

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资  
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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
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	58
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	58

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 .....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</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 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	民生加银城镇化混合	
基金主代码	000408	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 12 日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	264,981,856.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
下属分级基金的交易代码	000408	009706
报告期末下属分级基金的份额总额	262,271,697.72 份	2,710,159.19 份

注：本基金自 2020 年 9 月 10 日起，增加民生加银城镇化混合 C 类份额类别。

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	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)	
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
本期已实现收益	637,974.30	-5,180.88
本期利润	4,650,402.95	62,539.25
加权平均基金份 额本期利润	0.0173	0.0223
本期加权平均净 值利润率	0.95%	1.24%
本期基金份额净 值增长率	0.73%	0.57%
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	2,055,729.02
	期末可供分配基 金份额利润	0.7585
	109,437,756.25	0.4173

期末基金资产净值	467,470,324.83	4,765,888.21
期末基金份额净值	1.782	1.759
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	285.24%	-23.79%

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

民生加银城镇化混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.47%	0.76%	0.96%	0.51%	1.51%	0.25%
过去三个月	-2.68%	0.74%	-2.27%	0.49%	-0.41%	0.25%
过去六个月	0.73%	0.81%	0.78%	0.50%	-0.05%	0.31%
过去一年	-15.74%	1.06%	-6.89%	0.58%	-8.85%	0.48%
过去三年	-9.22%	1.23%	1.24%	0.72%	-10.46%	0.51%
自基金合同生效起至今	285.24%	1.46%	68.41%	0.84%	216.83%	0.62%

民生加银城镇化混合 C

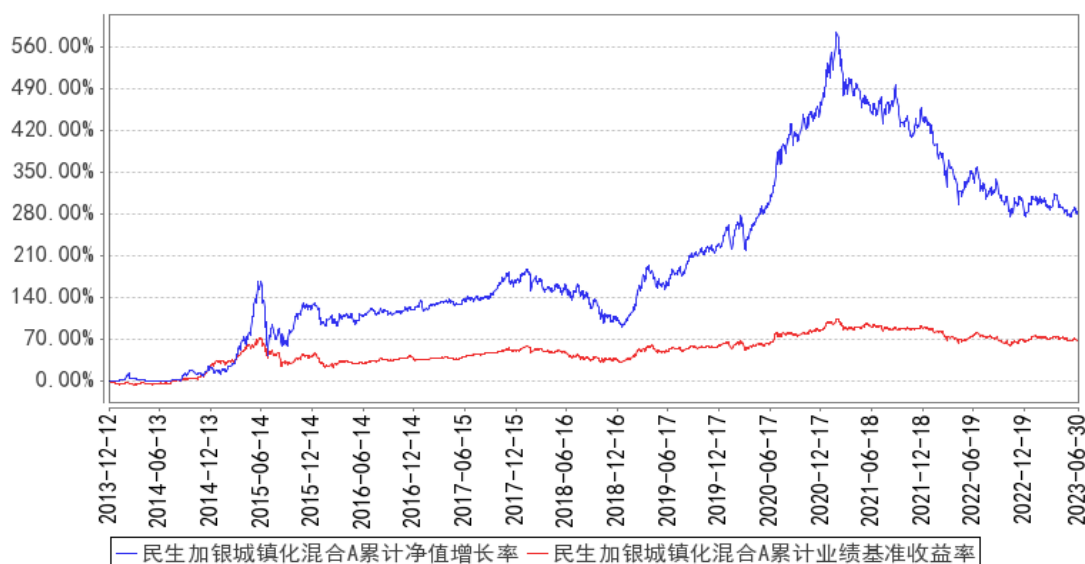
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.51%	0.76%	0.96%	0.51%	1.55%	0.25%

过去三个月	-2.76%	0.74%	-2.27%	0.49%	-0.49%	0.25%
过去六个月	0.57%	0.81%	0.78%	0.50%	-0.21%	0.31%
过去一年	-16.12%	1.06%	-6.89%	0.58%	-9.23%	0.48%
自基金合同生效起 至今	-23.79%	1.19%	-4.17%	0.69%	-19.62%	0.50%

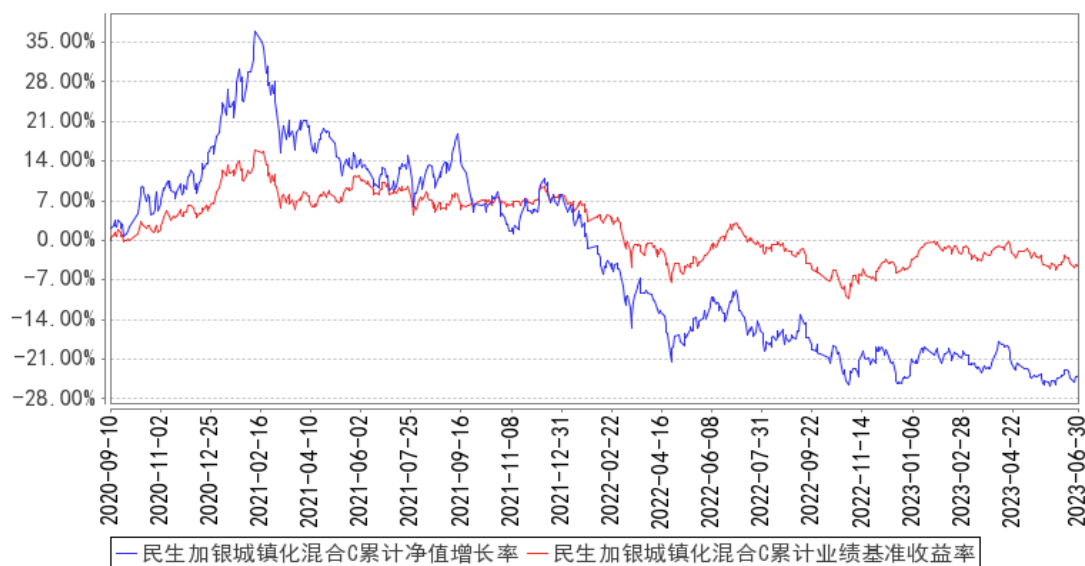
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：本基金合同于 2013 年 12 月 12 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至



建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。本基金于 2020 年 9 月 10 日增加 C 类份额。

## § 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 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、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		
柳世庆	本基金基金经理、投资部总监	2017年3月31日	-	16年	北京大学金融学硕士，16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。

#### 4.3.2 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

上半年，中国经济从去年的疫情影响中逐步走出，主要行业都在春节前后经历了一轮快速的疫后复苏，并且体现为一季度经济增速超出普遍预期。但是进入二季度后，虽然经济仍然在稳步复苏，但是其复苏力度出现放缓，内生动力呈现一定的走弱。从外部经济来看，自从疫情以来，外需一直是较强的拉动经济的动力，在进入二季度后也明显走弱。受此影响，价格指数一路走低，企业盈利整体依然较快下滑。受此影响，尽管春节前市场呈现明显反弹，但进入二季度后，则出现较大波动。尤其和经济增长相关性较大的行业回撤较多，带动市场指数也出现下跌。

从操作来看，上半年我们基本围绕结构转型带来的机会以及需求相对稳定或者估值较低的机会来布局。先后配置了计算机、医药、地产、机械设备、公用事业等行业，并且动态减持了估值相对较高，且盈利能力和竞争力难以支撑估值的板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银城镇化混合 A 的基金份额净值为 1.782 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%；截至本报告期末民生加银城镇化混合 C 的基金份额净值为 1.759 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.78%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为当前面临的需求不足问题可能并非短期问题，无论是居民、企业还是财政的需求都不同程度的在过去几年疫情中遭到负面影响。因此，经济状况也有可能带来经济体的较长时间总量与结构的变化。从历史经验来看，即使在一定政策干预对冲的条件下，这样的调整

过程也可能以年度计算，而非一蹴而就所能完成的。但是，即便在这样一个中长期的调整过程中，并不意味着经济和企业不存在阶段性的周期性的自发见底反弹。因此，即使不考虑宏观政策变量，资本市场过悲观的评估经济潜力依然可能带来阶段性和结构性的机会。

从下半年来看，我们认为经历了二季度需求较快减速以及相对应的资本市场调整之后，经济依然在寻找底部，是否在某个时间点出现反弹依然需要观察。而这对资本市场走向将产生较大影响，但是无论如何，经济的结构变化都在继续，部分受益于结构变化的行业在即使悲观的环境下也在呈现投资机会，如技术的进步或者成本的节约等等。因此，我们将耐心观察变化，并且相对均衡地为不确定性做准备。继续关注受到结构性变化影响的高端制造、医药、农业等领域，以及估值较低的房地产、公用事业等行业。

#### 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

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《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合规守信、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：民生加银城镇化灵活配置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	81,682,739.77	30,132,601.53
结算备付金		517,182.42	1,581,500.26
存出保证金		151,418.44	245,935.93
交易性金融资产	6.4.7.2	388,180,166.45	466,338,848.38
其中：股票投资		388,180,166.45	461,274,644.27
基金投资		-	-
债券投资		-	5,064,204.11
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		3,036,236.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		132,491.51	265,620.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		473,700,235.05	498,564,506.73
<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		-	320,553.23
应付赎回款		275,409.02	367,137.94
应付管理人报酬		580,887.64	696,894.12
应付托管费		96,814.60	116,149.02
应付销售服务费		1,993.33	2,112.02
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	508,917.42	973,604.67
负债合计		1,464,022.01	2,476,451.00
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	264,981,856.91	280,513,922.44
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	207,254,356.13	215,574,133.29
净资产合计		472,236,213.04	496,088,055.73
负债和净资产总计		473,700,235.05	498,564,506.73

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 264,981,856.91 份，其中民生加银城镇化混合 A 的基金份额净值为 1.782 元，份额总额为 262,271,697.72 份；其中民生加银城镇化混合 C 的基金份额净值为 1.759 元，份额总额为 2,710,159.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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
一、营业总收入		9,129,735.70	-134,922,489.04

1. 利息收入		91,789.97	238,252.95
其中：存款利息收入	6.4.7.13	91,789.97	238,252.95
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）		4,931,850.05	-109,889,669.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	986,975.57	-116,318,164.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	29,375.52	-
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	3,915,498.96	6,428,495.10
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	4,080,148.78	-25,361,397.56
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	25,946.90	90,324.75
<b>减：二、营业总支出</b>		4,416,793.50	6,594,744.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,697,973.08	5,503,393.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	616,328.85	917,232.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,535.76	83,798.51
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	89,955.81	90,319.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,712,942.20	-141,517,233.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		4,712,942.20	-141,517,233.55



号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,712,942.20	-141,517,233.55

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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)	280,513,922.44	-	215,574,133.29	496,088,055.73
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)	280,513,922.44	-	215,574,133.29	496,088,055.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,532,065.53	-	-8,319,777.16	-23,851,842.69
(一)、综合收益总额	-	-	4,712,942.20	4,712,942.20
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值	-15,532,065.53	-	-13,032,719.36	-28,564,784.89

减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	15,380,867.37	-	12,675,422.33	28,056,289.70
2. 基金赎回款	-30,912,932.90	-	-25,708,141.69	-56,621,074.59
(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)	264,981,856.91	-	207,254,356.13	472,236,213.04
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)	352,467,778.85	-	532,610,701.65	885,078,480.50
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	352,467,778.85	-	532,610,701.65	885,078,480.50
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-16,880,345.07	-	-158,646,932.45	-175,527,277.52
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-141,517,233.55	-141,517,233.55
(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)	-16,880,345.07	-	-17,129,698.90	-34,010,043.97
其中:1. 基 金 申 购 款	31,049,105.52	-	36,549,780.61	67,598,886.13
2 .基 金 赎 回 款	-47,929,450.59	-	-53,679,479.51	-101,608,930.10
(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)	335,587,433.78	-	373,963,769.20	709,551,202.98

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和

转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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	81,682,739.77
等于：本金	81,675,366.58
加：应计利息	7,373.19
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	81,682,739.77

##### 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	386,104,446.21	-	388,180,166.45	2,075,720.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	386,104,446.21	-	388,180,166.45	2,075,720.24

##### 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：无。



**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：无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**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	408.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	424,666.17
其中：交易所市场	424,666.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
预提银行间账户维护费	4,500.00
合计	508,917.42

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 民生加银城镇化混合 A

项目	本期 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	277,668,258.17	277,668,258.17
本期申购	13,992,132.48	13,992,132.48
本期赎回（以“-”号填列）	-29,388,692.93	-29,388,692.93
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,271,697.72	262,271,697.72

##### 民生加银城镇化混合 C

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	2,845,664.27	2,845,664.27
本期申购	1,388,734.89	1,388,734.89
本期赎回（以“-”号填列）	-1,524,239.97	-1,524,239.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,710,159.19	2,710,159.19

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 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

民生加银城镇化混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,507,192.00	97,934,521.02	213,441,713.02
本期利润	637,974.30	4,012,428.65	4,650,402.95
本期基金份额交易产生的变动数	-6,707,410.05	-6,186,078.81	-12,893,488.86
其中：基金申购款	6,172,438.37	5,406,814.74	11,579,253.11
基金赎回款	-12,879,848.42	-11,592,893.55	-24,472,741.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	109,437,756.25	95,760,870.86	205,198,627.11

民生加银城镇化混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,370,308.29	-1,237,888.02	2,132,420.27
本期利润	-5,180.88	67,720.13	62,539.25
本期基金份额交易产生的变动数	-163,878.98	24,648.48	-139,230.50
其中：基金申购款	1,679,765.52	-583,596.30	1,096,169.22
基金赎回款	-1,843,644.50	608,244.78	-1,235,399.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,201,248.43	-1,145,519.41	2,055,729.02

## 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	82,155.56
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	8,027.77
其他	1,606.64
合计	91,789.97

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	986,975.57
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	986,975.57

#### 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	769,686,143.55
减：卖出股票成本总额	766,789,664.18
减：交易费用	1,909,503.80
买卖股票差价收入	986,975.57

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	30,295.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-920.37
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	29,375.52

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,097,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,000,920.37
减：应计利息总额	97,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-920.37

##### 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：无。

## 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：无。

## 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：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 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	3,915,498.96
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	3,915,498.96

#### 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	4,080,148.78
股票投资	4,076,728.41
债券投资	3,420.37
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,080,148.78

#### 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	25,678.69
基金转换费收入	268.21
合计	25,946.90

#### 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,612.65
债券账户维护费	9,000.00
合计	89,955.81

#### 6.4.7.24 分部报告

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

部报告。

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露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
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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：无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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管理费	3,697,973.08	5,503,393.99
其中：支付销售机构的客户维护费	1,061,497.80	1,379,402.26

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 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	616,328.85	917,232.34

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	合计
民生加银基金公司	-	79.16	79.16
中国建设银行	-	-	-
中国民生银行	-	636.29	636.29
合计	-	715.45	715.45
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		



名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C	合计
民生加银基金公司	-	22,925.37	22,925.37
中国建设银行	-	-	-
中国民生银行	-	1,065.71	1,065.71
合计	-	23,991.08	23,991.08

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

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 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：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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：本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 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：本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

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

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

#### 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 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	
	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	81,682,739.77	82,155.56	94,557,559.50	223,347.31

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：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 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“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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	529	6,284.52	11,119.58	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

		日								
001367	海森药业	2023年 3月30日	6个月	新股流 通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年 5月9日	6个月	新股流 通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年 6月15日	6个月	新股流 通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年 3月27日	6个月	新股流 通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023年 3月1日	6个月	新股流 通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年 6月16日	6个月	新股流 通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	1个月 内(含)	新股流 通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	6个月	新股流 通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301210	金杨股份	2023年 6月21日	6个月	新股流 通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年 3月10日	6个月	新股流 通受限	50.00	30.71	552	27,600.00	16,951.92	-
301260	格力博	2023年 1月20日	6个月	新股流 通受限	30.85	23.63	983	30,325.55	23,228.29	-
301261	恒工精密	2023年 6月29日	1个月 内(含)	新股流 通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工	2023年	6个月	新股流	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

	精密	6月29日		通受限							
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	600	18,132.00	15,300.00		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	559	21,314.67	17,345.77		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	920	24,656.00	20,534.40		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	673	16,993.25	13,251.37		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	591	19,112.94	18,829.26		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	358	24,086.24	23,423.94		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	87.22	53.24	230	20,059.83	12,245.20		-

301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	260	19,968.00	28,067.00	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	996	14,750.76	13,675.08	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	179	13,147.55	8,348.56	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	580	13,786.60	24,876.20	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-

		日									
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	310	16,513.70	12,462.00		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	642	12,833.58	10,849.80		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	2,918	168,251.88	168,251.88		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	325	18,739.50	18,739.50		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68		-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,331	8,757.98	10,088.98		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	498	5,159.28	5,896.32		-
601133	柏诚	2023年	6个月	新股流	11.66	12.26	440	5,130.40	5,394.40		-

	股份	3月31日		通受限							
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	156	4,052.88	3,826.68		-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	448	7,974.40	8,014.72		-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	482	17,424.30	18,378.66		-
688307	中润光学	2023年2月8日	6个月	新股流通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,287	15,572.70	15,534.09		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	465	10,974.00	30,071.55		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	5,224	29,724.56	28,261.84		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,760	19,536.00	29,990.40		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-

688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	新股流 通受限	33.99	29.49	318	10,808.82	9,377.82	-
688484	南芯科技	2023年 3月28日	6个月	新股流 通受限	39.99	36.71	463	18,515.37	16,996.73	-
688507	索辰科技	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	166.55	122.11	115	19,153.68	14,042.65	-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股流 通受限	20.92	19.16	682	14,267.44	13,067.12	-
688523	航天环宇	2023年 5月26日	6个月	新股流 通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688535	华海诚科	2023年 3月28日	6个月	新股流 通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年 6月14日	6个月	新股流 通受限	43.67	53.05	314	13,712.38	16,657.70	-
688552	航天南湖	2023年 5月8日	6个月	新股流 通受限	21.17	23.50	645	13,654.65	15,157.50	-
688562	航天软件	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年 5月29日	6个月	新股流 通受限	30.26	25.33	500	15,130.00	12,665.00	-
688576	西山科技	2023年 5月30日	6个月	新股流 通受限	135.80	120.41	177	24,036.60	21,312.57	-
688581	安杰思	2023年 5月12日	6个月	新股流 通受限	125.80	118.03	110	13,838.00	12,983.30	-
688582	芯动联科	2023年 6月21日	6个月	新股流 通受限	26.74	40.68	495	13,236.30	20,136.60	-
688593	新相微	2023年 5月25日	6个月	新股流 通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年 6月30日	1个月 内(含)	新股流 通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-



		日								
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	119	14,979.72	10,328.01	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

##### 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，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 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

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,064,204.11
合计	-	5,064,204.11

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

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的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	81,675,366.58	-	-	-	-	7,373.19	81,682,739.77
结算备付金	516,949.82	-	-	-	-	232.60	517,182.42
存出保证金	151,350.34	-	-	-	-	68.10	151,418.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-388,180,166.45	388,180,166.45
应收申购款	-	-	-	-	-	132,491.51	132,491.51
应收清算款	-	-	-	-	-	3,036,236.46	3,036,236.46
资产总计	82,343,666.74	-	-	-	-	-391,356,568.31	473,700,235.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	275,409.02	275,409.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	580,887.64	580,887.64
应付托管费	-	-	-	-	-	96,814.60	96,814.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,993.33	1,993.33
其他负债	-	-	-	-	-	508,917.42	508,917.42
负债总计	-	-	-	-	-	1,464,022.01	1,464,022.01
利率敏感度缺口	82,343,666.74	-	-	-	-	-389,892,546.30	472,236,213.04
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	30,128,480.00	-	-	-	-	4,121.53	30,132,601.53
结算备付金	1,580,717.83	-	-	-	-	782.43	1,581,500.26
存出保证金	245,814.16	-	-	-	-	121.77	245,935.93
交易性金融资产	-	-	4,997,500.00	-	-	-461,341,348.38	466,338,848.38
应收申购款	-	-	-	-	-	265,620.63	265,620.63
资产总计	31,955,011.99	-	4,997,500.00	-	-	-461,611,994.74	498,564,506.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	367,137.94	367,137.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	696,894.12	696,894.12

应付托管费	-	-	-	-	116,149.02	116,149.02
应付清算款	-	-	-	-	320,553.23	320,553.23
应付销售服务费	-	-	-	-	2,112.02	2,112.02
其他负债	-	-	-	-	973,604.67	973,604.67
负债总计	-	-	-	-	2,476,451.00	2,476,451.00
利率敏感度缺口	31,955,011.99	-4,997,500.00	-	-	-459,135,543.74	496,088,055.73

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	-	3,893.69
	2. 市场利率上升 25 个基点	-	-3,887.41

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 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	388,180,166.45	82.20	461,274,644.27	92.98
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	388,180,166.45	82.20	461,274,644.27	92.98

#### 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%	27,277,168.14	34,520,539.71
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-27,277,168.14	-34,520,539.71

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

##### 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	386,245,837.61	458,349,063.07
第二层次	1,934,328.84	7,989,785.31
第三层次	-	-
合计	388,180,166.45	466,338,848.38

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

## § 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	388,180,166.45	81.95
	其中：股票	388,180,166.45	81.95
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	82,199,922.19	17.35
8	其他各项资产	3,320,146.41	0.70
9	合计	473,700,235.05	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	20,539,422.00	4.35
B	采矿业	13,971,857.23	2.96
C	制造业	175,610,070.89	37.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,776,646.56	5.25
E	建筑业	90,820.86	0.02
F	批发和零售业	15,052,099.12	3.19
G	交通运输、仓储和邮政业	24,001,932.70	5.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,463,427.07	4.33
J	金融业	21,446.67	0.00
K	房地产业	70,554,945.10	14.94
L	租赁和商务服务业	25,015.97	0.01
M	科学研究和技术服务业	104,024.53	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	183,528.63	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,775,678.12	4.82
R	文化、体育和娱乐业	9,251.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	388,180,166.45	82.20

### 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	603338	浙江鼎力	677,247	37,932,604.47	8.03
2	601567	三星医疗	2,353,722	29,727,508.86	6.30
3	001979	招商蛇口	1,988,700	25,912,761.00	5.49
4	600150	中国船舶	740,300	24,363,273.00	5.16
5	600325	华发股份	2,343,946	23,087,868.10	4.89
6	000516	国际医学	2,695,800	22,671,678.00	4.80
7	002244	滨江集团	2,443,800	21,554,316.00	4.56
8	603477	巨星农牧	615,600	20,530,260.00	4.35
9	002422	科伦药业	682,980	20,270,846.40	4.29
10	688383	新益昌	117,399	16,344,288.78	3.46
11	600027	华电国际	2,298,700	15,378,303.00	3.26
12	002100	天康生物	1,845,949	15,229,079.25	3.22
13	600938	中国海油	765,600	13,872,672.00	2.94
14	601816	京沪高铁	2,311,000	12,155,860.00	2.57
15	601333	广深铁路	2,988,100	11,832,876.00	2.51
16	002567	唐人神	1,707,411	11,354,283.15	2.40
17	600276	恒瑞医药	229,700	11,002,630.00	2.33
18	603233	大参林	360,780	10,105,447.80	2.14
19	603927	中科软	254,902	9,829,021.12	2.08
20	002439	启明星辰	237,800	7,076,928.00	1.50
21	600011	华能国际	511,400	4,735,564.00	1.00
22	000690	宝新能源	656,600	4,609,332.00	0.98
23	603939	益丰药房	122,900	4,547,300.00	0.96
24	002401	中远海科	91,200	2,400,384.00	0.51
25	300832	新产业	38,600	2,277,400.00	0.48
26	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.07
27	688582	芯动联科	4,942	228,478.55	0.05
28	301486	致尚科技	3,243	186,991.38	0.04
29	301291	明阳电气	5,585	181,193.37	0.04
30	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.04
31	601933	永辉超市	54,967	172,046.71	0.04
32	688325	赛微微电	4,039	157,722.95	0.03
33	688275	万润新能	1,703	153,831.99	0.03
34	688376	美埃科技	3,713	146,626.37	0.03
35	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.03
36	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
37	688581	安杰思	1,097	133,880.93	0.03
38	688570	天玛智控	4,995	132,411.80	0.03
39	688553	汇宇制药	8,220	122,724.60	0.03
40	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
41	601061	中信金属	13,308	115,247.04	0.02
42	301439	泓淋电力	6,419	113,911.48	0.02
43	688682	霍莱沃	1,324	110,871.76	0.02

44	688623	二元科技	1,184	108,169.56	0.02
45	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
46	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.02
47	688479	友车科技	3,180	99,444.96	0.02
48	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.02
49	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
50	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.02
51	688625	呈和科技	2,472	96,877.68	0.02
52	688420	美腾科技	2,408	93,261.84	0.02
53	603135	中重科技	4,475	90,165.52	0.02
54	301265	华新环保	7,681	89,253.22	0.02
55	301281	科源制药	3,368	88,415.20	0.02
56	301345	涛涛车业	1,790	85,209.37	0.02
57	688247	宣泰医药	6,589	84,009.75	0.02
58	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
59	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.02
60	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.02
61	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.02
62	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
63	688203	海正生材	5,305	73,102.90	0.02
64	301269	华大九天	594	72,966.96	0.02
65	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
66	688455	科捷智能	4,859	71,087.17	0.02
67	688786	悦安新材	1,513	70,188.07	0.01
68	601065	江盐集团	4,972	65,982.14	0.01
69	601133	柏诚股份	4,392	64,318.72	0.01
70	301308	江波龙	617	62,785.92	0.01
71	301239	普瑞眼科	575	56,396.00	0.01
72	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.01
73	688485	九州一轨	3,580	54,917.20	0.01
74	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.01
75	301153	中科江南	716	53,671.36	0.01
76	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.01
77	688501	青达环保	2,003	44,566.75	0.01
78	603125	常青科技	1,553	43,571.33	0.01
79	301165	锐捷网络	668	41,228.96	0.01
80	301238	瑞泰新材	2,018	41,046.12	0.01
81	301095	广立微	481	39,754.65	0.01
82	301175	中科环保	6,370	39,685.10	0.01
83	301087	可孚医疗	763	37,615.90	0.01
84	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
85	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01
86	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01

87	301162	国能日新	468	36,915.84	0.01
88	301236	软通动力	1,354	36,842.34	0.01
89	301266	宇邦新材	517	36,350.27	0.01
90	301217	铜冠铜箔	2,536	36,087.28	0.01
91	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
92	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.01
93	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
94	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.01
95	688361	中科飞测	465	30,071.55	0.01
96	688472	阿特斯	1,760	29,990.40	0.01
97	301029	怡合达	665	29,712.20	0.01
98	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.01
99	301211	亨迪药业	1,160	28,884.00	0.01
100	688469	中芯集成	5,224	28,261.84	0.01
101	301325	曼恩斯特	260	28,067.00	0.01
102	301268	铭利达	641	26,838.67	0.01
103	001322	箭牌家居	1,595	26,700.30	0.01
104	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
105	301267	华夏眼科	432	26,330.40	0.01
106	301367	怡和嘉业	177	26,256.18	0.01
107	301389	隆扬电子	1,432	26,033.76	0.01
108	002594	比亚迪	100	25,827.00	0.01
109	301302	华如科技	699	25,723.20	0.01
110	301263	泰恩康	1,228	25,640.64	0.01
111	301102	兆讯传媒	931	25,015.97	0.01
112	301358	湖南裕能	580	24,876.20	0.01
113	603255	鼎际得	488	24,770.88	0.01
114	001367	海森药业	549	24,687.92	0.01
115	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
116	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.01
117	001339	智微智能	812	24,092.04	0.01
118	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
119	603211	晋拓股份	1,287	23,655.06	0.01
120	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.00
121	301310	鑫宏业	358	23,423.94	0.00
122	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
123	301260	格力博	983	23,228.29	0.00
124	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
125	301109	军信股份	1,388	22,915.88	0.00
126	301101	明月镜片	557	22,853.71	0.00
127	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
128	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.00
129	688576	西山科技	177	21,312.57	0.00

130	301103	何氏眼科	507	21,273.72	0.00
131	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
132	301366	一博科技	482	20,942.90	0.00
133	301171	易点天下	942	20,818.20	0.00
134	301303	真兰仪表	920	20,534.40	0.00
135	301168	通灵股份	329	20,496.70	0.00
136	301200	大族数控	509	20,298.92	0.00
137	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
138	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
139	301206	三元生物	549	19,209.51	0.00
140	301185	鸥玛软件	578	19,085.56	0.00
141	301152	天力锂能	423	18,891.18	0.00
142	301307	美利信	591	18,829.26	0.00
143	688146	中船特气	482	18,378.66	0.00
144	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
145	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
146	301150	中一科技	357	17,853.57	0.00
147	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
148	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
149	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
150	301216	万凯新材	1,057	17,577.91	0.00
151	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
152	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
153	688484	南芯科技	463	16,996.73	0.00
154	301246	宏源药业	552	16,951.92	0.00
155	301177	迪阿股份	436	16,755.48	0.00
156	301030	仕净科技	242	16,722.20	0.00
157	301356	天振股份	763	16,709.70	0.00
158	688543	国科军工	314	16,657.70	0.00
159	301127	天源环保	1,685	16,529.85	0.00
160	301096	百诚医药	272	16,485.92	0.00
161	301139	元道通信	566	16,351.74	0.00
162	301328	维峰电子	287	16,341.78	0.00
163	301256	华融化学	1,831	16,222.66	0.00
164	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
165	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.00
166	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.00
167	301248	杰创智能	708	15,767.16	0.00
168	301221	光庭信息	280	15,632.40	0.00
169	688122	西部超导	280	15,604.40	0.00
170	688352	颀中科技	1,287	15,534.09	0.00
171	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
172	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.00

173	301262	海看股份	600	15,300.00	0.00
174	688552	航天南湖	645	15,157.50	0.00
175	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
176	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
177	301121	紫建电子	290	14,685.60	0.00
178	301112	信邦智能	399	14,607.39	0.00
179	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
180	301201	诚达药业	353	14,543.60	0.00
181	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
182	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
183	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
184	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
185	301115	建科股份	625	14,287.50	0.00
186	688507	索辰科技	115	14,042.65	0.00
187	301335	天元宠物	588	14,017.92	0.00
188	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
189	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
190	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
191	603237	五芳斋	455	13,800.15	0.00
192	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
193	301069	凯盛新材	539	13,712.16	0.00
194	301332	德尔玛	996	13,675.08	0.00
195	301089	拓新药业	220	13,626.80	0.00
196	301212	联盛化学	416	13,619.84	0.00
197	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
198	301189	奥尼电子	435	13,306.65	0.00
199	301235	华康医疗	418	13,300.76	0.00
200	301305	朗坤环境	673	13,251.37	0.00
201	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
202	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
203	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
204	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
205	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
206	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
207	688512	慧智微	682	13,067.12	0.00
208	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
209	300834	星辉环材	534	13,029.60	0.00
210	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
211	301199	迈赫股份	402	12,799.68	0.00
212	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
213	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.00
214	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
215	301397	溯联股份	310	12,462.00	0.00

216	301151	冠龙节能	703	12,422.01	0.00
217	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
218	301100	风光股份	599	12,375.34	0.00
219	301322	绿通科技	230	12,245.20	0.00
220	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
221	301258	富士莱	295	11,599.40	0.00
222	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
223	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
224	603170	宝立食品	542	11,522.92	0.00
225	301137	哈焊华通	644	11,508.28	0.00
226	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
227	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
228	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
229	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
230	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
231	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
232	001287	中电港	529	11,119.58	0.00
233	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
234	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
235	301148	嘉戎技术	516	11,032.08	0.00
236	301166	优宁维	253	10,863.82	0.00
237	301190	善水科技	575	10,804.25	0.00
238	001333	光华股份	426	10,705.38	0.00
239	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
240	301219	腾远钴业	281	10,498.16	0.00
241	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
242	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
243	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
244	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
245	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00
246	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
247	301110	青木股份	202	10,186.86	0.00
248	301108	洁雅股份	280	10,136.00	0.00
249	301181	标榜股份	334	10,050.06	0.00
250	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
251	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
252	001366	播恩集团	646	9,961.32	0.00
253	301306	西测测试	255	9,906.75	0.00
254	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
255	301222	浙江恒威	332	9,777.40	0.00
256	301083	百胜智能	416	9,734.40	0.00
257	301220	亚香股份	285	9,721.35	0.00
258	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00

259	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
260	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
261	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
262	301176	逸豪新材	544	9,345.92	0.00
263	301135	瑞德智能	338	9,267.96	0.00
264	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
265	301196	唯科科技	271	9,200.45	0.00
266	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
267	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
268	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
269	002041	登海种业	600	9,162.00	0.00
270	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
271	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
272	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
273	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
274	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
275	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
276	301279	金道科技	296	8,791.20	0.00
277	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00
278	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
279	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
280	301273	瑞晨环保	277	8,686.72	0.00
281	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
282	301326	捷邦科技	227	8,632.81	0.00
283	002460	赣锋锂业	140	8,534.40	0.00
284	301092	争光股份	323	8,456.14	0.00
285	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
286	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
287	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
288	301193	家联科技	475	8,326.75	0.00
289	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
290	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
291	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
292	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
293	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
294	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
295	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
296	300814	中富电路	328	7,901.52	0.00
297	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
298	301288	清研环境	452	7,801.52	0.00
299	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
300	301237	和顺科技	261	7,749.09	0.00
301	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00

302	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
303	301133	金钟股份	286	7,596.16	0.00
304	603272	联翔股份	443	7,513.28	0.00
305	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
306	301111	粤万年青	379	7,420.82	0.00
307	301041	金百泽	215	7,120.80	0.00
308	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
309	301059	金三江	492	6,888.00	0.00
310	301233	盛帮股份	158	6,836.66	0.00
311	301182	凯旺科技	294	6,753.18	0.00
312	301198	喜悦智行	443	6,724.74	0.00
313	301158	德石股份	379	6,560.49	0.00
314	301130	西点药业	237	6,512.76	0.00
315	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
316	301038	深水规院	346	6,259.14	0.00
317	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
318	300776	帝尔激光	83	5,386.70	0.00
319	301056	森赫股份	572	5,239.52	0.00
320	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
321	301040	中环海陆	241	4,952.55	0.00
322	301081	严牌股份	484	4,815.80	0.00
323	301072	中捷精工	181	4,534.05	0.00
324	301049	超越科技	196	4,331.60	0.00
325	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
326	301079	邵阳液压	182	3,880.24	0.00
327	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
328	301057	汇隆新材	218	3,758.32	0.00
329	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
330	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
331	002635	安洁科技	100	1,380.00	0.00
332	688172	燕东微	24	570.72	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002439	启明星辰	32,386,470.17	6.53
2	002244	滨江集团	25,377,112.99	5.12
3	600570	恒生电子	22,237,052.89	4.48
4	603477	巨星农牧	21,214,711.36	4.28
5	603816	顾家家居	19,725,315.20	3.98
6	002422	科伦药业	19,644,375.20	3.96
7	688023	安恒信息	18,735,580.16	3.78



8	600150	中国船舶	18,435,365.06	3.72
9	002100	天康生物	18,229,163.29	3.67
10	002567	唐人神	17,453,665.15	3.52
11	688383	新益昌	16,434,195.50	3.31
12	601816	京沪高铁	16,380,695.00	3.30
13	000725	京东方 A	15,828,122.00	3.19
14	600027	华电国际	15,410,328.00	3.11
15	000768	中航西飞	15,263,849.62	3.08
16	600919	江苏银行	15,209,714.00	3.07
17	600276	恒瑞医药	15,007,997.68	3.03
18	300674	宇信科技	15,007,654.53	3.03
19	603927	中科软	14,965,325.77	3.02
20	600938	中国海油	14,044,704.00	2.83
21	603939	益丰药房	13,219,888.33	2.66
22	603233	大参林	13,025,193.10	2.63
23	601128	常熟银行	12,805,066.00	2.58
24	601717	郑煤机	12,619,552.18	2.54
25	300498	温氏股份	11,040,418.63	2.23
26	600211	西藏药业	10,755,921.80	2.17
27	600109	国金证券	10,515,177.00	2.12
28	001269	欧晶科技	10,470,747.00	2.11
29	603338	浙江鼎力	10,169,625.00	2.05
30	300003	乐普医疗	10,019,538.00	2.02
31	601333	广深铁路	9,989,969.00	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	300760	迈瑞医疗	33,088,234.00	6.67
2	603259	药明康德	30,096,634.58	6.07
3	300033	同花顺	29,573,263.24	5.96
4	600153	建发股份	26,040,147.32	5.25
5	002439	启明星辰	25,836,153.00	5.21
6	601456	国联证券	24,554,377.82	4.95
7	600048	保利发展	22,999,936.97	4.64
8	600383	金地集团	22,746,543.00	4.59
9	600435	北方导航	21,807,275.00	4.40
10	600570	恒生电子	20,908,845.82	4.21
11	688023	安恒信息	20,571,362.97	4.15
12	603939	益丰药房	19,747,348.00	3.98

13	601066	中信建投	18,883,666.00	3.81
14	000725	京东方 A	17,187,199.94	3.46
15	300122	智飞生物	17,004,098.93	3.43
16	300674	宇信科技	16,996,454.82	3.43
17	603816	顾家家居	16,559,680.00	3.34
18	600919	江苏银行	16,248,084.25	3.28
19	300059	东方财富	16,217,621.36	3.27
20	000776	广发证券	16,200,690.00	3.27
21	600030	中信证券	14,667,528.35	2.96
22	000935	四川双马	14,520,468.32	2.93
23	000768	中航西飞	14,405,661.40	2.90
24	002352	顺丰控股	13,762,669.00	2.77
25	601128	常熟银行	13,048,476.00	2.63
26	601717	郑煤机	12,799,613.00	2.58
27	600211	西藏药业	12,065,242.00	2.43
28	001269	欧晶科技	11,197,483.58	2.26
29	600109	国金证券	10,157,843.00	2.05

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	689,618,457.95
卖出股票收入（成交）总额	769,686,143.55

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

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

## 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。

### 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	151,418.44
2	应收清算款	3,036,236.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	132,491.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,320,146.41

#### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
民生加银城镇化混合 A	461,103	568.79	49,743,108.77	18.97	212,528,588.95	81.03
民生加银城镇化混合 C	3,216	842.71	-	-	2,710,159.19	100.00
合计	464,319	570.69	49,743,108.77	18.77	215,238,748.14	81.23

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）。

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	民生加银城镇化混合 A	1,209,750.46	0.4613
	民生加银城镇化混合 C	1,326.30	0.0489
	合计	1,211,076.76	0.4570

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

本基金基金经理持有本 开放式基金	民生加银城镇化混合 A	10 <sup>~</sup> 50
	民生加银城镇化混合 C	0
	合计	10 <sup>~</sup> 50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银城镇化混合 A	民生加银城镇化混合 C
基金合同生效日 (2013 年 12 月 12 日) 基金份额总额	235,923,426.05	-
本报告期期初基金份 额总额	277,668,258.17	2,845,664.27
本报告期基金总申购 份额	13,992,132.48	1,388,734.89
减: 本报告期基金总 赎回份额	29,388,692.93	1,524,239.97
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	262,271,697.72	2,710,159.19

## § 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 (%)	
中泰证券	2	314,526,026.33	21.74	230,010.84	22.49	-
中信建投	4	260,728,969.42	18.02	188,069.26	18.39	-
广发证券	1	173,601,553.12	12.00	126,948.47	12.41	-
招商证券	1	169,474,821.43	11.72	122,239.89	11.95	-
天风证券	2	142,685,259.52	9.86	75,815.78	7.41	-
浙商证券	2	133,603,816.09	9.24	96,368.65	9.42	-
中信证券	3	116,275,280.14	8.04	84,684.78	8.28	-
中金公司	2	82,159,031.34	5.68	60,077.30	5.87	-
长江证券	1	46,813,220.83	3.24	33,768.65	3.30	-
海通证券	1	6,719,233.14	0.46	4,909.85	0.48	-
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	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华创证	-	-	-	-	-	-



券						
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 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	-	-	-	-	-	-
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	民生加银城镇化灵活配置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
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	关于旗下部分开放式基金增加杭州银行股份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 2 月 10 日
4	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	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 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
6	民生加银城镇化灵活配置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	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

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

### 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