301109	军信股份	1,369	21,657.58	0.00
120	301117	佳缘科技	262	20,776.60	0.00
121	301216	万凯新材	705	20,219.40	0.00
122	301200	大族数控	514	20,148.80	0.00
123	301389	隆扬电子	1,140	19,562.40	0.00
124	301152	天力锂能	414	19,308.96	0.00
125	301120	新特电气	1,032	19,205.52	0.00
126	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
127	688122	西部超导	200	18,938.00	0.00
128	301096	百诚医药	272	18,580.32	0.00
129	301201	诚达药业	353	17,932.40	0.00
130	301150	中一科技	265	17,095.15	0.00
131	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
132	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
133	301256	华融化学	1,831	16,332.52	0.00

134	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
135	301171	易点天下	916	16,231.52	0.00
136	603211	晋拓股份	1,287	16,164.72	0.00
137	301127	天源环保	1,685	16,091.75	0.00
138	301103	何氏眼科	507	15,980.64	0.00
139	301089	拓新药业	220	15,840.00	0.00
140	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
141	301219	腾远钴业	223	15,371.39	0.00
142	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
143	603237	五芳斋	325	15,323.75	0.00
144	301235	华康医疗	418	14,951.86	0.00
145	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.00
146	301187	欧圣电气	876	14,821.92	0.00
147	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
148	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
149	301115	建科股份	600	14,424.00	0.00
150	301248	杰创智能	472	14,386.56	0.00
151	001298	好上好	403	14,379.04	0.00
152	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
153	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
154	301097	天益医疗	249	14,063.52	0.00
155	301212	联盛化学	416	13,823.68	0.00
156	301100	风光股份	599	13,273.84	0.00
157	300834	星辉环材	521	12,941.64	0.00
158	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
159	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
160	301349	信德新材	121	12,525.92	0.00
161	301189	奥尼电子	435	12,432.30	0.00
162	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
163	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
164	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
165	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
166	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
167	301151	冠龙节能	703	11,958.03	0.00
168	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
169	301258	富士莱	295	11,578.75	0.00
170	301166	优宁维	253	11,569.69	0.00
171	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
172	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
173	301179	泽宇智能	295	11,260.15	0.00
174	301148	嘉戎技术	516	11,150.76	0.00
175	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
176	301221	光庭信息	280	10,894.80	0.00

177	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
178	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
179	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
180	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
181	301180	万祥科技	654	10,758.30	0.00
182	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
183	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
184	301190	善水科技	575	10,338.50	0.00
185	301030	仕净科技	242	10,093.82	0.00
186	301116	益客食品	577	9,860.93	0.00
187	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
188	301126	达嘉维康	662	9,857.18	0.00
189	301193	家联科技	297	9,833.67	0.00
190	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
191	002460	赣锋锂业	140	9,731.40	0.00
192	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
193	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
194	301298	东利机械	634	9,605.10	0.00
195	301108	洁雅股份	280	9,452.80	0.00
196	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
197	301181	标榜股份	257	9,190.32	0.00
198	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
199	301259	艾布鲁	483	9,177.00	0.00
200	301196	唯科科技	271	9,100.18	0.00
201	301185	鸥玛软件	578	8,797.16	0.00
202	301092	争光股份	323	8,701.62	0.00
203	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
204	301137	哈焊华通	644	8,571.64	0.00
205	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
206	301222	浙江恒威	332	8,373.04	0.00
207	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
208	301198	喜悦智行	340	8,241.60	0.00
209	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
210	301199	迈赫股份	402	8,003.82	0.00
211	301125	腾亚精工	327	7,877.43	0.00
212	301135	瑞德智能	338	7,740.20	0.00
213	301237	和顺科技	261	7,707.33	0.00
214	301110	青木股份	202	7,647.72	0.00
215	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
216	301288	清研环境	452	7,525.80	0.00
217	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
218	301111	粤万年青	379	7,435.98	0.00
219	301163	宏德股份	277	7,282.33	0.00

220	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
221	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
222	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
223	301130	西点药业	237	6,842.19	0.00
224	301138	华研精机	285	6,774.45	0.00
225	001336	楚环科技	274	6,770.54	0.00
226	301279	金道科技	296	6,517.92	0.00
227	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
228	301158	德石股份	379	6,007.15	0.00
229	301133	金钟股份	286	5,988.84	0.00
230	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
231	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
232	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
233	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
234	301182	凯旺科技	294	5,533.08	0.00
235	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
236	301055	张小泉	355	5,403.10	0.00
237	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
238	301038	深水规院	346	5,113.88	0.00
239	301059	金三江	259	4,791.50	0.00
240	301081	严牌股份	403	4,650.62	0.00
241	301040	中环海陆	241	4,607.92	0.00
242	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
243	301057	汇隆新材	218	4,388.34	0.00
244	301056	森赫股份	572	4,352.92	0.00
245	301049	超越科技	196	4,129.72	0.00
246	301041	金百泽	215	4,112.95	0.00
247	301062	上海艾录	523	4,079.40	0.00
248	301027	华蓝集团	286	3,861.00	0.00
249	301072	中捷精工	181	3,710.50	0.00
250	301037	保立佳	212	3,406.84	0.00
251	301053	远信工业	155	3,144.95	0.00
252	300854	中兰环保	203	3,101.84	0.00
253	300748	金力永磁	100	2,926.00	0.00
254	301079	邵阳液压	140	2,563.40	0.00
255	000301	东方盛虹	27	352.08	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	72,786,206.90	8.05
2	300122	智飞生物	62,235,875.11	6.89

3	603259	药明康德	59,607,290.08	6.60
4	002244	滨江集团	55,437,971.00	6.13
5	002241	歌尔股份	52,767,651.12	5.84
6	000933	神火股份	52,207,559.06	5.78
7	600188	兖矿能源	50,696,538.61	5.61
8	603392	万泰生物	49,983,386.45	5.53
9	600383	金地集团	48,993,339.83	5.42
10	603338	浙江鼎力	48,532,303.96	5.37
11	000983	山西焦煤	48,135,493.22	5.33
12	600309	万华化学	46,854,043.54	5.18
13	603486	科沃斯	46,122,197.00	5.10
14	601666	平煤股份	45,272,019.59	5.01
15	600426	华鲁恒升	40,834,207.50	4.52
16	603520	司太立	39,185,290.00	4.34
17	300760	迈瑞医疗	37,354,706.00	4.13
18	002821	凯莱英	36,366,789.74	4.02
19	000002	万 科 A	35,951,529.00	3.98
20	002142	宁波银行	35,439,298.22	3.92
21	600919	江苏银行	34,536,054.44	3.82
22	600048	保利发展	34,365,607.99	3.80
23	601567	三星医疗	34,015,409.26	3.76
24	603816	顾家家居	33,324,603.04	3.69
25	600546	山煤国际	33,247,252.56	3.68
26	600256	广汇能源	32,809,870.27	3.63
27	002475	立讯精密	32,658,120.71	3.61
28	603833	欧派家居	32,134,310.09	3.56
29	002384	东山精密	31,305,437.22	3.46
30	601857	中国石油	29,832,930.00	3.30
31	001979	招商蛇口	29,575,042.28	3.27
32	000516	国际医学	28,719,685.00	3.18
33	300450	先导智能	28,037,068.51	3.10
34	601288	农业银行	28,024,197.00	3.10
35	600153	建发股份	26,341,393.54	2.91
36	603345	安井食品	26,173,412.82	2.90
37	002532	天山铝业	25,368,553.00	2.81
38	601456	国联证券	25,251,819.33	2.79
39	600900	长江电力	25,192,253.47	2.79
40	002353	杰瑞股份	24,516,697.50	2.71
41	601398	工商银行	24,475,294.00	2.71
42	601658	邮储银行	24,196,849.00	2.68
43	600276	恒瑞医药	24,029,991.39	2.66
44	300776	帝尔激光	23,984,651.45	2.65
45	000333	美的集团	23,791,732.00	2.63

46	002507	涪陵榨菜	23,494,899.00	2.60
47	000807	云铝股份	23,362,980.96	2.59
48	600325	华发股份	23,099,501.46	2.56
49	300033	同花顺	22,878,596.00	2.53
50	002385	大北农	22,673,296.78	2.51
51	601328	交通银行	21,714,661.38	2.40
52	603501	韦尔股份	21,283,036.80	2.36
53	601985	中国核电	20,949,220.00	2.32
54	000786	北新建材	20,237,000.00	2.24
55	000935	四川双马	19,839,452.43	2.20
56	600435	北方导航	18,416,431.00	2.04

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	88,271,706.08	9.77
2	600309	万华化学	83,315,977.11	9.22
3	603833	欧派家居	80,587,378.31	8.92
4	002244	滨江集团	66,064,487.51	7.31
5	300450	先导智能	63,479,669.91	7.02
6	300122	智飞生物	62,274,803.61	6.89
7	002142	宁波银行	61,277,056.54	6.78
8	603816	顾家家居	60,059,051.15	6.65
9	600188	兖矿能源	58,388,440.00	6.46
10	603259	药明康德	55,856,858.80	6.18
11	000933	神火股份	55,688,692.52	6.16
12	601155	新城控股	55,256,604.40	6.11
13	603338	浙江鼎力	52,250,831.09	5.78
14	000983	山西焦煤	51,022,880.23	5.65
15	002532	天山铝业	50,506,319.44	5.59
16	603392	万泰生物	49,687,506.76	5.50
17	601666	平煤股份	45,377,824.50	5.02
18	002241	歌尔股份	43,922,051.36	4.86
19	600546	山煤国际	42,560,301.00	4.71
20	002648	卫星化学	39,599,243.51	4.38
21	603486	科沃斯	38,460,297.17	4.26
22	000807	云铝股份	38,112,459.86	4.22
23	600426	华鲁恒升	37,572,140.05	4.16
24	002384	东山精密	37,413,317.53	4.14
25	603501	韦尔股份	35,057,198.44	3.88

26	600256	广汇能源	34,877,633.10	3.86
27	600919	江苏银行	34,387,487.08	3.81
28	000661	长春高新	33,814,831.33	3.74
29	603520	司太立	33,791,590.57	3.74
30	600570	恒生电子	31,415,847.33	3.48
31	002475	立讯精密	31,033,172.04	3.43
32	600438	通威股份	29,892,781.78	3.31
33	000002	万科 A	29,799,227.00	3.30
34	601288	农业银行	28,094,878.00	3.11
35	603345	安井食品	28,061,465.76	3.11
36	600900	长江电力	26,513,334.00	2.93
37	600276	恒瑞医药	26,266,021.36	2.91
38	601857	中国石油	26,076,784.00	2.89
39	601398	工商银行	24,807,934.00	2.75
40	002821	凯莱英	24,592,910.52	2.72
41	601658	邮储银行	23,421,743.00	2.59
42	600036	招商银行	22,039,055.00	2.44
43	601328	交通银行	21,790,049.84	2.41
44	002353	杰瑞股份	21,746,133.10	2.41
45	000333	美的集团	21,066,625.56	2.33
46	002507	涪陵榨菜	20,972,227.83	2.32
47	01999	敏华控股	20,763,548.14	2.30
48	002385	大北农	20,230,473.90	2.24
49	601985	中国核电	19,443,012.00	2.15
50	00175	吉利汽车	19,139,307.86	2.12

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	2,474,936,337.82
卖出股票收入（成交）总额	2,487,659,270.68

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	5,469,340.44	1.03
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	5,469,340.44	1.03

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	54,000	5,469,340.44	1.03

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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	237,965.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,543.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	241,508.98

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
民生加银 价值发现 一年持有 期混合 A	8,094	89,985.51	14,147,277.45	1.94	714,195,417.83	98.06
民生加银 价值发现 一年持有 期混合 C	7,351	7,070.36	-	-	51,974,201.88	100.00
合计	15,445	50,522.30	14,147,277.45	1.81	766,169,619.71	98.19

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	民生加银价值发现一年持有期 混合 A	149,370.10	0.0205
	民生加银价值发现一年持有期 混合 C	121,260.01	0.2333
	合计	270,630.11	0.0347

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、 基金投资和部门负 责人持有本开放式基金	民生加银价值发现一年持有 期混合 A	0
	民生加银价值发现一年持有 期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	民生加银价值发现一年持有 期混合 A	0
	民生加银价值发现一年持有 期混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银价值发现一年持有期混合 A	民生加银价值发现一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021年3月5)	855,262,125.05	80,807,410.10

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	857,894,459.31	82,327,774.22
本报告期基金总申购份额	1,981,760.93	2,859,079.67
减: 本报告期基金总赎回份额	131,533,524.96	33,212,652.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	728,342,695.28	51,974,201.88

§ 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。

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

本报告期支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 40,000.00 元人民币。截至本报告期末, 该事务所已向本基金提供 2 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 (%)	
天风证券	2	859,625,086.99	17.49	442,340.60	12.57	-
开源证券	2	807,964,368.16	16.44	589,354.39	16.75	-
中金公司	2	597,388,990.34	12.15	436,877.48	12.42	-
中泰证券	2	445,505,448.61	9.06	388,821.00	11.05	-
广发证券	1	400,181,493.17	8.14	292,641.53	8.32	-
英大证券	2	324,870,935.65	6.61	237,574.57	6.75	-
国盛证券	2	165,538,230.29	3.37	121,051.25	3.44	-
东方财富证券	1	150,583,715.05	3.06	108,615.99	3.09	-
华泰证券	4	133,409,533	2.71	96,228.24	2.74	-

		. 74				
兴业证券	1	124, 534, 463 . 97	2. 53	107, 147. 19	3. 05	-
华西证券	1	110, 806, 114 . 01	2. 25	81, 034. 55	2. 30	-
东兴证券	1	109, 462, 336 . 37	2. 23	78, 526. 42	2. 23	-
中信建投	4	107, 991, 941 . 69	2. 20	78, 670. 17	2. 24	-
浙商证券	2	101, 803, 814 . 86	2. 07	74, 454. 04	2. 12	-
民生证券	1	96, 502, 028. 89	1. 96	89, 872. 89	2. 55	-
海通证券	1	93, 303, 580. 01	1. 90	86, 895. 16	2. 47	-
招商证券	1	92, 281, 300. 98	1. 88	66, 086. 75	1. 88	-
东北证券	4	77, 940, 276. 40	1. 59	56, 998. 65	1. 62	-
信达证券	2	62, 836, 654. 39	1. 28	45, 957. 88	1. 31	-
申万宏源	2	22, 470, 393. 70	0. 46	16, 432. 98	0. 47	-
长江证券	1	12, 911, 256. 76	0. 26	9, 039. 64	0. 26	-
中信证券	3	12, 532, 081. 42	0. 25	9, 165. 42	0. 26	-
申港证券	1	5, 478, 991. 0 0	0. 11	3, 951. 77	0. 11	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	5,400,995.00	85.50	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证	-	-	-	-	-	-

券						
海通证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	915,653.51	14.50	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证	-	-	-	-	-	-

券						
平安证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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交易单元一个；退租渤海证券交易单元一个。

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
2	民生加银价值发现一年持有期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
3	民生加银价值发现一年持有期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 3 月 4 日
4	民生加银价值发现一年持有期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 3 月 4 日
5	民生加银价值发现一年持有期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 3 月 4 日
6	民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 3 月 4 日
7	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
8	民生加银价值发现一年持有期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
9	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
10	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	中国证监会规定媒介	2022 年 4 月 22 日

	公告		
11	民生加银价值发现一年持有期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
12	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
13	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
14	民生加银价值发现一年持有期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
15	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
16	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2022 年 8 月 30 日
17	民生加银价值发现一年持有期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
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	民生加银价值发现一年持有期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

§ 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) 中国证监会准予基金注册的文件；
- (2) 《民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；

- (3) 《民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金基金合同》;
- (4) 《民生加银价值发现一年持有期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