

民生加银中证 500 指数增强型发起式证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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
§ 5 托管人报告	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54

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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	民生加银中证 500 指数增强发起式	
基金主代码	012926	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 10 日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	185,108,173.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	012926	012927
报告期末下属分级基金的份额总额	134,241,548.48 份	50,866,624.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略、融资及转融通证券出借业务等，详见基金合同或招募说明书。</p> <p>其中：</p> <p>1、资产配置策略 本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略 本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以

	及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
--	---------------------------------------------------------------------

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘静	方圆
	联系电话	0755-23999841	95559
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-388	95559
传真		0755-23999800	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518038	200336
法定代表人		郑智军	任德奇

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	http://www.msjfund.com.cn
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C
本期已实现收益	-7,557,690.30	-1,627,566.26
本期利润	-11,452,741.90	-3,516,994.82
加权平均基金份额 本期利润	-0.1013	-0.0908
本期加权平均净	-14.64%	-13.10%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-11.29%	-11.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-47,438,790.53	-18,260,986.34
期末可供分配基金份额利润	-0.3534	-0.3590
期末基金资产净值	86,802,757.95	32,605,638.59
期末基金份额净值	0.6466	0.6410
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-35.34%	-35.90%

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

民生加银中证 500 指数增强发起式 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	-7.92%	0.98%	-6.55%	0.91%	-1.37%	0.07%
过去三个月	-9.24%	1.14%	-6.16%	1.09%	-3.08%	0.05%
过去六个月	-11.29%	1.60%	-8.46%	1.53%	-2.83%	0.07%
过去一年	-18.20%	1.23%	-16.71%	1.21%	-1.49%	0.02%

自基金合同生效 起至今	-35.34%	1.15%	-27.74%	1.14%	-7.60%	0.01%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

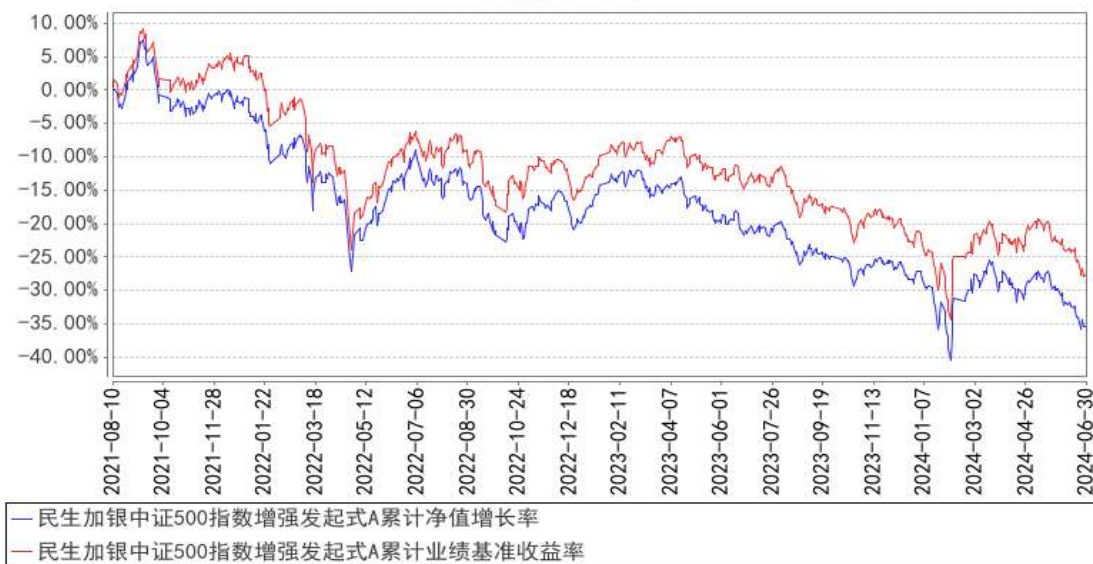
民生加银中证 500 指数增强发起式 C

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	-7.94%	0.98%	-6.55%	0.91%	-1.39%	0.07%
过去三个月	-9.31%	1.14%	-6.16%	1.09%	-3.15%	0.05%
过去六个月	-11.43%	1.60%	-8.46%	1.53%	-2.97%	0.07%
过去一年	-18.45%	1.23%	-16.71%	1.21%	-1.74%	0.02%
自基金合同生效 起至今	-35.90%	1.15%	-27.74%	1.14%	-8.16%	0.01%

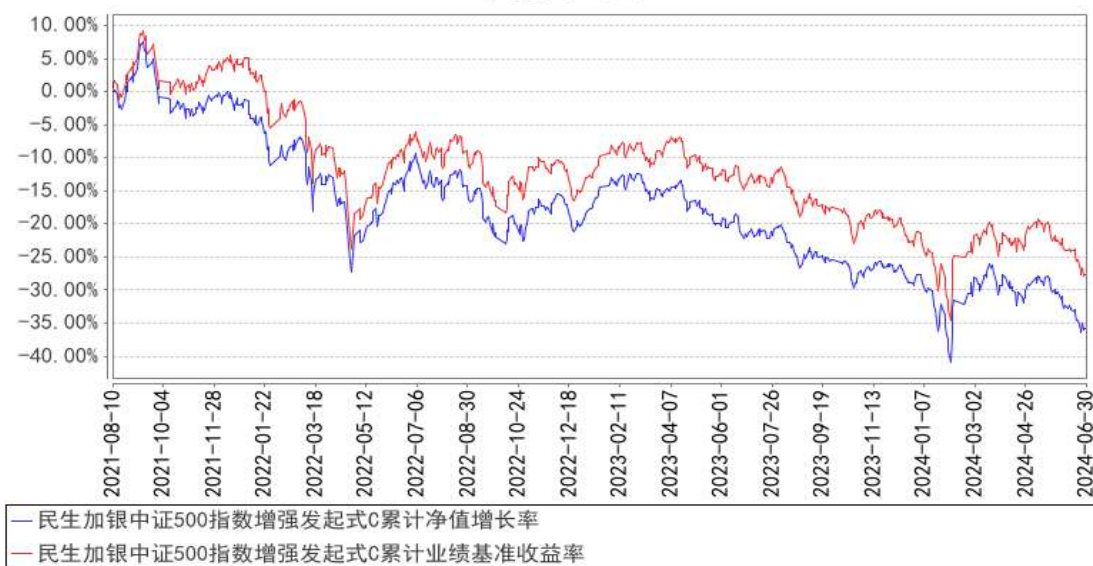
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

民生加银中证500指数增强发起式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



民生加银中证500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2021 年 8 月 10 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”）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。公司股东为中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和陕西省国际信托股份有限公司，三方股东持股比例分别为 63.33%、30%、6.67%。

截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 100 只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型证券投资基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

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		
周帅	本基金基金经理	2023 年 6 月 20 日	-	7 年	南开大学数量经济学硕士，7 年证券从业经历。自 2017 年 7 月至 2019 年 7 月，在中信建投基金管理有限公司任产品经理助理。2019 年 7 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任 PCF 专岗、基金经理助理，现任基金经理。自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指

					数证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任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基金经理；自 2023 年 6 月至今担任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基金经理；自 2023 年 12 月至今担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自 2023 年 6 月至 2024 年 1 月担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
杨林	本基金基金经理	2023 年 11 月 30 日	-	12 年	特许金融分析师 (CFA)，西安交通大学金融学学士，英国华威大学金融数学硕士，12 年证券从业经历。2012 年 1 月至 2015 年 8 月任阳光资产管理股份有限公司风险管理部权益及衍生品风险经理；2015 年 9 月至 2017 年 6 月任泰康资产管理有限责任公司风险控制部高级风险经理；2017 年 7 月至 2018 年 7 月任嘉实基金管理有限公司风险管理部权益投资风控组长，2018 年 8 月至 2019 年 9 月任禾永投资管理（北京）有限公司研究部研究员。2019 年 10 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任量化分析师、投资经理，现任基金经理。自 2023 年 11 月至今担任民生加银中证 500 指数增强型发起式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

投资策略上，本基金基于人工智能技术/机器学习方法构建收益预测模型。具体来看，基本面因子和量价因子是两类最重要的量化选股因子，都具有长期的投资价值，我们在模型中都进行了长期配置。根据绩效上限，所配置的量价类因子的权重相对更高，权重配置不会在短期内随意改动。

策略迭代上，本基金上半年在选股范围、风格偏离、指数结构层面进行了迭代：

1) 选股范围上，新“国九条”颁布之后，本基金顺应资本市场改革动态，在公司股票池基础上进行了正向优选和负面剔除。

2) 风格控制上，今年以来大盘股风格（Size）和中盘股风格（Non-Linear Size）与历史过往走势出现了较大背离，加大了风格因子的控制难度。二季度末，本基金将以上风格因子的暴露控制在较小的敞口以内。

3) 指数结构上，我们针对基准指数定制了对应的非线性风险因子，并在二季度末将其与其他重要风格因子一并约束到较小范围以内。

从研究结果来看，在不干预选股范围、不改变模型配比的情况下，通过上述风控策略的迭代，基本能起到规避这几次小盘股大跌事件对基金的冲击，且在正常年份下的模型整体收益能力也未受太大影响。

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中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 0.6466 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.29%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；截至本报告期末民生加银中

证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 0.6410 元,本报告期基金份额净值增长率为-11.43%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截至 2024 年二季度末,中证 500 指数的市盈率、市净率分别为 20 倍、1.5 倍,处于该指数自基期以来的估值低位,结合宏观经济层面、证券市场层面、行业走势层面的分析,管理人认为中证 500 或是当下市场环境里较优的一个选择。

1) 宏观经济层面,从交易预期到交易现实,中证 500 为代表的中盘有望占优。

大盘股与宏观经济环境强相关,4 月底到 5 月,房地产政策的调整引来北向资金在持续净流入,房地产板块表现领先,与经济强相关的大盘也表现不俗。从 5 月下旬开始到 6 月,随着中央和地方的地产政策落地,以及部分经济数据显示我国经济依然处于温和复苏的阶段,市场短期对于政策的预期交易也接近尾声,转而在经济的弱现实中寻找结构性亮点,因此往后看与宏观经济相关性较弱,具备结构性亮点的中证 500 有望有所表现。

2) 证券市场层面:前期受到微盘股拖累的中盘股有望修复。

在微盘股的三次冲击中,我们发现中证 500 在第一次冲击中的跌幅与微盘股接近,在第二次和第三次的调整中明显小于微盘股的跌幅,表明市场在逐步回归理性,然而年初至今,中证 500 仍然受到微盘股指数不小的拖累,后续有望迎来修复。需要明确的是,中证 500 是全部 A 股市值排名的第 301 到 800 位,是全部 A 股共 5300 只股票的市值较大的前六分之一,而微盘股指数是最靠后的 400 只,两者在市值层面、退市风险层面都有着巨大的差异。

3) 行业走势层面:新质生产力含量更足,驱动中盘指数走强

6 月 1 日出版的《求是》杂志发表习近平总书记的重要文章《发展新质生产力是推动高质量发展的内在要求和重要着力点》,新质生产力又一次得到强调和重视。

与核心大盘指数——沪深 300 进行对比,我们发现中证 500 在银行、非银金融、食品饮料、建筑装饰等传统行业有明显低配,而在医药生物、国防军工、基础化工、机械设备、计算机等行业有明显的超配,以上行业具备众多符合新质生产力的上市公司,在后续“科特估”有望成为阶段主线的条件下,中证 500 的表现有望更好。

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

本基金为发起式基金且成立不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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

本报告期内，基金托管人在民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，民生加银基金管理有限公司在民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由民生加银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,921,041.16	4,676,407.99
结算备付金		2,581,448.53	850,702.54
存出保证金		118,022.40	524,559.12
交易性金融资产	6.4.7.2	109,873,258.84	44,318,565.86
其中：股票投资		109,873,258.84	44,318,565.86
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		2,373,496.87	4,579,975.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		124,867,267.80	54,950,210.92
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,092,817.08
应付赎回款		5,290,132.50	688,931.46
应付管理人报酬		103,806.62	33,620.29
应付托管费		20,761.32	6,724.04
应付销售服务费		9,216.11	3,739.58
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	34,954.71	171,145.46
负债合计		5,458,871.26	1,996,977.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	185,108,173.41	72,787,274.12
未分配利润	6.4.7.12	-65,699,776.87	-19,834,041.11
净资产合计		119,408,396.54	52,953,233.01
负债和净资产总计		124,867,267.80	54,950,210.92

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 185,108,173.41 份，其中民生加银中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 0.6466 元，份额总额为 134,241,548.48 份；其中民生加银中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 0.6410 元，份额总额为 50,866,624.93 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-14,258,710.69	-520,978.45
1. 利息收入		41,121.34	23,046.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	41,121.34	23,046.89
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,207,808.63	-1,056,785.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,403,413.31	-1,700,521.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-413.65	-
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	-342,058.57	11,112.84
股利收益	6.4.7.19	1,538,076.90	632,622.55
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	-5,784,480.16	502,621.96

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	692,456.76	10,138.59
减：二、营业总支出		711,026.03	297,430.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	526,183.55	194,267.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	105,236.70	38,853.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	39,781.95	23,091.41
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		-	121.07
8. 其他费用	6.4.7.23	39,823.83	41,097.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,969,736.72	-818,409.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,969,736.72	-818,409.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,969,736.72	-818,409.13

6.3 净资产变动表

会计主体：民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	72,787,274.12	-	-19,834,041.11	52,953,233.01
二、本期期初净资产	72,787,274.12	-	-19,834,041.11	52,953,233.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	112,320,899.29	-	-45,865,735.76	66,455,163.53
（一）、综合收益总额	-	-	-14,969,736.72	-14,969,736.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	112,320,899.29	-	-30,895,999.04	81,424,900.25

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	442,748,200.47	-	129,443,011.58	313,305,188.89
2. 基金赎回款	- 330,427,301.18	-	98,547,012.54	-231,880,288.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	185,108,173.41	-	-65,699,776.87	119,408,396.54
项目	上年度可比期间 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	43,069,927.15	-	-8,620,730.18	34,449,196.97
二、本期期初净资产	43,069,927.15	-	-8,620,730.18	34,449,196.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,180,188.07	-	-1,785,064.00	4,395,124.07
(一)、综合收益总额	-	-	-818,409.13	-818,409.13
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	6,180,188.07	-	-966,654.87	5,213,533.20
其中：1. 基金申购款	22,103,112.58	-	-3,339,771.19	18,763,341.39
2. 基金赎回款	-15,922,924.51	-	2,373,116.32	-13,549,808.19
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	49,250,115.22	-	-10,405,794.18	38,844,321.04

资产				
----	--	--	--	--

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

民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1482 号《关于准予民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模共人民币 88,688,527.77 元。经向中国证监会备案,《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 10 日正式生效。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础编制。

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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、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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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《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》、财税[2016]36 号《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《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《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。

(4) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,409,830.73
等于：本金	5,409,375.54
加：应计利息	455.19
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	4,511,210.43
等于：本金	4,510,954.48
加：应计利息	255.95
减：坏账准备	-
合计	9,921,041.16

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专户证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	115,809,567.32	-	109,873,258.84	-5,936,308.48
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	115,809,567.32	-	109,873,258.84	-5,936,308.48

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	989,885.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	989,885.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	989,885.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	1.00	983,520.00	-6,365.00
合计				-6,365.00
减：可抵销期货暂收款				-6,365.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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：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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	147.21

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	9,944.48
预提信息披露费	24,863.02
合计	34,954.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银中证 500 指数增强发起式 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,009,690.54	53,009,690.54
本期申购	355,787,301.28	355,787,301.28
本期赎回（以“-”号填列）	-274,555,443.34	-274,555,443.34
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	134,241,548.48	134,241,548.48

民生加银中证 500 指数增强发起式 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,777,583.58	19,777,583.58
本期申购	86,960,899.19	86,960,899.19
本期赎回（以“-”号填列）	-55,871,857.84	-55,871,857.84
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	50,866,624.93	50,866,624.93

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

民生加银中证 500 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-11,473,118.33	-2,896,530.77	-14,369,649.10
本期期初	-11,473,118.33	-2,896,530.77	-14,369,649.10
本期利润	-7,557,690.30	-3,895,051.60	-11,452,741.90
本期基金份额交易产生的变动数	-15,089,635.57	-6,526,763.96	-21,616,399.53
其中：基金申购款	-79,196,820.37	-24,010,675.17	-103,207,495.54
基金赎回款	64,107,184.80	17,483,911.21	81,591,096.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,120,444.20	-13,318,346.33	-47,438,790.53

民生加银中证 500 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,381,912.19	-1,082,479.82	-5,464,392.01
本期期初	-4,381,912.19	-1,082,479.82	-5,464,392.01
本期利润	-1,627,566.26	-1,889,428.56	-3,516,994.82
本期基金份额交易产生的变动数	-7,218,449.53	-2,061,149.98	-9,279,599.51
其中：基金申购款	-20,177,132.40	-6,058,383.64	-26,235,516.04
基金赎回款	12,958,682.87	3,997,233.66	16,955,916.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,227,927.98	-5,033,058.36	-18,260,986.34

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	25,199.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,192.34
结算备付金利息收入	12,658.26
其他	71.03
合计	41,121.34

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,403,413.31
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	-

入	
合计	-10,403,413.31

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	523,496,225.96
减：卖出股票成本总额	533,102,499.82
减：交易费用	797,139.45
买卖股票差价收入	-10,403,413.31

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	64.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-478.02
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	-413.65

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,008,079.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,005,980.00
减：应计利息总额	2,575.33
减：交易费用	2.02
买卖债券差价收入	-478.02

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-342,058.57

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,538,076.90

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	1,538,076.90

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,728,315.16
股票投资	-5,728,315.16
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	-56,165.00
权证投资	-
期货投资	-56,165.00
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	-5,784,480.16

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	692,456.76
合计	692,456.76

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	5,016.33
合计	39,823.83

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）	基金管理人的中方投资者、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	526,183.55	194,267.62
其中:应支付销售机构的客户维护费	194,234.63	73,629.65
应支付基金管理人的净管理费	331,948.92	120,637.97

注:支付基金管理人民生加银基金公司的管理费按前一日基金资产净值 1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	105,236.70	38,853.50

注:支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	合计
交通银行	-	2,343.24	2,343.24
民生加银基金公司	-	4,812.15	4,812.15
中国民生银行	-	11,280.42	11,280.42
合计	-	18,435.81	18,435.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	合计
交通银行	-	4,428.97	4,428.97
民生加银基金公司	-	-	-

中国民生银行	-	12,555.32	12,555.32
合计	-	16,984.29	16,984.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类份额的基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 10 日）持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期初持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.4036%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	

	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 10 日）持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期初持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,002,500.25	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.3096%	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
交通银行	5,409,830.73	25,199.71	3,560,820.03	11,363.62

注：本基金的活期银行存款由基金托管人 交通银行保管，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

无。

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（2024 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：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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 2024 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 2024 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：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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他有资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在场外申赎基金份额均通过基金的基金管理人的直销柜台办理，基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额将在一年以内到期且计息(该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，

并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	9,920,330.02	-	-	-	-	711.14	9,921,041.16
结算备付金	2,575,453.30	-	-	-	-	5,995.23	2,581,448.53
存出保证金	-	-	-	-	-	118,022.40	118,022.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	109,873,258.84	109,873,258.84
应收申购款	-	-	-	-	-	2,373,496.87	2,373,496.87
资产总计	12,495,783.32	-	-	-	-	112,371,484.48	124,867,267.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,290,132.50	5,290,132.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,806.62	103,806.62
应付托管费	-	-	-	-	-	20,761.32	20,761.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,216.11	9,216.11
其他负债	-	-	-	-	-	34,954.71	34,954.71
负债总计	-	-	-	-	-	5,458,871.26	5,458,871.26
利率敏感度缺口	12,495,783.32	-	-	-	-	-106,912,613.22	119,408,396.54
上年度末 2023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							
货币资金	4,675,214.39	-	-	-	-	1,193.60	4,676,407.99
结算备付金	847,183.90	-	-	-	-	3,518.64	850,702.54
存出保证金	4,755.10	-	-	-	-	519,804.02	524,559.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	44,318,565.86	44,318,565.86
应收申购款	-	-	-	-	-	4,579,975.41	4,579,975.41
资产总计	5,527,153.39	-	-	-	-	49,423,057.53	54,950,210.92
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	688,931.46	688,931.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,620.29	33,620.29
应付托管费	-	-	-	-	-	6,724.04	6,724.04
应付清算款	-	-	-	-	-	1,092,817.08	1,092,817.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,739.58	3,739.58
其他负债	-	-	-	-	-	171,145.46	171,145.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,996,977.91	1,996,977.91
利率敏感度缺口	5,527,153.39	-	-	-	-	47,426,079.62	52,953,233.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	109,873,258.84	92.01	44,318,565.86	83.69
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	109,873,258.84	92.01	44,318,565.86	83.69

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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	6,088,378.62	2,410,002.99
	2. 业绩比较基准下降 5%	-6,088,378.62	-2,410,002.99

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	109,873,258.84	44,318,565.86
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	109,873,258.84	44,318,565.86
----	----------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	109,873,258.84	87.99
	其中：股票	109,873,258.84	87.99
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	12,502,489.69	10.01
8	其他各项资产	2,491,519.27	2.00
9	合计	124,867,267.80	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,260,241.00	1.06
B	采矿业	6,600,568.40	5.53
C	制造业	50,292,918.39	42.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,339,005.00	3.63
E	建筑业	1,265,761.00	1.06
F	批发和零售业	3,528,214.00	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,408,797.80	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,059,497.20	5.91
J	金融业	11,330,103.80	9.49
K	房地产业	1,302,277.00	1.09
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	1,093,959.00	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,272,492.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	91,753,834.59	76.84

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	756,204.00	0.63
C	制造业	12,687,123.25	10.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,083,000.00	0.91

E	建筑业	413,649.00	0.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,168,312.00	2.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,136.00	0.01
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	18,119,424.25	15.17

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601077	渝农商行	316,690	1,589,783.80	1.33
2	600885	宏发股份	56,700	1,569,456.00	1.31
3	600497	驰宏锌锗	277,200	1,480,248.00	1.24
4	002008	大族激光	70,200	1,460,160.00	1.22
5	600879	航天电子	187,200	1,454,544.00	1.22
6	002128	电投能源	67,964	1,434,040.40	1.20
7	601997	贵阳银行	267,000	1,407,090.00	1.18
8	300088	长信科技	291,500	1,370,050.00	1.15
9	601990	南京证券	178,100	1,367,808.00	1.15
10	000738	航发控制	67,700	1,358,739.00	1.14

11	601216	君正集团	364,800	1,346,112.00	1.13
12	000636	风华高科	102,400	1,337,344.00	1.12
13	600704	物产中大	307,700	1,335,418.00	1.12
14	600143	金发科技	200,500	1,325,305.00	1.11
15	300296	利亚德	290,100	1,305,450.00	1.09
16	002240	盛新锂能	95,800	1,285,636.00	1.08
17	002056	横店东磁	102,200	1,274,434.00	1.07
18	603882	金城医学	46,800	1,272,492.00	1.07
19	601577	长沙银行	154,700	1,265,446.00	1.06
20	600598	北大荒	100,900	1,260,241.00	1.06
21	600901	江苏金租	249,000	1,257,450.00	1.05
22	600959	江苏有线	474,500	1,252,680.00	1.05
23	000027	深圳能源	171,200	1,249,760.00	1.05
24	600873	梅花生物	124,600	1,248,492.00	1.05
25	688002	睿创微纳	44,600	1,247,462.00	1.04
26	600517	国网英大	285,800	1,237,514.00	1.04
27	000937	冀中能源	184,200	1,234,140.00	1.03
28	600329	达仁堂	38,101	1,234,091.39	1.03
29	600967	内蒙一机	170,700	1,229,040.00	1.03
30	600380	健康元	110,000	1,228,700.00	1.03
31	603688	石英股份	41,400	1,225,854.00	1.03
32	688425	铁建重工	330,200	1,215,136.00	1.02
33	600350	山东高速	137,100	1,213,335.00	1.02
34	603233	大参林	84,600	1,209,780.00	1.01
35	600377	宁沪高速	94,878	1,195,462.80	1.00
36	600299	安迪苏	121,500	1,178,550.00	0.99
37	600663	陆家嘴	133,500	1,177,470.00	0.99
38	601231	环旭电子	72,900	1,170,045.00	0.98
39	688276	百克生物	41,200	1,168,844.00	0.98
40	002563	森马服饰	199,600	1,159,676.00	0.97
41	600008	首创环保	429,600	1,151,328.00	0.96
42	688819	天能股份	47,800	1,140,508.00	0.96
43	002465	海格通信	109,300	1,132,348.00	0.95
44	002138	顺络电子	40,600	1,114,876.00	0.93
45	002439	启明星辰	64,500	1,113,270.00	0.93
46	300253	卫宁健康	188,200	1,110,380.00	0.93
47	601611	中国核建	136,200	1,101,858.00	0.92
48	002472	双环传动	49,800	1,096,596.00	0.92
49	001203	大中矿业	114,000	1,095,540.00	0.92
50	600486	扬农化工	19,400	1,095,130.00	0.92
51	002266	浙富控股	392,100	1,093,959.00	0.92
52	600699	均胜电子	73,600	1,090,752.00	0.91
53	000887	中鼎股份	88,900	1,088,136.00	0.91

54	002531	天顺风能	121,600	1,087,104.00	0.91
55	002223	鱼跃医疗	28,900	1,086,640.00	0.91
56	600348	华阳股份	108,800	1,083,648.00	0.91
57	002065	东华软件	239,700	1,083,444.00	0.91
58	002500	山西证券	227,800	1,070,660.00	0.90
59	000039	中集集团	115,300	1,067,678.00	0.89
60	603786	科博达	16,400	1,052,060.00	0.88
61	002738	中矿资源	37,300	999,640.00	0.84
62	600827	百联股份	133,200	983,016.00	0.82
63	000729	燕京啤酒	111,200	981,896.00	0.82
64	600177	雅戈尔	130,700	930,584.00	0.78
65	600863	内蒙华电	199,600	926,144.00	0.78
66	000987	越秀资本	182,700	906,192.00	0.76
67	600271	航天信息	117,800	867,008.00	0.73
68	002195	岩山科技	318,200	798,682.00	0.67
69	600909	华安证券	189,000	795,690.00	0.67
70	601016	节能风电	264,700	791,453.00	0.66
71	002078	太阳纸业	46,300	645,885.00	0.54
72	300146	汤臣倍健	43,900	594,845.00	0.50
73	000830	鲁西化工	47,700	552,843.00	0.46
74	002831	裕同科技	21,600	552,744.00	0.46
75	002372	伟星新材	34,100	525,822.00	0.44
76	600481	双良节能	98,400	459,528.00	0.38
77	600315	上海家化	25,000	444,500.00	0.37
78	601555	东吴证券	73,300	432,470.00	0.36
79	300861	美畅股份	22,000	425,700.00	0.36
80	600352	浙江龙盛	48,400	415,756.00	0.35
81	002185	华天科技	47,100	383,865.00	0.32
82	002558	巨人网络	29,700	280,368.00	0.23
83	002497	雅化集团	30,600	272,952.00	0.23
84	000703	恒逸石化	36,000	255,240.00	0.21
85	601966	玲珑轮胎	13,400	246,158.00	0.21
86	002624	完美世界	30,500	231,800.00	0.19
87	300383	光环新网	26,400	223,080.00	0.19
88	000060	中金岭南	52,200	221,328.00	0.19
89	601158	重庆水务	45,900	220,320.00	0.18
90	600060	海信视像	8,100	200,394.00	0.17
91	688063	派能科技	5,000	198,550.00	0.17
92	002203	海亮股份	23,700	189,126.00	0.16
93	600126	杭钢股份	43,400	178,374.00	0.15
94	600820	隧道股份	25,100	163,903.00	0.14
95	600521	华海药业	9,400	160,270.00	0.13
96	603456	九洲药业	10,400	142,688.00	0.12

97	600848	上海临港	13,700	124,807.00	0.10
98	002153	石基信息	17,240	98,785.20	0.08
99	000959	首钢股份	27,800	75,616.00	0.06
100	688375	国博电子	800	56,512.00	0.05
101	600801	华新水泥	700	9,625.00	0.01
102	002429	兆驰股份	100	481.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	000970	中科三环	166,425	1,273,151.25	1.07
2	600556	天下秀	314,900	1,146,236.00	0.96
3	600941	中国移动	10,600	1,139,500.00	0.95
4	603366	日出东方	313,600	1,119,552.00	0.94
5	300259	新天科技	442,100	1,118,513.00	0.94
6	300639	凯普生物	243,000	1,117,800.00	0.94
7	002228	合兴包装	476,900	1,115,946.00	0.93
8	300026	红日药业	361,100	1,101,355.00	0.92
9	002030	达安基因	219,100	1,095,500.00	0.92
10	688033	天宜上佳	181,600	1,089,600.00	0.91
11	688553	汇宇制药	87,400	1,085,508.00	0.91
12	601778	晶科科技	475,000	1,083,000.00	0.91
13	300504	天邑股份	85,600	1,043,464.00	0.87
14	301090	华润材料	144,900	953,442.00	0.80
15	000968	蓝焰控股	118,900	756,204.00	0.63
16	601668	中国建筑	77,900	413,649.00	0.35
17	002649	博彦科技	45,600	362,976.00	0.30
18	603758	秦安股份	41,300	313,880.00	0.26
19	600050	中国联通	60,400	283,880.00	0.24
20	688588	凌志软件	31,000	212,350.00	0.18
21	688728	格科微	15,000	181,650.00	0.15
22	605068	明新旭腾	5,900	77,762.00	0.07
23	601728	中国电信	3,800	23,370.00	0.02
24	002010	传化智联	2,900	11,136.00	0.01

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	002065	东华软件	5,781,692.00	10.92
2	688002	睿创微纳	5,059,767.81	9.56
3	300088	长信科技	4,950,202.00	9.35

4	603456	九洲药业	4,900,957.00	9.26
5	600497	驰宏锌锗	4,498,323.86	8.49
6	600517	国网英大	4,396,224.00	8.30
7	002558	巨人网络	4,386,697.00	8.28
8	601958	金钼股份	4,321,025.00	8.16
9	300639	凯普生物	4,169,620.00	7.87
10	601997	贵阳银行	4,123,432.00	7.79
11	600901	江苏金租	4,088,322.00	7.72
12	002153	石基信息	3,953,045.60	7.47
13	688029	南微医学	3,840,325.41	7.25
14	000636	风华高科	3,819,545.00	7.21
15	600399	抚顺特钢	3,740,338.00	7.06
16	002563	森马服饰	3,703,160.00	6.99
17	601577	长沙银行	3,675,563.00	6.94
18	603517	绝味食品	3,675,218.00	6.94
19	002092	ST 中泰	3,592,290.00	6.78
20	002185	华天科技	3,563,179.00	6.73
21	000623	吉林敖东	3,493,642.12	6.60
22	601555	东吴证券	3,417,307.32	6.45
23	000887	中鼎股份	3,380,877.00	6.38
24	000547	航天发展	3,360,489.00	6.35
25	000937	冀中能源	3,314,100.00	6.26
26	002008	大族激光	3,286,658.00	6.21
27	300296	利亚德	3,284,922.00	6.20
28	603267	鸿远电子	3,284,830.00	6.20
29	002056	横店东磁	3,196,910.00	6.04
30	605358	立昂微	3,135,166.00	5.92
31	002128	电投能源	3,093,871.64	5.84
32	600642	申能股份	3,085,432.00	5.83
33	600380	健康元	3,076,106.00	5.81
34	000027	深圳能源	3,072,452.00	5.80
35	000581	威孚高科	3,070,159.00	5.80
36	000553	安道麦 A	3,010,509.00	5.69
37	600704	物产中大	3,003,248.00	5.67
38	688772	珠海冠宇	2,988,936.10	5.64
39	600739	辽宁成大	2,953,664.00	5.58
40	000703	恒逸石化	2,946,622.00	5.56
41	300383	光环新网	2,934,824.00	5.54
42	600959	江苏有线	2,928,207.00	5.53
43	688234	天岳先进	2,889,955.51	5.46
44	002203	海亮股份	2,875,105.00	5.43
45	688819	天能股份	2,847,354.88	5.38
46	300776	帝尔激光	2,799,255.40	5.29

47	002223	鱼跃医疗	2,783,710.00	5.26
48	000970	中科三环	2,778,754.00	5.25
49	002266	浙富控股	2,776,378.00	5.24
50	600637	东方明珠	2,751,297.00	5.20
51	000960	锡业股份	2,751,282.00	5.20
52	000050	深天马 A	2,733,649.00	5.16
53	002010	传化智联	2,729,742.54	5.16
54	000060	中金岭南	2,728,316.00	5.15
55	600143	金发科技	2,719,087.00	5.13
56	002472	双环传动	2,693,597.00	5.09
57	000959	首钢股份	2,687,526.00	5.08
58	688276	百克生物	2,658,526.28	5.02
59	600498	烽火通信	2,646,829.00	5.00
60	002195	岩山科技	2,595,401.00	4.90
61	600352	浙江龙盛	2,561,278.00	4.84
62	002683	广东宏大	2,546,760.00	4.81
63	601058	赛轮轮胎	2,540,970.00	4.80
64	601077	渝农商行	2,531,459.80	4.78
65	600500	中化国际	2,511,270.00	4.74
66	600663	陆家嘴	2,505,916.36	4.73
67	601231	环旭电子	2,503,324.00	4.73
68	002025	航天电器	2,503,234.50	4.73
69	603185	弘元绿能	2,502,016.91	4.72
70	300682	朗新集团	2,472,734.00	4.67
71	000739	普洛药业	2,441,184.28	4.61
72	002120	韵达股份	2,431,510.00	4.59
73	603882	金域医学	2,410,086.00	4.55
74	300558	贝达药业	2,371,957.00	4.48
75	600879	航天电子	2,367,208.00	4.47
76	300504	天邑股份	2,318,873.76	4.38
77	600348	华阳股份	2,298,511.00	4.34
78	688028	沃尔德	2,294,467.54	4.33
79	300451	创业慧康	2,289,344.00	4.32
80	600967	内蒙一机	2,285,071.00	4.32
81	605068	明新旭腾	2,281,419.00	4.31
82	688425	铁建重工	2,259,382.30	4.27
83	600598	北大荒	2,255,301.00	4.26
84	002500	山西证券	2,253,934.00	4.26
85	600008	首创环保	2,241,820.40	4.23
86	600597	光明乳业	2,241,395.00	4.23
87	601990	南京证券	2,232,649.00	4.22
88	600392	盛和资源	2,169,174.00	4.10
89	600261	阳光照明	2,155,689.00	4.07

90	300551	古鳌科技	2,150,805.00	4.06
91	600859	王府井	2,131,363.00	4.02
92	688571	杭华股份	2,128,393.18	4.02
93	600377	宁沪高速	2,125,895.32	4.01
94	002506	协鑫集成	2,117,743.00	4.00
95	601611	中国核建	2,105,815.00	3.98
96	002300	太阳电缆	2,095,397.20	3.96
97	002465	海格通信	2,052,054.00	3.88
98	601158	重庆水务	2,027,641.98	3.83
99	300850	新强联	2,020,543.00	3.82
100	002044	美年健康	2,018,103.00	3.81
101	600909	华安证券	2,015,841.00	3.81
102	600271	航天信息	2,000,331.00	3.78
103	002032	苏泊尔	1,993,823.00	3.77
104	300136	信维通信	1,982,895.00	3.74
105	600699	均胜电子	1,967,353.00	3.72
106	600511	国药股份	1,955,531.00	3.69
107	601636	旗滨集团	1,950,677.00	3.68
108	000987	越秀资本	1,943,975.00	3.67
109	600827	百联股份	1,934,850.00	3.65
110	600329	达仁堂	1,933,173.15	3.65
111	002244	滨江集团	1,931,479.00	3.65
112	600095	湘财股份	1,920,907.16	3.63
113	688375	国博电子	1,914,081.21	3.61
114	688588	凌志软件	1,911,016.98	3.61
115	688690	纳微科技	1,903,640.12	3.59
116	600873	梅花生物	1,900,006.00	3.59
117	600390	五矿资本	1,887,385.00	3.56
118	002531	天顺风能	1,842,643.00	3.48
119	603688	石英股份	1,836,326.00	3.47
120	002399	海普瑞	1,822,738.00	3.44
121	688133	泰坦科技	1,821,203.65	3.44
122	000039	中集集团	1,811,266.00	3.42
123	002390	信邦制药	1,804,605.00	3.41
124	300357	我武生物	1,799,837.00	3.40
125	603218	日月股份	1,794,197.00	3.39
126	000559	万向钱潮	1,780,155.00	3.36
127	601098	中南传媒	1,776,299.00	3.35
128	002135	东南网架	1,770,589.00	3.34
129	600885	宏发股份	1,760,867.00	3.33
130	600546	山煤国际	1,759,469.00	3.32
131	688220	翱捷科技	1,757,882.96	3.32
132	603228	景旺电子	1,740,530.00	3.29

133	600941	中国移动	1,732,261.00	3.27
134	002078	太阳纸业	1,726,063.00	3.26
135	688586	江航装备	1,725,306.87	3.26
136	002384	东山精密	1,702,049.00	3.21
137	688728	格科微	1,700,426.67	3.21
138	002783	凯龙股份	1,682,605.00	3.18
139	000825	太钢不锈	1,679,574.00	3.17
140	603613	国联股份	1,675,160.00	3.16
141	002228	合兴包装	1,662,431.00	3.14
142	301029	怡合达	1,639,003.00	3.10
143	600063	皖维高新	1,611,029.00	3.04
144	002497	雅化集团	1,598,947.13	3.02
145	601216	君正集团	1,596,730.00	3.02
146	603758	秦安股份	1,596,353.00	3.01
147	688536	思瑞浦	1,594,877.11	3.01
148	600435	北方导航	1,586,720.00	3.00
149	000156	华数传媒	1,585,870.00	2.99
150	002539	云图控股	1,564,790.00	2.96
151	600004	白云机场	1,559,840.00	2.95
152	000728	国元证券	1,555,490.00	2.94
153	002511	中顺洁柔	1,547,953.40	2.92
154	002340	格林美	1,527,067.00	2.88
155	002468	申通快递	1,523,607.00	2.88
156	000738	航发控制	1,519,712.00	2.87
157	688387	信科移动	1,518,720.24	2.87
158	300001	特锐德	1,514,653.00	2.86
159	603233	大参林	1,495,127.76	2.82
160	002131	利欧股份	1,486,095.00	2.81
161	601966	玲珑轮胎	1,480,337.00	2.80
162	600867	通化东宝	1,479,346.00	2.79
163	688521	芯原股份	1,471,724.11	2.78
164	000830	鲁西化工	1,470,451.00	2.78
165	600927	永安期货	1,451,662.00	2.74
166	601778	晶科科技	1,446,044.00	2.73
167	600528	中铁工业	1,440,540.00	2.72
168	603697	有友食品	1,437,514.00	2.71
169	688312	燕麦科技	1,426,882.49	2.69
170	600765	中航重机	1,426,694.00	2.69
171	002156	通富微电	1,425,118.00	2.69
172	002240	盛新锂能	1,419,559.00	2.68
173	600350	山东高速	1,413,259.00	2.67
174	688281	华秦科技	1,410,525.02	2.66
175	688385	复旦微电	1,410,027.36	2.66

176	000402	金融街	1,409,280.00	2.66
177	600556	天下秀	1,406,662.00	2.66
178	000893	亚钾国际	1,403,533.00	2.65
179	601928	凤凰传媒	1,397,528.00	2.64
180	688553	汇宇制药	1,397,275.12	2.64
181	603366	日出东方	1,389,877.00	2.62
182	300259	新天科技	1,389,241.00	2.62
183	600219	南山铝业	1,385,618.00	2.62
184	300506	*ST 名家	1,384,448.00	2.61
185	300595	欧普康视	1,382,991.00	2.61
186	600486	扬农化工	1,382,456.00	2.61
187	688033	天宜上佳	1,367,246.53	2.58
188	002276	万马股份	1,349,874.00	2.55
189	688105	诺唯赞	1,349,028.55	2.55
190	603883	老百姓	1,326,966.00	2.51
191	600731	湖南海利	1,309,422.00	2.47
192	000530	冰山冷热	1,307,190.00	2.47
193	603786	科博达	1,300,601.00	2.46
194	601139	深圳燃气	1,289,178.00	2.43
195	002439	启明星辰	1,287,402.29	2.43
196	600299	安迪苏	1,286,985.00	2.43
197	000729	燕京啤酒	1,281,597.00	2.42
198	002743	富煌钢构	1,277,876.00	2.41
199	000933	神火股份	1,262,842.00	2.38
200	601677	明泰铝业	1,257,588.00	2.37
201	603737	三棵树	1,242,409.00	2.35
202	688528	秦川物联	1,232,040.91	2.33
203	300253	卫宁健康	1,219,550.00	2.30
204	603927	中科软	1,216,321.00	2.30
205	600481	双良节能	1,214,086.00	2.29
206	002138	顺络电子	1,211,544.00	2.29
207	600491	龙元建设	1,210,867.00	2.29
208	002030	达安基因	1,207,403.00	2.28
209	300026	红日药业	1,204,926.00	2.28
210	001203	大中矿业	1,204,024.68	2.27
211	600315	上海家化	1,193,854.00	2.25
212	601717	郑煤机	1,192,823.00	2.25
213	603355	莱克电气	1,187,672.00	2.24
214	300860	锋尚文化	1,187,555.00	2.24
215	600580	卧龙电驱	1,186,859.00	2.24
216	603987	康德莱	1,175,692.00	2.22
217	600835	上海机电	1,160,323.00	2.19
218	003031	中瓷电子	1,150,680.00	2.17

219	300009	安科生物	1,146,139.33	2.16
220	002608	江苏国信	1,135,789.00	2.14
221	600141	兴发集团	1,134,709.00	2.14
222	600066	宇通客车	1,128,207.00	2.13
223	600863	内蒙华电	1,128,080.00	2.13
224	600862	中航高科	1,101,619.00	2.08
225	688209	英集芯	1,099,074.80	2.08
226	300416	苏试试验	1,093,319.00	2.06
227	600105	永鼎股份	1,090,874.00	2.06
228	600032	浙江新能	1,089,600.00	2.06
229	600177	雅戈尔	1,088,835.00	2.06
230	002645	华宏科技	1,088,505.00	2.06
231	688208	道通科技	1,084,486.00	2.05
232	000878	云南铜业	1,071,204.00	2.02
233	002422	科伦药业	1,065,303.00	2.01
234	002738	中矿资源	1,063,363.00	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	002065	东华软件	4,799,433.00	9.06
2	601958	金钼股份	4,484,599.00	8.47
3	002558	巨人网络	4,316,672.00	8.15
4	603456	九洲药业	4,221,127.00	7.97
5	688002	睿创微纳	3,963,970.96	7.49
6	600399	抚顺特钢	3,721,378.00	7.03
7	002153	石基信息	3,697,504.00	6.98
8	000623	吉林敖东	3,688,063.70	6.96
9	600642	申能股份	3,685,900.00	6.96
10	688029	南微医学	3,665,047.35	6.92
11	002185	华天科技	3,656,865.00	6.91
12	603517	绝味食品	3,642,619.00	6.88
13	601058	赛轮轮胎	3,565,601.00	6.73
14	600497	驰宏锌锗	3,469,666.00	6.55
15	600517	国网英大	3,381,528.00	6.39
16	300088	长信科技	3,342,061.00	6.31
17	603267	鸿远电子	3,337,446.00	6.30
18	688772	珠海冠宇	3,261,856.42	6.16
19	002683	广东宏大	3,214,920.00	6.07
20	600739	辽宁成大	3,210,923.00	6.06

21	600637	东方明珠	3,189,048.48	6.02
22	300776	帝尔激光	3,168,246.00	5.98
23	000547	航天发展	3,140,275.00	5.93
24	600901	江苏金租	3,110,506.62	5.87
25	605358	立昂微	3,104,557.00	5.86
26	000960	锡业股份	3,086,711.00	5.83
27	000636	风华高科	3,079,300.02	5.82
28	000581	威孚高科	3,030,516.50	5.72
29	000553	安道麦 A	3,026,509.00	5.72
30	688234	天岳先进	3,020,035.82	5.70
31	600498	烽火通信	3,005,795.00	5.68
32	002092	ST 中泰	2,988,214.00	5.64
33	601555	东吴证券	2,873,403.34	5.43
34	002120	韵达股份	2,845,406.00	5.37
35	000887	中鼎股份	2,763,708.00	5.22
36	300639	凯普生物	2,756,458.00	5.21
37	300383	光环新网	2,738,235.00	5.17
38	002203	海亮股份	2,732,755.00	5.16
39	601997	贵阳银行	2,709,882.00	5.12
40	000703	恒逸石化	2,641,447.00	4.99
41	300682	朗新集团	2,619,302.00	4.95
42	000959	首钢股份	2,581,995.00	4.88
43	002010	传化智联	2,570,290.00	4.85
44	000739	普洛药业	2,557,049.70	4.83
45	300558	贝达药业	2,555,385.00	4.83
46	601636	旗滨集团	2,531,212.00	4.78
47	601577	长沙银行	2,502,053.00	4.73
48	000050	深天马 A	2,493,869.00	4.71
49	002563	森马服饰	2,475,609.00	4.68
50	002025	航天电器	2,452,259.78	4.63
51	301029	怡合达	2,361,507.00	4.46
52	000060	中金岭南	2,320,374.00	4.38
53	603185	弘元绿能	2,310,759.00	4.36
54	002128	电投能源	2,280,442.00	4.31
55	600392	盛和资源	2,273,088.00	4.29
56	000937	冀中能源	2,264,386.00	4.28
57	600500	中化国际	2,257,108.00	4.26
58	603218	日月股份	2,245,085.54	4.24
59	603228	景旺电子	2,244,265.00	4.24
60	002223	鱼跃医疗	2,232,555.00	4.22
61	002032	苏泊尔	2,211,415.00	4.18
62	002384	东山精密	2,164,551.00	4.09
63	688028	沃尔德	2,149,525.79	4.06

64	600597	光明乳业	2,124,250.00	4.01
65	300357	我武生物	2,119,949.00	4.00
66	300451	创业慧康	2,110,943.80	3.99
67	002244	滨江集团	2,097,485.00	3.96
68	600546	山煤国际	2,088,395.00	3.94
69	002056	横店东磁	2,070,663.00	3.91
70	000728	国元证券	2,066,720.00	3.90
71	600859	王府井	2,026,568.00	3.83
72	600352	浙江龙盛	2,017,386.00	3.81
73	002506	协鑫集成	2,012,570.00	3.80
74	600261	阳光照明	2,003,170.00	3.78
75	000559	万向钱潮	1,987,828.20	3.75
76	300136	信维通信	1,978,664.00	3.74
77	600380	健康元	1,959,011.00	3.70
78	600959	江苏有线	1,954,115.00	3.69
79	605068	明新旭腾	1,943,284.00	3.67
80	600390	五矿资本	1,943,144.00	3.67
81	601158	重庆水务	1,914,550.00	3.62
82	600704	物产中大	1,904,287.85	3.60
83	002399	海普瑞	1,903,558.00	3.59
84	300850	新强联	1,899,570.00	3.59
85	002300	太阳电缆	1,898,577.14	3.59
86	300001	特锐德	1,885,022.00	3.56
87	688385	复旦微电	1,884,051.93	3.56
88	688571	杭华股份	1,846,655.77	3.49
89	600095	湘财股份	1,845,692.00	3.49
90	002008	大族激光	1,828,954.00	3.45
91	601098	中南传媒	1,828,470.00	3.45
92	600511	国药股份	1,823,787.00	3.44
93	002044	美年健康	1,807,933.00	3.41
94	000027	深圳能源	1,800,638.00	3.40
95	002131	利欧股份	1,795,674.00	3.39
96	000156	华数传媒	1,787,613.00	3.38
97	300296	利亚德	1,783,267.00	3.37
98	688375	国博电子	1,770,301.64	3.34
99	688536	思瑞浦	1,756,418.00	3.32
100	603613	国联股份	1,755,438.44	3.32
101	688690	纳微科技	1,746,980.47	3.30
102	002468	申通快递	1,741,950.00	3.29
103	688586	江航装备	1,706,351.35	3.22
104	002195	岩山科技	1,691,794.00	3.19
105	002783	凯龙股份	1,690,807.00	3.19
106	600765	中航重机	1,684,020.00	3.18

107	002135	东南网架	1,680,011.00	3.17
108	603927	中科软	1,675,639.00	3.16
109	002340	格林美	1,674,010.00	3.16
110	002511	中顺洁柔	1,670,037.84	3.15
111	688276	百克生物	1,669,439.80	3.15
112	601231	环旭电子	1,666,904.00	3.15
113	002390	信邦制药	1,660,618.00	3.14
114	688133	泰坦科技	1,645,094.80	3.11
115	688220	翱捷科技	1,630,768.63	3.08
116	600927	永安期货	1,629,529.00	3.08
117	000970	中科三环	1,627,856.00	3.07
118	300009	安科生物	1,624,180.86	3.07
119	600663	陆家嘴	1,619,339.00	3.06
120	601966	玲珑轮胎	1,613,126.00	3.05
121	002266	浙富控股	1,601,980.00	3.03
122	000825	太钢不锈	1,597,225.00	3.02
123	601717	郑煤机	1,594,646.00	3.01
124	600066	宇通客车	1,594,055.00	3.01
125	000402	金融街	1,587,137.00	3.00
126	688312	燕麦科技	1,563,430.20	2.95
127	688588	凌志软件	1,559,739.18	2.95
128	600141	兴发集团	1,559,392.00	2.94
129	688105	诺唯赞	1,552,726.91	2.93
130	600063	皖维高新	1,548,478.00	2.92
131	601677	明泰铝业	1,541,743.00	2.91
132	688819	天能股份	1,532,255.59	2.89
133	600004	白云机场	1,524,544.00	2.88
134	688281	华秦科技	1,521,334.00	2.87
135	601139	深圳燃气	1,521,271.00	2.87
136	601928	凤凰传媒	1,520,609.00	2.87
137	600435	北方导航	1,508,373.00	2.85
138	688387	信科移动	1,503,010.76	2.84
139	002539	云图控股	1,496,350.00	2.83
140	688728	格科微	1,488,527.61	2.81
141	002156	通富微电	1,486,429.00	2.81
142	600528	中铁工业	1,484,208.00	2.80
143	603355	莱克电气	1,481,008.00	2.80
144	600867	通化东宝	1,478,643.00	2.79
145	002472	双环传动	1,477,763.00	2.79
146	600219	南山铝业	1,464,728.00	2.77
147	600580	卧龙电驱	1,449,294.00	2.74
148	002645	华宏科技	1,441,097.00	2.72
149	600862	中航高科	1,437,303.00	2.71

150	600909	华安证券	1,433,953.00	2.71
151	300595	欧普康视	1,426,727.00	2.69
152	688208	道通科技	1,414,280.00	2.67
153	000933	神火股份	1,407,224.00	2.66
154	000089	深圳机场	1,404,331.00	2.65
155	300551	古鳌科技	1,395,331.00	2.64
156	002422	科伦药业	1,369,740.72	2.59
157	002276	万马股份	1,347,795.00	2.55
158	603883	老百姓	1,327,066.00	2.51
159	600755	厦门国贸	1,322,442.00	2.50
160	603697	有友食品	1,320,395.00	2.49
161	002273	水晶光电	1,312,072.00	2.48
162	600418	江淮汽车	1,307,785.00	2.47
163	600161	天坛生物	1,293,630.00	2.44
164	600377	宁沪高速	1,289,094.00	2.43
165	003031	中瓷电子	1,282,331.00	2.42
166	000530	冰山冷热	1,275,135.00	2.41
167	603000	人民网	1,267,208.00	2.39
168	000893	亚钾国际	1,267,164.00	2.39
169	603317	天味食品	1,261,600.00	2.38
170	600731	湖南海利	1,257,383.00	2.37
171	600348	华阳股份	1,254,788.00	2.37
172	600879	航天电子	1,249,943.00	2.36
173	601168	西部矿业	1,231,518.00	2.33
174	000750	国海证券	1,220,329.00	2.30
175	002743	富煌钢构	1,218,514.00	2.30
176	600737	中粮糖业	1,211,754.00	2.29
177	600491	龙元建设	1,202,005.00	2.27
178	002608	江苏国信	1,201,625.00	2.27
179	600271	航天信息	1,197,076.00	2.26
180	002497	雅化集团	1,195,152.00	2.26
181	603893	瑞芯微	1,192,009.00	2.25
182	600835	上海机电	1,181,450.00	2.23
183	603737	三棵树	1,170,806.00	2.21
184	300416	苏试试验	1,163,666.00	2.20
185	002028	思源电气	1,162,756.00	2.20
186	600143	金发科技	1,162,460.00	2.20
187	300504	天邑股份	1,156,171.00	2.18
188	000878	云南铜业	1,152,617.00	2.18
189	600155	华创云信	1,129,523.00	2.13
190	688209	英集芯	1,116,544.00	2.11
191	688521	芯原股份	1,115,462.06	2.11
192	300860	锋尚文化	1,113,407.00	2.10

193	688528	秦川物联	1,112,908.99	2.10
194	603306	华懋科技	1,090,210.00	2.06
195	000039	中集集团	1,072,320.00	2.03
196	600032	浙江新能	1,068,658.00	2.02
197	300395	菲利华	1,066,524.00	2.01
198	603338	浙江鼎力	1,060,662.00	2.00

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	604,385,507.96
卖出股票收入（成交）总额	523,496,225.96

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

本基金可投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

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

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

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：

贵阳银行股份有限公司因违法违规被国家金融监督管理总局贵州监管局处罚。

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	118,022.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,373,496.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,491,519.27

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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 (%)
民生加银中证 500 指数增强发起式 A	1,688	79,526.98	11,373,966.33	8.47	122,867,582.15	91.53
民生加银中证 500 指数增强发起式 C	3,231	15,743.31	19,438,062.72	38.21	31,428,562.21	61.79
合计	4,919	37,631.26	30,812,029.05	16.65	154,296,144.36	83.35

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	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	44,582.21	0.0332
	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	2,824.59	0.0056
	合计	47,406.80	0.0256

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	0
	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	0~10

	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,500.25	5.40	10,002,500.25	5.40	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	不少于 3 年
基金经理等人员	10,352.25	0.01	-	-	不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	不少于 3 年
其他	-	-	-	-	不少于 3 年
合计	10,012,852.50	5.41	10,002,500.25	5.40	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	民生加银中证 500 指数增强发起式 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 10 日) 基金份额总额	58,275,142.80	30,413,384.97
本报告期期初基金份额总额	53,009,690.54	19,777,583.58
本报告期基金总申购份额	355,787,301.28	86,960,899.19
减：本报告期基金总赎回份额	274,555,443.34	55,871,857.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	134,241,548.48	50,866,624.93

§ 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 2024 年 3 月 5 日发布公告，自 2024 年 3 月 4 日起宋永明先生不再担任公司副总经理。

本报告期内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：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
国盛证券	2	796,693,091.65	70.64	265,863.27	57.41	-
兴业证券	1	120,381,451.26	10.67	89,791.30	19.39	-
财信证券	3	119,313,374.57	10.58	40,072.85	8.65	-
中信证券	2	91,493,816.	8.11	67,330.90	14.54	-

		44				
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	5	-	-	-	-	-

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，能及时为投资组合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，并能根据投资组合投资的特定要求，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，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

v 具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理投资组合进行证券交易的要求，并能为基金公司投资提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③本基金在本报告期由托管结算模式转换为券商结算模式，本基金管理人选择财信证券、国盛证券作为证券经纪商，新增财信证券、国盛证券上海、深圳交易单元各一个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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 (%)
国盛证券	2,011,484.00	100.00	-	-	-	-

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
财信证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分开放式基金增加财信证券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	2024 年 1 月 11 日
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
4	关于民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 2 日
5	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 2 日
6	关于民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 7 日
7	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 7 日

	(2024 年第 1 号)		
8	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
9	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
10	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
11	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
12	关于旗下部分开放式基金增加财咨道信息技术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	2024 年 5 月 17 日
13	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 24 日
14	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 24 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) 中国证监会准予基金注册的文件；
- (2) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式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

2024 年 8 月 30 日