

民生加银新能源智选混合型发起式证券投资
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48

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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	民生加银新能源智选混合发起	
基金主代码	013371	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,379,449.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C
下属分级基金的交易代码	013371	013372
报告期末下属分级基金的份额总额	24,424,273.58 份	12,955,176.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型筛选新能源产业中具有长期竞争力的上市公司，在严格控制风险和保证良好流动性的前提下，力争获取相对业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略。其中大类资产配置策略： 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。
业绩比较基准	中证新能源指数收益率*75%+中债新综合财富指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘静
	联系电话	0755-23999841
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn
客户服务电话	400-8888-388	95558
传真	0755-23999800	010-85230024
注册地址	深圳市福田区莲花街道福中三路	北京市朝阳区光华路 10 号院 1

	2005 号民生金融大厦 13 楼 13A	号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	518038	100020
法定代表人	郑智军	方合英

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)	
	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C
本期已实现收益	-4,415,961.23	-2,302,769.58
本期利润	-1,898,558.66	-1,025,303.77
加权平均基金份 额本期利润	-0.0760	-0.0785
本期加权平均净 值利润率	-14.41%	-15.05%
本期基金份额净 值增长率	-13.29%	-13.46%
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	-12,392,094.45	-6,643,110.16
期末可供分配基 金份额利润	-0.5074	-0.5128

期末基金资产净值	12,032,179.13	6,312,066.21
期末基金份额净值	0.4926	0.4872
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	-50.74%	-51.28%

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

民生加银新能源智选混合发起 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	-6.01%	0.93%	-9.19%	0.84%	3.18%	0.09%
过去三个月	-8.40%	1.25%	-11.02%	1.20%	2.62%	0.05%
过去六个月	-13.29%	1.44%	-13.74%	1.39%	0.45%	0.05%
过去一年	-31.23%	1.28%	-31.40%	1.24%	0.17%	0.04%
自基金合同生效起至今	-50.74%	1.38%	-49.33%	1.41%	-1.41%	-0.03%

民生加银新能源智选混合发起 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	-6.04%	0.93%	-9.19%	0.84%	3.15%	0.09%
过去三个月	-8.49%	1.25%	-11.02%	1.20%	2.53%	0.05%
过去六个月	-13.46%	1.44%	-13.74%	1.39%	0.28%	0.05%

过去一年	-31.51%	1.28%	-31.40%	1.24%	-0.11%	0.04%
自基金合同生效起至今	-51.28%	1.38%	-49.33%	1.41%	-1.95%	-0.03%

注：业绩比较基准=中证新能源指数收益率*75%+中债新综合财富指数收益率*25%

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

民生加银新能源智选混合发起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



民生加银新能源智选混合发起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 9 月 28 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		
何江	本基金基金经理、量化投资部总监	2021 年 9 月 28 日	-	19 年	清华大学流体力学硕士，19 年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、公司投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2019 年 12 月至今担任民生加银沪深 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基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 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 2022 年 2 月至今担任民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 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 3 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 2024 年 3 月至今担任民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理。自 2020 年 12 月至 2023 年 6 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；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月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 2022 年 6 月至 2023 年 6 月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。
--	--	--	--	--	---

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

2024 年上半年,全球制造业 PMI 持续在扩张区间,外部需求总体较好。欧美的通胀水平下行,瑞士央行、欧洲央行开启降息,市场主流预期美联储也将于年内降息。上半年,国内 GDP 同比增长 5.0%,经济运行总体平稳。二季度经济增长水平较一季度有所回落,反映出当前经济仍然面临一些挑战,特别是国内有效需求不足的问题比较突出,地产行业的显著改善仍然需要一些时间。

2024 年上半年,万得全 A 指数下跌 8.01%。银行、煤炭和石油石化等行业涨幅靠前,综合、消费者服务和计算机等行业跌幅靠前,稳定风格相对占优。

报告期内,本基金根据量化多因子模型构建股票组合。组合在阿尔法因子层面上进行优化配置,并严格控制行业、市值等风险暴露,做好跟踪误差的控制。

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新能源智选混合发起 A 的基金份额净值为 0.4926 元,本报告期基金份额净值增长率为-13.29%,同期业绩比较基准收益率为-13.74%;截至本报告期末民生加银新能源智选混合发起 C 的基金份额净值为 0.4872 元,本报告期基金份额净值增长率为-13.46%,同期业绩比较基准收益率为-13.74%。

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 2024 年下半年,全球经济或仍处于温和复苏进程中,新兴市场国家有望呈现较快的复苏势头,而发达经济体可能面临更多挑战,美联储降息时点的不确定性仍将对全球经济产生重要影响。国内方面,经济增速将保持在合理区间,高技术制造业和装备制造业将继续保持较快增速。宏观经济政策将对经济增速形成托底。

6 月底,万得全 A 指数的市盈率(TTM)在 16 倍左右水平,处在历史较低位置,整体市场估值具有较好的性价比。在经济不确定性预期和低利率环境下,市场或将持续关注确定性强的红利资产。人工智能技术快速发展,相关板块值得长期关注。

6 月底,中证新能指数的市盈率(TTM)在 18 倍左右水平,估值水平较低。行业逐步出清后,龙头公司将更具吸引力。

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。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式,谨慎合理地制定了基

金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究各部门参加人员应包含相关行业研究员及固定收益信评人员。分管运营的公司领导任估值委员会主席。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 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》第四十一条第一款之规定。

§ 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，民生加银基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，民生加银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：民生加银新能源智选混合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	3,213,542.02	4,253,873.79
结算备付金		118,932.29	24,348.01
存出保证金		3,197.75	3,124.53
交易性金融资产	6.4.7.2	15,125,370.24	17,444,064.81
其中：股票投资		15,125,370.24	17,444,064.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,769.39	4,693.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		18,464,811.69	21,730,105.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
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		-	-
应付赎回款		4,517.16	197,083.19

应付管理人报酬		18,866.73	21,487.69
应付托管费		3,144.46	3,581.30
应付销售服务费		2,186.61	2,390.80
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	91,851.39	43,452.35
负债合计		120,566.35	267,995.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	37,379,449.95	37,893,161.64
未分配利润	6.4.7.12	-19,035,204.61	-16,431,051.87
净资产合计		18,344,245.34	21,462,109.77
负债和净资产总计		18,464,811.69	21,730,105.10

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 37,379,449.95 份，其中民生加银新能源智选混合发起 A 的基金份额净值为 0.4926 元，份额总额为 24,424,273.58 份；其中民生加银新能源智选混合发起 C 的基金份额净值为 0.4872 元，份额总额为 12,955,176.37 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银新能源智选混合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		-2,735,970.59	-2,079,703.39
1. 利息收入		6,413.77	5,087.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,315.69	4,151.09
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		2,098.08	936.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,539,289.79	-2,152,212.42
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,690,498.95	-2,492,532.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	31,817.80
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	151,209.16	308,502.22
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	3,794,868.38	60,626.87
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	2,037.05	6,794.52
减：二、营业总支出		187,891.84	338,059.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	119,110.28	235,255.41
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,851.72	39,209.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,540.34	23,448.85
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		-	1.01
8. 其他费用	6.4.7.23	35,389.50	40,144.58
三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列)		-2,923,862.43	-2,417,762.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以 “-”号填列)		-2,923,862.43	-2,417,762.43
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,923,862.43	-2,417,762.43

6.3 净资产变动表

会计主体：民生加银新能源智选混合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	37,893,161.64	-	-16,431,051.87	21,462,109.77
二、本期期初净资产	37,893,161.64	-	-16,431,051.87	21,462,109.77
三、本期增减变动额(减少以“-”	-513,711.69	-	-2,604,152.74	-3,117,864.43

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-2,923,862.43	-2,923,862.43
(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)	-513,711.69	-	319,709.69	-194,002.00
其中：1. 基金申购款	4,642,600.78	-	-2,171,325.62	2,471,275.16
2. 基金赎回款	-5,156,312.47	-	2,491,035.31	-2,665,277.16
(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	37,379,449.95	-	-19,035,204.61	18,344,245.34
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	40,338,684.19	-	-9,256,705.45	31,081,978.74
二、本期期初净资产	40,338,684.19	-	-9,256,705.45	31,081,978.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,006,511.58	-	-2,834,991.76	-828,480.18
(一)、综合收益总额	-	-	-2,417,762.43	-2,417,762.43
(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)	2,006,511.58	-	-417,229.33	1,589,282.25
其中：1. 基金申购款	9,750,714.10	-	-2,398,193.46	7,352,520.64
2. 基金赎回款	-7,744,202.52	-	1,980,964.13	-5,763,238.39
(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	42,345,195.77	-	-12,091,697.21	30,253,498.56

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

民生加银新能源智选混合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]2588号《关于准予民生加银新能源智选混合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《民生加银新能源智选混合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46,860,244.27元。经向中国证监会备案,《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年9月28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,基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

6.4.2 会计报表的编制基础

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》、《民生加银新能源智选混合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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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	3,213,542.02
等于：本金	3,213,361.98
加：应计利息	180.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,213,542.02

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	17,209,008.58	-	15,125,370.24	-2,083,638.34
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	17,209,008.58	-	15,125,370.24	-2,083,638.34

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：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	0.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	57,043.87
其中：交易所市场	57,043.87
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	91,851.39

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银新能源智选混合发起 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	25,167,956.16	25,167,956.16
本期申购	865,538.21	865,538.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,609,220.79	-1,609,220.79
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	24,424,273.58	24,424,273.58

民生加银新能源智选混合发起 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	12,725,205.48	12,725,205.48
本期申购	3,777,062.57	3,777,062.57
本期赎回(以“-”号填列)	-3,547,091.68	-3,547,091.68
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	12,955,176.37	12,955,176.37

注：申购含红利再投、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

民生加银新能源智选混合发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,568,956.82	-3,301,003.99	-10,869,960.81
本期期初	-7,568,956.82	-3,301,003.99	-10,869,960.81
本期利润	-4,415,961.23	2,517,402.57	-1,898,558.66
本期基金份额交易产生的变动数	336,466.82	39,958.20	376,425.02
其中：基金申购款	-334,006.58	-64,409.95	-398,416.53
基金赎回款	670,473.40	104,368.15	774,841.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,648,451.23	-743,643.22	-12,392,094.45

民生加银新能源智选混合发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,899,597.16	-1,661,493.90	-5,561,091.06
本期期初	-3,899,597.16	-1,661,493.90	-5,561,091.06
本期利润	-2,302,769.58	1,277,465.81	-1,025,303.77
本期基金份额交易产生的变动数	-41,366.94	-15,348.39	-56,715.33
其中：基金申购款	-1,528,154.04	-244,755.05	-1,772,909.09
基金赎回款	1,486,787.10	229,406.66	1,716,193.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,243,733.68	-399,376.48	-6,643,110.16

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	3,564.19
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	730.28
其他	21.22
合计	4,315.69

注：其他为保证金利息收入。

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 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	-6,690,498.95
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-6,690,498.95

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	77,539,597.61
减：卖出股票成本总额	84,066,171.09
减：交易费用	163,925.47
买卖股票差价收入	-6,690,498.95

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	151,209.16
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	151,209.16

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	3,794,868.38
股票投资	3,794,868.38
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,794,868.38

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	2,037.05
合计	2,037.05

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	582.00
合计	35,389.50

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、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：本基金本报告期内及上年度可比期间均无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	119,110.28	235,255.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	40,899.86	84,464.81
应支付基金管理人的净管理费	78,210.42	150,790.60

注：支付基金管理人民生加银基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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托管费	19,851.72	39,209.19

注：支付基金托管人中信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		
	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C	合计
民生加银基金公司	-	-	-
中国民生银行	-	-	-
中信银行	-	7,133.40	7,133.40
合计	-	7,133.40	7,133.40
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		
	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C	合计
民生加银基金公司	-	-	-

中国民生银行	-	-	-
中信银行	-	14,388.24	14,388.24
合计	-	14,388.24	14,388.24

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

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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：无。

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：无。

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	
	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 28 日）持有的基金份额	10,000,500.05	-
报告期初持有的基金份额	10,000,500.05	-
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	10,000,500.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.7540%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C

基金合同生效日（2021年9月28日）持有的基金份额	10,000,500.05	-
报告期初持有的基金份额	10,000,500.05	-
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	10,000,500.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.6166%	-

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：无。

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
中信银行	3,213,542.02	3,564.19	2,882,411.16	3,763.25

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，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：无。

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：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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，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	3,213,361.98	-	-	-	-	180.04	3,213,542.02
结算备付金	118,878.79	-	-	-	-	53.50	118,932.29
存出保证金	3,196.35	-	-	-	-	1.40	3,197.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	15,125,370.24	15,125,370.24
应收申购款	-	-	-	-	-	3,769.39	3,769.39
资产总计	3,335,437.12	-	-	-	-	15,129,374.57	18,464,811.69
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,517.16	4,517.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,866.73	18,866.73
应付托管费	-	-	-	-	-	3,144.46	3,144.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,186.61	2,186.61
其他负债	-	-	-	-	-	91,851.39	91,851.39
负债总计	-	-	-	-	-	120,566.35	120,566.35
利率敏感度缺口	3,335,437.12	-	-	-	-	15,008,808.22	18,344,245.34
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	4,253,612.98	-	-	-	-	260.81	4,253,873.79
结算备付金	24,336.13	-	-	-	-	11.88	24,348.01
存出保证金	3,122.99	-	-	-	-	1.54	3,124.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	17,444,064.81	17,444,064.81
应收申购款	-	-	-	-	-	4,693.96	4,693.96
资产总计	4,281,072.10	-	-	-	-	17,449,033.00	21,730,105.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	197,083.19	197,083.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,487.69	21,487.69
应付托管费	-	-	-	-	-	3,581.30	3,581.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,390.80	2,390.80
其他负债	-	-	-	-	-	43,452.35	43,452.35
负债总计	-	-	-	-	-	267,995.33	267,995.33
利率敏感度缺口	4,281,072.10	-	-	-	-	17,181,037.67	21,462,109.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	15,125,370.24	82.45	17,444,064.81	81.28
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	15,125,370.24	82.45	17,444,064.81	81.28

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. 本基金业绩比较 基准上升 5%	885,457.94	1,108,601.19
2. 本基金业绩比较 基准下降 5%	-885,457.94	-1,108,601.19

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	15,125,370.24	17,444,064.81
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	15,125,370.24	17,444,064.81

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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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	15,125,370.24	81.91
	其中：股票	15,125,370.24	81.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,332,474.31	18.05
8	其他各项资产	6,967.14	0.04
9	合计	18,464,811.69	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	252,262.00	1.38
C	制造业	12,486,134.48	68.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,638,856.00	8.93
E	建筑业	73,570.00	0.40
F	批发和零售业	69,440.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	36,962.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	353,327.76	1.93
J	金融业	64,825.00	0.35
K	房地产业	40,559.00	0.22
L	租赁和商务服务业	14,086.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	33,451.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	13,164.00	0.07
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	48,733.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	15,125,370.24	82.45

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	300750	宁德时代	8,300	1,494,249.00	8.15
2	601985	中国核电	66,500	708,890.00	3.86
3	300274	阳光电源	10,080	625,262.40	3.41
4	600905	三峡能源	99,800	435,128.00	2.37
5	002594	比亚迪	1,600	400,400.00	2.18
6	600089	特变电工	21,580	299,314.60	1.63
7	002340	格林美	44,900	286,013.00	1.56
8	002466	天齐锂业	7,200	215,352.00	1.17
9	605117	德业股份	2,800	208,152.00	1.13
10	603606	东方电缆	4,100	200,121.00	1.09
11	600438	通威股份	10,100	193,011.00	1.05
12	300014	亿纬锂能	4,100	163,672.00	0.89
13	002920	德赛西威	1,800	156,762.00	0.85
14	002709	天赐材料	8,800	154,528.00	0.84
15	002202	金风科技	22,300	149,856.00	0.82
16	300450	先导智能	7,640	127,053.20	0.69
17	300340	科恒股份	18,100	124,890.00	0.68
18	688330	宏力达	6,000	122,340.00	0.67
19	688663	新风光	5,200	121,004.00	0.66
20	002738	中矿资源	4,500	120,600.00	0.66
21	688148	芳源股份	28,400	119,564.00	0.65
22	001283	豪鹏科技	2,800	119,560.00	0.65

23	300341	麦克奥迪	13,600	116,688.00	0.64
24	603938	三孚股份	9,900	116,325.00	0.63
25	000690	宝新能源	22,800	116,280.00	0.63
26	300611	美力科技	15,200	115,824.00	0.63
27	002480	新筑股份	36,400	113,568.00	0.62
28	603051	鹿山新材	5,200	113,516.00	0.62
29	600819	耀皮玻璃	26,600	112,252.00	0.61
30	002631	德尔未来	30,100	107,758.00	0.59
31	600876	凯盛新能	11,100	104,784.00	0.57
32	002150	通润装备	8,400	102,732.00	0.56
33	300724	捷佳伟创	1,900	102,619.00	0.56
34	002255	海陆重工	20,900	102,201.00	0.56
35	688275	万润新能	3,400	100,028.00	0.55
36	300091	金通灵	84,700	99,099.00	0.54
37	002600	领益智造	12,500	89,000.00	0.49
38	600522	中天科技	4,600	72,910.00	0.40
39	600312	平高电气	3,700	71,965.00	0.39
40	003816	中国广核	15,100	69,913.00	0.38
41	300679	电连技术	1,700	68,391.00	0.37
42	301150	中一科技	3,800	68,286.00	0.37
43	603993	洛阳钼业	7,900	67,150.00	0.37
44	600066	宇通客车	2,600	67,080.00	0.37
45	002560	通达股份	12,000	66,000.00	0.36
46	600104	上汽集团	4,700	65,142.00	0.36
47	300648	星云股份	3,800	64,524.00	0.35
48	002139	拓邦股份	6,000	63,720.00	0.35
49	688660	电气风电	22,100	63,648.00	0.35
50	002169	智光电气	14,400	63,504.00	0.35
51	605196	华通线缆	6,000	63,120.00	0.34
52	688345	博力威	3,700	62,493.00	0.34
53	002008	大族激光	3,000	62,400.00	0.34
54	002534	西子洁能	6,200	62,062.00	0.34
55	688819	天能股份	2,600	62,036.00	0.34
56	002227	奥特迅	7,700	61,908.00	0.34
57	688529	豪森智能	4,605	61,891.20	0.34
58	688707	振华新材	6,300	61,362.00	0.33
59	688733	壹石通	4,100	61,295.00	0.33
60	603906	龙蟠科技	7,800	60,762.00	0.33
61	002196	方正电机	14,200	59,498.00	0.32
62	688392	骄成超声	1,400	59,416.00	0.32
63	603398	沐邦高科	3,800	59,318.00	0.32
64	300082	奥克股份	13,900	59,214.00	0.32
65	002866	传艺科技	4,600	59,202.00	0.32

66	600152	维科技术	12,200	58,560.00	0.32
67	002546	新联电子	18,000	58,500.00	0.32
68	000027	深圳能源	8,000	58,400.00	0.32
69	600006	东风股份	9,100	58,149.00	0.32
70	002783	凯龙股份	7,900	57,828.00	0.32
71	601311	骆驼股份	7,200	57,744.00	0.31
72	002300	太阳电缆	10,900	57,552.00	0.31
73	300491	通合科技	4,000	57,440.00	0.31
74	601168	西部矿业	3,200	57,440.00	0.31
75	301219	腾远钴业	1,500	57,390.00	0.31
76	002472	双环传动	2,600	57,252.00	0.31
77	002611	东方精工	10,900	57,225.00	0.31
78	600273	嘉化能源	8,000	57,120.00	0.31
79	000969	安泰科技	7,200	57,096.00	0.31
80	600163	中闽能源	11,800	56,876.00	0.31
81	300224	正海磁材	6,100	56,486.00	0.31
82	002274	华昌化工	7,600	56,392.00	0.31
83	000887	中鼎股份	4,600	56,304.00	0.31
84	002221	东华能源	6,800	55,828.00	0.30
85	601222	林洋能源	8,900	55,803.00	0.30
86	002860	星帅尔	6,800	55,692.00	0.30
87	002108	沧州明珠	18,200	55,692.00	0.30
88	300409	道氏技术	6,500	55,640.00	0.30
89	688560	明冠新材	5,200	55,380.00	0.30
90	603633	徕木股份	7,000	55,370.00	0.30
91	301278	快可电子	1,700	55,284.00	0.30
92	301349	信德新材	2,000	55,280.00	0.30
93	605222	起帆电缆	3,600	55,224.00	0.30
94	600549	厦门钨业	3,200	55,200.00	0.30
95	002158	汉钟精机	3,300	55,176.00	0.30
96	600586	金晶科技	9,500	55,100.00	0.30
97	002135	东南网架	13,900	55,044.00	0.30
98	601016	节能风电	18,400	55,016.00	0.30
99	002046	国机精工	5,400	54,918.00	0.30
100	000012	南玻 A	10,800	54,432.00	0.30
101	000550	江铃汽车	2,500	54,275.00	0.30
102	300953	震裕科技	1,000	54,200.00	0.30
103	002514	宝馨科技	13,100	54,103.00	0.29
104	600995	南网储能	5,600	54,096.00	0.29
105	600546	山煤国际	3,700	54,094.00	0.29
106	000811	冰轮环境	5,600	54,040.00	0.29
107	000559	万向钱潮	12,100	53,966.00	0.29
108	600499	科达制造	6,400	53,952.00	0.29

109	002276	万马股份	7,500	53,775.00	0.29
110	000581	威孚高科	3,300	53,724.00	0.29
111	002706	良信股份	7,800	53,508.00	0.29
112	001289	龙源电力	3,100	53,475.00	0.29
113	002080	中材科技	4,100	52,890.00	0.29
114	601886	江河集团	10,800	52,704.00	0.29
115	000933	神火股份	2,600	52,598.00	0.29
116	688628	优利德	1,600	52,432.00	0.29
117	688499	利元亨	2,700	51,651.00	0.28
118	600691	阳煤化工	29,600	50,616.00	0.28
119	002759	天际股份	7,200	49,536.00	0.27
120	301310	鑫宏业	2,000	48,200.00	0.26
121	300985	致远新能	2,500	40,050.00	0.22
122	688608	恒玄科技	200	29,276.00	0.16
123	688281	华秦科技	280	23,329.60	0.13
124	688235	百济神州	200	23,168.00	0.13
125	688408	中信博	200	18,416.00	0.10
126	688082	盛美上海	200	16,902.00	0.09
127	688507	索辰科技	292	14,191.20	0.08
128	688375	国博电子	200	14,128.00	0.08
129	688041	海光信息	200	14,064.00	0.08
130	300308	中际旭创	100	13,788.00	0.08
131	688686	奥普特	200	12,806.00	0.07
132	688348	昱能科技	200	11,800.00	0.06
133	688776	国光电气	200	11,080.00	0.06
134	688266	泽璟制药	200	10,844.00	0.06
135	600941	中国移动	100	10,750.00	0.06
136	688278	特宝生物	200	10,710.00	0.06
137	688383	新益昌	200	10,422.00	0.06
138	603501	韦尔股份	100	9,937.00	0.05
139	688187	时代电气	200	9,876.00	0.05
140	688213	思特威	200	9,700.00	0.05
141	600660	福耀玻璃	200	9,580.00	0.05
142	688568	中科星图	200	9,540.00	0.05
143	688522	纳睿雷达	200	9,376.00	0.05
144	688981	中芯国际	200	9,220.00	0.05
145	601088	中国神华	200	8,874.00	0.05
146	301196	唯科科技	300	8,859.00	0.05
147	300408	三环集团	300	8,757.00	0.05
148	301133	金钟股份	400	8,716.00	0.05
149	001266	宏英智能	400	8,688.00	0.05
150	600900	长江电力	300	8,676.00	0.05
151	688244	永信至诚	296	8,581.04	0.05

152	600690	海尔智家	300	8,514.00	0.05
153	600183	生益科技	400	8,424.00	0.05
154	301226	祥明智能	500	8,320.00	0.05
155	301125	腾亚精工	840	8,307.60	0.05
156	300837	浙矿股份	400	8,304.00	0.05
157	600547	山东黄金	300	8,214.00	0.04
158	688667	菱电电控	200	8,160.00	0.04
159	000338	潍柴动力	500	8,120.00	0.04
160	603171	税友股份	300	8,112.00	0.04
161	603489	八方股份	300	8,094.00	0.04
162	600309	万华化学	100	8,086.00	0.04
163	601179	中国西电	1,000	8,040.00	0.04
164	601231	环旭电子	500	8,025.00	0.04
165	688322	奥比中光	300	8,013.00	0.04
166	688023	安恒信息	200	8,002.00	0.04
167	688611	杭州柯林	300	7,995.00	0.04
168	688259	创耀科技	200	7,992.00	0.04
169	002938	鹏鼎控股	200	7,952.00	0.04
170	300980	祥源新材	500	7,880.00	0.04
171	301197	工大科雅	600	7,872.00	0.04
172	688520	神州细胞	200	7,870.00	0.04
173	301051	信濠光电	300	7,869.00	0.04
174	002475	立讯精密	200	7,862.00	0.04
175	301033	迈普医学	200	7,822.00	0.04
176	002241	歌尔股份	400	7,804.00	0.04
177	688162	巨一科技	400	7,792.00	0.04
178	301317	鑫磊股份	500	7,770.00	0.04
179	301161	唯万密封	500	7,765.00	0.04
180	301356	天振股份	600	7,764.00	0.04
181	600299	安迪苏	800	7,760.00	0.04
182	688150	莱特光电	400	7,760.00	0.04
183	300884	狄耐克	900	7,758.00	0.04
184	688152	麒麟信安	200	7,744.00	0.04
185	301117	佳缘科技	300	7,740.00	0.04
186	002635	安洁科技	500	7,720.00	0.04
187	300069	金利华电	700	7,700.00	0.04
188	601066	中信建投	400	7,696.00	0.04
189	300512	中亚股份	1,300	7,696.00	0.04
190	301365	矩阵股份	700	7,693.00	0.04
191	002001	新和成	400	7,680.00	0.04
192	688519	南亚新材	300	7,671.00	0.04
193	301309	万得凯	300	7,668.00	0.04
194	600845	宝信软件	240	7,663.20	0.04

195	300615	欣天科技	800	7,656.00	0.04
196	300810	中科海讯	500	7,655.00	0.04
197	601298	青岛港	800	7,648.00	0.04
198	688562	航天软件	500	7,635.00	0.04
199	301045	天禄科技	400	7,624.00	0.04
200	601801	皖新传媒	1,100	7,623.00	0.04
201	002179	中航光电	200	7,610.00	0.04
202	600028	中国石化	1,200	7,584.00	0.04
203	688678	福立旺	700	7,581.00	0.04
204	688011	新光光电	500	7,575.00	0.04
205	605099	共创草坪	400	7,564.00	0.04
206	600377	宁沪高速	600	7,560.00	0.04
207	000877	天山股份	1,400	7,560.00	0.04
208	600025	华能水电	700	7,546.00	0.04
209	300472	新元科技	1,700	7,531.00	0.04
210	300691	联合光电	500	7,525.00	0.04
211	000598	兴蓉环境	1,000	7,520.00	0.04
212	600018	上港集团	1,300	7,514.00	0.04
213	688435	英方软件	300	7,488.00	0.04
214	600406	国电南瑞	300	7,488.00	0.04
215	688396	华润微	200	7,488.00	0.04
216	601328	交通银行	1,000	7,470.00	0.04
217	688349	三一重能	300	7,452.00	0.04
218	300986	志特新材	1,100	7,447.00	0.04
219	605118	力鼎光电	500	7,445.00	0.04
220	688426	康为世纪	400	7,440.00	0.04
221	688260	昀冢科技	500	7,435.00	0.04
222	688329	艾隆科技	500	7,430.00	0.04
223	002601	龙佰集团	400	7,428.00	0.04
224	601288	农业银行	1,700	7,412.00	0.04
225	601398	工商银行	1,300	7,410.00	0.04
226	688618	三旺通信	296	7,408.88	0.04
227	000039	中集集团	800	7,408.00	0.04
228	688153	唯捷创芯	200	7,400.00	0.04
229	300148	天舟文化	3,200	7,392.00	0.04
230	601988	中国银行	1,600	7,392.00	0.04
231	300389	艾比森	600	7,368.00	0.04
232	300157	新锦动力	4,000	7,360.00	0.04
233	688127	蓝特光学	400	7,356.00	0.04
234	300440	运达科技	1,400	7,350.00	0.04
235	300996	普联软件	500	7,335.00	0.04
236	603637	镇海股份	1,200	7,320.00	0.04
237	300433	蓝思科技	400	7,300.00	0.04

238	002532	天山铝业	900	7,299.00	0.04
239	300830	金现代	1,200	7,296.00	0.04
240	002111	威海广泰	700	7,294.00	0.04
241	600936	广西广电	3,600	7,272.00	0.04
242	688227	品高股份	600	7,266.00	0.04
243	600640	国脉文化	700	7,245.00	0.04
244	002155	湖南黄金	400	7,240.00	0.04
245	601857	中国石油	700	7,224.00	0.04
246	300235	方直科技	900	7,218.00	0.04
247	300521	爱司凯	700	7,210.00	0.04
248	002976	瑞玛精密	300	7,200.00	0.04
249	300715	凯伦股份	1,000	7,200.00	0.04
250	605060	联德股份	500	7,185.00	0.04
251	300140	节能环境	1,200	7,164.00	0.04
252	688158	优刻得	700	7,161.00	0.04
253	601006	大秦铁路	1,000	7,160.00	0.04
254	002674	兴业科技	700	7,154.00	0.04
255	300369	绿盟科技	1,400	7,154.00	0.04
256	688231	隆达股份	500	7,130.00	0.04
257	300168	万达信息	1,500	7,125.00	0.04
258	605388	均瑶健康	1,300	7,124.00	0.04
259	300866	安克创新	100	7,121.00	0.04
260	300768	迪普科技	600	7,110.00	0.04
261	600362	江西铜业	300	7,104.00	0.04
262	300405	科隆股份	2,000	7,100.00	0.04
263	688561	奇安信	300	7,086.00	0.04
264	301078	孩子王	1,400	7,084.00	0.04
265	600551	时代出版	1,000	7,080.00	0.04
266	600350	山东高速	800	7,080.00	0.04
267	301102	兆讯传媒	600	7,074.00	0.04
268	688579	山大地纬	900	7,065.00	0.04
269	603130	云中马	400	7,056.00	0.04
270	600663	陆家嘴	800	7,056.00	0.04
271	002947	恒铭达	200	7,040.00	0.04
272	688081	兴图新科	800	7,040.00	0.04
273	600098	广州发展	1,100	7,040.00	0.04
274	688165	埃夫特	900	7,038.00	0.04
275	001330	博纳影业	1,300	7,033.00	0.04
276	601899	紫金矿业	400	7,028.00	0.04
277	688768	容知日新	300	7,023.00	0.04
278	300271	华宇软件	1,500	7,020.00	0.04
279	300795	米奥会展	400	7,012.00	0.04
280	601811	新华文轩	500	7,005.00	0.04

281	002599	盛通股份	1,400	7,000.00	0.04
282	688575	亚辉龙	300	6,996.00	0.04
283	688219	会通股份	900	6,993.00	0.04
284	300816	艾可蓝	300	6,990.00	0.04
285	300275	梅安森	700	6,979.00	0.04
286	688788	科思科技	300	6,975.00	0.04
287	601969	海南矿业	1,100	6,974.00	0.04
288	001260	坤泰股份	500	6,965.00	0.04
289	688196	卓越新能	300	6,963.00	0.04
290	300191	潜能恒信	500	6,960.00	0.04
291	600999	招商证券	500	6,955.00	0.04
292	002736	国信证券	800	6,952.00	0.04
293	688132	邦彦技术	400	6,940.00	0.04
294	600989	宝丰能源	400	6,932.00	0.04
295	600376	首开股份	3,300	6,930.00	0.04
296	603103	横店影视	500	6,920.00	0.04
297	603025	大豪科技	500	6,910.00	0.04
298	688078	龙软科技	300	6,909.00	0.04
299	300515	三德科技	700	6,909.00	0.04
300	301056	森赫股份	900	6,903.00	0.04
301	002908	德生科技	900	6,903.00	0.04
302	688523	航天环宇	400	6,900.00	0.04
303	301302	华如科技	400	6,900.00	0.04
304	603955	大千生态	800	6,880.00	0.04
305	601808	中海油服	400	6,880.00	0.04
306	688283	坤恒顺维	200	6,876.00	0.04
307	300876	蒙泰高新	400	6,872.00	0.04
308	301057	汇隆新材	600	6,864.00	0.04
309	605228	神通科技	800	6,864.00	0.04
310	601512	中新集团	900	6,858.00	0.04
311	688588	凌志软件	1,000	6,850.00	0.04
312	600837	海通证券	800	6,848.00	0.04
313	300821	东岳硅材	1,000	6,840.00	0.04
314	688501	青达环保	500	6,840.00	0.04
315	301373	凌玮科技	300	6,840.00	0.04
316	688475	萤石网络	200	6,822.00	0.04
317	300134	大富科技	1,000	6,820.00	0.04
318	000553	安道麦 A	1,500	6,810.00	0.04
319	688203	海正生材	800	6,800.00	0.04
320	002273	水晶光电	400	6,792.00	0.04
321	688432	有研硅	700	6,783.00	0.04
322	002214	大立科技	600	6,768.00	0.04
323	603096	新经典	400	6,760.00	0.04

324	601588	北辰实业	5,000	6,750.00	0.04
325	300832	新产业	100	6,744.00	0.04
326	603282	亚光股份	400	6,744.00	0.04
327	603213	镇洋发展	900	6,732.00	0.04
328	300675	建科院	600	6,720.00	0.04
329	300772	运达股份	700	6,720.00	0.04
330	603192	汇得科技	500	6,715.00	0.04
331	300981	中红医疗	700	6,699.00	0.04
332	600927	永安期货	600	6,690.00	0.04
333	688258	卓易信息	200	6,680.00	0.04
334	688079	美迪凯	900	6,678.00	0.04
335	688400	凌云光	400	6,672.00	0.04
336	688020	方邦股份	200	6,672.00	0.04
337	688098	申联生物	1,600	6,672.00	0.04
338	603717	天域生态	1,100	6,666.00	0.04
339	603909	建发合诚	800	6,656.00	0.04
340	688365	光云科技	1,100	6,622.00	0.04
341	300198	纳川股份	6,000	6,600.00	0.04
342	001333	光华股份	400	6,600.00	0.04
343	600938	中国海油	200	6,600.00	0.04
344	600007	中国国贸	300	6,588.00	0.04
345	688310	迈得医疗	500	6,570.00	0.04
346	688459	哈铁科技	800	6,568.00	0.04
347	301069	凯盛新材	500	6,555.00	0.04
348	300320	海达股份	800	6,528.00	0.04
349	600861	北京人力	400	6,528.00	0.04
350	688586	江航装备	700	6,510.00	0.04
351	301100	风光股份	500	6,495.00	0.04
352	300659	中孚信息	500	6,485.00	0.04
353	688552	航天南湖	400	6,480.00	0.04
354	688172	燕东微	400	6,472.00	0.04
355	000333	美的集团	100	6,450.00	0.04
356	688138	清溢光电	300	6,450.00	0.04
357	688143	长盈通	300	6,426.00	0.04
358	688137	近岸蛋白	200	6,420.00	0.03
359	603786	科博达	100	6,415.00	0.03
360	688622	禾信仪器	400	6,400.00	0.03
361	600848	上海临港	700	6,377.00	0.03
362	301200	大族数控	200	6,312.00	0.03
363	300860	锋尚文化	300	6,312.00	0.03
364	605389	长龄液压	300	6,297.00	0.03
365	301276	嘉曼服饰	300	6,288.00	0.03
366	688030	山石网科	600	6,270.00	0.03

367	688433	华曙高科	300	6,258.00	0.03
368	688010	福光股份	400	6,228.00	0.03
369	301068	大地海洋	300	6,222.00	0.03
370	688420	美腾科技	300	6,204.00	0.03
371	688292	浩瀚深度	400	6,184.00	0.03
372	002415	海康威视	200	6,182.00	0.03
373	603568	伟明环保	300	6,174.00	0.03
374	002653	海思科	200	6,140.00	0.03
375	300979	华利集团	100	6,085.00	0.03
376	603351	威尔药业	300	6,078.00	0.03
377	688080	映翰通	200	6,066.00	0.03
378	688237	超卓航科	300	6,015.00	0.03
379	688255	凯尔达	300	6,015.00	0.03
380	688419	耐科装备	200	5,984.00	0.03
381	688316	青云科技	200	5,982.00	0.03
382	688146	中船特气	200	5,970.00	0.03
383	300949	奥雅股份	200	5,962.00	0.03
384	301195	北路智控	200	5,948.00	0.03
385	688443	智翔金泰	200	5,948.00	0.03
386	688232	新点软件	300	5,916.00	0.03
387	688201	信安世纪	500	5,905.00	0.03
388	688682	霍莱沃	200	5,868.00	0.03
389	301283	聚胶股份	200	5,674.00	0.03
390	688113	联测科技	200	5,674.00	0.03
391	688800	瑞可达	200	5,616.00	0.03
392	688496	清越科技	600	5,544.00	0.03
393	688168	安博通	200	5,380.00	0.03
394	688229	博睿数据	206	5,298.32	0.03
395	688270	臻镭科技	200	5,220.00	0.03
396	002032	苏泊尔	100	5,010.00	0.03
397	688147	微导纳米	200	4,980.00	0.03
398	688161	威高骨科	200	3,964.00	0.02

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	600089	特变电工	471,725.00	2.20
2	601985	中国核电	463,636.00	2.16
3	002459	晶澳科技	454,187.00	2.12
4	600212	绿能慧充	430,150.00	2.00
5	003816	中国广核	386,897.00	1.80
6	600066	宇通客车	380,035.00	1.77

7	002594	比亚迪	363,829.00	1.70
8	600905	三峡能源	357,028.00	1.66
9	300953	震裕科技	347,780.00	1.62
10	002227	奥特迅	343,881.00	1.60
11	002274	华昌化工	333,741.00	1.56
12	300014	亿纬锂能	333,135.00	1.55
13	688148	芳源股份	327,825.43	1.53
14	002340	格林美	306,577.00	1.43
15	601615	明阳智能	303,778.00	1.42
16	301150	中一科技	301,300.00	1.40
17	601012	隆基绿能	300,293.00	1.40
18	300091	金通灵	299,266.00	1.39
19	600819	耀皮玻璃	292,094.00	1.36
20	601908	京运通	286,755.00	1.34

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	601012	隆基绿能	1,289,277.40	6.01
2	002459	晶澳科技	750,737.12	3.50
3	600089	特变电工	610,883.00	2.85
4	688599	天合光能	603,189.40	2.81
5	601615	明阳智能	583,827.00	2.72
6	002129	TCL 中环	543,761.75	2.53
7	300919	中伟股份	492,576.00	2.30
8	300274	阳光电源	487,523.40	2.27
9	003816	中国广核	440,474.00	2.05
10	300014	亿纬锂能	435,891.00	2.03
11	600549	厦门钨业	434,045.00	2.02
12	600212	绿能慧充	424,948.00	1.98
13	002460	赣锋锂业	399,831.40	1.86
14	603659	璞泰来	393,537.90	1.83
15	600438	通威股份	382,975.00	1.78
16	603799	华友钴业	365,696.10	1.70
17	601877	正泰电器	358,869.00	1.67
18	300450	先导智能	356,794.00	1.66
19	300073	当升科技	354,319.00	1.65
20	300724	捷佳伟创	353,724.00	1.65

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	77,952,608.14
卖出股票收入（成交）总额	77,539,597.61

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

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

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

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

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	3,197.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,769.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,967.14

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
民生加银 新能源智 选混合发 起 A	622	39,267.32	10,000,500.05	40.94	14,423,773.53	59.06
民生加银 新能源智 选混合发 起 C	2,042	6,344.36	0.00	0.00	12,955,176.37	100.00
合计	2,664	14,031.33	10,000,500.05	26.75	27,378,949.90	73.25

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	民生加银新能源智选混合发 起 A	80,623.66	0.3301
	民生加银新能源智选混合发 起 C	-	-
	合计	80,623.66	0.2157

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	民生加银新能源智选混合 发起 A	0~10
	民生加银新能源智选混合 发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	民生加银新能源智选混合 发起 A	0~10
	民生加银新能源智选混合 发起 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	10,000,500.05	26.75	10,000,500.05	26.75	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	80,623.66	0.22	-	-	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	10,081,123.71	26.97	10,000,500.05	26.75	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银新能源智选混合发起 A	民生加银新能源智选混合发起 C
基金合同生效日 (2021年9月28日) 基金份额总额	27,679,955.56	19,180,288.71
本报告期期初基金份额总额	25,167,956.16	12,725,205.48
本报告期基金总申购份额	865,538.21	3,777,062.57
减：本报告期基金总赎回份额	1,609,220.79	3,547,091.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	24,424,273.58	12,955,176.37

§ 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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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	89,953,915.05	57.85	66,299.13	57.56	-
华创证券	1	65,538,290.70	42.15	48,884.55	42.44	-

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。

③本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	2,830,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 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
2	民生加银新能源智选混合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
3	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
4	民生加银新能源智选混合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
5	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
6	民生加银新能源智选混合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
7	民生加银新能源智选混合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
8	民生加银新能源智选混合型发起式	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 24 日

	证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新		
--	------------------------	--	--

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240101~20240630	10,000,500.05	0.00	0.00	10,000,500.05	26.75

产品特有风险

1、大额赎回风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

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) 《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银新能源智选混合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