

# 民生加银精选混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银精选混合型证券投资基金
基金简称	民生加银精选混合
基金主代码	690003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3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	77,108,220.36份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在充分控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，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定增值。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置与行业配置以及自下而上的个股精选相结合的策略，进行积极主动资产管理。 本基金在个股选择上采取自下而上的股票精选策略，通过构建初选股票池、精选股票池，从基本面角度筛选出具有核心竞争力优势企业，并通过估值水平和流动性筛选个股，构建股票投资组合，最后通过风险评估优化股票投资组合。本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
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@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》
登载基金中期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>

基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所
------------	----------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,287,427.86
本期利润	-4,295,557.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0580
本期加权平均净值利润率	-8.81%
本期基金份额净值增长率	-8.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-29,192,292.12
期末可供分配基金份额利润	-0.3786
期末基金资产净值	47,915,928.24
期末基金份额净值	0.621
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-37.90%

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 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

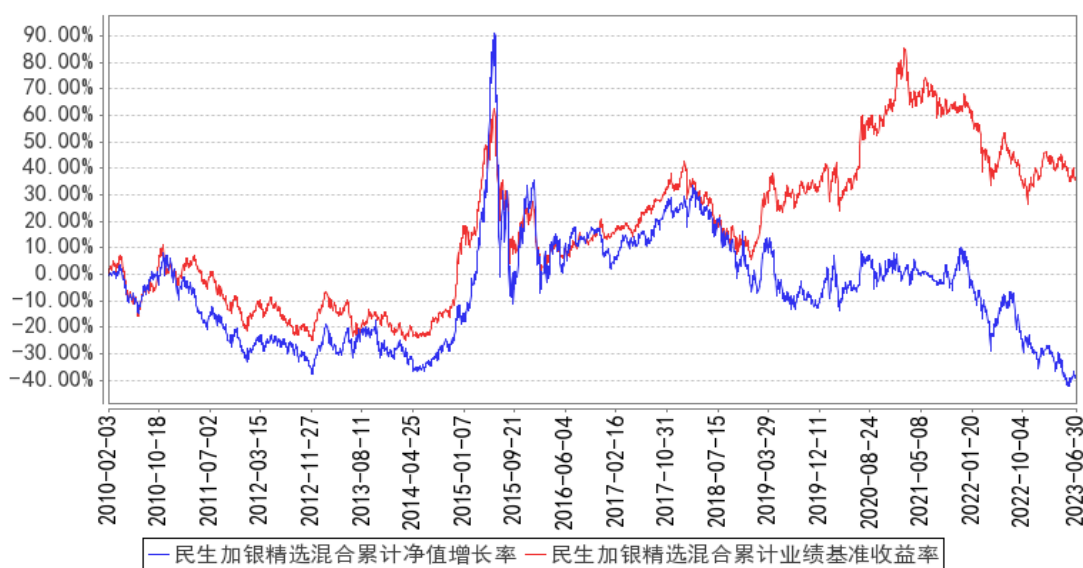
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.16%	1.20%	1.02%	0.70%	2.14%	0.50%
过去三个月	-9.08%	1.61%	-3.84%	0.66%	-5.24%	0.95%

过去六个月	-8.94%	1.41%	-0.11%	0.67%	-8.83%	0.74%
过去一年	-30.61%	1.53%	-10.81%	0.79%	-19.80%	0.74%
过去三年	-35.58%	1.50%	-3.41%	0.96%	-32.17%	0.54%
自基金合同生效起至今	-37.90%	1.58%	36.67%	1.12%	-74.57%	0.46%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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

民生加银精选混合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 2010 年 2 月 3 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。

## § 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：2023 年 6 月 30 日，民生加银基金管理有限公司管理 98 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、民生加银科技创新混合型证券投资基金（LOF）、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、民生加银瑞华绿色债券一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银均衡优选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施名轩	本基金的基金经理	2021 年 9 月 9 日	-	12 年	英国莱斯特大学金融数学硕士，12 年证券从业经历。自 2011 年 10 月至 2012 年 5 月在方正证券股份有限公司研究所任行业研究员；自 2012 年 5 月至 2015 年 3 月在中信建投证券股份有限公司担任策略分析师；自 2015 年 3 月至 2017 年 2 月在兴业证券股份有限公司担任行业分析师；自 2017 年 3 月至 2019 年 1 月在博时基金管理有限公司绝对收益部担任权益投资经理助理。2019 年 7 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任基金经理。自 2021 年 9 月至今担任民生加银精选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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，上证指数涨幅 3.8%，深证指数涨幅 0.1%，创业板跌 5.6%。行业方面，涨幅居前的是通信、传媒、计算机、电子、家电、机械等等，跌幅居前的行业是商贸零售、房地产等。这背后的逻辑第一是科技创新成为 A 股市场的主要驱动力，尤其是在新能源汽车、芯片、云计算、人工智能等领域，涌现出了一批优秀的创新企业，为市场带来了新的增长点和投资机会。其次随着疫情结束，国内外经济逐步恢复，消费者的信心和需求也逐渐回升，消费升级的趋势更加明显。在这个过程中，以医药、家电、食品饮料、文化娱乐等为代表的消费板块表现出了较强的韧性和增长潜力，为经济增长提供了稳定的支撑。本基金整体还是在稳健的基础上，以中游制造业为主要仓位，同时去年年底积极加仓布局 TMT，上半年也主要围绕 AI 和中游制造中寻找机会，同时对于经济复苏较弱的情况，也选择了一些类似弱周期的行业譬如火电来应对。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.621 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.94%，业绩

比较基准收益率为-0.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济方面，上半年的数据来看，例如国内生产总值比去年同期增长 5.5%，社会消费品零售总额同比增长 8.2%，服务业增加值同比增长 6.4%等等都可以看出我国经济运行呈现出的回升向好态势。展望下半年，我国经济逐步摆脱疫情影响，向常态化运行轨道回归，呈现恢复向好态势。全年来看，尽管面临压力和挑战，但随着就业改善、居民收入增加、内需拉动逐步增强、供给结构优化调整、新动能成长壮大，经济将稳步恢复，发展质量将继续提升。但是全球来看，尤其是海外方面，地缘政治冲突加剧贸易摩擦，同时海外高通胀和未来的潜在衰退风险等问题依旧影响全球经济。

证券市场来看，上半年金融改革也取得了重要进展，包括推进注册制改革、完善退市制度、深化资本市场对外开放等。这些改革举措有利于提高市场效率和活力，增强市场吸引力和竞争力，促进市场资源配置和风险防范，为投资者创造了更多的机会和价值。同时目前市场非金融股股债收益差在-2X 标准差其实已经反映了悲观的预期，因此目前反而更多是机会大于风险。

2023 年下半年从投资线索看，景气和复苏依旧是全年脉络，景气回升预期的半导体周期以及 AI 产业支撑下的基本面改善预期强的方向依旧是我们重点关注的方向，景气脉络下，关注新能源车、军工、风光储，军工、高端装备、计算机行业；复苏脉络下，关注保险、消费、地产产业链。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照相关会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人为确保估值工作的合规开展，已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》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。

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

本报告期内本基金存在连续二十个工作日资产净值低于五千万的情形，时间范围是 2023-04-10 至 2023-06-30。

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

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,314,655.86	5,580,573.75
结算备付金		500,172.07	397,822.45
存出保证金		26,336.06	47,068.65
交易性金融资产	6.4.7.2	44,504,162.00	43,982,924.24
其中：股票投资		44,504,162.00	43,982,924.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,114.49	9,654.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		48,348,440.48	50,018,043.69
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		709.60	-
应付赎回款		59,731.26	7,912.48
应付管理人报酬		57,934.51	63,324.00
应付托管费		9,655.71	10,554.01
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.9	304,481.16	281,704.55
负债合计		432,512.24	363,495.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	77,108,220.36	72,859,187.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-29,192,292.12	-23,204,639.16
净资产合计		47,915,928.24	49,654,548.65
负债和净资产总计		48,348,440.48	50,018,043.69

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.621 元，基金份额总额 77,108,220.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,831,251.87	-9,900,004.05
1. 利息收入		10,798.19	12,421.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,798.19	12,421.70
债券利息收入		-	-
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）		-6,837,750.22	-6,903,019.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,994,873.19	-7,236,356.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	157,122.97	333,337.07
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,991,870.84	-3,018,153.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,829.32	8,747.15
<b>减：二、营业总支出</b>		464,305.15	590,392.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	363,298.83	458,513.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,549.74	76,418.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	40, 456. 58	55, 460. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4, 295, 557. 02	-10, 490, 396. 48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4, 295, 557. 02	-10, 490, 396. 48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4, 295, 557. 02	-10, 490, 396. 48

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	72, 859, 187. 81	-	-23, 204, 639. 16	49, 654, 548. 65
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)	72, 859, 187. 81	-	-23, 204, 639. 16	49, 654, 548. 65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4, 249, 032. 55	-	-5, 987, 652. 96	-1, 738, 620. 41
(一)、综合收益总额	-	-	-4, 295, 557. 02	-4, 295, 557. 02

(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)	4,249,032.55	-	-1,692,095.94	2,556,936.61
其中:1. 基金申购款	11,433,986.92	-	-4,181,979.40	7,252,007.52
2 .基金赎回款	-7,184,954.37	-	2,489,883.46	-4,695,070.91
(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)	77,108,220.36	-	-29,192,292.12	47,915,928.24
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净资产(基 金净值)	68,154,120.44	-	3,400,277.22	71,554,397.66



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)	68,154,120.44	-	3,400,277.22	71,554,397.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,269,362.86	-	-10,814,848.04	-8,545,485.18
(一)、综合收益总额	-	-	-10,490,396.48	-10,490,396.48
(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)	2,269,362.86	-	-324,451.56	1,944,911.30
其中:1.基金申购款	9,892,324.13	-	-1,063,586.59	8,828,737.54
2.基金赎回款	-7,622,961.27	-	739,135.03	-6,883,826.24
(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)	70,423,483.30	-	-7,414,570.82	63,008,912.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郑智军</u>	<u>王国栋</u>	<u>洪锐珠</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银精选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”）《关于核准民生加银精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]1323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、《民生加银精选股票型证券投资基金基金合同》、《民生加银精选股票型证券投资基金招募说明书》及《民生加银精选股票型证券投资基金份额发售公告》的规定发售，基金合同于2010年2月3日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为2,475,168,598.16份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司（以下简称“民生加银基金公司”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。经协商取得民生加银精选股票型证券投资基金基金托管人同意，并报中国证监会备案，自2015年8月8日起，本基金管理人旗下“民生加银精选股票型证券投资基金”正式更名为“民生加银精选混合型证券投资基金”。基金更名后，《民生加银精选股票型证券投资基金基金合同》、《民生加银精选股票型证券投资基金托管协议》等法律文件项下的全部权利、义务由民生加银精选混合型证券投资基金承担和继承。

根据中国证监会2017年8月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”），对已经成立的开放式基金，原基金合同内容不符

合该《流动性风险管理规定》的，应当在《流动性风险管理规定》施行之日起 6 个月内修改基金合同并公告。根据《流动性风险管理规定》等法律法规，经与基金托管人协商一致，并报监管机构备案，民生加银基金管理有限公司对本基金的基金合同进行了修改。修改后的基金合同已于 2018 年 3 月 23 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银精选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、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、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。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。本基金各类资产的投资比例为：股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%，其中，权证投资比例占基金资产净值的比例不高于 3%；债券等固定收益类资产占基金资产的 0%-35%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合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 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况、2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	3,314,655.86
等于：本金	3,314,326.05
加：应计利息	329.81
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	3,314,655.86

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	41,912,657.80	-	44,504,162.00	2,591,504.20
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	41,912,657.80	-	44,504,162.00	2,591,504.20

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：无。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金于本期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金于本期末无其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	125.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	264,683.80
其中：交易所市场	264,683.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	24,795.19
合计	304,481.16

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,859,187.81	72,859,187.81
本期申购	11,433,986.92	11,433,986.92
本期赎回（以“-”号填列）	-7,184,954.37	-7,184,954.37
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	77,108,220.36	77,108,220.36

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,812,368.61	-18,392,270.55	-23,204,639.16
本期利润	-7,287,427.86	2,991,870.84	-4,295,557.02
本期基金份额交易产生的变动数	-652,609.22	-1,039,486.72	-1,692,095.94
其中：基金申购款	-1,546,113.96	-2,635,865.44	-4,181,979.40
基金赎回款	893,504.74	1,596,378.72	2,489,883.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,752,405.69	-16,439,886.43	-29,192,292.12

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,468.87
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	3,065.24
其他	264.08
合计	10,798.19

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,994,873.19
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	-6,994,873.19

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	292,222,434.14
减：卖出股票成本总额	298,452,346.79
减：交易费用	764,960.54
买卖股票差价收入	-6,994,873.19

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金于本期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	157,122.97
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	157,122.97

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,991,870.84
股票投资	2,991,870.84
债券投资	-
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	2,991,870.84

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	3,789.84
基金转换费收入	39.48
合计	3,829.32

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	785.00
合计	40,456.58

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司（“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

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	363,298.83	458,513.55
其中：支付销售机构的客户维护费	80,053.00	92,810.21

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,549.74	76,418.88

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：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。

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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,314,655.86	7,468.87	5,673,797.95	10,936.06

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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。

#### 6.4.11 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“6.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险

## ● 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。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 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 2023 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合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。



#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,314,326.05	-	-	-	-	329.81	3,314,655.86
结算备付金	499,947.07	-	-	-	-	225.00	500,172.07
存出保证金	26,324.16	-	-	-	-	11.90	26,336.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	44,504,162.00	44,504,162.00
应收申购款	-	-	-	-	-	3,114.49	3,114.49
资产总计	3,840,597.28	-	-	-	-	44,507,843.20	48,348,440.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	59,731.26	59,731.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	57,934.51	57,934.51
应付托管费	-	-	-	-	-	9,655.71	9,655.71
应付清算款	-	-	-	-	-	709.60	709.60
其他负债	-	-	-	-	-	304,481.16	304,481.16
负债总计	-	-	-	-	-	432,512.24	432,512.24
利率敏感度缺口	3,840,597.28	-	-	-	-	44,075,330.96	47,915,928.24
上年度末 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	5,580,017.22	-	-	-	-	556.53	5,580,573.75
结算备付金	397,625.66	-	-	-	-	196.79	397,822.45
存出保证金	47,045.33	-	-	-	-	23.32	47,068.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	43,982,924.24	43,982,924.24
应收申购款	-	-	-	-	-	9,654.60	9,654.60
资产总计	6,024,688.21	-	-	-	-	43,993,355.48	50,018,043.69

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,912.48	7,912.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,324.00	63,324.00
应付托管费	-	-	-	-	-	10,554.01	10,554.01
其他负债	-	-	-	-	-	281,704.55	281,704.55
负债总计	-	-	-	-	-	363,495.04	363,495.04
利率敏感度缺口	6,024,688.21	-	-	-	-	-43,629,860.44	49,654,548.65

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末所持有的利率敏感性资产账面金额较小，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	44,504,162.00	92.88	43,982,924.24	88.58
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	44,504,162.00	92.88	43,982,924.24	88.58

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	2,166,122.43	2,795,189.72
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-2,166,122.43	-2,795,189.72

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 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。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	44,504,162.00	43,982,924.24
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	44,504,162.00	43,982,924.24

**6.4.14.2.2 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。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2023 年 06 月 30 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。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	44,504,162.00	92.05
	其中：股票	44,504,162.00	92.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,814,827.93	7.89
8	其他各项资产	29,450.55	0.06
9	合计	48,348,440.48	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

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	21,136,982.00	44.11

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,449,900.00	19.72
E	建筑业	2,884,300.00	6.02
F	批发和零售业	1,041,000.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,644,500.00	3.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,237,480.00	15.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,110,000.00	2.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,504,162.00	92.88

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	16,500	4,261,455.00	8.89
2	688111	金山办公	6,000	2,833,320.00	5.91
3	603888	新华网	70,000	2,297,400.00	4.79
4	002475	立讯精密	70,000	2,271,500.00	4.74
5	002230	科大讯飞	31,000	2,106,760.00	4.40
6	600023	浙能电力	400,000	2,028,000.00	4.23
7	688390	固德威	12,000	2,002,320.00	4.18
8	603118	共进股份	150,000	1,993,500.00	4.16
9	000690	宝新能源	280,000	1,965,600.00	4.10
10	300913	兆龙互连	42,030	1,954,395.00	4.08
11	605289	罗曼股份	50,000	1,915,500.00	4.00
12	000600	建投能源	220,000	1,700,600.00	3.55
13	600017	日照港	550,000	1,644,500.00	3.43
14	002669	康达新材	120,000	1,602,000.00	3.34
15	002919	名臣健康	35,000	1,578,500.00	3.29
16	600021	上海电力	130,000	1,400,100.00	2.92
17	002608	江苏国信	180,000	1,362,600.00	2.84

18	688170	德龙激光	30,000	1,343,100.00	2.80
19	601689	拓普集团	15,000	1,210,500.00	2.53
20	000656	金科股份	1,000,000	1,110,000.00	2.32
21	300538	同益股份	60,000	1,041,000.00	2.17
22	002741	光华科技	59,900	1,011,112.00	2.11
23	601991	大唐发电	300,000	993,000.00	2.07
24	300563	神宇股份	60,000	980,400.00	2.05
25	300517	海波重科	70,000	968,800.00	2.02
26	603309	维力医疗	60,000	928,200.00	1.94

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	11,675,132.00	23.51
2	688390	固德威	6,028,978.45	12.14
3	002602	世纪华通	5,651,630.00	11.38
4	002594	比亚迪	4,853,187.00	9.77
5	601633	长城汽车	4,838,822.00	9.74
6	300750	宁德时代	4,641,685.00	9.35
7	301052	果麦文化	4,280,336.00	8.62
8	300474	景嘉微	4,194,792.00	8.45
9	002415	海康威视	3,799,971.00	7.65
10	688032	禾迈股份	3,788,977.57	7.63
11	601138	工业富联	3,713,465.00	7.48
12	603259	药明康德	3,647,116.00	7.34
13	600760	中航沈飞	3,443,492.00	6.93
14	002155	湖南黄金	3,399,885.00	6.85
15	688120	华海清科	2,984,152.39	6.01
16	600703	三安光电	2,832,324.00	5.70
17	300339	润和软件	2,719,440.00	5.48
18	601689	拓普集团	2,705,214.14	5.45
19	002517	恺英网络	2,673,092.00	5.38
20	301227	森鹰窗业	2,636,077.00	5.31
21	000976	ST 华铁	2,569,634.00	5.18
22	688022	瀚川智能	2,566,356.48	5.17
23	601012	隆基绿能	2,562,821.00	5.16
24	300951	博硕科技	2,531,811.00	5.10
25	600017	日照港	2,447,349.00	4.93
26	603255	鼎际得	2,445,990.00	4.93
27	002803	吉宏股份	2,377,488.00	4.79
28	603501	韦尔股份	2,345,761.00	4.72
29	603118	共进股份	2,271,826.24	4.58

30	002741	光华科技	2,226,280.00	4.48
31	300517	海波重科	2,224,329.00	4.48
32	002621	美吉姆	2,218,571.43	4.47
33	002475	立讯精密	2,216,046.00	4.46
34	000600	建投能源	2,214,808.00	4.46
35	002837	英维克	2,199,656.33	4.43
36	300393	中来股份	2,199,329.00	4.43
37	002919	名臣健康	2,177,506.00	4.39
38	605289	罗曼股份	2,171,469.00	4.37
39	603309	维力医疗	2,144,323.00	4.32
40	688410	山外山	2,142,813.10	4.32
41	002236	大华股份	2,135,655.00	4.30
42	603888	新华网	2,133,558.00	4.30
43	600667	太极实业	2,130,672.00	4.29
44	688502	茂莱光学	2,110,540.92	4.25
45	300229	拓尔思	2,107,133.00	4.24
46	688111	金山办公	2,099,066.83	4.23
47	600023	浙能电力	2,067,724.00	4.16
48	300502	新易盛	2,066,185.00	4.16
49	600021	上海电力	2,057,804.00	4.14
50	603825	华扬联众	2,048,029.00	4.12
51	688158	优刻得	2,016,856.89	4.06
52	300913	兆龙互连	2,013,070.80	4.05
53	000690	宝新能源	1,998,965.00	4.03
54	601390	中国中铁	1,989,917.00	4.01
55	688018	乐鑫科技	1,983,176.89	3.99
56	300770	新媒股份	1,980,038.00	3.99
57	688172	燕东微	1,931,261.47	3.89
58	000021	深科技	1,928,085.00	3.88
59	301051	信濠光电	1,922,633.00	3.87
60	300845	捷安高科	1,895,783.00	3.82
61	300428	立中集团	1,885,832.00	3.80
62	002709	天赐材料	1,880,790.82	3.79
63	600588	用友网络	1,863,875.04	3.75
64	300182	捷成股份	1,860,646.00	3.75
65	300707	威唐工业	1,857,350.00	3.74
66	002179	中航光电	1,853,600.14	3.73
67	002985	北摩高科	1,844,192.40	3.71
68	688258	卓易信息	1,814,925.75	3.66
69	300360	炬华科技	1,804,568.00	3.63
70	688088	虹软科技	1,797,541.87	3.62
71	300484	蓝海华腾	1,796,194.00	3.62
72	688147	微导纳米	1,765,569.17	3.56

73	300033	同花顺	1,726,338.00	3.48
74	002995	天地在线	1,716,636.00	3.46
75	600031	三一重工	1,709,002.00	3.44
76	688348	昱能科技	1,700,884.40	3.43
77	000063	中兴通讯	1,700,100.00	3.42
78	300613	富瀚微	1,687,215.00	3.40
79	600900	长江电力	1,660,800.00	3.34
80	300454	深信服	1,655,510.00	3.33
81	001337	四川黄金	1,625,329.49	3.27
82	300563	神宇股份	1,613,988.00	3.25
83	001380	华纬科技	1,605,267.00	3.23
84	300538	同益股份	1,569,347.00	3.16
85	002384	东山精密	1,539,713.00	3.10
86	002230	科大讯飞	1,528,789.00	3.08
87	600528	中铁工业	1,510,008.00	3.04
88	688170	德龙激光	1,503,427.34	3.03
89	600335	国机汽车	1,497,556.00	3.02
90	601100	恒立液压	1,474,484.00	2.97
91	002669	康达新材	1,467,206.00	2.95
92	002011	盾安环境	1,467,084.00	2.95
93	601991	大唐发电	1,454,000.00	2.93
94	601360	三六零	1,444,001.00	2.91
95	600237	铜峰电子	1,432,481.00	2.88
96	600941	中国移动	1,427,408.00	2.87
97	000703	恒逸石化	1,412,720.00	2.85
98	300014	亿纬锂能	1,411,612.00	2.84
99	000858	五粮液	1,410,271.00	2.84
100	300299	富春股份	1,400,517.00	2.82
101	000733	振华科技	1,396,254.00	2.81
102	300491	通合科技	1,391,289.00	2.80
103	300413	芒果超媒	1,379,535.00	2.78
104	600150	中国船舶	1,377,177.00	2.77
105	002122	汇洲智能	1,376,926.00	2.77
106	600660	福耀玻璃	1,347,171.00	2.71
107	688256	寒武纪	1,345,746.89	2.71
108	002608	江苏国信	1,343,278.00	2.71
109	002051	中工国际	1,337,164.00	2.69
110	000615	*ST美谷	1,322,108.00	2.66
111	600536	中国软件	1,310,478.00	2.64
112	300308	中际旭创	1,308,040.00	2.63
113	002174	游族网络	1,296,388.00	2.61
114	002812	恩捷股份	1,289,083.00	2.60
115	002466	天齐锂业	1,276,496.00	2.57



116	000539	粤电力 A	1,264,725.00	2.55
117	300782	卓胜微	1,163,999.00	2.34
118	300593	新雷能	1,134,077.38	2.28
119	600578	京能电力	1,133,240.00	2.28
120	002158	汉钟精机	1,103,687.00	2.22
121	603063	禾望电气	1,096,682.00	2.21
122	600547	山东黄金	1,077,879.78	2.17
123	000656	金科股份	1,070,000.00	2.15
124	002558	巨人网络	1,053,432.00	2.12
125	600859	王府井	1,040,660.65	2.10
126	000975	银泰黄金	1,035,908.00	2.09
127	300980	祥源新材	1,030,942.00	2.08
128	603444	吉比特	1,023,211.00	2.06
129	300418	昆仑万维	1,023,198.00	2.06
130	002955	鸿合科技	999,000.00	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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	11,255,867.26	22.67
2	002602	世纪华通	6,382,911.00	12.85
3	688390	固德威	6,074,265.22	12.23
4	301052	果麦文化	5,158,878.00	10.39
5	601633	长城汽车	4,661,730.00	9.39
6	300750	宁德时代	4,565,289.00	9.19
7	601138	工业富联	4,361,598.45	8.78
8	002594	比亚迪	4,319,774.00	8.70
9	300517	海波重科	4,204,693.30	8.47
10	002179	中航光电	4,007,619.00	8.07
11	002155	湖南黄金	3,651,875.00	7.35
12	300474	景嘉微	3,587,297.92	7.22
13	688111	金山办公	3,543,396.39	7.14
14	603259	药明康德	3,513,322.00	7.08
15	002415	海康威视	3,508,828.00	7.07
16	600760	中航沈飞	3,458,103.00	6.96
17	688032	禾迈股份	3,252,518.70	6.55
18	688348	昱能科技	3,104,213.05	6.25
19	002897	意华股份	3,083,520.27	6.21
20	300776	帝尔激光	2,985,941.60	6.01
21	688120	华海清科	2,939,188.30	5.92

22	000733	振华科技	2,888,428.20	5.82
23	002648	卫星化学	2,851,827.72	5.74
24	600703	三安光电	2,752,813.00	5.54
25	688223	晶科能源	2,681,343.68	5.40
26	300339	润和软件	2,658,462.00	5.35
27	002236	大华股份	2,563,188.00	5.16
28	002517	恺英网络	2,558,586.00	5.15
29	300712	永福股份	2,458,932.00	4.95
30	301227	森鹰窗业	2,436,151.00	4.91
31	601012	隆基绿能	2,426,871.00	4.89
32	688022	瀚川智能	2,425,963.32	4.89
33	603255	鼎际得	2,424,183.40	4.88
34	000976	ST 华铁	2,422,891.99	4.88
35	300951	博硕科技	2,410,525.00	4.85
36	600745	闻泰科技	2,384,999.00	4.80
37	600435	北方导航	2,335,118.00	4.70
38	300724	捷佳伟创	2,328,384.00	4.69
39	002056	横店东磁	2,312,630.00	4.66
40	002803	吉宏股份	2,220,470.00	4.47
41	688410	山外山	2,157,616.68	4.35
42	603501	韦尔股份	2,124,839.60	4.28
43	002621	美吉姆	2,120,772.00	4.27
44	688502	茂莱光学	2,078,552.46	4.19
45	300229	拓尔思	2,070,566.00	4.17
46	600667	太极实业	2,030,900.00	4.09
47	300428	立中集团	2,000,138.00	4.03
48	300707	威唐工业	1,997,581.00	4.02
49	688018	乐鑫科技	1,968,087.82	3.96
50	300393	中来股份	1,959,521.00	3.95
51	603825	华扬联众	1,926,478.00	3.88
52	301051	信濠光电	1,919,239.00	3.87
53	002837	英维克	1,917,556.00	3.86
54	601390	中国中铁	1,881,300.00	3.79
55	300770	新媒股份	1,865,165.00	3.76
56	300502	新易盛	1,863,576.00	3.75
57	300360	炬华科技	1,851,537.00	3.73
58	688147	微导纳米	1,849,465.45	3.72
59	001337	四川黄金	1,802,840.53	3.63
60	300845	捷安高科	1,787,049.00	3.60
61	300182	捷成股份	1,781,462.00	3.59
62	001380	华纬科技	1,757,241.00	3.54
63	000021	深科技	1,725,100.00	3.47
64	002709	天赐材料	1,712,000.00	3.45

65	300484	蓝海华腾	1,693,505.00	3.41
66	300033	同花顺	1,681,108.00	3.39
67	600031	三一重工	1,678,971.00	3.38
68	600900	长江电力	1,664,000.00	3.35
69	000063	中兴通讯	1,661,404.00	3.35
70	002985	北摩高科	1,652,577.00	3.33
71	300454	深信服	1,630,950.00	3.28
72	002046	国机精工	1,623,246.00	3.27
73	600588	用友网络	1,612,731.00	3.25
74	688258	卓易信息	1,600,063.89	3.22
75	002384	东山精密	1,599,638.00	3.22
76	688088	虹软科技	1,593,386.22	3.21
77	600528	中铁工业	1,592,737.00	3.21
78	601689	拓普集团	1,532,257.00	3.09
79	688172	燕东微	1,524,817.78	3.07
80	300613	富瀚微	1,476,508.00	2.97
81	600335	国机汽车	1,468,147.20	2.96
82	600941	中国移动	1,454,436.00	2.93
83	688158	优刻得	1,451,770.83	2.92
84	002995	天地在线	1,446,696.00	2.91
85	601100	恒立液压	1,446,295.00	2.91
86	688256	寒武纪	1,414,215.41	2.85
87	600237	铜峰电子	1,408,085.00	2.84
88	002051	中工国际	1,388,327.52	2.80
89	000703	恒逸石化	1,377,322.05	2.77
90	600660	福耀玻璃	1,371,066.00	2.76
91	300014	亿纬锂能	1,370,037.00	2.76
92	000858	五粮液	1,367,520.00	2.75
93	300413	芒果超媒	1,355,929.00	2.73
94	000539	粤电力A	1,347,876.00	2.71
95	002011	盾安环境	1,335,924.00	2.69
96	300308	中际旭创	1,320,200.00	2.66
97	002919	名臣健康	1,310,547.00	2.64
98	300782	卓胜微	1,310,372.00	2.64
99	600150	中国船舶	1,294,608.00	2.61
100	601360	三六零	1,280,900.00	2.58
101	002122	汇洲智能	1,264,745.00	2.55
102	002812	恩捷股份	1,258,735.00	2.53
103	300299	富春股份	1,249,158.00	2.52
104	300491	通合科技	1,226,210.00	2.47
105	000615	*ST美谷	1,213,938.00	2.44
106	002558	巨人网络	1,200,770.00	2.42
107	002531	天顺风能	1,196,202.00	2.41

108	300418	昆仑万维	1,163,308.00	2.34
109	002174	游族网络	1,159,607.00	2.34
110	300144	宋城演艺	1,154,253.00	2.32
111	600152	维科技术	1,143,333.00	2.30
112	002466	天齐锂业	1,135,503.00	2.29
113	002741	光华科技	1,129,403.00	2.27
114	002409	雅克科技	1,105,015.00	2.23
115	600536	中国软件	1,096,336.00	2.21
116	603063	禾望电气	1,092,596.00	2.20
117	300593	新雷能	1,083,922.20	2.18
118	600578	京能电力	1,080,000.00	2.18
119	002158	汉钟精机	1,049,315.00	2.11
120	000975	银泰黄金	1,035,925.00	2.09
121	300980	祥源新材	1,015,488.00	2.05
122	603444	吉比特	1,015,425.00	2.04
123	600547	山东黄金	1,011,393.00	2.04
124	600859	王府井	1,001,029.00	2.02

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	295,981,713.71
卖出股票收入（成交）总额	292,222,434.14

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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在报告编制日前一年内受到处罚如下：

广东宝丽华新能源股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会广东监管局处罚；

除上述发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,336.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,114.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,450.55

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,054	15,256.87	10,197,691.01	13.23	66,910,529.35	86.77

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	107.58	0.0001

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 3 日) 基金份额总额	2,475,168,598.16
本报告期期初基金份额总额	72,859,187.81
本报告期基金总申购份额	11,433,986.92
减：本报告期基金总赎回份额	7,184,954.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	77,108,220.36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 11 日发布公告，自 2023 年 4 月 10 日起于善辉先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	1	214,593,094.20	36.49	154,785.68	36.30	-
招商证券	1	112,609,422.06	19.15	81,225.56	19.05	-
华西证券	1	109,691,657.88	18.65	80,217.21	18.81	-
中信建投	4	89,012,261.07	15.14	65,095.14	15.26	-
中信证券	3	22,766,154.29	3.87	16,648.51	3.90	-
东方财富证券	1	14,325,070.00	2.44	10,332.24	2.42	-
开源证券	2	14,141,751.8	2.41	10,200.34	2.39	-

		0				
广发证券	1	10,873,032.29	1.85	7,951.45	1.86	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------



称	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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2023 年 1 月 20 日

	基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告		
2	民生加银精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	民生加银基金管理有限公司旗下部分 基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
4	民生加银精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
5	民生加银基金管理有限公司旗下部分 基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
6	民生加银精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
7	关于旗下部分开放式基金增加上海陆 享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	2023 年 6 月 8 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《民生加银精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银精选混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银精选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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/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 8 月 30 日