

民生加银中证 500 指数增强型发起式证券
投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§ 9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	81
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	81
§ 10 开放式基金份额变动	81
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 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	126,857,521.07 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	85,270,073.09 份	41,587,447.98 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。其中：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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</p> <p>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		李业弟	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.msjfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	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	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	911,510.92	1,915,150.40	3,438,474.95	2,338,826.37	4,057,033.43	2,361,712.93

本期利润	35,392.91	1,707,800.33	2,111,190.33	1,569,879.21	5,580,077.69	3,306,839.98
加权平均基金份额本期利润	0.0003	0.0320	-0.0719	-0.0812	-0.1914	-0.1903
本期加权平均净值利润率	0.05%	4.85%	-9.07%	-10.29%	-22.37%	-22.38%
本期基金份额净值增长率	0.34%	0.04%	-9.02%	-9.30%	-19.04%	-19.28%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	22,901,040.38	11,478,115.22	14,369,649.10	5,464,392.01	5,044,491.52	3,576,238.66
期末可供分配基金份额利润	-0.2686	-0.2760	-0.2711	-0.2763	-0.1988	-0.2021
期末基金资产净值	62,369,032.71	30,109,332.76	38,640,041.44	14,313,191.57	20,331,383.65	14,117,813.32
期末基金份额净值	0.7314	0.7240	0.7289	0.7237	0.8012	0.7979

3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	基金份额累计净值增长率	-26.86%	-27.60%	-27.11%	-27.63%	-19.88%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银中证 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
过去三个月	-0.15%	1.72%	-0.23%	1.93%	0.08%	-0.21%
过去六个月	13.11%	1.76%	15.14%	1.91%	-2.03%	-0.15%
过去一年	0.34%	1.68%	5.40%	1.73%	-5.06%	-0.05%
过去三年	-26.09%	1.30%	-20.91%	1.33%	-5.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-26.86%	1.26%	-16.80%	1.29%	-10.06%	-0.03%

民生加银中证 500 指数增强发起式 C

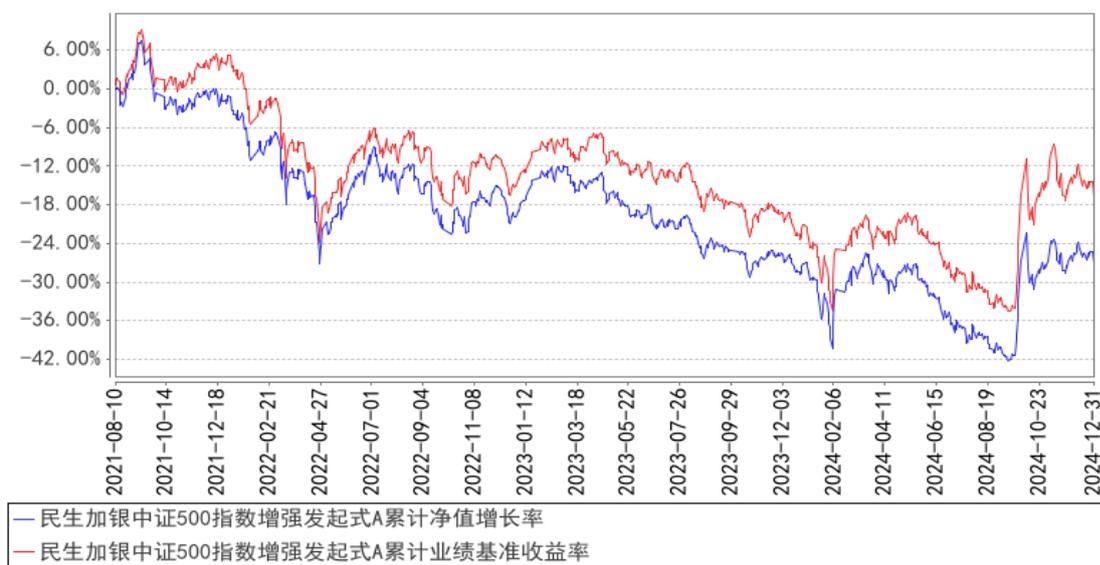
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	-0.22%	1.72%	-0.23%	1.93%	0.01%	-0.21%
过去六个月	12.95%	1.76%	15.14%	1.91%	-2.19%	-0.15%
过去一年	0.04%	1.68%	5.40%	1.73%	-5.36%	-0.05%
过去三年	-26.76%	1.30%	-20.91%	1.33%	-5.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-27.60%	1.26%	-16.80%	1.29%	-10.80%	-0.03%

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

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



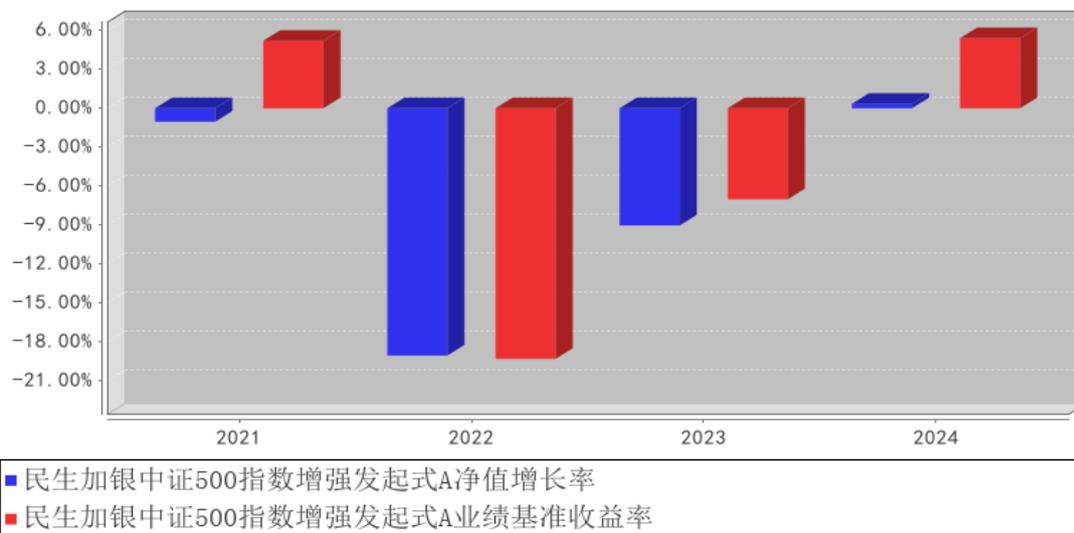
民生加银中证500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



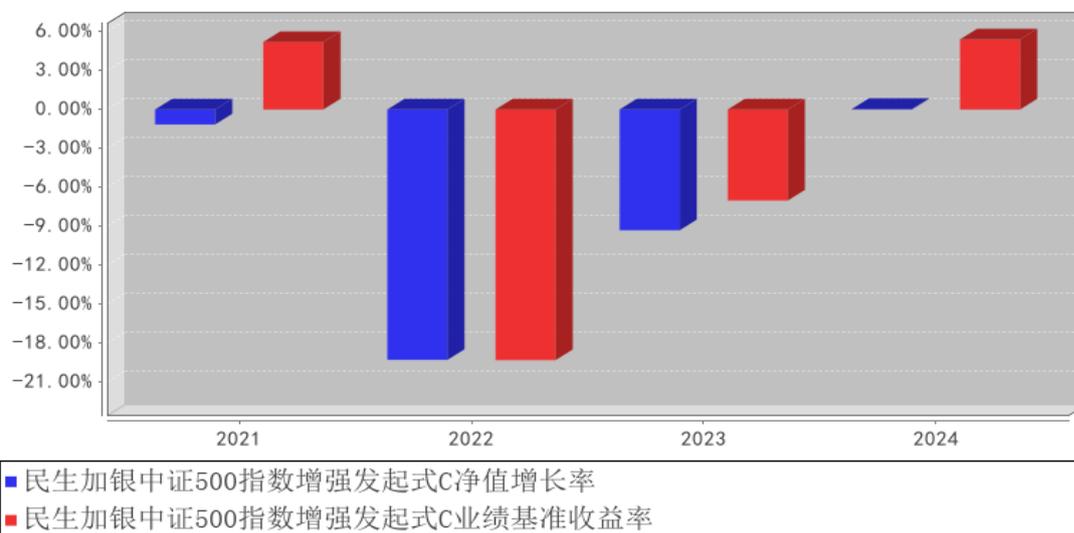
注：本基金合同于 2021 年 8 月 10 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银中证500指数增强发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



民生加银中证500指数增强发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 08 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）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 12 月 31 日，公司旗下共管理 99 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		
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	本基金的基金经理	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；2024 年 6 月至今担任民生加银智选成长股票型证券投资基金。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 完善了公司公平交易制度, 制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动, 同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节, 形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易, 公司启用了交易系统内的公平交易程序, 在指令分发及指令执行阶段, 均由系统强制执行公平委托; 此外, 公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易, 公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度, 保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易, 各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量, 公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）

的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2024 年，如无国庆行情启动，沪深 300 指数将会是年线四连阴，恒生指数将会是年线五连阴。前三季度市场以央企、红利等防御风格为主，而四季度则上演了 2015 年杠杆牛的行情，尤其是 10、11 月两个月，越是没有盈利、没有股息的公司，抛压越轻，上市公司的基本面反而不再重要。前三季度，上市公司净利润延续负增长，流动性推动的估值回升是股市的上涨的主要驱动因素。主动型基金规模在四季度首次低于被动型基金，预计未来被动型基金份额将会进一步提高。

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。

选股范围上，管理人进一步规则化了股票池的定期筛选机制，在公司股票池基础上进行正向因素筛选和负向因素剔除，并将筛选结果作为基金选股范围。

风险控制上，

a) 非线性风险因子：自二季度末起，管理人针对基准指数定制了对应的风险因子，并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崩盘事件对基金的冲击，且在正常年份下的模型整体收益能力也未受太大影响。经过完整下半年的实盘运作，基金净值表现符合预期，特别是在 2024 年 12 月微盘股下跌时期，基金净值和相对收益表现也较为稳健。

b) 肥尾状态因子：管理人参考当日市场量价状态，判定当下市场行情是否处于异常阶段，将这一信息提炼为肥尾状态因子，并将其与常规风险因子、非线性风险因子等一并约束。

投资运作上，作为指数增强基金，本产品始终保持较高仓位运作，不主动择时，秉持以概率取胜的方式、以风险调整后收益为目标，力争跑赢指数，增厚投资收益。

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 0.7314 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.34%,同期业绩比较基准收益率为 5.40%;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 0.7240 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.04%,同期业绩比较基准收益率为 5.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2025 年的市场同样也是机遇与风险并存,但对权益市场整体的 beta 和 alpha 都保持乐观的看法。

【beta 层面】

政策上,2025 年有一个重要的不确定性和一个重要的确定性:不确定性来自于美国的新一届政府所带来的中美关系的影响,确定的是国内的增量政策一定会持续发力。特朗普上一任总统任职期间,在一些决策上有着较强的随机性。但国内关于适当宽松的货币政策的定调没有变,稳经济、稳楼市、稳股市的基调也没有变,这是对市场相当大的支撑。受地缘政治的影响,国内政策的增量上将可能是见招拆招的过程,市场的预期可能会相应的拉长。

经济上,2024 年 9 月份经济工作会议之后,整体经济也已经更加呈现出以内部为主的状态。各类财政和货币政策上的支持,有望让整体的经济复苏看到实质的成果,在这个过程中最起码结构性行情和机会是值得期待的。

估值上,目前股债风险溢价仍处于较高水平,意味着股市仍有较好的配置价值:虽然股指从 2700 点到 3200 点上涨了几百点,但因为国债涨的也不少,从大类资产比价来看,当前点位的权益类资产并不比 2024 年 9 月末时的估值贵。

【alpha 层面】

一方面,2024 年春节和国庆引发市场两次剧烈调整的风险因素不复存在,2025 年权益市场的整体波动率预期会温和一些,持有体验可能会更好一些。

另一方面,2024 年 9 月份以来整个市场的成交量大幅提高,对于量化模型通过低吸高抛创造超额收益,整体环境会更友好一些。

【基金层面】

从资金上看,中证 500 指数有望继续承载长期资金入市,成为促进资本市场高质量发展的重要抓手,具有较好的投资价值。同时我们认为新质生产力含量较高的中小盘科技成长股有望持续占优。

从估值上看,截至本报告期末,中证 500 指数市盈率 TTM、市净率均处于上市以来的中位数

以下水平，指数仍有一定向上的空间，属于胜率较高的点位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人内部对本基金的监察稽核工作主要针对本基金投资运作的合法、合规性，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部进行监察，通过实时监控、定期检查、专项检查、不定期抽查等方式，及时发现问题，提出整改意见并跟踪改进落实情况，并按照中国证监会的要求将《季度监察稽核报告》和《年度监察稽核报告》提交给公司全体董事审阅。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照相关会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人为确保估值工作的合规开展，已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究各部门参加人员应包含相关行业研究员及固定收益信评人员。分管运营的公司领导任估值委员会主席。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期可不进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2503598 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	<p>该基金管理人民生加银基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不</p>

	<p>确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	吴钟鸣	吴巧莉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025年3月26日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	6,825,716.11	4,676,407.99
结算备付金		1,090,220.15	850,702.54
存出保证金		549,081.60	524,559.12
交易性金融资产	7.4.7.2	81,606,452.95	44,318,565.86
其中：股票投资		81,606,452.95	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,006,994.45	4,579,975.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		94,078,465.26	54,950,210.92
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,092,817.08
应付赎回款		1,360,310.31	688,931.46
应付管理人报酬		70,737.70	33,620.29
应付托管费		14,147.55	6,724.04
应付销售服务费		6,873.69	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	7.4.7.9	148,030.54	171,145.46
负债合计		1,600,099.79	1,996,977.91
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	126,857,521.07	72,787,274.12
未分配利润	7.4.7.12	-34,379,155.60	-19,834,041.11
净资产合计		92,478,365.47	52,953,233.01
负债和净资产总计		94,078,465.26	54,950,210.92

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 126,857,521.07 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 0.7314 元，份额总额为 85,270,073.09 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 0.7240 元，份额总额为 41,587,447.98 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
一、营业总收入		3,350,781.97	-3,099,744.91
1. 利息收入		71,247.26	39,548.58

其中：存款利息收入	7.4.7.13	69,360.86	39,477.21
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		-	71.37
其他利息收入		1,886.40	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,138,141.89	-5,258,080.79
其中：股票投资收益	7.4.7.14	943,067.82	-5,848,916.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-413.65	4,729.94
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-337,052.92	-253,121.49
股利收益	7.4.7.19	2,532,540.64	839,226.82
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-1,083,468.08	2,096,231.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,224,860.90	22,555.52
减：二、营业总支出		1,607,588.73	581,324.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,120,542.57	385,299.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	224,108.48	77,059.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	105,669.21	45,762.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	121.07
8. 其他费用	7.4.7.23	157,268.47	73,081.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,743,193.24	-3,681,069.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,743,193.24	-3,681,069.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,743,193.24	-3,681,069.54

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	54,070,246.95	-	-14,545,114.49	39,525,132.46
(一)、综合收益总额	-	-	1,743,193.24	1,743,193.24
(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)	54,070,246.95	-	-16,288,307.73	37,781,939.22
其中：1. 基金申购款	804,825,527.30	-	-	546,927,591.02
2. 基金赎回款	-	-	257,897,936.28	-509,145,651.80
(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	126,857,521.07	-	-34,379,155.60	92,478,365.47
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	29,717,346.97	-	-11,213,310.93	18,504,036.04

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-3,681,069.54	-3,681,069.54
(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)	29,717,346.97	-	-7,532,241.39	22,185,105.58
其中：1. 基金申购款	56,077,032.86	-	-12,664,307.92	43,412,724.94
2. 基金赎回款	-26,359,685.89	-	5,132,066.53	-21,227,619.36
(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	72,787,274.12	-	-19,834,041.11	52,953,233.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郑智军

王国栋

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”、“民生加银中证 500 指数增强发起式”）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》准予注册，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 88,688,527.77 份基金份额。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（以下简称“民生加银基金公司”），基金托管人为交通银行股份有限

公司（以下简称“交通银行”）。

根据《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》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股，其他非指数成份股（包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、港股通标的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金以标的指数（中证 500 指数）成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不得低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成分股和备选成分股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0 - 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

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

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

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

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

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

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流

量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(c) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产 / 负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

-以摊余成本计量的金融资产

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

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利

得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后,对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

-该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;

-该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

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

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值;

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的,本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础,对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损

失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

(a) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(b) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(c) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(d) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(e) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政

策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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。

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。

(d) 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。

(e) 对基金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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,043,730.04	4,676,407.99
等于：本金	2,043,495.11	4,675,214.39
加：应计利息	234.93	1,193.60
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	4,781,986.07	-
等于：本金	4,781,762.85	-
加：应计利息	223.22	-
减：坏账准备	-	-
合计	6,825,716.11	4,676,407.99

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	82,736,039.69	-	81,606,452.95	-1,129,586.74
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	82,736,039.69	-	81,606,452.95	-1,129,586.74
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,526,559.18	-	44,318,565.86	-207,993.32

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	44,526,559.18	-	44,318,565.86	-207,993.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,687,754.66	-	-	-
其中： 股指期货投资	4,687,754.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,687,754.66	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,281,880.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	4,281,880.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,281,880.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2501	IC2501	4.00	4,575,680.00	-112,074.66
合计				-112,074.66
减：可抵销期货暂收款				-112,074.66
净额				0.00

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	30.54	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	101,145.46
其中：交易所市场	-	101,145.46
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	28,000.00	20,000.00
预提信息披露费	120,000.00	50,000.00
合计	148,030.54	171,145.46

7.4.7.10 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 12 月 31 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	468,054,390.76	468,054,390.76
本期赎回（以“-”号填列）	-435,794,008.21	-435,794,008.21
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	85,270,073.09	85,270,073.09

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 12 月 31 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	336,771,136.54	336,771,136.54
本期赎回(以“-”号填列)	-314,961,272.14	-314,961,272.14
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	41,587,447.98	41,587,447.98

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

民生加银中证 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	911,510.92	-876,118.01	35,392.91
本期基金份额交易产生的变动数	-1,772,705.61	-6,794,078.58	-8,566,784.19
其中：基金申购款	-106,543,160.65	-33,172,320.22	-139,715,480.87
基金赎回款	104,770,455.04	26,378,241.64	131,148,696.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,334,313.02	-10,566,727.36	-22,901,040.38

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	1,915,150.40	-207,350.07	1,707,800.33
本期基金份额交易产生的变动数	-3,880,045.24	-3,841,478.30	-7,721,523.54
其中：基金申购款	-89,609,779.94	-28,572,675.47	-118,182,455.41
基金赎回款	85,729,734.70	24,731,197.17	110,460,931.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,346,807.03	-5,131,308.19	-11,478,115.22

7.4.7.13 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 12 月 31	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023

	日	年 12 月 31 日
活期存款利息收入	30,488.52	18,466.01
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	12,987.44	-
结算备付金利息收入	25,813.87	20,931.59
其他	71.03	79.61
合计	69,360.86	39,477.21

注：其他为保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	943,067.82	-5,848,916.06
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	943,067.82	-5,848,916.06

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	1,132,997,795.04	183,026,382.21
减：卖出股票成本 总额	1,130,663,917.61	188,427,996.03
减：交易费用	1,390,809.61	447,302.24
买卖股票差价收 入	943,067.82	-5,848,916.06

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	64.37	8,674.94
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	-3,945.00
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	4,729.94

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,008,079.33	2,102,606.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,005,980.00	2,093,889.00
减：应计利息总额	2,575.33	12,662.06
减：交易费用	2.02	-
买卖债券差价收入	-478.02	-3,945.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
股指期货投资收益	-337,052.92	-253,121.49

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资产生的股利收益	2,532,540.64	839,226.82
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	2,532,540.64	839,226.82

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
------	---------------------------------	--------------------------------------

1. 交易性金融资产	-921,593.42	1,955,271.78
股票投资	-921,593.42	1,955,271.78
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	-161,874.66	140,960.00
权证投资	-	-
期货投资	-161,874.66	140,960.00
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	-1,083,468.08	2,096,231.78

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	1,224,826.84	22,530.97
基金转换费收入	34.06	24.55
合计	1,224,860.90	22,555.52

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	28,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,268.47	2,681.54
开户费	-	400.00
合计	157,268.47	73,081.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司(“民生加银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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(“中国民生银行”)	基金管理人的中方投资者、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的外方投资者
陕西省国际信托股份有限公司	基金管理人的中方投资者
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据民生加银基金管理有限公司于 2023 年 9 月 21 日发布的公告，经民生加银基金管理有限公司 2023 年第二次股东会会议的决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2023]1834 号核准，民生加银基金管理有限公司原股东三峡财务有限责任公司将其持有的民生加银基金管理有限公司 6.67%股权转让给陕西省国际信托股份有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 权证交易

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

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,120,542.57	385,299.48
其中：应支付销售机构的客户维护	412,642.03	146,534.33

费		
应支付基金管理人的净管理费	707,900.54	238,765.15

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 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	224,108.48	77,059.87

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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银中证 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	-	4,877.24	4,877.24
民生加银基金公司	-	10,603.56	10,603.56
中国民生银行	-	21,525.63	21,525.63
合计	-	37,006.43	37,006.43
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 12 月 31 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	-	8,119.89	8,119.89
民生加银基金公司	-	-	-
中国民生银行	-	24,724.14	24,724.14
合计	-	32,844.03	32,844.03

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。本基金 C 类基金份额支付销售机构的基金销售服务

费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：
 民生加银中证 500 指数增强发起式 C 日基金销售服务费=前一日 C 类份额基金资产净值×0.30%/
 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 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	7.8848%	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	13.7421%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,043,730.04	30,488.52	4,676,407.99	18,466.01

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注: 1) 本基金于本期未进行利润分配。

2) 本基金资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前的利润分配情况，详见本报告“7.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	87	1,274.55	2,379.45	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

本基金的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。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的货币资金存放在信用良好的金融机构，与该货币资金相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金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。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	6,825,257.96	-	-	-	-	458.15	6,825,716.11
结算备付金	1,089,677.31	-	-	-	-	542.84	1,090,220.15
存出保证金	-	-	-	-	-	549,081.60	549,081.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,606,452.95	81,606,452.95
应收申购款	-	-	-	-	-	4,006,994.45	4,006,994.45
资产总计	7,914,935.27	-	-	-	-	86,163,529.99	94,078,465.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,360,310.31	1,360,310.31

						31	
应付管理人报酬						70,737.70	70,737.70
应付托管费						14,147.55	14,147.55
应付销售服务费						6,873.69	6,873.69
其他负债						148,030.54	148,030.54
负债总计						1,600,099.79	1,600,099.79
利率敏感度缺口	7,914,935.27					84,563,430.20	92,478,365.47
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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	81,606,452.95	88.24	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	81,606,452.95	88.24	44,318,565.86	83.69

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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12月31日）	上年度末（2023年12月31日）

1. 业绩比较基准上 升 5%	4,397,481.74	2,410,002.99
2. 业绩比较基准下 降 5%	-4,397,481.74	-2,410,002.99

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	81,604,073.50	44,318,565.86
第二层次	2,379.45	-
第三层次	-	-
合计	81,606,452.95	44,318,565.86

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期间，本基金无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31

日：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 (2023 年 12 月 31 日：无)。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,606,452.95	86.74
	其中：股票	81,606,452.95	86.74
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	7,915,936.26	8.41
8	其他各项资产	4,556,076.05	4.84
9	合计	94,078,465.26	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	126,850.00	0.14
B	采矿业	4,018,745.00	4.35
C	制造业	44,620,446.50	48.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,350,735.00	3.62
E	建筑业	1,012,136.00	1.09

F	批发和零售业	1,542,400.00	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,835,757.00	1.99
H	住宿和餐饮业	900,625.00	0.97
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,895,213.00	4.21
J	金融业	7,842,774.00	8.48
K	房地产业	423,120.00	0.46
L	租赁和商务服务业	137,812.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	1,124,580.00	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	417,144.00	0.45
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	1,208,885.00	1.31
S	综合	-	-
	合计	72,457,222.50	78.35

8.2.2 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	169,806.00	0.18
C	制造业	6,946,233.45	7.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	80,192.00	0.09
F	批发和零售业	151,083.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	174,317.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,055,594.00	1.14
J	金融业	438,415.00	0.47
K	房地产业	133,590.00	0.14
L	租赁和商务服务	-	-

	业		
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,149,230.45	9.89

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	600487	亨通光电	50,600	871,332.00	0.94
2	600096	云天化	35,500	791,650.00	0.86
3	601168	西部矿业	48,600	781,002.00	0.84
4	600352	浙江龙盛	75,800	779,982.00	0.84
5	002532	天山铝业	93,500	735,845.00	0.80
6	002128	电投能源	37,500	734,250.00	0.79
7	600109	国金证券	82,900	723,717.00	0.78
8	000783	长江证券	105,800	721,556.00	0.78
9	002138	顺络电子	22,700	714,596.00	0.77
10	000738	航发控制	30,700	682,768.00	0.74
11	000623	吉林敖东	38,300	661,441.00	0.72
12	600820	隧道股份	91,800	660,042.00	0.71
13	601717	郑煤机	49,400	641,212.00	0.69
14	688002	睿创微纳	13,600	639,336.00	0.69
15	688777	中控技术	12,800	635,776.00	0.69
16	000683	远兴能源	112,500	628,875.00	0.68
17	601966	玲珑轮胎	34,600	624,184.00	0.67
18	002939	长城证券	75,500	619,100.00	0.67
19	600862	中航高科	24,500	618,870.00	0.67
20	600583	海油工程	112,600	615,922.00	0.67
21	300207	欣旺达	27,600	615,756.00	0.67

22	000423	东阿阿胶	9,800	614,656.00	0.66
23	688772	珠海冠宇	38,200	614,256.00	0.66
24	002507	涪陵榨菜	43,100	609,003.00	0.66
25	600885	宏发股份	19,000	604,580.00	0.65
26	600038	中直股份	15,500	597,680.00	0.65
27	002120	韵达股份	79,200	595,584.00	0.64
28	600282	南钢股份	125,100	586,719.00	0.63
29	601108	财通证券	71,800	586,606.00	0.63
30	600528	中铁工业	71,500	576,290.00	0.62
31	002966	苏州银行	70,900	574,999.00	0.62
32	600299	安迪苏	44,700	560,985.00	0.61
33	688425	铁建重工	126,800	557,920.00	0.60
34	601577	长沙银行	62,600	556,514.00	0.60
35	600098	广州发展	86,300	554,046.00	0.60
36	600298	安琪酵母	15,300	551,565.00	0.60
37	002223	鱼跃医疗	15,100	550,999.00	0.60
38	600699	均胜电子	35,100	550,017.00	0.59
39	300699	光威复材	15,800	547,470.00	0.59
40	688188	柏楚电子	2,800	543,900.00	0.59
41	600765	中航重机	26,400	540,408.00	0.58
42	000728	国元证券	64,500	539,220.00	0.58
43	002595	豪迈科技	10,700	537,033.00	0.58
44	300866	安克创新	5,500	537,020.00	0.58
45	688122	西部超导	12,400	530,968.00	0.57
46	601233	桐昆股份	44,800	528,640.00	0.57
47	603596	伯特利	11,800	526,162.00	0.57
48	601990	南京证券	59,900	518,734.00	0.56
49	000729	燕京啤酒	42,900	516,516.00	0.56
50	601696	中银证券	45,600	508,896.00	0.55
51	600521	华海药业	28,200	503,934.00	0.54
52	000878	云南铜业	40,900	498,571.00	0.54
53	002739	万达电影	40,800	495,312.00	0.54
54	603087	甘李药业	11,200	493,920.00	0.53
55	600909	华安证券	81,500	493,890.00	0.53
56	002409	雅克科技	8,500	492,575.00	0.53
57	002984	森麒麟	19,800	488,268.00	0.53
58	603939	益丰药房	20,100	485,013.00	0.52
59	600546	山煤国际	40,800	482,664.00	0.52
60	000513	丽珠集团	12,700	482,600.00	0.52
61	600486	扬农化工	8,200	474,534.00	0.51
62	002385	大北农	109,100	472,403.00	0.51
63	000830	鲁西化工	40,400	472,276.00	0.51
64	600642	申能股份	49,700	471,653.00	0.51

65	688278	特宝生物	6,400	469,568.00	0.51
66	000636	风华高科	32,600	467,810.00	0.51
67	600655	豫园股份	71,900	462,317.00	0.50
68	600582	天地科技	74,800	462,264.00	0.50
69	600754	锦江酒店	17,200	461,992.00	0.50
70	600901	江苏金租	88,400	461,448.00	0.50
71	601665	齐鲁银行	82,500	461,175.00	0.50
72	600380	健康元	40,800	459,816.00	0.50
73	002414	高德红外	61,700	458,431.00	0.50
74	688065	凯赛生物	11,800	457,840.00	0.50
75	000060	中金岭南	97,450	457,040.50	0.49
76	600707	彩虹股份	55,600	457,032.00	0.49
77	300373	扬杰科技	10,500	456,960.00	0.49
78	603927	中科软	21,000	455,700.00	0.49
79	002831	裕同科技	16,600	449,860.00	0.49
80	601231	环旭电子	27,100	447,150.00	0.48
81	600166	福田汽车	178,000	446,780.00	0.48
82	600004	白云机场	46,500	446,400.00	0.48
83	000739	普洛药业	27,400	445,524.00	0.48
84	600566	济川药业	15,300	444,924.00	0.48
85	002373	千方科技	43,500	441,090.00	0.48
86	000932	华菱钢铁	105,500	440,990.00	0.48
87	600258	首旅酒店	29,900	438,633.00	0.47
88	603658	安图生物	10,000	436,400.00	0.47
89	000883	湖北能源	87,100	433,758.00	0.47
90	601958	金铂股份	43,100	433,586.00	0.47
91	600873	梅花生物	43,200	433,296.00	0.47
92	603486	科沃斯	9,200	432,400.00	0.47
93	003031	中瓷电子	8,200	429,598.00	0.46
94	603298	杭叉集团	24,000	429,360.00	0.46
95	000709	河钢股份	194,000	428,740.00	0.46
96	000778	新兴铸管	110,600	424,704.00	0.46
97	600863	内蒙华电	98,000	424,340.00	0.46
98	600977	中国电影	36,500	423,765.00	0.46
99	600663	陆家嘴	43,000	423,120.00	0.46
100	002372	伟星新材	33,400	421,842.00	0.46
101	603228	景旺电子	15,100	420,384.00	0.45
102	002266	浙富控股	133,700	417,144.00	0.45
103	600060	海信视像	20,900	416,746.00	0.45
104	002019	亿帆医药	38,700	414,864.00	0.45
105	000937	冀中能源	65,600	414,592.00	0.45
106	600688	上海石化	134,300	405,586.00	0.44
107	601866	中远海发	154,500	403,245.00	0.44

108	601608	中信重工	95,900	402,780.00	0.44
109	000967	盈峰环境	79,600	395,612.00	0.43
110	002690	美亚光电	26,400	391,248.00	0.42
111	601228	广州港	115,200	390,528.00	0.42
112	002153	石基信息	54,300	387,702.00	0.42
113	600928	西安银行	106,900	385,909.00	0.42
114	688248	南网科技	12,000	385,080.00	0.42
115	688375	国博电子	7,800	385,008.00	0.42
116	000959	首钢股份	126,000	384,300.00	0.42
117	688520	神州细胞	10,600	384,038.00	0.42
118	600968	海油发展	88,700	378,749.00	0.41
119	003035	南网能源	90,500	378,290.00	0.41
120	603786	科博达	6,100	376,980.00	0.41
121	600361	创新新材	97,400	375,964.00	0.41
122	601158	重庆水务	75,700	370,930.00	0.40
123	000539	粤电力 A	79,800	361,494.00	0.39
124	601965	中国汽研	20,500	361,210.00	0.39
125	002517	恺英网络	25,300	344,333.00	0.37
126	603156	养元饮品	15,000	342,600.00	0.37
127	601611	中国核建	37,800	341,712.00	0.37
128	300001	特锐德	14,400	316,080.00	0.34
129	300251	光线传媒	30,700	289,808.00	0.31
130	002625	光启技术	6,000	286,800.00	0.31
131	600418	江淮汽车	7,000	262,500.00	0.28
132	600563	法拉电子	2,200	261,624.00	0.28
133	600927	永安期货	19,400	255,886.00	0.28
134	600499	科达制造	32,800	255,840.00	0.28
135	000039	中集集团	29,900	232,323.00	0.25
136	600008	首创环保	68,100	223,368.00	0.24
137	002273	水晶光电	8,600	191,092.00	0.21
138	300017	网宿科技	17,700	187,089.00	0.20
139	002185	华天科技	16,000	185,760.00	0.20
140	002410	广联达	14,900	175,224.00	0.19
141	603338	浙江鼎力	2,600	167,752.00	0.18
142	002432	九安医疗	4,100	167,198.00	0.18
143	603816	顾家家居	6,000	165,480.00	0.18
144	600637	东方明珠	21,300	165,288.00	0.18
145	600143	金发科技	19,100	165,024.00	0.18
146	600704	物产中大	32,600	164,956.00	0.18
147	002065	东华软件	22,700	164,802.00	0.18
148	300529	健帆生物	5,500	161,370.00	0.17
149	600998	九州通	31,400	160,768.00	0.17
150	000960	锡业股份	11,300	158,539.00	0.17

151	002368	太极股份	6,500	153,920.00	0.17
152	002557	洽洽食品	5,200	151,060.00	0.16
153	600517	国网英大	27,300	150,423.00	0.16
154	002608	江苏国信	19,100	146,497.00	0.16
155	000537	中绿电	15,900	145,008.00	0.16
156	603129	春风动力	900	141,363.00	0.15
157	002444	巨星科技	4,300	139,105.00	0.15
158	002531	天顺风能	17,500	138,425.00	0.15
159	601666	平煤股份	13,800	138,276.00	0.15
160	600153	建发股份	13,100	137,812.00	0.15
161	002508	老板电器	6,400	137,152.00	0.15
162	600549	厦门钨业	7,100	136,817.00	0.15
163	600021	上海电力	14,800	135,716.00	0.15
164	601061	中信金属	18,600	135,036.00	0.15
165	600141	兴发集团	6,200	134,540.00	0.15
166	600056	中国医药	12,100	134,310.00	0.15
167	300142	沃森生物	11,100	134,088.00	0.14
168	002465	海格通信	12,200	133,956.00	0.14
169	600390	五矿资本	20,400	131,580.00	0.14
170	688120	华海清科	800	130,392.00	0.14
171	600598	北大荒	8,600	126,850.00	0.14
172	600131	国网信通	6,300	119,133.00	0.13
173	601997	贵阳银行	19,000	114,000.00	0.12
174	300339	润和软件	1,600	80,048.00	0.09
175	002078	太阳纸业	4,500	66,915.00	0.07
176	000400	许继电气	1,900	52,307.00	0.06
177	600157	永泰能源	28,700	49,077.00	0.05
178	000988	华工科技	1,100	47,630.00	0.05
179	688099	晶晨股份	600	41,208.00	0.04
180	002384	东山精密	1,400	40,880.00	0.04
181	600348	华阳股份	5,600	39,704.00	0.04
182	002281	光迅科技	700	36,519.00	0.04
183	600578	京能电力	9,900	34,848.00	0.04
184	002926	华西证券	3,100	25,761.00	0.03
185	600839	四川长虹	2,500	24,125.00	0.03
186	002850	科达利	200	19,536.00	0.02
187	002797	第一创业	1,600	13,360.00	0.01
188	600339	中油工程	2,900	10,382.00	0.01

8.3.2 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	601877	正泰电器	20,800	486,928.00	0.53

2	002236	大华股份	29,100	465,600.00	0.50
3	688568	中科星图	6,800	347,004.00	0.38
4	601319	中国人保	45,300	345,186.00	0.37
5	600176	中国巨石	30,300	345,117.00	0.37
6	600875	东方电气	21,700	344,813.00	0.37
7	002032	苏泊尔	6,400	340,544.00	0.37
8	000100	TCL 科技	67,400	339,022.00	0.37
9	603806	福斯特	22,800	337,440.00	0.36
10	002007	华兰生物	20,000	337,000.00	0.36
11	300253	卫宁健康	46,800	335,088.00	0.36
12	002498	汉缆股份	98,700	334,593.00	0.36
13	600100	同方股份	47,000	334,170.00	0.36
14	300455	航天智装	25,500	330,480.00	0.36
15	300661	圣邦股份	4,000	327,120.00	0.35
16	688100	威胜信息	9,000	325,800.00	0.35
17	688728	格科微	24,000	322,560.00	0.35
18	000333	美的集团	4,100	308,402.00	0.33
19	000089	深圳机场	25,300	174,317.00	0.19
20	601799	星宇股份	1,200	160,176.00	0.17
21	601898	中煤能源	11,400	138,852.00	0.15
22	688093	世华科技	6,800	137,292.00	0.15
23	688553	汇宇制药	9,000	136,800.00	0.15
24	603987	康德莱	18,900	135,702.00	0.15
25	002091	江苏国泰	18,400	134,688.00	0.15
26	002546	新联电子	31,100	134,663.00	0.15
27	600383	金地集团	30,500	133,590.00	0.14
28	002550	千红制药	21,500	133,300.00	0.14
29	603039	泛微网络	2,700	132,300.00	0.14
30	000917	电广传媒	18,600	131,502.00	0.14
31	300777	中简科技	4,600	130,134.00	0.14
32	603799	华友钴业	4,300	125,818.00	0.14
33	603697	有友食品	11,300	115,034.00	0.12
34	301050	雷电微力	2,200	113,476.00	0.12
35	688588	凌志软件	6,800	93,840.00	0.10
36	002001	新和成	3,800	83,486.00	0.09
37	603301	振德医疗	3,700	81,363.00	0.09
38	600248	陕建股份	17,900	80,192.00	0.09
39	002459	晶澳科技	4,700	64,625.00	0.07
40	600066	宇通客车	2,200	58,036.00	0.06
41	000686	东北证券	7,100	56,374.00	0.06
42	300433	蓝思科技	1,900	41,610.00	0.04
43	601318	中国平安	700	36,855.00	0.04
44	600985	淮北矿业	2,200	30,954.00	0.03

45	600827	百联股份	1,500	16,395.00	0.02
46	300682	朗新集团	1,300	15,860.00	0.02
47	600967	内蒙一机	1,500	12,750.00	0.01
48	603205	健尔康	87	2,379.45	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002065	东华软件	7,719,474.00	14.58
2	002185	华天科技	7,199,034.53	13.60
3	601958	金铂股份	6,991,652.00	13.20
4	688002	睿创微纳	6,285,220.33	11.87
5	601997	贵阳银行	6,182,502.00	11.68
6	002558	巨人网络	5,994,901.00	11.32
7	600517	国网英大	5,655,114.00	10.68
8	000887	中鼎股份	5,652,765.00	10.68
9	601577	长沙银行	5,543,232.00	10.47
10	603456	九洲药业	5,507,260.00	10.40
11	600497	驰宏锌锗	5,474,042.86	10.34
12	002128	电投能源	5,466,287.64	10.32
13	300296	利亚德	5,361,864.00	10.13
14	300088	长信科技	5,228,367.00	9.87
15	600637	东方明珠	5,202,403.00	9.82
16	600901	江苏金租	5,025,288.00	9.49
17	600704	物产中大	4,952,595.00	9.35
18	300502	新易盛	4,876,431.00	9.21
19	000636	风华高科	4,871,152.00	9.20
20	601231	环旭电子	4,760,810.00	8.99
21	000739	普洛药业	4,721,158.28	8.92
22	000960	锡业股份	4,611,718.00	8.71
23	600380	健康元	4,594,745.00	8.68
24	000623	吉林敖东	4,574,967.12	8.64
25	000729	燕京啤酒	4,514,662.00	8.53
26	601636	旗滨集团	4,396,450.00	8.30
27	002153	石基信息	4,389,380.60	8.29
28	600927	永安期货	4,380,712.00	8.27
29	601966	玲珑轮胎	4,347,499.76	8.21
30	002056	横店东磁	4,337,392.00	8.19
31	000060	中金岭南	4,305,497.00	8.13
32	000959	首钢股份	4,297,596.00	8.12
33	688029	南微医学	4,213,575.87	7.96
34	600143	金发科技	4,188,953.00	7.91

35	002008	大族激光	4,184,933.00	7.90
36	688375	国博电子	4,178,278.21	7.89
37	300639	凯普生物	4,169,620.00	7.87
38	002138	顺络电子	4,162,208.00	7.86
39	600873	梅花生物	4,160,666.00	7.86
40	600329	达仁堂	4,137,968.15	7.81
41	600399	抚顺特钢	4,134,143.00	7.81
42	002563	森马服饰	4,134,025.00	7.81
43	600390	五矿资本	4,123,360.00	7.79
44	002472	双环传动	4,118,845.00	7.78
45	688819	天能股份	4,109,514.17	7.76
46	000728	国元证券	4,092,045.00	7.73
47	688425	铁建重工	4,090,495.39	7.72
48	601608	中信重工	4,073,421.00	7.69
49	000937	冀中能源	4,065,163.00	7.68
50	002500	山西证券	4,062,554.00	7.67
51	600909	华安证券	4,058,394.00	7.66
52	600867	通化东宝	4,056,960.80	7.66
53	600642	申能股份	4,015,825.00	7.58
54	600765	中航重机	3,955,652.00	7.47
55	600879	航天电子	3,930,237.00	7.42
56	601077	渝农商行	3,889,573.80	7.35
57	300001	特锐德	3,884,764.00	7.34
58	600967	内蒙一机	3,862,700.00	7.29
59	002195	岩山科技	3,850,341.00	7.27
60	600348	华阳股份	3,845,523.00	7.26
61	000559	万向钱潮	3,827,349.00	7.23
62	603228	景旺电子	3,814,808.29	7.20
63	600663	陆家嘴	3,798,377.72	7.17
64	002025	航天电器	3,794,285.50	7.17
65	600352	浙江龙盛	3,785,640.00	7.15
66	688772	珠海冠宇	3,762,045.45	7.10
67	601717	郑煤机	3,731,353.00	7.05
68	000878	云南铜业	3,707,584.00	7.00
69	600498	烽火通信	3,689,520.00	6.97
70	600862	中航高科	3,686,254.00	6.96
71	603517	绝味食品	3,675,218.00	6.94
72	002266	浙富控股	3,657,644.00	6.91
73	601990	南京证券	3,645,087.00	6.88
74	600598	北大荒	3,625,505.00	6.85
75	601058	赛轮轮胎	3,593,479.00	6.79
76	002092	ST 中泰	3,592,290.00	6.78
77	000027	深圳能源	3,586,544.00	6.77

78	601158	重庆水务	3,573,405.98	6.75
79	601216	君正集团	3,548,483.00	6.70
80	603185	弘元绿能	3,522,068.09	6.65
81	002223	鱼跃医疗	3,453,309.00	6.52
82	002120	韵达股份	3,451,016.00	6.52
83	002465	海格通信	3,441,189.00	6.50
84	601555	东吴证券	3,417,307.32	6.45
85	300383	光环新网	3,405,417.00	6.43
86	600959	江苏有线	3,399,846.00	6.42
87	600827	百联股份	3,362,855.00	6.35
88	600066	宇通客车	3,360,759.00	6.35
89	000547	航天发展	3,360,489.00	6.35
90	688234	天岳先进	3,336,873.51	6.30
91	000423	东阿阿胶	3,334,529.00	6.30
92	000933	神火股份	3,330,874.00	6.29
93	688276	百克生物	3,318,531.16	6.27
94	000987	越秀资本	3,291,756.65	6.22
95	603267	鸿远电子	3,284,830.00	6.20
96	601108	财通证券	3,271,429.00	6.18
97	000039	中集集团	3,247,096.00	6.13
98	000581	威孚高科	3,240,807.00	6.12
99	002340	格林美	3,174,115.00	5.99
100	002203	海亮股份	3,168,679.00	5.98
101	600528	中铁工业	3,151,224.00	5.95
102	000830	鲁西化工	3,145,227.00	5.94
103	605358	立昂微	3,135,166.00	5.92
104	600885	宏发股份	3,076,259.00	5.81
105	603927	中科软	3,049,020.32	5.76
106	600177	雅戈尔	3,021,460.00	5.71
107	002152	广电运通	3,015,768.00	5.70
108	000553	安道麦 A	3,010,509.00	5.69
109	300009	安科生物	3,007,933.33	5.68
110	603883	老百姓	2,973,384.70	5.62
111	688777	中控技术	2,971,361.89	5.61
112	600739	辽宁成大	2,953,664.00	5.58
113	000703	恒逸石化	2,948,018.00	5.57
114	603218	日月股份	2,942,697.00	5.56
115	300682	朗新集团	2,942,637.00	5.56
116	600271	航天信息	2,938,777.00	5.55
117	300017	网宿科技	2,922,965.00	5.52
118	600546	山煤国际	2,908,635.00	5.49
119	601611	中国核建	2,905,259.00	5.49
120	600500	中化国际	2,889,868.00	5.46

121	300504	天邑股份	2,876,696.76	5.43
122	002078	太阳纸业	2,867,262.00	5.41
123	600511	国药股份	2,858,453.00	5.40
124	300866	安克创新	2,850,002.40	5.38
125	002532	天山铝业	2,845,278.00	5.37
126	600655	豫园股份	2,841,013.00	5.37
127	601233	桐昆股份	2,823,224.00	5.33
128	601615	明阳智能	2,812,598.00	5.31
129	300776	帝尔激光	2,799,255.40	5.29
130	300054	鼎龙股份	2,786,660.00	5.26
131	000970	中科三环	2,778,754.00	5.25
132	603658	安图生物	2,756,279.00	5.21
133	603317	天味食品	2,746,062.00	5.19
134	601696	中银证券	2,740,594.00	5.18
135	000050	深天马 A	2,733,649.00	5.16
136	600699	均胜电子	2,730,775.00	5.16
137	002010	传化智联	2,729,742.54	5.16
138	600582	天地科技	2,710,543.00	5.12
139	300373	扬杰科技	2,703,712.00	5.11
140	002390	信邦制药	2,684,579.00	5.07
141	300003	乐普医疗	2,684,184.00	5.07
142	600109	国金证券	2,662,052.00	5.03
143	000778	新兴铸管	2,647,002.00	5.00
144	002966	苏州银行	2,644,538.00	4.99
145	603786	科博达	2,635,174.00	4.98
146	002409	雅克科技	2,633,199.00	4.97
147	000738	航发控制	2,625,007.00	4.96
148	603893	瑞芯微	2,605,357.00	4.92
149	601139	深圳燃气	2,598,240.00	4.91
150	688122	西部超导	2,584,917.63	4.88
151	600583	海油工程	2,563,739.00	4.84
152	600008	首创环保	2,552,763.40	4.82
153	002683	广东宏大	2,546,760.00	4.81
154	600499	科达制造	2,536,598.00	4.79
155	600315	上海家化	2,530,889.00	4.78
156	603688	石英股份	2,524,357.50	4.77
157	600261	阳光照明	2,510,494.00	4.74
158	600141	兴发集团	2,505,555.00	4.73
159	001203	大中矿业	2,505,282.68	4.73
160	600820	隧道股份	2,489,650.00	4.70
161	000009	中国宝安	2,470,092.00	4.66
162	000783	长江证券	2,443,237.00	4.61
163	600126	杭钢股份	2,439,252.00	4.61

164	600486	扬农化工	2,420,466.00	4.57
165	600848	上海临港	2,416,691.60	4.56
166	002436	兴森科技	2,413,276.00	4.56
167	603882	金域医学	2,410,086.00	4.55
168	002984	森麒麟	2,409,462.60	4.55
169	600392	盛和资源	2,405,560.00	4.54
170	002608	江苏国信	2,404,122.00	4.54
171	002517	恺英网络	2,397,586.00	4.53
172	000683	远兴能源	2,392,758.00	4.52
173	600839	四川长虹	2,383,330.00	4.50
174	002384	东山精密	2,381,787.00	4.50
175	300558	贝达药业	2,371,957.00	4.48
176	300136	信维通信	2,348,307.00	4.43
177	600299	安迪苏	2,346,903.00	4.43
178	002032	苏泊尔	2,338,103.00	4.42
179	688028	沃尔德	2,294,467.54	4.33
180	603939	益丰药房	2,290,460.80	4.33
181	300451	创业慧康	2,289,344.00	4.32
182	605068	明新旭腾	2,282,740.00	4.31
183	600597	光明乳业	2,241,395.00	4.23
184	600863	内蒙华电	2,240,688.00	4.23
185	002156	通富微电	2,236,457.00	4.22
186	000967	盈峰环境	2,231,459.00	4.21
187	002414	高德红外	2,228,764.50	4.21
188	000591	太阳能	2,219,646.00	4.19
189	300253	卫宁健康	2,211,599.00	4.18
190	600098	广州发展	2,204,712.00	4.16
191	301267	华夏眼科	2,195,787.00	4.15
192	600377	宁沪高速	2,195,714.32	4.15
193	002439	启明星辰	2,195,222.29	4.15
194	601168	西部矿业	2,195,022.00	4.15
195	600398	海澜之家	2,193,605.00	4.14
196	601098	中南传媒	2,176,508.00	4.11
197	002202	金风科技	2,174,503.00	4.11
198	600060	海信视像	2,163,980.00	4.09
199	688385	复旦微电	2,153,447.55	4.07
200	300551	古鳌科技	2,150,805.00	4.06
201	688220	翱捷科技	2,144,188.46	4.05
202	600859	王府井	2,131,363.00	4.02
203	688571	杭华股份	2,128,393.18	4.02
204	002506	协鑫集成	2,117,743.00	4.00
205	000825	太钢不锈	2,112,732.00	3.99
206	688169	石头科技	2,105,477.82	3.98

207	002300	太阳电缆	2,095,397.20	3.96
208	000156	华数传媒	2,086,143.00	3.94
209	600521	华海药业	2,082,637.00	3.93
210	688553	汇宇制药	2,074,778.40	3.92
211	600004	白云机场	2,066,237.00	3.90
212	002228	合兴包装	2,062,530.00	3.90
213	688188	柏楚电子	2,060,403.37	3.89
214	601598	中国外运	2,055,786.00	3.88
215	688728	格科微	2,046,366.67	3.86
216	600350	山东高速	2,033,606.00	3.84
217	688588	凌志软件	2,030,595.19	3.83
218	300396	迪瑞医疗	2,030,208.00	3.83
219	300850	新强联	2,020,543.00	3.82
220	002044	美年健康	2,018,103.00	3.81
221	603156	养元饮品	2,012,142.00	3.80
222	002372	伟星新材	2,008,989.00	3.79
223	002531	天顺风能	1,989,925.00	3.76
224	002244	滨江集团	1,931,479.00	3.65
225	600032	浙江新能	1,927,232.00	3.64
226	600095	湘财股份	1,920,907.16	3.63
227	600038	中直股份	1,913,322.00	3.61
228	688690	纳微科技	1,903,640.12	3.59
229	603833	欧派家居	1,898,236.00	3.58
230	002429	兆驰股份	1,895,111.00	3.58
231	601156	东航物流	1,878,071.00	3.55
232	600998	九州通	1,868,929.00	3.53
233	600941	中国移动	1,867,718.00	3.53
234	600273	嘉化能源	1,834,377.00	3.46
235	002430	杭氧股份	1,831,304.00	3.46
236	002299	圣农发展	1,826,177.00	3.45
237	002399	海普瑞	1,822,738.00	3.44
238	001872	招商港口	1,822,136.00	3.44
239	688133	泰坦科技	1,821,203.65	3.44
240	603305	旭升集团	1,817,516.00	3.43
241	600906	财达证券	1,803,451.00	3.41
242	300357	我武生物	1,799,837.00	3.40
243	600968	海油发展	1,797,325.00	3.39
244	000709	河钢股份	1,790,122.00	3.38
245	002135	东南网架	1,770,589.00	3.34
246	300070	碧水源	1,753,265.00	3.31
247	002375	亚厦股份	1,752,518.00	3.31
248	600153	建发股份	1,737,899.00	3.28
249	688586	江航装备	1,725,306.87	3.26

250	000513	丽珠集团	1,721,916.00	3.25
251	002557	洽洽食品	1,720,145.00	3.25
252	603987	康德莱	1,718,760.00	3.25
253	002020	京新药业	1,710,561.00	3.23
254	603979	金诚信	1,699,375.00	3.21
255	600580	卧龙电驱	1,694,686.00	3.20
256	000932	华菱钢铁	1,691,923.00	3.20
257	600566	济川药业	1,684,258.00	3.18
258	002783	凯龙股份	1,682,605.00	3.18
259	600258	首旅酒店	1,679,263.00	3.17
260	003031	中瓷电子	1,679,100.00	3.17
261	603613	国联股份	1,675,160.00	3.16
262	002867	周大生	1,652,991.00	3.12
263	002831	裕同科技	1,651,878.54	3.12
264	002978	安宁股份	1,647,032.00	3.11
265	688295	中复神鹰	1,646,701.89	3.11
266	301029	怡合达	1,639,003.00	3.10
267	300638	广和通	1,633,108.00	3.08
268	601666	平煤股份	1,624,846.00	3.07
269	300146	汤臣倍健	1,618,965.00	3.06
270	600063	皖维高新	1,611,029.00	3.04
271	002273	水晶光电	1,607,462.00	3.04
272	000725	京东方 A	1,607,062.00	3.03
273	601677	明泰铝业	1,606,798.00	3.03
274	002497	雅化集团	1,598,947.13	3.02
275	603758	秦安股份	1,596,353.00	3.01
276	688536	思瑞浦	1,594,877.11	3.01
277	002294	信立泰	1,590,286.00	3.00
278	603233	大参林	1,588,073.76	3.00
279	600435	北方导航	1,586,720.00	3.00
280	002539	云图控股	1,564,790.00	2.96
281	603697	有友食品	1,555,968.00	2.94
282	002511	中顺洁柔	1,547,953.40	2.92
283	600481	双良节能	1,547,110.00	2.92
284	300699	光威复材	1,542,331.40	2.91
285	600369	西南证券	1,537,450.00	2.90
286	002468	申通快递	1,523,607.00	2.88
287	688387	信科移动	1,518,720.24	2.87
288	300207	欣旺达	1,512,990.00	2.86
289	688231	隆达股份	1,499,937.69	2.83
290	600418	江淮汽车	1,488,366.00	2.81
291	002507	涪陵榨菜	1,487,471.80	2.81
292	002131	利欧股份	1,486,095.00	2.81

293	601222	林洋能源	1,483,135.00	2.80
294	000818	航锦科技	1,477,166.00	2.79
295	002939	长城证券	1,474,041.00	2.78
296	688521	芯原股份	1,471,724.11	2.78
297	688475	萤石网络	1,460,132.59	2.76
298	300741	华宝股份	1,452,519.00	2.74
299	688208	道通科技	1,447,913.38	2.73
300	601778	晶科科技	1,446,044.00	2.73
301	002385	大北农	1,445,969.00	2.73
302	600556	天下秀	1,445,068.00	2.73
303	600096	云天化	1,436,424.00	2.71
304	600731	湖南海利	1,433,966.00	2.71
305	600021	上海电力	1,433,159.00	2.71
306	688200	华峰测控	1,428,602.74	2.70
307	688312	燕麦科技	1,426,882.49	2.69
308	002240	盛新锂能	1,419,559.00	2.68
309	601568	北元集团	1,415,205.00	2.67
310	600219	南山铝业	1,413,914.00	2.67
311	600129	太极集团	1,411,908.00	2.67
312	688281	华秦科技	1,410,525.02	2.66
313	000402	金融街	1,409,280.00	2.66
314	002262	恩华药业	1,405,603.00	2.65
315	000893	亚钾国际	1,403,533.00	2.65
316	688349	三一重能	1,401,303.98	2.65
317	601928	凤凰传媒	1,397,528.00	2.64
318	600970	中材国际	1,395,318.00	2.64
319	002028	思源电气	1,393,414.00	2.63
320	603366	日出东方	1,389,877.00	2.62
321	300259	新天科技	1,389,241.00	2.62
322	002624	完美世界	1,388,332.00	2.62
323	000883	湖北能源	1,387,055.00	2.62
324	688033	天宜上佳	1,384,526.53	2.61
325	300506	*ST 名家	1,384,448.00	2.61
326	300595	欧普康视	1,382,991.00	2.61
327	300012	华测检测	1,377,383.00	2.60
328	600170	上海建工	1,362,453.00	2.57
329	600612	老凤祥	1,354,746.00	2.56
330	002276	万马股份	1,349,874.00	2.55
331	002236	大华股份	1,349,450.00	2.55
332	688105	诺唯赞	1,349,028.55	2.55
333	600118	中国卫星	1,341,906.00	2.53
334	603816	顾家家居	1,319,664.00	2.49
335	000530	冰山冷热	1,307,190.00	2.47

336	600079	人福医药	1,298,550.00	2.45
337	603338	浙江鼎力	1,292,880.00	2.44
338	000089	深圳机场	1,284,474.06	2.43
339	002743	富煌钢构	1,277,876.00	2.41
340	603529	爱玛科技	1,276,128.00	2.41
341	000811	冰轮环境	1,275,194.00	2.41
342	002595	豪迈科技	1,275,170.00	2.41
343	000055	方大集团	1,274,396.00	2.41
344	603355	莱克电气	1,256,539.00	2.37
345	002030	达安基因	1,247,163.00	2.36
346	600737	中粮糖业	1,246,030.00	2.35
347	603737	三棵树	1,242,409.00	2.35
348	600379	宝光股份	1,233,689.00	2.33
349	688528	秦川物联	1,232,040.91	2.33
350	600491	龙元建设	1,210,867.00	2.29
351	300026	红日药业	1,204,926.00	2.28
352	601186	中国铁建	1,198,029.00	2.26
353	601801	皖新传媒	1,194,861.00	2.26
354	688172	燕东微	1,193,455.04	2.25
355	300860	锋尚文化	1,187,555.00	2.24
356	002791	坚朗五金	1,183,475.00	2.23
357	600208	衢州发展	1,176,728.00	2.22
358	600256	广汇能源	1,166,856.00	2.20
359	000661	长春高新	1,166,461.90	2.20
360	600835	上海机电	1,160,323.00	2.19
361	600487	亨通光电	1,155,293.00	2.18
362	601601	中国太保	1,139,386.00	2.15
363	688678	福立旺	1,131,287.04	2.14
364	603303	得邦照明	1,131,098.00	2.14
365	300303	聚飞光电	1,128,847.00	2.13
366	002546	新联电子	1,128,452.50	2.13
367	688099	晶晨股份	1,127,360.35	2.13
368	600057	厦门象屿	1,121,938.00	2.12
369	002287	奇正藏药	1,121,045.00	2.12
370	300573	兴齐眼药	1,120,790.60	2.12
371	300679	电连技术	1,118,403.00	2.11
372	301283	聚胶股份	1,117,864.00	2.11
373	002060	广东建工	1,114,152.00	2.10
374	600480	凌云股份	1,113,923.00	2.10
375	600549	厦门钨业	1,113,215.00	2.10
376	000969	安泰科技	1,109,646.00	2.10
377	688111	金山办公	1,102,950.35	2.08
378	603661	恒林股份	1,099,945.00	2.08

379	688209	英集芯	1,099,074.80	2.08
380	300416	苏试试验	1,093,319.00	2.06
381	600105	永鼎股份	1,090,874.00	2.06
382	300861	美畅股份	1,088,857.00	2.06
383	002645	华宏科技	1,088,505.00	2.06
384	000789	万年青	1,079,554.00	2.04
385	600062	华润双鹤	1,070,208.00	2.02
386	002422	科伦药业	1,065,303.00	2.01
387	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002065	东华软件	7,918,687.00	14.95
2	002185	华天科技	7,709,875.00	14.56
3	601958	金钼股份	6,734,998.00	12.72
4	002558	巨人网络	6,266,746.00	11.83
5	000887	中鼎股份	6,253,764.00	11.81
6	600497	驰宏锌锗	6,196,271.00	11.70
7	601997	贵阳银行	6,191,620.00	11.69
8	600517	国网英大	5,982,890.00	11.30
9	600637	东方明珠	5,717,145.48	10.80
10	688002	睿创微纳	5,680,990.97	10.73
11	002128	电投能源	5,312,209.72	10.03
12	300296	利亚德	5,272,853.00	9.96
13	600704	物产中大	5,150,289.85	9.73
14	603456	九洲药业	5,098,736.00	9.63
15	000636	风华高科	5,089,355.02	9.61
16	300088	长信科技	4,971,010.00	9.39
17	601577	长沙银行	4,928,595.00	9.31
18	000960	锡业股份	4,884,522.00	9.22
19	601636	旗滨集团	4,845,216.00	9.15
20	600901	江苏金租	4,809,332.62	9.08
21	300502	新易盛	4,737,146.00	8.95
22	601058	赛轮轮胎	4,618,790.00	8.72
23	600390	五矿资本	4,609,201.00	8.70
24	601231	环旭电子	4,552,645.00	8.60
25	002056	横店东磁	4,483,944.00	8.47
26	000739	普洛药业	4,424,873.70	8.36
27	600927	永安期货	4,393,234.00	8.30

28	000728	国元证券	4,379,108.00	8.27
29	002472	双环传动	4,335,488.00	8.19
30	000559	万向钱潮	4,276,660.20	8.08
31	600879	航天电子	4,234,206.00	8.00
32	002500	山西证券	4,224,809.30	7.98
33	000623	吉林敖东	4,196,332.77	7.92
34	600498	烽火通信	4,188,738.00	7.91
35	002008	大族激光	4,180,736.00	7.90
36	600642	申能股份	4,155,967.00	7.85
37	002563	森马服饰	4,155,277.00	7.85
38	000729	燕京啤酒	4,136,254.00	7.81
39	600399	抚顺特钢	4,131,193.00	7.80
40	601077	渝农商行	4,113,514.60	7.77
41	688819	天能股份	4,096,014.85	7.74
42	600909	华安证券	4,049,076.00	7.65
43	601966	玲珑轮胎	4,031,358.00	7.61
44	688029	南微医学	4,026,920.89	7.60
45	600380	健康元	4,021,601.00	7.59
46	300001	特锐德	3,975,738.00	7.51
47	603228	景旺电子	3,945,192.00	7.45
48	688375	国博电子	3,934,574.55	7.43
49	600765	中航重机	3,910,610.00	7.39
50	600143	金发科技	3,893,697.00	7.35
51	600867	通化东宝	3,891,548.00	7.35
52	600329	达仁堂	3,885,121.66	7.34
53	300639	凯普生物	3,871,711.00	7.31
54	600066	宇通客车	3,870,214.00	7.31
55	600663	陆家嘴	3,869,451.00	7.31
56	600967	内蒙一机	3,846,470.00	7.26
57	000959	首钢股份	3,846,463.00	7.26
58	002153	石基信息	3,828,752.80	7.23
59	000060	中金岭南	3,810,923.00	7.20
60	000937	冀中能源	3,790,610.00	7.16
61	688276	百克生物	3,784,466.38	7.15
62	600959	江苏有线	3,773,997.00	7.13
63	002195	岩山科技	3,765,285.00	7.11
64	601216	君正集团	3,758,973.00	7.10
65	601608	中信重工	3,690,932.00	6.97
66	600862	中航高科	3,688,221.00	6.97
67	002025	航天电器	3,669,577.78	6.93
68	603517	绝味食品	3,642,619.00	6.88
69	603185	弘元绿能	3,575,261.53	6.75
70	600873	梅花生物	3,530,282.00	6.67

71	603218	日月股份	3,528,943.54	6.66
72	688234	天岳先进	3,494,531.23	6.60
73	600598	北大荒	3,490,462.00	6.59
74	000027	深圳能源	3,449,187.00	6.51
75	600348	华阳股份	3,445,159.00	6.51
76	002223	鱼跃医疗	3,434,157.00	6.49
77	002138	顺络电子	3,408,417.00	6.44
78	688772	珠海冠宇	3,407,746.24	6.44
79	300383	光环新网	3,404,659.00	6.43
80	601717	郑煤机	3,404,543.00	6.43
81	300009	安科生物	3,386,681.46	6.40
82	603893	瑞芯微	3,374,880.00	6.37
83	603927	中科软	3,365,019.00	6.35
84	002152	广电运通	3,351,369.00	6.33
85	603267	鸿远电子	3,337,446.00	6.30
86	000933	神火股份	3,332,205.00	6.29
87	000878	云南铜业	3,325,046.14	6.28
88	601555	东吴证券	3,301,379.34	6.23
89	002340	格林美	3,294,535.00	6.22
90	000039	中集集团	3,290,036.00	6.21
91	002120	韵达股份	3,279,868.00	6.19
92	002683	广东宏大	3,214,920.00	6.07
93	601158	重庆水务	3,214,133.00	6.07
94	688425	铁建重工	3,211,467.29	6.06
95	600739	辽宁成大	3,210,923.00	6.06
96	300682	朗新集团	3,210,036.00	6.06
97	000423	东阿阿胶	3,208,738.00	6.06
98	002203	海亮股份	3,206,211.00	6.05
99	000581	威孚高科	3,198,259.50	6.04
100	600827	百联股份	3,192,675.00	6.03
101	603317	天味食品	3,172,951.00	5.99
102	300776	帝尔激光	3,168,246.00	5.98
103	000987	越秀资本	3,158,421.50	5.96
104	600177	雅戈尔	3,145,901.00	5.94
105	600271	航天信息	3,145,327.00	5.94
106	002465	海格通信	3,144,961.00	5.94
107	000547	航天发展	3,140,275.00	5.93
108	002266	浙富控股	3,137,676.00	5.93
109	605358	立昂微	3,104,557.00	5.86
110	601990	南京证券	3,091,179.00	5.84
111	688385	复旦微电	3,084,404.37	5.82
112	000553	安道麦 A	3,026,509.00	5.72
113	002092	ST 中泰	2,988,214.00	5.64

114	300054	鼎龙股份	2,972,172.00	5.61
115	601108	财通证券	2,952,834.00	5.58
116	600352	浙江龙盛	2,932,740.00	5.54
117	300504	天邑股份	2,926,968.00	5.53
118	000970	中科三环	2,917,182.50	5.51
119	601139	深圳燃气	2,911,345.00	5.50
120	600141	兴发集团	2,899,805.00	5.48
121	000703	恒逸石化	2,897,170.00	5.47
122	603883	老百姓	2,883,866.00	5.45
123	002078	太阳纸业	2,862,110.96	5.40
124	300017	网宿科技	2,788,460.15	5.27
125	002384	东山精密	2,773,805.00	5.24
126	601615	明阳智能	2,769,593.00	5.23
127	600546	山煤国际	2,717,724.00	5.13
128	600398	海澜之家	2,717,317.00	5.13
129	600511	国药股份	2,701,270.00	5.10
130	600528	中铁工业	2,687,141.00	5.07
131	300866	安克创新	2,676,756.68	5.05
132	000830	鲁西化工	2,627,505.00	4.96
133	600500	中化国际	2,623,076.00	4.95
134	600377	宁沪高速	2,615,397.88	4.94
135	002966	苏州银行	2,613,512.00	4.94
136	002010	传化智联	2,581,513.00	4.88
137	300003	乐普医疗	2,572,416.00	4.86
138	600885	宏发股份	2,568,908.00	4.85
139	601611	中国核建	2,560,155.71	4.83
140	300558	贝达药业	2,555,385.00	4.83
141	601233	桐昆股份	2,520,288.00	4.76
142	600655	豫园股份	2,510,635.00	4.74
143	600839	四川长虹	2,510,364.00	4.74
144	000009	中国宝安	2,503,638.00	4.73
145	001203	大中矿业	2,501,308.00	4.72
146	002202	金风科技	2,499,577.00	4.72
147	600392	盛和资源	2,499,507.00	4.72
148	000050	深天马 A	2,493,869.00	4.71
149	002390	信邦制药	2,459,703.00	4.65
150	600848	上海临港	2,458,234.20	4.64
151	002608	江苏国信	2,455,130.00	4.64
152	002436	兴森科技	2,424,359.00	4.58
153	002156	通富微电	2,408,790.00	4.55
154	000738	航发控制	2,403,639.00	4.54
155	002532	天山铝业	2,400,498.00	4.53
156	600126	杭钢股份	2,388,372.00	4.51

157	301029	怡合达	2,361,507.00	4.46
158	600261	阳光照明	2,345,591.00	4.43
159	300136	信维通信	2,341,741.00	4.42
160	000156	华数传媒	2,336,539.00	4.41
161	603658	安图生物	2,323,559.00	4.39
162	600315	上海家化	2,309,602.00	4.36
163	600008	首创环保	2,301,408.20	4.35
164	600499	科达制造	2,283,850.00	4.31
165	000591	太阳能	2,277,246.00	4.30
166	688169	石头科技	2,272,407.54	4.29
167	601098	中南传媒	2,269,228.00	4.29
168	600941	中国移动	2,260,227.00	4.27
169	002867	周大生	2,241,987.00	4.23
170	603688	石英股份	2,236,492.00	4.22
171	002409	雅克科技	2,229,913.00	4.21
172	600582	天地科技	2,223,456.00	4.20
173	300373	扬杰科技	2,220,739.00	4.19
174	002032	苏泊尔	2,211,415.00	4.18
175	601696	中银证券	2,209,360.00	4.17
176	002429	兆驰股份	2,198,554.00	4.15
177	688777	中控技术	2,167,624.45	4.09
178	600699	均胜电子	2,151,886.00	4.06
179	688028	沃尔德	2,149,525.79	4.06
180	000967	盈峰环境	2,138,490.00	4.04
181	688220	翱捷科技	2,128,444.03	4.02
182	000778	新兴铸管	2,126,032.00	4.01
183	600580	卧龙电驱	2,125,998.00	4.01
184	600597	光明乳业	2,124,250.00	4.01
185	300357	我武生物	2,119,949.00	4.00
186	300451	创业慧康	2,110,943.80	3.99
187	002244	滨江集团	2,097,485.00	3.96
188	603882	金城医学	2,091,232.00	3.95
189	603833	欧派家居	2,085,487.00	3.94
190	000783	长江证券	2,079,916.00	3.93
191	002439	启明星辰	2,070,137.00	3.91
192	600998	九州通	2,060,987.00	3.89
193	002517	恺英网络	2,049,267.00	3.87
194	600032	浙江新能	2,035,707.00	3.84
195	605068	明新旭腾	2,032,750.00	3.84
196	601598	中国外运	2,029,858.00	3.83
197	600859	王府井	2,026,568.00	3.83
198	688188	柏楚电子	2,017,878.88	3.81
199	600486	扬农化工	2,017,160.00	3.81

200	002506	协鑫集成	2,012,570.00	3.80
201	688122	西部超导	2,007,770.55	3.79
202	000825	太钢不锈	2,003,924.00	3.78
203	600350	山东高速	2,003,921.00	3.78
204	600906	财达证券	1,994,044.00	3.77
205	601677	明泰铝业	1,940,580.00	3.66
206	600153	建发股份	1,922,696.00	3.63
207	000683	远兴能源	1,916,640.00	3.62
208	301267	华夏眼科	1,913,354.00	3.61
209	603786	科博达	1,905,008.00	3.60
210	002414	高德红外	1,903,686.00	3.60
211	002399	海普瑞	1,903,558.00	3.59
212	300850	新强联	1,899,570.00	3.59
213	002300	太阳电缆	1,898,577.14	3.59
214	600109	国金证券	1,896,276.00	3.58
215	002228	合兴包装	1,881,078.00	3.55
216	688208	道通科技	1,879,767.01	3.55
217	600273	嘉化能源	1,878,184.00	3.55
218	601156	东航物流	1,871,528.00	3.53
219	002294	信立泰	1,865,637.00	3.52
220	688553	汇宇制药	1,851,220.86	3.50
221	688571	杭华股份	1,846,655.77	3.49
222	001872	招商港口	1,846,295.00	3.49
223	600095	湘财股份	1,845,692.00	3.49
224	002984	森麒麟	1,837,971.00	3.47
225	600820	隧道股份	1,831,236.00	3.46
226	600583	海油工程	1,819,242.00	3.44
227	002299	圣农发展	1,814,792.00	3.43
228	002044	美年健康	1,807,933.00	3.41
229	600299	安迪苏	1,799,810.00	3.40
230	300396	迪瑞医疗	1,796,205.00	3.39
231	002131	利欧股份	1,795,674.00	3.39
232	688588	凌志软件	1,790,616.69	3.38
233	601168	西部矿业	1,773,730.00	3.35
234	600369	西南证券	1,769,743.00	3.34
235	002020	京新药业	1,765,604.00	3.33
236	603305	旭升集团	1,764,265.59	3.33
237	600863	内蒙华电	1,761,704.00	3.33
238	688536	思瑞浦	1,756,418.00	3.32
239	603613	国联股份	1,755,438.44	3.32
240	688690	纳微科技	1,746,980.47	3.30
241	600060	海信视像	1,742,737.00	3.29
242	002468	申通快递	1,741,950.00	3.29

243	300070	碧水源	1,722,246.00	3.25
244	002028	思源电气	1,713,257.00	3.24
245	688586	江航装备	1,706,351.35	3.22
246	300253	卫宁健康	1,700,455.00	3.21
247	002783	凯龙股份	1,690,807.00	3.19
248	002375	亚厦股份	1,685,472.00	3.18
249	600737	中粮糖业	1,682,558.00	3.18
250	002135	东南网架	1,680,011.00	3.17
251	603939	益丰药房	1,679,929.00	3.17
252	300741	华宝股份	1,673,320.00	3.16
253	002511	中顺洁柔	1,670,037.84	3.15
254	601666	平煤股份	1,669,030.00	3.15
255	002372	伟星新材	1,667,390.00	3.15
256	603979	金诚信	1,666,999.00	3.15
257	688728	格科微	1,665,073.61	3.14
258	600481	双良节能	1,661,032.00	3.14
259	002273	水晶光电	1,658,800.00	3.13
260	000513	丽珠集团	1,658,058.00	3.13
261	600521	华海药业	1,655,991.00	3.13
262	601222	林洋能源	1,650,838.00	3.12
263	688133	泰坦科技	1,645,094.80	3.11
264	300638	广和通	1,628,464.00	3.08
265	603156	养元饮品	1,605,988.00	3.03
266	000725	京东方 A	1,600,284.00	3.02
267	000402	金融街	1,587,137.00	3.00
268	000089	深圳机场	1,585,560.00	2.99
269	002531	天顺风能	1,583,439.99	2.99
270	600098	广州发展	1,581,461.00	2.99
271	002978	安宁股份	1,572,778.00	2.97
272	600118	中国卫星	1,572,583.74	2.97
273	600004	白云机场	1,566,521.00	2.96
274	688312	燕麦科技	1,563,430.20	2.95
275	688105	诺唯赞	1,552,726.91	2.93
276	600566	济川药业	1,551,563.00	2.93
277	603355	莱克电气	1,550,142.00	2.93
278	600063	皖维高新	1,548,478.00	2.92
279	002430	杭氧股份	1,536,108.00	2.90
280	600418	江淮汽车	1,536,105.00	2.90
281	300146	汤臣倍健	1,531,731.00	2.89
282	688281	华秦科技	1,521,334.00	2.87
283	601928	凤凰传媒	1,520,609.00	2.87
284	600435	北方导航	1,508,373.00	2.85
285	688387	信科移动	1,503,010.76	2.84

286	002557	洽洽食品	1,497,263.00	2.83
287	002539	云图控股	1,496,350.00	2.83
288	688349	三一重能	1,496,346.09	2.83
289	300861	美畅股份	1,490,505.00	2.81
290	600219	南山铝业	1,490,101.00	2.81
291	000932	华菱钢铁	1,486,467.00	2.81
292	600038	中直股份	1,474,685.00	2.78
293	601568	北元集团	1,473,052.70	2.78
294	002497	雅化集团	1,465,656.00	2.77
295	688295	中复神鹰	1,457,163.71	2.75
296	688172	燕东微	1,453,728.31	2.75
297	688475	萤石网络	1,449,476.62	2.74
298	600129	太极集团	1,441,792.00	2.72
299	002645	华宏科技	1,441,097.00	2.72
300	300595	欧普康视	1,426,727.00	2.69
301	600968	海油发展	1,425,872.00	2.69
302	300012	华测检测	1,423,445.00	2.69
303	688231	隆达股份	1,422,562.55	2.69
304	002262	恩华药业	1,405,698.00	2.65
305	600731	湖南海利	1,400,042.00	2.64
306	300551	古鳌科技	1,395,331.00	2.64
307	002624	完美世界	1,392,002.95	2.63
308	688200	华峰测控	1,386,441.06	2.62
309	002240	盛新锂能	1,385,631.00	2.62
310	000811	冰轮环境	1,379,406.00	2.60
311	600170	上海建工	1,372,392.00	2.59
312	002422	科伦药业	1,369,740.72	2.59
313	003031	中瓷电子	1,365,259.00	2.58
314	002276	万马股份	1,347,795.00	2.55
315	300259	新天科技	1,341,565.00	2.53
316	600612	老凤祥	1,339,193.00	2.53
317	600556	天下秀	1,338,350.00	2.53
318	600970	中材国际	1,331,960.00	2.52
319	600021	上海电力	1,330,995.00	2.51
320	600755	厦门国贸	1,322,442.00	2.50
321	603697	有友食品	1,320,395.00	2.49
322	688439	振华风光	1,316,995.88	2.49
323	603233	大参林	1,314,977.00	2.48
324	601801	皖新传媒	1,312,736.00	2.48
325	603529	爱玛科技	1,304,094.00	2.46
326	600161	天坛生物	1,293,630.00	2.44
327	603987	康德莱	1,293,239.00	2.44
328	600379	宝光股份	1,282,613.00	2.42

329	600079	人福医药	1,277,591.00	2.41
330	600480	凌云股份	1,276,362.00	2.41
331	688033	天宜上佳	1,276,181.04	2.41
332	000530	冰山冷热	1,275,135.00	2.41
333	603366	日出东方	1,273,815.00	2.41
334	603000	人民网	1,267,208.00	2.39
335	000893	亚钾国际	1,267,164.00	2.39
336	000709	河钢股份	1,267,073.00	2.39
337	601778	晶科科技	1,247,114.00	2.36
338	600258	首旅酒店	1,245,896.00	2.35
339	002939	长城证券	1,237,941.00	2.34
340	601601	中国太保	1,234,545.00	2.33
341	000818	航锦科技	1,227,957.00	2.32
342	603758	秦安股份	1,227,618.00	2.32
343	000750	国海证券	1,220,329.00	2.30
344	002743	富煌钢构	1,218,514.00	2.30
345	300303	聚飞光电	1,212,275.00	2.29
346	600208	衢州发展	1,207,948.00	2.28
347	300026	红日药业	1,206,830.00	2.28
348	002287	奇正藏药	1,206,245.00	2.28
349	600491	龙元建设	1,202,005.00	2.27
350	601118	海南橡胶	1,200,070.00	2.27
351	002831	裕同科技	1,198,332.00	2.26
352	600549	厦门钨业	1,197,684.00	2.26
353	603338	浙江鼎力	1,194,438.00	2.26
354	600256	广汇能源	1,190,524.00	2.25
355	000055	方大集团	1,190,026.00	2.25
356	002030	达安基因	1,183,914.00	2.24
357	000661	长春高新	1,182,592.00	2.23
358	600835	上海机电	1,181,450.00	2.23
359	688099	晶晨股份	1,171,312.32	2.21
360	603737	三棵树	1,170,806.00	2.21
361	002791	坚朗五金	1,163,831.00	2.20
362	300416	苏试试验	1,163,666.00	2.20
363	002540	亚太科技	1,155,589.00	2.18
364	002996	顺博合金	1,151,307.10	2.17
365	600155	华创云信	1,129,523.00	2.13
366	600325	华发股份	1,128,173.00	2.13
367	002060	广东建工	1,123,184.00	2.12
368	688678	福立旺	1,116,626.45	2.11
369	688209	英集芯	1,116,544.00	2.11
370	688521	芯原股份	1,115,462.06	2.11
371	600064	南京高科	1,114,768.00	2.11

372	300860	锋尚文化	1, 113, 407. 00	2. 10
373	688528	秦川物联	1, 112, 908. 99	2. 10
374	000969	安泰科技	1, 109, 443. 00	2. 10
375	688111	金山办公	1, 105, 056. 07	2. 09
376	301283	聚胶股份	1, 099, 019. 00	2. 08
377	300679	电连技术	1, 092, 883. 00	2. 06
378	603306	华懋科技	1, 090, 210. 00	2. 06
379	002507	涪陵榨菜	1, 086, 993. 50	2. 05
380	002738	中矿资源	1, 078, 621. 00	2. 04
381	300699	光威复材	1, 070, 579. 00	2. 02
382	601186	中国铁建	1, 070, 373. 00	2. 02
383	300395	菲利华	1, 066, 524. 00	2. 01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1, 168, 873, 398. 12
卖出股票收入（成交）总额	1, 132, 997, 795. 04

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

国金证券股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会厦门监管局处罚；

长江证券股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会湖北监管局处罚。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	549,081.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,006,994.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,556,076.05

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	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	1,074	79,394.85	11,373,966.33	13.34	73,896,106.76	86.66
民生加银中证 500 指数增强发起式 C	2,795	14,879.23	2,143,788.86	5.15	39,443,659.12	94.85
合计	3,869	32,788.19	13,517,755.19	10.66	113,339,765.88	89.34

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	民生加银中证 500 指数增强发起式 A	23,570.57	0.0276
	民生加银中证 500 指数增强发起式 C	2,824.59	0.0068

	合计	26,395.16	0.0208
--	----	-----------	--------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

9.4 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	7.88	10,002,500.25	7.88	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	7.89	10,002,500.25	7.88	-

§ 10 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	53,009,690.54	19,777,583.58

份额总额		
本报告期基金总申购份额	468,054,390.76	336,771,136.54
减：本报告期基金总赎回份额	435,794,008.21	314,961,272.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	85,270,073.09	41,587,447.98

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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；于 2024 年 11 月 2 日发布公告，自 2024 年 10 月 31 日起聘任王国栋先生担任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 28,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国盛证券	2	1,325,520,493.83	57.58	359,440.91	53.13	-
财信证券	3	764,462,744.73	33.21	159,968.93	23.65	-
兴业证券	1	120,381,451.26	5.23	89,791.30	13.27	-
中信证券	2	91,493,816.44	3.97	67,330.90	9.95	-
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本基金在本报告期由托管结算模式转换为证券公司交易结算模式，本期选择财信证券、国盛证券作为证券经纪商。

②本基金管理人负责选择证券公司，选择标准如下：

- i 具备证券经纪业务资格；
- ii 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- 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，具备完善的风险管理与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 最近两年未发生重大风险、最近三年无重大违法违规记录且未处于立案调查过程中；
- vi 具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合处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。

③基金的证券公司选择程序如下：

- i 本基金管理人根据上述标准建立券商准入评价流程，通过实施充分的业务隔离机制，依据

评价得分结果，确定拟准入的证券公司；

ii 本基金管理人与准入证券公司签署证券经纪服务协议，并按公司制度对合作券商进行定期评价及动态管理。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国盛证券	2,011,484.00	100.00	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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 (2024 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 7 日
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
15	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 7 月 19 日
16	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 7 月 19 日
17	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 8 月 9 日
18	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 8 月 9 日
19	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 (2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 8 月 9 日
20	民生加银基金管理有限公司旗下部	中国证监会规定媒介	2024 年 8 月 30 日

	分基金 2024 年中期报告提示性公告		
21	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	中国证监会规定媒介	2024 年 8 月 30 日
22	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 25 日
23	民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 25 日
24	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 10 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予基金注册的文件；
- (2) 《民生加银中证 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。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日