

民生加银国证 2000 指数增强型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	民生加银国证 2000 指数增强	
基金主代码	019814	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 3 月 19 日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	66,131,894.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	019814	019815
报告期末下属分级 基金的份额总额	57,050,888.40 份	9,081,006.43 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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	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： 1、资产配置策略。本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 2、股票投资策略。本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对国证 2000 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。
业绩比较基准	国证 2000 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。同时本基金为指数增强基金，通过采用量化增强投资策略跟踪标的指数表现，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	招商证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	刘静	韩鑫普
	联系电话	0755-23999841	0755-82943666
	电子邮箱	liujing@msjyfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-8888-388	95565
传真		0755-23999800	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 号
邮政编码		518038	518000
法定代表人		李业弟	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.msjyfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	14,804,023.36	4,221,557.49
本期利润	13,856,864.19	2,575,884.82
加权平均基金份 额本期利润	0.2324	0.1510
本期加权平均净 值利润率	12.56%	8.23%
本期基金份额净 值增长率	14.06%	13.89%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	52,744,221.95	8,264,536.63
期末可供分配基金份额利润	0.9245	0.9101
期末基金资产净值	109,795,110.35	17,345,543.06
期末基金份额净值	1.9245	1.9101
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	92.45%	91.01%

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

民生加银国证 2000 指数增强 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	10.49%	1.45%	12.46%	1.55%	-1.97%	-0.10%
过去六个月	14.06%	1.48%	13.22%	1.58%	0.84%	-0.10%
过去一年	38.27%	1.23%	34.04%	1.35%	4.23%	-0.12%
自基金合同生效起至今	92.45%	1.54%	55.73%	1.68%	36.72%	-0.14%

民生加银国证 2000 指数增强 C

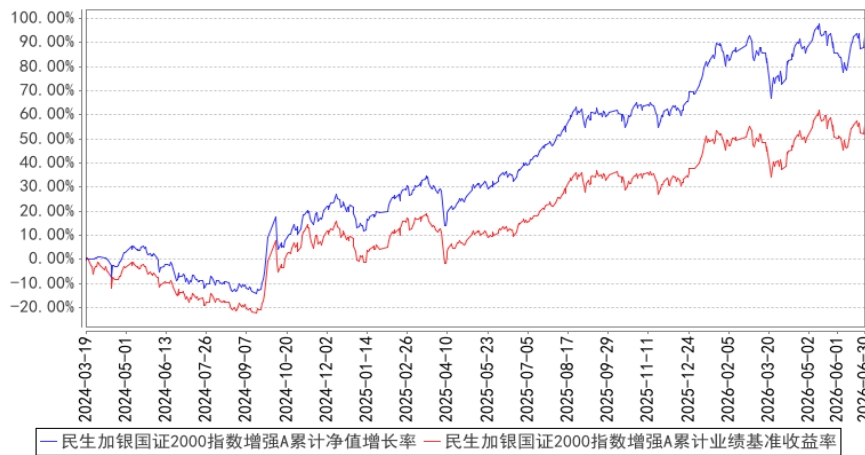
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.40%	1.45%	12.46%	1.55%	-2.06%	-0.10%

过去六个月	13.89%	1.48%	13.22%	1.58%	0.67%	-0.10%
过去一年	37.86%	1.23%	34.04%	1.35%	3.82%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	91.01%	1.54%	55.73%	1.68%	35.28%	-0.14%

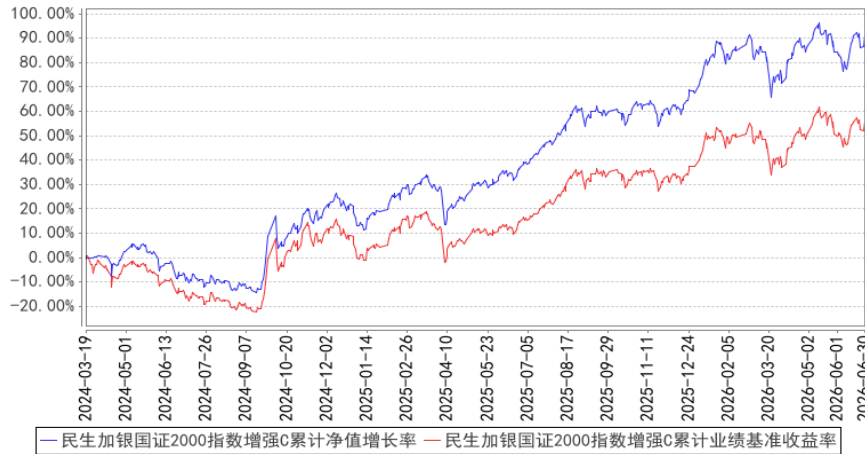
注：本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

民生加银国证2000指数增强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



民生加银国证2000指数增强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 2024 年 3 月 19 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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 107 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	本基金经理、量化投资部总监	2024 年 3 月 19 日	-	21 年	清华大学流体力学硕士。自 2003 年 7 月至 2004 年 5 月在北京色诺芬信息服务有限公司担任合伙人、研究部负责人；自 2004 年 5 月至 2005 年 5 月在北京方速信融有限公司担任高级分析师；自 2005 年 6 月至 2005 年 11 月在金诚国际信用评估有限公司担任信用分析师；自 2005 年 11 月至 2014 年 10 月在工银瑞信基金管理有限公司担任风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管，指数投资部基金经理、副总监；自 2014 年 11 月至 2019 年 3 月在上海海狮资产管理有限公司担任投资总监、副总经理。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 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 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 2025 年 1 月至今担任民生加银中证 A500 指数型证券投资基金基金经理；自 2025 年 3 月至今担任民生加银中证全指指数增强

					型证券投资基金基金经理；自 2025 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 2025 年 7 月至今担任民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2025 年 10 月至今担任民生加银智选成长股票型证券投资基金基金经理；自 2026 年 6 月担任民生加银创业板综合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；自 2021 年 9 月至 2024 年 10 月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 2024 年 10 月担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至 2025 年 2 月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 2025 年 2 月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 2022 年 2 月至 2025 年 11 月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。
--	--	--	--	--	--

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

2026 年上半年，全球经济呈现“脆弱的增长”态势，地缘政治冲突加剧与贸易保护主义持续升级共同抑制增长。中东局势紧张导致国际能源价格大幅波动，全球通胀再度升温，部分国家央行已转向重新加息。主要国际机构普遍下调 2026 年经济增长预期。上半年，国内 GDP 同比增长 4.7%，经济运行总体平稳，但面临外部不确定性上升和内部结构性挑战。工业生产保持增长，出口保持强劲，新动能快速增长，高端制造业持续向好，但消费和投资增长承压，房地产市场持续调整。

2026 年上半年，万得全 A 指数上涨超过 10%。电子、通信和建材等行业涨跌幅靠前，消费者服务、综合金融和综合等行业涨跌幅靠后，成长风格占优。

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国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.9245 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.06%，同期业绩比较基准收益率为 13.22%；截至本报告期末民生加银国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.9101 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.89%，同期业绩比较基准收益率为 13.22%。

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 2026 年下半年，全球贸易环境仍面临较多不确定因素，地缘政治风险与贸易保护主义政策扰动或将持续。AI 投资热潮有望延续，算力基础设施建设、半导体周期上行和智能终端创新或

将继续为重要驱动力。国内方面，“十五五”规划开局之年政策红利将持续释放，生产好于需求、外需好于内需、新动能好于旧动能的结构性特征或将持续。中国将持续受益于 AI 技术变革浪潮下的硬件制造链的扩张。

2026 年 6 月底，中证全指的市净率在 1.9 倍水平。估值或将不是行情下一阶段的主要驱动因素，基本面和趋势因素将更占主导。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,226,729.20	10,613,988.01
结算备付金		1,966.68	956.15
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	116,773,341.24	122,276,199.20
其中：股票投资		116,773,341.24	122,276,199.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,616,446.64	1,883,929.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		127,618,483.76	134,775,072.93
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 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		291,486.03	3,936,212.41
应付管理人报酬		84,392.73	96,482.13
应付托管费		10,549.08	12,060.29
应付销售服务费		5,457.67	6,642.55
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	85,944.84	138,500.00
负债合计		477,830.35	4,189,897.38
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	66,131,894.83	77,496,604.83
未分配利润	6.4.7.12	61,008,758.58	53,088,570.72
净资产合计		127,140,653.41	130,585,175.55
负债和净资产总计		127,618,483.76	134,775,072.93

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 66,131,894.83 份，其中民生加银国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.9245 元，份额总额为 57,050,888.40 份；其中民生加银国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.9101 元，份额总额为 9,081,006.43 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17,186,465.08	12,032,923.60
1. 利息收入		17,392.68	9,003.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,752.66	8,986.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		640.02	16.65

2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,629,093.26	8,593,133.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,078,144.24	8,013,237.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	3,306.95
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	550,949.02	576,588.44
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,592,831.84	3,190,087.66
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	132,810.98	240,699.86
减：二、营业总支出		753,716.07	377,345.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	563,633.15	281,449.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,454.07	35,181.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46,732.91	11,622.73
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	72,895.94	49,092.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,432,749.01	11,655,577.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,432,749.01	11,655,577.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,432,749.01	11,655,577.87

6.3 净资产变动表

会计主体：民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	77,496,604.83	-	53,088,570.72	130,585,175.55
二、本期期初净资产	77,496,604.83	-	53,088,570.72	130,585,175.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,364,710.00	-	7,920,187.86	-3,444,522.14
(一)、综合收益总额	-	-	16,432,749.01	16,432,749.01
(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)	-11,364,710.00	-	-8,512,561.15	-19,877,271.15
其中：1. 基金申购款	69,640,994.19	-	59,635,321.60	129,276,315.79
2. 基金赎回款	-81,005,704.19	-	-68,147,882.75	-149,153,586.94
(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	66,131,894.83	-	61,008,758.58	127,140,653.41
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	58,859,290.74	-	11,017,845.31	69,877,136.05
二、本期期初净资产	58,859,290.74	-	11,017,845.31	69,877,136.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,073,675.59	-	9,643,267.47	3,569,591.88
(一)、综合收益总额	-	-	11,655,577.87	11,655,577.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-6,073,675.59	-	-2,012,310.40	-8,085,985.99

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	86,571,661.52	-	25,184,159.39	111,755,820.91
2. 基金赎回款	-92,645,337.11	-	-27,196,469.79	-119,841,806.90
(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	52,785,615.15	-	20,661,112.78	73,446,727.93

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：

郑智军

丁辉

蔡海峰

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

民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”、“民生加银国证 2000 指数增强”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2023]2210 号)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》及其配套法规、《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》及《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定发售，基金合同于 2024 年 3 月 19 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 223,233,318.58 份基金份额，上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证。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”)，基金托管人为招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国证 2000 指数的成份股及其备选成份股(均含存托凭证，下同)，其他非标的指数成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证)、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(国证 2000 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低于基金资产的 80%,投资于国证 2000 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;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。本基金的业绩比较基准为:国证 2000 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 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的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对本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。对投资者从本基金分配中取得的收入，

暂不征收企业所得税。

(c)对本基金从上市公司、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。对本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。对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(d)本基金卖出股票按 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)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	57,477.41
等于：本金	57,443.29
加：应计利息	34.12
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	8,169,251.79
等于：本金	8,169,110.27
加：应计利息	141.52
合计	8,226,729.20

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		117,151,417.01	-	116,773,341.24	-378,075.77
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		117,151,417.01	-	116,773,341.24	-378,075.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	13,388.57
预提信息披露费	59,507.37
其他	13,048.90
合计	85,944.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,674,499.78	60,674,499.78
本期申购	50,492,000.54	50,492,000.54
本期赎回（以“-”号填列）	-54,115,611.92	-54,115,611.92
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	57,050,888.40	57,050,888.40

民生加银国证 2000 指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,822,105.05	16,822,105.05
本期申购	19,148,993.65	19,148,993.65
本期赎回（以“-”号填列）	-26,890,092.27	-26,890,092.27
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	9,081,006.43	9,081,006.43

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

民生加银国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,853,508.63	-1,155,362.87	41,698,145.76
本期期初	42,853,508.63	-1,155,362.87	41,698,145.76
本期利润	14,804,023.36	-947,159.17	13,856,864.19
本期基金份额交易产生的变动数	-2,902,184.82	91,396.82	-2,810,788.00
其中：基金申购款	43,513,477.94	-41,028.16	43,472,449.78
基金赎回款	-46,415,662.76	132,424.98	-46,283,237.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,755,347.17	-2,011,125.22	52,744,221.95

民生加银国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,710,594.81	-320,169.85	11,390,424.96
本期期初	11,710,594.81	-320,169.85	11,390,424.96
本期利润	4,221,557.49	-1,645,672.67	2,575,884.82
本期基金份额交易产生的变动数	-7,348,704.04	1,646,930.89	-5,701,773.15
其中：基金申购款	15,844,054.87	318,816.95	16,162,871.82
基金赎回款	-23,192,758.91	1,328,113.94	-21,864,644.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,583,448.26	-318,911.63	8,264,536.63

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,276.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,466.11
结算备付金利息收入	10.53
其他	-
合计	16,752.66

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,078,144.24
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	19,078,144.24

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	594,386,793.76
减：卖出股票成本总额	574,715,113.03
减：交易费用	593,536.49
买卖股票差价收入	19,078,144.24

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：无。

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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	550,949.02
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	550,949.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,592,831.84
股票投资	-2,592,831.84
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-2,592,831.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	132,798.72
基金转换费收入	12.26
合计	132,810.98

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	72,895.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	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”）	基金销售机构、基金管理人的中方投资者

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
招商证券	-	-	103,868,749.59	15.67

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比 例（%）
招商证券	-	-	599,370.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
招商证券	19,878.43	15.75	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自 2024 年 7 月 1 日起，券商不再为本基金提供除交易单元租用以外服务。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	563,633.15	281,449.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	106,670.62	38,924.45
应支付基金管理人的净管理费	456,962.53	242,524.72

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 0.80%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×0.80%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,454.07	35,181.20

注：支付基金托管人招商证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C	合计
招商证券	-	254.93	254.93
中国民生银行	-	1,670.80	1,670.80
合计	-	1,925.73	1,925.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C	合计
民生加银基金公司	-	-	-
招商证券	-	505.05	505.05
中国民生银行	-	-	-
合计	-	505.05	505.05

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：

民生加银国证 2000 指数增强 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

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：无。

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 3 月 19 日）持有的基金份额	0.00	—
报告期初持有的基金份额	28,606,150.50	—
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	28,606,150.50	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.2562%	—
项目	上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 3 月 19 日）持有的基金份额	0.00	—
报告期初持有的基金份额	30,138,247.50	—
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	1,532,097.00	—
报告期末持有的基金份额	28,606,150.50	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.1931%	—

比例		
----	--	--

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：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。

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

注：无。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：1）本基金于本期未进行利润分配。

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	60	3,195.60	3,524.40	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	4,082	41,269.02	41,269.02	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	1,749	17,682.39	17,682.39	-
001312	福恩	2026 年 4 月	6 个月	新股流通	18.38	16.78	50	919.00	839.00	-

	股份	月 14 日		受限						
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	101	3,068.38	3,937.99	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	668	6,760.16	18,523.64	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	89	2,372.74	4,535.44	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	169	2,247.70	8,713.64	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	179	2,489.89	5,812.13	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	218	10,045.44	101,005.94	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	270	1,911.60	7,668.00	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	25	837.25	848.25	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	483	3,096.03	11,654.79	-

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。

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。

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同责任，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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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 6.4.12 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 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金及债券投资等。

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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	8,226,553.56	-	-	-	-	175.64	8,226,729.20
结算备付金	1,965.98	-	-	-	-	0.70	1,966.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	116,773,341.24	116,773,341.24
应收申购款	-	-	-	-	-	2,616,446.64	2,616,446.64
资产总计	8,228,519.54	-	-	-	-	119,389,964.22	127,618,483.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	291,486.03	291,486.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,392.73	84,392.73
应付托管费	-	-	-	-	-	10,549.08	10,549.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,457.67	5,457.67
其他负债	-	-	-	-	-	85,944.84	85,944.84
负债总计	-	-	-	-	-	477,830.35	477,830.35
利率敏感度缺口	8,228,519.54	-	-	-	-	118,912,133.87	127,140,653.41
上年度末 2025 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	10,613,674.40	-	-	-	-	313.61	10,613,988.01
结算备付金	955.82	-	-	-	-	0.33	956.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	122,276,199.20	122,276,199.20
应收申购款	-	-	-	-	-	1,883,929.57	1,883,929.57
资产总计	10,614,630.22	-	-	-	-	124,160,442.71	134,775,072.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,936,212.41	3,936,212.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	96,482.13	96,482.13
应付托管费	-	-	-	-	-	12,060.29	12,060.29

应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,642.55	6,642.55
其他负债	-	-	-	-	-	138,500.00	138,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,189,897.38	4,189,897.38
利率敏感度缺口	10,614,630.22	-	-	-	-	119,970,545.33	130,585,175.55

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金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。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	116,773,341.24	91.85	122,276,199.20	93.64
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	116,773,341.24	91.85	122,276,199.20	93.64

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	5,804,492.94	5,670,241.42
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-5,804,492.94	-5,670,241.42

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	116,547,326.61	122,078,677.20
第二层次	226,014.63	197,522.00
第三层次	-	-
合计	116,773,341.24	122,276,199.20

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2025 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 (2025 年 12 月 31 日：无)。

§ 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	116,773,341.24	91.50
	其中：股票	116,773,341.24	91.50
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	8,228,695.88	6.45
8	其他各项资产	2,616,446.64	2.05
9	合计	127,618,483.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	444,521.70	0.35
B	采矿业	2,251,653.00	1.77

C	制造业	75,214,731.86	59.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	899,889.00	0.71
E	建筑业	1,105,972.00	0.87
F	批发和零售业	1,676,510.00	1.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,525,530.20	1.20
H	住宿和餐饮业	327,600.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,577,094.80	6.75
J	金融业	401,608.00	0.32
K	房地产业	567,525.00	0.45
L	租赁和商务服务业	430,496.80	0.34
M	科学研究和技术服务业	3,280,345.20	2.58
N	水利、环境和公共设施管理业	1,812,116.00	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	137,025.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	757,012.00	0.60
S	综合	154,572.00	0.12
	合计	99,564,202.56	78.31

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	28,400.00	0.02
B	采矿业	376,017.00	0.30
C	制造业	14,134,845.27	11.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,951.41	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	184,675.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件	567,712.00	0.45

	和信息技术服务业		
J	金融业	858,594.00	0.68
K	房地产业	191,328.00	0.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	258,418.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	550,198.00	0.43
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	17,209,138.68	13.54

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603061	金海通	2,100	1,054,662.00	0.83
2	001314	亿道信息	16,200	1,001,160.00	0.79
3	605196	华通线缆	31,100	811,710.00	0.64
4	688717	艾罗能源	9,800	809,186.00	0.64
5	688609	九联科技	72,000	792,720.00	0.62
6	688627	精智达	1,087	777,205.00	0.61
7	301086	鸿富瀚	3,700	774,336.00	0.61
8	603507	振江股份	22,900	753,181.00	0.59
9	605376	博迁新材	2,700	732,510.00	0.58
10	600961	株冶集团	22,600	732,014.00	0.58
11	301392	汇成真空	2,400	692,736.00	0.54
12	688678	福立旺	27,800	671,926.00	0.53
13	688559	海目星	7,800	654,576.00	0.51
14	300277	汽轮科技	43,200	649,728.00	0.51
15	688372	伟测科技	3,400	632,400.00	0.50
16	300602	飞荣达	12,300	629,760.00	0.50

17	000810	创维数字	47,300	626,725.00	0.49
18	300613	富瀚微	7,800	624,624.00	0.49
19	301087	可孚医疗	13,100	624,215.00	0.49
20	688779	五矿新能	76,800	622,848.00	0.49
21	002283	天润工业	63,300	610,845.00	0.48
22	301510	固高科技	19,100	609,863.00	0.48
23	300008	天海防务	99,700	604,182.00	0.48
24	002768	国恩股份	11,496	598,481.76	0.47
25	300681	英搏尔	20,700	592,434.00	0.47
26	300191	潜能恒信	21,100	583,415.00	0.46
27	002923	润都股份	59,600	563,816.00	0.44
28	001359	平安电工	4,480	561,120.00	0.44
29	002838	道恩股份	18,200	557,284.00	0.44
30	688035	德邦科技	6,000	550,800.00	0.43
31	300098	高新兴	116,200	533,358.00	0.42
32	300236	上海新阳	3,800	499,700.00	0.39
33	300671	富满微	5,500	473,880.00	0.37
34	000922	佳电股份	33,880	472,964.80	0.37
35	603366	日出东方	62,700	455,829.00	0.36
36	688127	蓝特光学	4,600	448,960.00	0.35
37	002458	益生股份	57,210	444,521.70	0.35
38	688097	博众精工	7,000	441,350.00	0.35
39	301369	联动科技	1,800	441,000.00	0.35
40	300738	奥飞数据	21,800	440,796.00	0.35
41	603588	高能环境	22,900	439,680.00	0.35
42	301095	广立微	3,700	436,785.00	0.34
43	688202	美迪西	5,400	435,834.00	0.34
44	688221	前沿生物	19,400	434,560.00	0.34
45	002636	金安国纪	3,600	431,892.00	0.34
46	301191	菲菱科思	3,800	431,490.00	0.34
47	000422	湖北宜化	30,600	429,930.00	0.34
48	603629	利通电子	2,400	429,144.00	0.34
49	300179	四方达	7,200	427,896.00	0.34
50	300480	光力科技	10,000	426,800.00	0.34
51	300607	拓斯达	10,300	424,669.00	0.33
52	301421	波长光电	4,100	424,555.00	0.33
53	688062	迈威生物	15,000	423,750.00	0.33
54	688378	奥来德	6,800	421,600.00	0.33
55	300323	华灿光电	20,600	420,240.00	0.33
56	688416	恒烁股份	3,000	420,000.00	0.33
57	688376	美埃科技	3,600	418,680.00	0.33
58	600520	三佳科技	10,500	416,955.00	0.33
59	603032	德新科技	15,400	414,260.00	0.33

60	002979	雷赛智能	7,400	412,772.00	0.32
61	688084	晶品特装	8,200	412,296.00	0.32
62	301516	中远通	29,000	410,350.00	0.32
63	301592	六九一二	3,100	410,285.00	0.32
64	688230	芯导科技	5,200	409,812.00	0.32
65	603997	继峰股份	34,200	404,586.00	0.32
66	301219	腾远钴业	7,350	402,780.00	0.32
67	688046	药康生物	16,600	401,720.00	0.32
68	688107	安路科技	8,800	401,280.00	0.32
69	300858	科拓生物	26,300	399,497.00	0.31
70	688059	华锐精密	2,000	399,420.00	0.31
71	002810	山东赫达	16,100	397,670.00	0.31
72	000917	电广传媒	59,000	394,710.00	0.31
73	300404	博济医药	45,000	394,200.00	0.31
74	301345	涛涛车业	1,700	392,700.00	0.31
75	301371	敷尔佳	15,100	392,600.00	0.31
76	301221	光庭信息	13,300	392,483.00	0.31
77	300740	水羊股份	21,300	392,133.00	0.31
78	002191	劲嘉股份	99,600	389,436.00	0.31
79	600428	中远海特	49,800	388,938.00	0.31
80	605228	神通科技	28,900	388,127.00	0.31
81	688087	英科再生	11,600	387,672.00	0.30
82	300569	天能重工	80,400	387,528.00	0.30
83	605222	起帆电缆	16,600	387,112.00	0.30
84	301123	奕东电子	3,200	386,304.00	0.30
85	300443	金雷股份	17,900	386,282.00	0.30
86	002516	旷达科技	68,800	383,904.00	0.30
87	688293	奥浦迈	9,200	383,548.00	0.30
88	002196	方正电机	31,800	383,508.00	0.30
89	300291	百纳千成	79,400	383,502.00	0.30
90	301251	威尔高	7,180	382,550.40	0.30
91	688575	亚辉龙	43,600	381,936.00	0.30
92	002376	新北洋	66,400	381,800.00	0.30
93	603035	常熟汽饰	35,900	381,258.00	0.30
94	300938	信测标准	7,640	381,083.20	0.30
95	300031	宝通科技	13,300	379,981.00	0.30
96	301357	北方长龙	4,800	379,632.00	0.30
97	600971	恒源煤电	55,000	379,500.00	0.30
98	600197	伊力特	39,500	379,200.00	0.30
99	688182	灿勤科技	8,800	379,016.00	0.30
100	300552	万集科技	16,500	377,025.00	0.30
101	000036	华联控股	86,100	376,257.00	0.30
102	002440	闰土股份	36,700	376,175.00	0.30

103	600195	中牧股份	63,700	375,830.00	0.30
104	688700	东威科技	4,200	375,480.00	0.30
105	603162	海通发展	41,660	373,690.20	0.29
106	301631	壹连科技	5,200	373,672.00	0.29
107	002154	报喜鸟	104,800	373,088.00	0.29
108	601789	宁波建工	92,900	372,529.00	0.29
109	301558	三态股份	60,300	372,051.00	0.29
110	301608	博实结	7,400	371,924.00	0.29
111	002365	永安药业	36,700	371,404.00	0.29
112	001311	多利科技	22,990	370,828.70	0.29
113	301393	昊帆生物	5,700	369,189.00	0.29
114	301109	军信股份	29,600	368,816.00	0.29
115	002737	葵花药业	32,900	368,809.00	0.29
116	002641	公元股份	95,400	368,244.00	0.29
117	603135	中重科技	30,400	367,840.00	0.29
118	601339	百隆东方	54,300	367,611.00	0.29
119	000905	厦门港务	47,200	366,272.00	0.29
120	300842	帝科股份	4,100	365,597.00	0.29
121	605077	华康股份	33,800	365,378.00	0.29
122	300227	光韵达	30,700	365,330.00	0.29
123	300072	海新能科	107,400	365,160.00	0.29
124	603291	联合水务	45,400	365,016.00	0.29
125	300388	节能国祯	57,700	356,009.00	0.28
126	002079	苏州固锝	22,300	335,169.00	0.26
127	300843	胜蓝股份	2,100	328,125.00	0.26
128	301073	君亭酒店	18,000	327,600.00	0.26
129	300213	佳讯飞鸿	53,000	321,180.00	0.25
130	301172	君逸数码	12,300	319,185.00	0.25
131	688275	万润新能	2,400	306,120.00	0.24
132	002947	恒铭达	4,000	304,200.00	0.24
133	002338	奥普光电	5,300	303,160.00	0.24
134	002721	金一文化	134,500	298,590.00	0.23
135	688503	聚和材料	2,200	291,940.00	0.23
136	300284	苏交科	57,700	288,500.00	0.23
137	000552	甘肃能化	124,900	279,776.00	0.22
138	300747	锐科激光	5,000	265,450.00	0.21
139	605289	罗曼股份	1,800	261,000.00	0.21
140	300489	光智科技	800	249,560.00	0.20
141	688549	中巨芯	6,600	242,946.00	0.19
142	300933	中辰股份	39,700	241,376.00	0.19
143	688388	嘉元科技	5,400	237,600.00	0.19
144	300852	四会富仕	3,400	235,416.00	0.19
145	002182	宝武镁业	14,800	230,436.00	0.18

146	300863	卡倍亿	3,000	229,890.00	0.18
147	003043	华亚智能	2,300	228,597.00	0.18
148	300811	铂科新材	2,400	227,736.00	0.18
149	688279	峰昭科技	1,000	224,440.00	0.18
150	603317	天味食品	17,200	223,772.00	0.18
151	300762	上海瀚讯	4,900	223,685.00	0.18
152	600259	中稀有色	2,200	223,542.00	0.18
153	603063	禾望电气	4,200	222,138.00	0.17
154	605060	联德股份	3,900	221,286.00	0.17
155	301328	维峰电子	3,100	220,720.00	0.17
156	002955	鸿合科技	6,100	218,075.00	0.17
157	688620	安凯微	13,400	217,080.00	0.17
158	300563	神宇股份	7,600	215,764.00	0.17
159	301603	乔锋智能	1,500	215,700.00	0.17
160	002643	万润股份	10,200	213,690.00	0.17
161	688531	日联科技	1,200	213,408.00	0.17
162	301031	中熔电气	1,776	212,143.20	0.17
163	001287	中电港	6,800	211,820.00	0.17
164	002237	恒邦股份	14,400	211,536.00	0.17
165	300409	道氏技术	10,600	211,258.00	0.17
166	002897	意华股份	2,400	211,152.00	0.17
167	688800	瑞可达	2,200	211,134.00	0.17
168	002255	海陆重工	21,500	211,130.00	0.17
169	688173	希荻微	11,000	210,540.00	0.17
170	688337	普源精电	2,800	209,804.00	0.17
171	688327	云从科技	16,800	209,328.00	0.16
172	688305	科德数控	3,200	208,864.00	0.16
173	688653	康希通信	12,000	208,560.00	0.16
174	603115	海星股份	1,700	208,199.00	0.16
175	688605	先锋精科	2,000	208,040.00	0.16
176	603931	格林达	3,500	207,900.00	0.16
177	002043	兔宝宝	18,700	207,196.00	0.16
178	688001	华兴源创	2,400	205,680.00	0.16
179	603124	江南新材	1,100	205,678.00	0.16
180	603026	石大胜华	2,300	205,551.00	0.16
181	603223	恒通股份	15,700	204,885.00	0.16
182	000973	佛塑科技	14,200	203,770.00	0.16
183	000682	东方电子	16,100	203,343.00	0.16
184	300855	图南股份	6,500	203,190.00	0.16
185	603186	华正新材	900	202,770.00	0.16
186	301529	福赛科技	2,100	202,356.00	0.16
187	603663	三祥新材	2,100	202,230.00	0.16
188	688710	益诺思	3,000	201,600.00	0.16

189	301487	盟固利	10,500	201,075.00	0.16
190	002134	天津普林	6,600	200,772.00	0.16
191	002077	大港股份	10,400	200,616.00	0.16
192	603125	常青科技	6,100	199,714.00	0.16
193	300151	昌红科技	8,000	199,600.00	0.16
194	002454	松芝股份	41,620	198,943.60	0.16
195	002057	中钢天源	16,000	198,880.00	0.16
196	688023	安恒信息	5,400	198,288.00	0.16
197	000880	潍柴重机	8,600	197,886.00	0.16
198	002498	汉缆股份	29,000	197,780.00	0.16
199	301216	万凯新材	8,600	197,714.00	0.16
200	001298	好上好	9,500	197,125.00	0.16
201	000612	焦作万方	18,600	196,974.00	0.15
202	600507	方大特钢	48,600	196,830.00	0.15
203	688225	亚信安全	15,800	196,236.00	0.15
204	002488	金固股份	22,000	196,020.00	0.15
205	002541	鸿路钢构	11,300	195,716.00	0.15
206	688636	智明达	5,400	195,642.00	0.15
207	301571	国科天成	3,000	195,540.00	0.15
208	603538	美诺华	6,000	195,300.00	0.15
209	301261	恒工精密	2,500	195,250.00	0.15
210	301280	珠城科技	3,860	195,200.20	0.15
211	301021	英诺激光	1,600	195,040.00	0.15
212	002645	华宏科技	7,080	194,770.80	0.15
213	300337	银邦股份	16,700	194,722.00	0.15
214	002448	中原内配	15,800	194,340.00	0.15
215	300768	迪普科技	14,100	194,157.00	0.15
216	002948	青岛银行	38,200	194,056.00	0.15
217	000049	德赛电池	8,300	193,971.00	0.15
218	301085	亚康股份	3,200	193,952.00	0.15
219	301246	宏源药业	7,200	193,680.00	0.15
220	603938	三孚股份	2,700	193,455.00	0.15
221	600783	鲁信创投	9,700	193,224.00	0.15
222	000950	重药控股	38,500	192,885.00	0.15
223	002067	景兴纸业	52,400	192,832.00	0.15
224	688480	赛恩斯	2,200	192,698.00	0.15
225	002925	盈趣科技	7,800	192,348.00	0.15
226	000719	中原传媒	16,800	192,024.00	0.15
227	300400	劲拓股份	5,100	192,015.00	0.15
228	603209	兴通股份	15,300	191,709.00	0.15
229	001208	华菱线缆	13,500	191,565.00	0.15
230	603590	康辰药业	6,600	191,466.00	0.15
231	600325	华发股份	82,800	191,268.00	0.15

232	002803	吉宏股份	7,400	191,216.00	0.15
233	605009	豪悦护理	8,200	191,142.00	0.15
234	000923	河钢资源	15,400	191,114.00	0.15
235	603239	浙江仙通	12,900	191,049.00	0.15
236	603567	珍宝岛	43,500	190,530.00	0.15
237	603275	众辰科技	5,000	190,350.00	0.15
238	600461	洪城环境	21,000	190,260.00	0.15
239	002328	新朋股份	25,900	190,106.00	0.15
240	600502	安徽建工	43,700	190,095.00	0.15
241	300663	科蓝软件	28,400	189,144.00	0.15
242	603630	拉芳家化	14,800	189,144.00	0.15
243	603016	新宏泰	5,600	189,056.00	0.15
244	600826	兰生股份	21,500	188,985.00	0.15
245	301153	中科江南	11,600	188,964.00	0.15
246	002215	诺普信	22,800	187,644.00	0.15
247	301285	鸿日达	1,700	187,561.00	0.15
248	300969	恒帅股份	2,000	187,520.00	0.15
249	002534	西子洁能	10,100	187,355.00	0.15
250	603193	润本股份	10,100	187,355.00	0.15
251	002443	金洲管道	19,600	186,788.00	0.15
252	600894	广日股份	24,500	186,690.00	0.15
253	002060	广东建工	61,600	186,648.00	0.15
254	301535	浙江华远	13,900	186,538.00	0.15
255	600123	兰花科创	34,900	186,366.00	0.15
256	601083	锦江航运	18,700	185,878.00	0.15
257	601388	怡球资源	65,600	185,648.00	0.15
258	301500	飞南资源	7,100	184,955.00	0.15
259	003012	东鹏控股	42,400	184,864.00	0.15
260	603966	法兰泰克	22,630	184,434.50	0.15
261	603406	天富龙	7,100	184,245.00	0.14
262	301349	信德新材	2,500	184,000.00	0.14
263	601121	宝地矿业	32,600	183,864.00	0.14
264	001379	腾达科技	11,700	183,690.00	0.14
265	301090	华润材料	29,200	183,084.00	0.14
266	603057	紫燕食品	8,200	182,860.00	0.14
267	301559	中集环科	15,000	182,850.00	0.14
268	300689	澄天伟业	2,600	182,468.00	0.14
269	605577	龙版传媒	20,600	181,486.00	0.14
270	601107	四川成渝	37,100	181,048.00	0.14
271	603121	华培动力	15,400	180,950.00	0.14
272	301439	泓淋电力	11,500	180,780.00	0.14
273	301665	泰禾股份	8,600	180,256.00	0.14
274	688386	泛亚微透	2,000	179,680.00	0.14

275	301196	唯科科技	1,430	179,350.60	0.14
276	301628	强达电路	1,700	179,265.00	0.14
277	301630	同宇新材	700	175,112.00	0.14
278	300576	容大感光	3,400	174,148.00	0.14
279	002232	启明信息	12,800	173,568.00	0.14
280	603861	白云电器	13,300	171,703.00	0.14
281	603099	长白山	4,800	171,216.00	0.13
282	603867	新化股份	5,000	167,450.00	0.13
283	688232	新点软件	9,400	167,132.00	0.13
284	300918	南山智尚	15,500	166,160.00	0.13
285	002406	远东传动	25,300	165,968.00	0.13
286	002900	哈三联	18,000	165,240.00	0.13
287	001339	智微智能	1,610	164,670.80	0.13
288	601326	秦港股份	51,700	163,372.00	0.13
289	603013	亚普股份	10,300	162,637.00	0.13
290	688073	毕得医药	3,000	161,460.00	0.13
291	300358	楚天科技	20,100	160,800.00	0.13
292	000833	粤桂股份	6,600	154,572.00	0.12
293	002969	嘉美包装	10,800	152,064.00	0.12
294	301551	无线传媒	7,500	147,975.00	0.12
295	300448	浩云科技	25,000	144,000.00	0.11
296	600626	申达股份	44,400	141,636.00	0.11
297	002245	蔚蓝锂芯	7,500	140,325.00	0.11
298	603216	梦天家居	6,800	139,876.00	0.11
299	300290	ST 荣科	21,000	139,650.00	0.11
300	301239	普瑞眼科	4,500	137,025.00	0.11
301	600872	中炬高新	7,800	135,408.00	0.11
302	301316	慧博云通	3,400	133,892.00	0.11
303	002111	威海广泰	14,700	132,300.00	0.10
304	002988	豪美新材	5,600	123,536.00	0.10
305	000603	盛达资源	5,300	122,430.00	0.10
306	301286	侨源股份	2,000	115,980.00	0.09
307	002745	木林森	9,200	115,460.00	0.09
308	600116	三峡水利	20,600	115,360.00	0.09
309	601827	三峰环境	15,500	112,685.00	0.09
310	301238	瑞泰新材	4,600	112,240.00	0.09
311	301005	超捷股份	1,000	111,560.00	0.09
312	600633	浙数文化	10,700	108,926.00	0.09
313	300990	同飞股份	1,000	105,070.00	0.08
314	688696	极米科技	1,600	103,264.00	0.08
315	000030	富奥股份	26,300	101,781.00	0.08
316	300324	旋极信息	26,900	100,068.00	0.08
317	002922	伊戈尔	3,000	98,400.00	0.08

318	688151	华强科技	6,600	98,142.00	0.08
319	002061	浙江交科	29,000	95,700.00	0.08
320	603686	福龙马	7,400	95,608.00	0.08
321	300063	天龙集团	11,000	95,480.00	0.08
322	688025	杰普特	200	94,000.00	0.07
323	688209	英集芯	3,200	93,056.00	0.07
324	002918	蒙娜丽莎	8,900	89,445.00	0.07
325	603283	赛腾股份	1,100	89,078.00	0.07
326	300302	同有科技	1,700	86,989.00	0.07
327	603619	中曼石油	4,600	86,066.00	0.07
328	002398	垒知集团	22,700	85,125.00	0.07
329	002697	红旗连锁	20,300	84,448.00	0.07
330	603915	国茂股份	5,900	83,721.00	0.07
331	300153	科泰电源	3,600	81,432.00	0.06
332	600391	航发科技	2,300	76,935.00	0.06
333	002833	弘亚数控	3,900	75,231.00	0.06
334	300596	利安隆	1,400	73,472.00	0.06
335	000061	农产品	13,100	73,360.00	0.06
336	600389	江山股份	3,700	72,224.00	0.06
337	603738	泰晶科技	1,200	72,060.00	0.06
338	002832	比音勒芬	3,400	70,176.00	0.06
339	301389	隆扬电子	800	69,432.00	0.05
340	920808	曙光数创	800	68,560.00	0.05
341	300129	泰胜风能	7,700	65,835.00	0.05
342	300986	志特新材	3,800	65,170.00	0.05
343	688658	悦康药业	5,000	64,300.00	0.05
344	600230	沧州大化	4,900	63,798.00	0.05
345	688227	品高股份	600	61,614.00	0.05
346	002345	潮宏基	5,900	54,103.00	0.04
347	003010	若羽臣	2,200	53,460.00	0.04
348	002970	锐明技术	1,000	53,430.00	0.04
349	688523	航天环宇	1,000	52,400.00	0.04
350	605016	百龙创园	1,900	49,115.00	0.04
351	000404	长虹华意	5,800	45,588.00	0.04
352	688513	苑东生物	1,000	43,960.00	0.03
353	300639	凯普生物	8,500	42,245.00	0.03
354	003009	中天火箭	700	41,972.00	0.03
355	920368	连城数控	1,400	40,894.00	0.03
356	300785	值得买	1,100	40,337.00	0.03
357	002572	索菲亚	5,400	39,420.00	0.03
358	002953	日丰股份	4,500	39,240.00	0.03
359	301150	中一科技	600	37,866.00	0.03
360	688486	龙迅股份	560	35,604.80	0.03

361	002441	众业达	4,500	35,100.00	0.03
362	301517	陕西华达	700	34,741.00	0.03
363	920522	纳科诺尔	1,400	33,180.00	0.03
364	600861	北京人力	2,500	30,500.00	0.02
365	920599	同力股份	1,800	29,646.00	0.02
366	603889	新澳股份	5,750	29,382.50	0.02
367	605389	长龄液压	300	28,800.00	0.02
368	920047	诺思兰德	1,400	28,770.00	0.02
369	920077	吉林碳谷	1,600	28,384.00	0.02
370	300662	科锐国际	1,600	27,168.00	0.02
371	920139	华岭股份	1,500	27,120.00	0.02
372	920799	艾融软件	800	26,848.00	0.02
373	000753	漳州发展	5,700	25,593.00	0.02
374	920593	鼎智科技	900	25,560.00	0.02
375	600576	祥源文旅	4,300	25,370.00	0.02
376	000885	城发环境	2,100	25,263.00	0.02
377	920640	富士达	800	25,128.00	0.02
378	301048	金鹰重工	2,900	24,969.00	0.02
379	600054	黄山旅游	2,300	24,771.00	0.02
380	600125	铁龙物流	4,700	23,829.00	0.02
381	920493	并行科技	200	22,132.00	0.02
382	920402	硅烷科技	1,400	19,936.00	0.02
383	301613	新铝时代	500	18,215.00	0.01
384	002297	博云新材	600	17,394.00	0.01
385	688449	联芸科技	200	17,262.00	0.01
386	600033	XD 福建高	5,300	17,066.00	0.01
387	002479	富春环保	4,000	16,840.00	0.01
388	300490	华自科技	1,200	15,876.00	0.01
389	603132	金徽股份	1,000	15,580.00	0.01
390	603697	有友食品	1,600	15,344.00	0.01
391	300226	上海钢联	980	15,003.80	0.01
392	000567	海德股份	2,400	14,328.00	0.01
393	603919	金徽酒	700	10,535.00	0.01
394	002039	黔源电力	400	7,528.00	0.01
395	603273	天元智能	300	3,885.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002756	永兴材料	11,600	657,024.00	0.52
2	300390	天华新能	6,300	589,113.00	0.46
3	688498	源杰科技	300	565,800.00	0.45
4	300223	北京君正	1,600	398,240.00	0.31

5	002805	丰元股份	13,700	391,683.00	0.31
6	301536	星宸科技	2,900	373,259.00	0.29
7	002497	雅化集团	18,200	370,734.00	0.29
8	601995	中金公司	10,200	368,730.00	0.29
9	600150	中国船舶	10,900	368,311.00	0.29
10	000960	锡业股份	8,600	367,134.00	0.29
11	600549	厦门钨业	4,300	366,360.00	0.29
12	603276	恒兴新材	23,800	364,378.00	0.29
13	688536	思瑞浦	1,000	364,090.00	0.29
14	603516	淳中科技	2,700	363,447.00	0.29
15	600323	瀚蓝环境	13,200	362,472.00	0.29
16	301296	新巨丰	61,400	361,032.00	0.28
17	600110	诺德股份	23,800	359,142.00	0.28
18	601069	西部黄金	16,200	356,400.00	0.28
19	003022	联泓新科	13,700	354,830.00	0.28
20	002378	章源钨业	10,100	338,148.00	0.27
21	301295	美硕科技	6,400	269,952.00	0.21
22	688629	华丰科技	1,400	262,514.00	0.21
23	603826	坤彩科技	10,200	260,712.00	0.21
24	600884	杉杉股份	18,800	254,740.00	0.20
25	688011	新光光电	3,200	223,584.00	0.18
26	688301	奕瑞科技	1,800	223,200.00	0.18
27	300953	震裕科技	1,660	221,942.00	0.17
28	688796	百奥赛图	2,000	218,800.00	0.17
29	301122	采纳股份	6,700	197,047.00	0.15
30	688045	必易微	2,400	193,872.00	0.15
31	300033	同花顺	800	192,800.00	0.15
32	688195	腾景科技	1,000	192,580.00	0.15
33	688307	中润光学	2,400	191,880.00	0.15
34	600641	先导基电	4,800	191,328.00	0.15
35	002386	天原股份	30,800	190,960.00	0.15
36	002025	航天电器	2,500	190,550.00	0.15
37	001389	广合科技	800	189,800.00	0.15
38	688101	三达膜	11,400	188,442.00	0.15
39	688236	春立医疗	13,000	187,980.00	0.15
40	002266	浙富控股	37,100	187,726.00	0.15
41	601000	唐山港	44,500	184,675.00	0.15
42	002222	福晶科技	2,000	184,560.00	0.15
43	301329	信音电子	7,500	182,175.00	0.14
44	688677	海泰新光	1,800	182,034.00	0.14
45	002759	ST 天际	7,400	180,486.00	0.14
46	688081	兴图新科	4,400	179,872.00	0.14
47	301057	汇隆新材	7,800	179,400.00	0.14

48	605186	健麾信息	5,700	178,752.00	0.14
49	600392	盛和资源	6,000	178,620.00	0.14
50	603150	万朗磁塑	2,400	169,920.00	0.13
51	002353	杰瑞股份	1,100	167,750.00	0.13
52	601108	财通证券	18,400	159,160.00	0.13
53	688323	瑞华泰	2,800	158,200.00	0.12
54	603799	华友钴业	3,200	154,432.00	0.12
55	000703	恒逸石化	10,900	147,913.00	0.12
56	600595	中孚实业	25,900	145,558.00	0.11
57	300394	天孚通信	460	139,232.80	0.11
58	600030	中信证券	4,800	137,904.00	0.11
59	300857	协创数据	400	135,960.00	0.11
60	600105	永鼎股份	2,000	134,960.00	0.11
61	300502	新易盛	220	133,540.00	0.11
62	000581	威孚高科	7,700	131,054.00	0.10
63	301669	高特电子	2,694	107,367.12	0.08
64	301666	大普微	218	101,005.94	0.08
65	002271	东方雨虹	8,500	100,895.00	0.08
66	603519	立霸股份	5,900	90,270.00	0.07
67	301275	汉朔科技	2,000	89,800.00	0.07
68	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.07
69	002384	东山精密	300	78,705.00	0.06
70	002752	昇兴股份	13,600	75,072.00	0.06
71	301599	理奇智能	1,689	74,033.93	0.06
72	301513	尚水智能	886	59,903.03	0.05
73	001248	华润新能源	5,831	58,951.41	0.05
74	001399	惠科股份	1,670	56,780.00	0.04
75	300718	长盛轴承	900	54,873.00	0.04
76	603280	南方路机	1,800	44,640.00	0.04
77	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.03
78	300620	光库科技	100	37,820.00	0.03
79	603259	药明康德	300	37,353.00	0.03
80	002772	众兴菌业	2,500	28,400.00	0.02
81	600497	驰宏锌锗	2,300	27,853.00	0.02
82	600583	海油工程	3,900	19,617.00	0.02
83	001393	维通利	334	16,440.77	0.01
84	000553	安道麦 A	2,900	15,515.00	0.01
85	002545	东方铁塔	900	14,598.00	0.01
86	603091	众鑫股份	280	13,655.60	0.01
87	688811	有研复材	483	11,654.79	0.01
88	000651	格力电器	300	11,250.00	0.01
89	002169	智光电气	700	10,248.00	0.01
90	002517	恺英网络	600	9,750.00	0.01

91	301531	春光集团	169	8,713.64	0.01
92	300591	万里马	1,000	6,730.00	0.01
93	001237	惠康科技	60	3,524.40	0.00
94	920122	中纺标	100	2,265.00	0.00
95	603293	埃泰克	25	848.25	0.00
96	001312	福恩股份	50	839.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	001314	亿道信息	2,049,274.00	1.57
2	605196	华通线缆	1,809,525.00	1.39
3	603061	金海通	1,783,381.00	1.37
4	001359	平安电工	1,643,650.00	1.26
5	000422	湖北宜化	1,523,339.00	1.17
6	688062	迈威生物	1,499,434.86	1.15
7	688627	精智达	1,471,088.21	1.13
8	603507	振江股份	1,436,619.00	1.10
9	603162	海通发展	1,376,609.66	1.05
10	603223	恒通股份	1,369,180.00	1.05
11	301608	博实结	1,361,825.00	1.04
12	300191	潜能恒信	1,344,182.00	1.03
13	002324	普利特	1,335,261.00	1.02
14	300740	水羊股份	1,334,268.00	1.02
15	301109	军信股份	1,316,674.00	1.01
16	688678	福立旺	1,277,961.21	0.98
17	688766	普冉股份	1,243,509.52	0.95
18	603663	三祥新材	1,229,284.00	0.94
19	301626	苏州天脉	1,218,263.00	0.93
20	605376	博迁新材	1,215,487.00	0.93

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	688498	源杰科技	2,063,128.40	1.58
2	603061	金海通	1,974,038.00	1.51
3	301377	鼎泰高科	1,883,663.00	1.44
4	688167	炬光科技	1,686,439.40	1.29

5	688610	埃科光电	1,684,274.29	1.29
6	000600	建投能源	1,652,221.00	1.27
7	001359	平安电工	1,588,824.00	1.22
8	301626	苏州天脉	1,557,638.00	1.19
9	603256	宏和科技	1,547,116.00	1.18
10	688627	精智达	1,515,706.23	1.16
11	688073	毕得医药	1,513,412.53	1.16
12	301303	真兰仪表	1,502,400.00	1.15
13	301391	卡莱特	1,496,835.00	1.15
14	001314	亿道信息	1,450,899.00	1.11
15	001337	四川黄金	1,435,624.00	1.10
16	601083	锦江航运	1,430,099.00	1.10
17	002990	盛视科技	1,425,123.00	1.09
18	603075	热威股份	1,423,654.00	1.09
19	300502	新易盛	1,409,423.00	1.08
20	301608	博实结	1,381,754.16	1.06

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	571,805,086.91
卖出股票收入（成交）总额	594,386,793.76

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低

交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

江苏振江新能源装备股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会江苏监管局处罚；

浙江艾罗网络能源技术股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会浙江监管局处罚。

除上述发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,616,446.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,616,446.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
民生加银 国证 2000 指数增强 A	833	68,488.46	30,579,392.80	53.60	26,471,495.60	46.40
民生加银 国证 2000 指数增强 C	507	17,911.26	2,681,843.32	29.53	6,399,163.11	70.47
合计	1,340	49,352.16	33,261,236.12	50.30	32,870,658.71	49.70

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	民生加银国证 2000 指数增强 A	2,039,514.20	3.5749
	民生加银国证 2000 指数增强 C	5,888.93	0.0648

有本基金			
	合计	2,045,403.13	3.0929

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	民生加银国证 2000 指数增强 A	>100
	民生加银国证 2000 指数增强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银国证 2000 指数增强 A	0~10
	民生加银国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银国证 2000 指数增强 A	民生加银国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 3 月 19 日）基金份额总额	39,228,047.41	184,005,271.17
本报告期期初基金份额总额	60,674,499.78	16,822,105.05
本报告期基金总申购份额	50,492,000.54	19,148,993.65
减：本报告期基金总赎回份额	54,115,611.92	26,890,092.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,050,888.40	9,081,006.43

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

基金 2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

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、公募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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
华林证券	2	679,785,441.47	58.30	128,994.79	58.25	-
金融街证券	3	446,925,100.60	38.33	85,026.48	38.40	-
国新证券	3	39,221,538.	3.36	7,430.64	3.36	-

		71				
--	--	----	--	--	--	--

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本基金使用证券公司交易结算模式。本期选择金融街证券、国新证券、华林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。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
华林证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-

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 2025 年第 4 季度报告提示性	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日

	公告		
2	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 19 日
4	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 19 日
5	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 (2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 19 日
6	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 30 日
7	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 30 日
8	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
9	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
10	民生加银基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级划分规则及公募基金产品风险等级评定结果的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20260101~20260630	28,606,150.50	0.00	0.00	28,606,150.50	43.26
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）《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- （3）《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- （4）《民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- （5）法律意见书；
- （6）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （7）基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

民生加银基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日