

民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 03 月 19 日（基金合同生效日）起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
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	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	57
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
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	29,534,200.58 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	23,818,099.83 份	5,716,100.75 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	<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。本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略。本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对国证 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。</p>
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@msjfund.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	郑智军	霍达	

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjfund.com.cn">http://www.msjfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福中三 路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）-2024 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	-601,688.67	-164,696.41
本期利润	-1,104,861.70	-593,501.64
加权平均基金份 额本期利润	-0.0691	-0.0236
本期加权平均净 值利润率	-6.98%	-2.37%
本期基金份额净 值增长率	-7.00%	-7.14%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	-1,667,068.00	-408,062.82
期末可供分配基金份额利润	-0.0700	-0.0714
期末基金资产净值	22,151,031.83	5,308,037.93
期末基金份额净值	0.9300	0.9286
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-7.00%	-7.14%

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。

④本基金合同生效日为2024年3月19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
过去一个月	-9.18%	1.73%	-8.54%	1.50%	-0.64%	0.23%
过去三个月	-7.34%	1.62%	-11.29%	1.60%	3.95%	0.02%
自基金合同生效起至今	-7.00%	1.50%	-13.96%	1.59%	6.96%	-0.09%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-9.26%	1.74%	-8.54%	1.50%	-0.72%	0.24%
过去三个月	-7.47%	1.62%	-11.29%	1.60%	3.82%	0.02%
自基金合同生效起 至今	-7.14%	1.50%	-13.96%	1.59%	6.82%	-0.09%

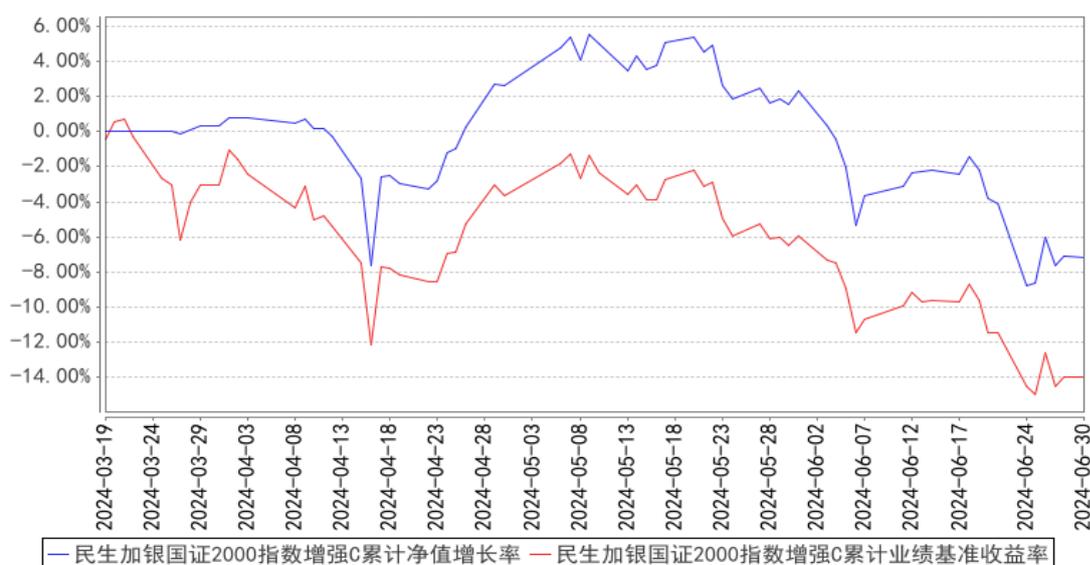
注：本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

### 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：①本基金合同于 2024 年 3 月 19 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满一年；

②本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金建仓期未结束。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会[2008]1187 号文批准，于 2008 年 11 月 3 日在深圳正式成立，2012 年注册资本增加至 3 亿元人民币。公司股东为中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和陕西省国际信托股份有限公司，三方股东持股比例分别为 63.33%、30%、6.67%。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	本基金的基金经理、量化投资部总监	2024 年 3 月 19 日	-	19 年	清华大学流体力学硕士，19 年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、公司投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2019 年 12 月至今担任民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理

					理；自 2023 年 3 月至今担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 3 月至今担任民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理。自 2020 年 12 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 6 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，全球制造业 PMI 持续在扩张区间，外部需求总体较好。欧美的通胀水平下行，瑞士央行、欧洲央行开启降息，市场主流预期美联储也将于年内降息。上半年，国内 GDP 同比增

长 5.0%，经济运行总体平稳。二季度经济增长水平较一季度有所回落，反映出当前经济仍然面临一些挑战，特别是国内有效需求不足的问题比较突出，地产行业的显著改善仍然需要一些时间。

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

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.9300 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.00%，同期业绩比较基准收益率为-13.96%；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 0.9286 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.14%，同期业绩比较基准收益率为-13.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024-04-01 至 2024-06-16。

### § 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	1,451,368.30
结算备付金		9,678.97
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,829,329.87
其中：股票投资		24,728,256.80
基金投资		-

债券投资		101,073.07
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		1,202,957.87
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		27,493,335.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		3,888.90
应付管理人报酬		13,403.41
应付托管费		1,675.41
应付销售服务费		2,481.53
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	12,816.00
负债合计		34,265.25
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	29,534,200.58
未分配利润	6.4.7.12	-2,075,130.82
净资产合计		27,459,069.76
负债和净资产总计		27,493,335.01

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 29,534,200.58 份，其中民生加银国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.9300 元，份额总额为 23,818,099.83 份；其中民生加银国证 2000

指数增强 C 的基金份额净值为 0.9286 元，份额总额为 5,716,100.75 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：2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同 生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-1,579,106.88
1. 利息收入		116,565.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	86,605.04
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		29,960.24
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-867,428.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,021,703.31
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	173.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-2.00
股利收益	6.4.7.19	154,103.35
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	-931,978.26
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	103,734.67
<b>减：二、营业总支出</b>		119,256.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	80,378.18
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,047.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	17,631.02
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	11,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,698,363.34
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,698,363.34
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,698,363.34

注：本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日。

### 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：2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	223,233,318.58	-	-	223,233,318.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-193,699,118.00	-	-2,075,130.82	-195,774,248.82
（一）、综合收益总额	-	-	-1,698,363.34	-1,698,363.34
（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）	-193,699,118.00	-	-376,767.48	-194,075,885.48
其中：1. 基金申购款	60,606,121.35	-	-1,506,924.82	59,099,196.53
2. 基金赎回款	-254,305,239.35	-	1,130,157.34	-253,175,082.01
（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	29,534,200.58	-	-2,075,130.82	27,459,069.76

注：本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郑智军</u>	<u>王国栋</u>	<u>洪锐珠</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“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》、《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，首次设立募集规模为 223,233,318.58 份基金份额。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。

本基金投资组合资产配置比例：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×95%+银行活期存款利率（税后）×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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况、2024 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 03 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。商业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商业模式。

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。

### 6.4.4 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。

### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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

损益占基金净值比例计算的金额。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。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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) 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。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(d) 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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券监督管理委员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。

## 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》、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。

(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费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	637,237.69
等于：本金	636,715.65
加：应计利息	522.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	814,130.61
等于：本金	813,566.00
加：应计利息	564.61
减：坏账准备	-
合计	1,451,368.30

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 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	25,660,204.06	-	24,728,256.80	-931,947.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	100,261.00	843.07	101,073.07	-31.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100,261.00	843.07	101,073.07	-31.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	25,760,465.06	843.07	24,829,329.87	-931,978.26	

## 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：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	10,000.00
其他	2,816.00
合计	12,816.00

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 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	39,228,047.41	39,228,047.41
本期申购	22,305,506.04	22,305,506.04
本期赎回（以“-”号填列）	-37,715,453.62	-37,715,453.62
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	23,818,099.83	23,818,099.83

民生加银国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	184,005,271.17	184,005,271.17
本期申购	38,300,615.31	38,300,615.31
本期赎回（以“-”号填列）	-216,589,785.73	-216,589,785.73
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	5,716,100.75	5,716,100.75

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

民生加银国证 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-601,688.67	-503,173.03	-1,104,861.70
本期基金份额交易产生的变动数	160,452.68	-722,658.98	-562,206.30
其中：基金申购款	273,256.42	-779,339.35	-506,082.93
基金赎回款	-112,803.74	56,680.37	-56,123.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-441,235.99	-1,225,832.01	-1,667,068.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-164,696.41	-428,805.23	-593,501.64
本期基金份额交易产生的变动数	50,555.19	134,883.63	185,438.82
其中：基金申购款	419,403.72	-1,420,245.61	-1,000,841.89
基金赎回款	-368,848.53	1,555,129.24	1,186,280.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-114,141.22	-293,921.60	-408,062.82

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
活期存款利息收入	74,056.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,869.81
结算备付金利息收入	9,678.97
其他	-
合计	86,605.04

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,021,703.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,021,703.31

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出股票成交总额	66,578,111.38
减：卖出股票成本总额	67,470,909.77
减：交易费用	128,904.92
买卖股票差价收入	-1,021,703.31

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	334.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	-160.78

券到期兑付) 差价收入	
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	173.39

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	303,046.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	300,269.00
减：应计利息总额	2,837.83
减：交易费用	100.78
买卖债券差价收入	-160.78

#### 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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 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：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股指期货投资收益	-2.00

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	154,103.35
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	154,103.35

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-931,978.26
股票投资	-931,947.26
债券投资	-31.00
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	-931,978.26

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	103,734.67
合计	103,734.67

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
开户费	1,200.00
合计	11,200.00

#### 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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
招商证券	158,499,661.05	99.24

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
招商证券	500,478.00	83.31

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
招商证券	87,066,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年3月19日（基金合同生效日）至2024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	89,411.43	99.54	-	-

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、经手费等的净额列示。

2、根据《证券经纪服务协议》及补充协议，本基金管理人使用招商证券专用交易单元，并从招商证券获得符合法律法规及监管规定的各项服务。

#### 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 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
----	---

当期发生的基金应支付的管理费	80,378.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,463.17
应支付基金管理人的净管理费	57,915.01

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 0.8% 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×0.8%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,047.26

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 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银国证 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	-	5,801.11	5,801.11
招商证券	-	7,085.45	7,085.45
中国民生银行	-	-	-
合计	-	12,886.56	12,886.56

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.30% 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 类份额日基金销售服务费=前一日 C 类资产净值 × 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：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

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

注：本基金在本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金在本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2024 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 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	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	15,325,431.70	-
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	15,325,431.70	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.8905%	-

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

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：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金在本报告期内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) 本基金于本期末进行利润分配。

2) 本基金资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前的利润分配情况，详见本报告“6.4.8.2 资产负债表日后事项”部分内容。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会合规与风险管理委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	101,073.07

合计	101,073.07
----	------------

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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 期末本基金持有的流通受限证券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根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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 6 月 30 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。

#### 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现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,450,281.65	-	-	-	-	1,086.65	1,451,368.30
结算备付金	9,676.77	-	-	-	-	2.20	9,678.97
交易性金融资产	-	-100,230.00	-	-	-	-24,729,099.87	24,829,329.87
应收申购款	-	-	-	-	-	1,202,957.87	1,202,957.87
资产总计	1,459,958.42	-100,230.00	-	-	-	-25,933,146.59	27,493,335.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,888.90	3,888.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,403.41	13,403.41
应付托管费	-	-	-	-	-	1,675.41	1,675.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,481.53	2,481.53
其他负债	-	-	-	-	-	12,816.00	12,816.00
负债总计	-	-	-	-	-	34,265.25	34,265.25
利率敏感度缺口	1,459,958.42	-100,230.00	-	-	-	-25,898,881.34	27,459,069.76

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2024年6月30日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	142.82
	2. 市场利率上升 25 个基点	-142.54

### 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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	24,728,256.80	90.05
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	24,728,256.80	90.05

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2024年6月30日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	1,142,640.24
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-1,142,640.24

### 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 2024年6月30日
第一层次	24,728,256.80
第二层次	101,073.07
第三层次	-
合计	24,829,329.87

##### 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 2024 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。

**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 2024 年 06 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。

**§ 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	24,728,256.80	89.94
	其中：股票	24,728,256.80	89.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,073.07	0.37
	其中：债券	101,073.07	0.37
	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	1,461,047.27	5.31
8	其他各项资产	1,202,957.87	4.38
9	合计	27,493,335.01	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	128,438.00	0.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,221,113.70	51.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	607,002.00	2.21
E	建筑业	447,273.00	1.63
F	批发和零售业	1,456,515.30	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	359,653.00	1.31

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,901,938.60	6.93
J	金融业	63,617.40	0.23
K	房地产业	502,839.00	1.83
L	租赁和商务服务业	554,505.60	2.02
M	科学研究和技术服务业	145,801.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	296,295.00	1.08
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	233,880.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	20,918,871.60	76.18

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,064.00	0.01
C	制造业	2,895,327.20	10.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,408.00	0.25
E	建筑业	26,448.00	0.10
F	批发和零售业	104,869.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	32,936.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	434,749.00	1.58
J	金融业	94,944.00	0.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,108.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	18,756.00	0.07
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	61,866.00	0.23

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	65,910.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	3,809,385.20	13.87

### 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	000551	创元科技	22,200	193,806.00	0.71
2	000045	深纺织 A	23,900	191,678.00	0.70
3	002441	众业达	24,700	187,226.00	0.68
4	688232	新点软件	7,700	151,844.00	0.55
5	002390	信邦制药	45,600	150,936.00	0.55
6	601200	上海环境	16,300	138,550.00	0.50
7	601609	金田股份	23,900	135,274.00	0.49
8	002026	山东威达	16,200	134,460.00	0.49
9	002449	国星光电	18,800	133,856.00	0.49
10	603618	杭电股份	30,200	132,276.00	0.48
11	600746	江苏索普	22,400	131,936.00	0.48
12	605068	明新旭腾	10,000	131,800.00	0.48
13	301327	华宝新能	2,300	131,790.00	0.48
14	600713	南京医药	30,900	130,398.00	0.47
15	600081	东风科技	14,900	130,375.00	0.47
16	603630	拉芳家化	12,400	130,324.00	0.47
17	688663	新风光	5,600	130,312.00	0.47
18	688550	瑞联新材	5,600	129,864.00	0.47
19	605208	永茂泰	20,800	129,584.00	0.47
20	002955	鸿合科技	5,500	128,590.00	0.47
21	301330	熵基科技	5,700	128,136.00	0.47
22	000718	苏宁环球	76,200	128,016.00	0.47
23	002378	章源钨业	22,300	128,002.00	0.47
24	002328	新朋股份	27,300	127,764.00	0.47
25	300440	运达科技	24,300	127,575.00	0.46
26	002988	豪美新材	8,300	127,405.00	0.46
27	601512	中新集团	16,700	127,254.00	0.46
28	688768	容知日新	5,400	126,414.00	0.46
29	600467	好当家	88,500	125,670.00	0.46
30	600861	北京人力	7,700	125,664.00	0.46

31	002082	万邦德	29,600	124,616.00	0.45
32	688369	致远互联	7,900	124,267.00	0.45
33	601616	广电电气	42,500	123,675.00	0.45
34	603949	雪龙集团	10,500	118,230.00	0.43
35	600826	兰生股份	21,720	116,853.60	0.43
36	600662	外服控股	28,000	112,280.00	0.41
37	000407	胜利股份	40,000	104,400.00	0.38
38	300420	五洋自控	46,100	100,959.00	0.37
39	300435	中泰股份	8,400	98,868.00	0.36
40	600618	氯碱化工	11,200	98,336.00	0.36
41	600742	一汽富维	12,900	96,105.00	0.35
42	601226	华电重工	18,700	91,630.00	0.33
43	600269	赣粤高速	17,200	88,924.00	0.32
44	002140	东华科技	11,200	86,800.00	0.32
45	300451	创业慧康	24,700	85,462.00	0.31
46	002878	元隆雅图	6,700	84,219.00	0.31
47	300428	立中集团	4,400	81,796.00	0.30
48	603859	能科科技	3,880	81,557.60	0.30
49	688018	乐鑫科技	800	78,944.00	0.29
50	600216	浙江医药	7,000	76,860.00	0.28
51	000690	宝新能源	14,800	75,480.00	0.27
52	002139	拓邦股份	6,900	73,278.00	0.27
53	600525	长园集团	17,200	73,272.00	0.27
54	002398	垒知集团	19,600	72,912.00	0.27
55	300319	麦捷科技	7,800	72,774.00	0.27
56	000049	德赛电池	3,100	72,695.00	0.26
57	600420	国药现代	6,800	72,624.00	0.26
58	603738	泰晶科技	5,300	72,292.00	0.26
59	300227	光韵达	12,900	70,563.00	0.26
60	600261	阳光照明	26,100	70,470.00	0.26
61	603111	康尼机电	12,100	70,422.00	0.26
62	301051	信濠光电	2,680	70,296.40	0.26
63	603113	金能科技	12,800	70,016.00	0.25
64	002106	莱宝高科	6,400	69,760.00	0.25
65	600577	精达股份	17,500	69,475.00	0.25
66	002483	润邦股份	15,400	69,454.00	0.25
67	300079	数码视讯	17,100	69,426.00	0.25
68	002815	崇达技术	7,400	69,412.00	0.25
69	300479	神思电子	4,600	69,368.00	0.25
70	603583	捷昌驱动	3,400	69,292.00	0.25
71	603277	银都股份	2,300	69,092.00	0.25
72	600835	上海机电	6,000	69,060.00	0.25
73	600351	亚宝药业	12,300	69,003.00	0.25

74	600468	百利电气	16,000	68,960.00	0.25
75	603686	福龙马	9,000	68,580.00	0.25
76	603337	杰克股份	2,600	68,432.00	0.25
77	600787	中储股份	14,200	68,302.00	0.25
78	300709	精研科技	2,700	68,256.00	0.25
79	300962	中金辐照	5,000	68,200.00	0.25
80	300170	汉得信息	11,100	68,154.00	0.25
81	002020	京新药业	6,500	68,055.00	0.25
82	000600	建投能源	10,800	68,040.00	0.25
83	300303	聚飞光电	14,000	68,040.00	0.25
84	002635	安洁科技	4,400	67,936.00	0.25
85	002171	楚江新材	10,300	67,877.00	0.25
86	603258	电魂网络	4,200	67,830.00	0.25
87	301087	可孚医疗	2,000	67,800.00	0.25
88	603766	隆鑫通用	10,000	67,800.00	0.25
89	002543	万和电气	6,800	67,728.00	0.25
90	000028	国药一致	2,100	67,683.00	0.25
91	002649	博彦科技	8,500	67,660.00	0.25
92	002226	江南化工	15,100	67,648.00	0.25
93	002004	华邦健康	17,800	67,640.00	0.25
94	603008	喜临门	3,900	67,587.00	0.25
95	300872	天阳科技	5,100	67,575.00	0.25
96	300193	佳士科技	9,100	67,522.00	0.25
97	002332	仙琚制药	5,900	67,319.00	0.25
98	000823	超声电子	7,900	67,229.00	0.24
99	300040	九洲集团	10,900	67,144.00	0.24
100	300873	海晨股份	4,600	67,068.00	0.24
101	600572	康恩贝	15,000	67,050.00	0.24
102	300788	中信出版	2,700	66,987.00	0.24
103	600736	苏州高新	16,100	66,976.00	0.24
104	601789	宁波建工	18,200	66,976.00	0.24
105	603206	嘉环科技	5,300	66,939.00	0.24
106	600966	博汇纸业	14,000	66,920.00	0.24
107	600237	铜峰电子	12,800	66,816.00	0.24
108	688568	中科星图	1,400	66,780.00	0.24
109	002540	亚太科技	12,600	66,654.00	0.24
110	605507	国邦医药	4,000	66,600.00	0.24
111	600595	中孚实业	26,700	66,483.00	0.24
112	600218	全柴动力	9,900	66,429.00	0.24
113	300039	上海凯宝	12,400	66,340.00	0.24
114	301200	大族数控	2,100	66,276.00	0.24
115	600658	电子城	20,100	66,129.00	0.24
116	603758	秦安股份	8,700	66,120.00	0.24

117	002046	国机精工	6,500	66,105.00	0.24
118	002845	同兴达	5,000	66,100.00	0.24
119	000810	创维数字	7,700	66,066.00	0.24
120	603309	维力医疗	6,000	66,060.00	0.24
121	002274	华昌化工	8,900	66,038.00	0.24
122	600226	亨通股份	33,500	65,995.00	0.24
123	300409	道氏技术	7,700	65,912.00	0.24
124	301439	泓淋电力	5,200	65,884.00	0.24
125	000059	华锦股份	15,700	65,783.00	0.24
126	688306	均普智能	16,200	65,772.00	0.24
127	600810	神马股份	10,600	65,720.00	0.24
128	300233	金城医药	4,400	65,648.00	0.24
129	600429	三元股份	17,600	65,648.00	0.24
130	600228	返利科技	13,500	65,610.00	0.24
131	603012	创力集团	14,700	65,562.00	0.24
132	002577	雷柏科技	5,300	65,561.00	0.24
133	300188	国投智能	5,900	65,549.00	0.24
134	300288	朗玛信息	6,200	65,534.00	0.24
135	300166	东方国信	10,700	65,484.00	0.24
136	601388	怡球资源	29,900	65,481.00	0.24
137	605005	合兴股份	4,100	65,436.00	0.24
138	300231	银信科技	8,900	65,415.00	0.24
139	002545	东方铁塔	9,600	65,376.00	0.24
140	000498	山东路桥	12,500	65,375.00	0.24
141	002206	海利得	17,100	65,322.00	0.24
142	688575	亚辉龙	2,800	65,296.00	0.24
143	603081	大丰实业	7,000	65,240.00	0.24
144	605020	永和股份	3,400	65,212.00	0.24
145	600965	福成股份	17,900	65,156.00	0.24
146	603135	中重科技	5,200	65,156.00	0.24
147	002757	南兴股份	5,400	65,070.00	0.24
148	300439	美康生物	7,100	65,036.00	0.24
149	603811	诚意药业	10,400	65,000.00	0.24
150	002017	东信和平	7,800	64,974.00	0.24
151	300940	南极光	5,100	64,974.00	0.24
152	002061	浙江交科	17,800	64,970.00	0.24
153	300571	平治信息	3,100	64,914.00	0.24
154	002095	生意宝	5,300	64,872.00	0.24
155	300011	鼎汉技术	13,000	64,870.00	0.24
156	000517	荣安地产	24,200	64,856.00	0.24
157	301078	孩子王	12,800	64,768.00	0.24
158	002376	新北洋	12,000	64,680.00	0.24
159	688789	宏华数科	600	64,680.00	0.24

160	000652	泰达股份	21,700	64,666.00	0.24
161	000061	农产品	13,300	64,638.00	0.24
162	002287	奇正藏药	3,300	64,614.00	0.24
163	300850	新强联	4,300	64,586.00	0.24
164	688553	汇宇制药	5,200	64,584.00	0.24
165	002956	西麦食品	4,700	64,578.00	0.24
166	688209	英集芯	5,200	64,532.00	0.24
167	000411	英特集团	6,700	64,521.00	0.23
168	603916	苏博特	9,600	64,416.00	0.23
169	300566	激智科技	4,600	64,354.00	0.23
170	002375	亚厦股份	19,800	64,350.00	0.23
171	000019	深粮控股	11,200	64,288.00	0.23
172	300174	元力股份	4,700	64,155.00	0.23
173	300559	佳发教育	6,700	64,119.00	0.23
174	300160	秀强股份	13,700	64,116.00	0.23
175	300134	大富科技	9,400	64,108.00	0.23
176	002852	道道全	8,900	64,080.00	0.23
177	300687	赛意信息	4,600	64,032.00	0.23
178	300326	凯利泰	16,800	63,840.00	0.23
179	300085	银之杰	7,900	63,832.00	0.23
180	300997	欢乐家	5,400	63,828.00	0.23
181	300355	蒙草生态	29,000	63,800.00	0.23
182	002438	江苏神通	5,900	63,779.00	0.23
183	605319	无锡振华	3,600	63,720.00	0.23
184	002641	公元股份	16,200	63,666.00	0.23
185	603098	森特股份	8,100	63,666.00	0.23
186	002908	德生科技	8,300	63,661.00	0.23
187	300110	华仁药业	20,600	63,654.00	0.23
188	000567	海德股份	11,340	63,617.40	0.23
189	002443	金洲管道	11,900	63,546.00	0.23
190	603075	热威股份	3,600	63,540.00	0.23
191	002462	嘉事堂	5,800	63,452.00	0.23
192	301116	益客食品	7,100	63,403.00	0.23
193	002950	奥美医疗	9,600	63,360.00	0.23
194	301217	铜冠铜箔	6,600	63,360.00	0.23
195	600327	大东方	19,800	63,360.00	0.23
196	002613	北玻股份	18,200	63,336.00	0.23
197	603633	徕木股份	8,000	63,280.00	0.23
198	002983	芯瑞达	3,800	63,270.00	0.23
199	301246	宏源药业	4,700	63,262.00	0.23
200	002393	力生制药	4,000	63,240.00	0.23
201	603567	珍宝岛	6,000	63,180.00	0.23
202	002860	星帅尔	7,700	63,063.00	0.23

203	600479	千金药业	6,200	63,054.00	0.23
204	601811	新华文轩	4,500	63,045.00	0.23
205	000576	甘化科工	10,500	63,000.00	0.23
206	002265	建设工业	7,300	62,999.00	0.23
207	600477	杭萧钢构	27,000	62,910.00	0.23
208	002242	九阳股份	6,000	62,880.00	0.23
209	603281	江瀚新材	2,800	62,860.00	0.23
210	300196	长海股份	6,200	62,806.00	0.23
211	300485	赛升药业	10,200	62,628.00	0.23
212	002658	雪迪龙	12,200	62,586.00	0.23
213	002801	微光股份	3,300	62,568.00	0.23
214	003005	竞业达	3,000	62,520.00	0.23
215	002034	旺能环境	4,800	62,448.00	0.23
216	002990	盛视科技	3,100	62,403.00	0.23
217	002187	广百股份	15,100	62,363.00	0.23
218	688371	菲沃泰	6,200	62,248.00	0.23
219	000505	京粮控股	11,400	62,016.00	0.23
220	301017	漱玉平民	6,300	61,992.00	0.23
221	301322	绿通科技	3,300	61,941.00	0.23
222	301278	快可电子	1,900	61,788.00	0.23
223	002838	道恩股份	6,800	61,608.00	0.22
224	600158	中体产业	8,000	61,520.00	0.22
225	688519	南亚新材	2,400	61,368.00	0.22
226	301391	卡莱特	1,400	61,292.00	0.22
227	603065	宿迁联盛	8,200	61,254.00	0.22
228	301015	百洋医药	2,600	61,178.00	0.22
229	300481	濮阳惠成	4,400	60,720.00	0.22
230	300091	金通灵	51,700	60,489.00	0.22
231	300994	久祺股份	5,500	60,445.00	0.22
232	002334	英威腾	10,100	60,398.00	0.22
233	301122	采纳股份	3,200	60,256.00	0.22
234	002132	恒星科技	28,400	60,208.00	0.22
235	688339	亿华通	2,000	59,960.00	0.22
236	688410	山外山	2,800	59,640.00	0.22
237	688127	蓝特光学	3,200	58,848.00	0.21
238	688001	华兴源创	2,600	58,708.00	0.21
239	002946	新乳业	6,700	58,692.00	0.21
240	688062	迈威生物	2,000	57,880.00	0.21
241	688377	迪威尔	4,400	57,640.00	0.21
242	688667	菱电电控	1,400	57,120.00	0.21
243	688246	嘉和美康	2,800	57,008.00	0.21
244	688606	奥泰生物	1,200	56,556.00	0.21
245	000607	华媒控股	18,100	55,929.00	0.20

246	688121	卓然股份	4,600	55,292.00	0.20
247	688408	中信博	600	55,248.00	0.20
248	605016	百龙创园	2,690	54,795.30	0.20
249	603297	永新光学	900	54,441.00	0.20
250	688238	和元生物	11,700	54,171.00	0.20
251	688320	禾川科技	2,200	53,988.00	0.20
252	000910	大亚圣象	8,700	53,418.00	0.19
253	300795	米奥会展	3,000	52,590.00	0.19
254	688478	晶升股份	1,800	52,416.00	0.19
255	002469	三维化学	9,100	51,870.00	0.19
256	002580	圣阳股份	8,300	51,045.00	0.19
257	002724	海洋王	11,300	50,285.00	0.18
258	300981	中红医疗	5,200	49,764.00	0.18
259	600648	外高桥	5,600	49,616.00	0.18
260	002570	贝因美	21,100	49,374.00	0.18
261	002181	粤传媒	15,000	48,450.00	0.18
262	300213	佳讯飞鸿	8,400	47,880.00	0.17
263	600604	市北高新	13,800	47,748.00	0.17
264	688348	昱能科技	800	47,200.00	0.17
265	300241	瑞丰光电	11,400	46,740.00	0.17
266	600279	重庆港	12,700	46,101.00	0.17
267	600210	紫江企业	8,600	45,752.00	0.17
268	301408	华人健康	4,400	45,012.00	0.16
269	688357	建龙微纳	1,800	41,940.00	0.15
270	000088	盐田港	9,100	41,223.00	0.15
271	300441	鲍斯股份	6,800	40,324.00	0.15
272	603353	和顺石油	3,100	40,176.00	0.15
273	000543	皖能电力	4,400	38,940.00	0.14
274	603112	华翔股份	3,700	38,887.00	0.14
275	002479	富春环保	10,300	36,256.00	0.13
276	002799	环球印务	6,000	35,280.00	0.13
277	601886	江河集团	7,200	35,136.00	0.13
278	600694	大商股份	2,030	34,124.30	0.12
279	002864	盘龙药业	1,300	33,644.00	0.12
280	000510	新金路	11,400	31,578.00	0.12
281	300224	正海磁材	3,300	30,558.00	0.11
282	603466	风语筑	3,400	29,036.00	0.11
283	600903	贵州燃气	4,600	28,704.00	0.10
284	000501	武商集团	4,200	28,014.00	0.10
285	603759	海天股份	4,700	27,871.00	0.10
286	300616	尚品宅配	2,300	25,438.00	0.09
287	300664	鹏鹞环保	5,700	25,365.00	0.09
288	601002	晋亿实业	8,000	23,200.00	0.08

289	603527	众源新材	3,200	22,720.00	0.08
290	605136	丽人丽妆	4,000	22,040.00	0.08
291	002881	美格智能	1,100	21,824.00	0.08
292	300679	电连技术	500	20,115.00	0.07
293	000900	现代投资	5,400	19,764.00	0.07
294	000906	浙商中拓	2,900	19,546.00	0.07
295	603213	镇洋发展	2,600	19,448.00	0.07
296	000557	西部创业	4,200	15,792.00	0.06
297	300379	东方通	1,500	12,120.00	0.04
298	600308	华泰股份	3,600	11,304.00	0.04
299	300860	锋尚文化	500	10,520.00	0.04
300	001328	登康口腔	400	10,120.00	0.04
301	603013	亚普股份	600	8,082.00	0.03
302	600897	厦门空港	500	6,305.00	0.02
303	603569	长久物流	900	6,174.00	0.02
304	688586	江航装备	600	5,580.00	0.02
305	300248	新开普	800	5,192.00	0.02
306	603266	天龙股份	300	5,076.00	0.02
307	605365	立达信	300	4,761.00	0.02
308	300119	瑞普生物	300	4,086.00	0.01
309	002768	国恩股份	200	3,740.00	0.01
310	300065	海兰信	500	3,305.00	0.01
311	001208	华菱线缆	400	3,032.00	0.01
312	603989	艾华集团	200	2,812.00	0.01
313	002697	红旗连锁	600	2,778.00	0.01
314	601801	皖新传媒	400	2,772.00	0.01
315	600371	万向德农	400	2,768.00	0.01
316	000905	厦门港务	400	2,260.00	0.01
317	600300	维维股份	900	2,160.00	0.01
318	600510	黑牡丹	500	1,860.00	0.01
319	603515	欧普照明	100	1,734.00	0.01
320	002083	孚日股份	300	1,269.00	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	600183	生益科技	6,500	136,890.00	0.50
2	603181	皇马科技	14,000	125,860.00	0.46
3	000055	方大集团	31,800	111,300.00	0.41
4	688168	安博通	4,000	107,600.00	0.39
5	601728	中国电信	15,400	94,710.00	0.34
6	600050	中国联通	16,800	78,960.00	0.29
7	603289	泰瑞机器	7,900	70,468.00	0.26
8	600900	长江电力	2,400	69,408.00	0.25

9	603678	火炬电子	2,800	69,132.00	0.25
10	301197	工大科雅	5,200	68,224.00	0.25
11	601233	桐昆股份	4,200	67,032.00	0.24
12	603511	爱慕股份	5,400	66,312.00	0.24
13	601318	中国平安	1,600	66,176.00	0.24
14	603096	新经典	3,900	65,910.00	0.24
15	300543	朗科智能	8,200	65,600.00	0.24
16	600219	南山铝业	17,200	65,532.00	0.24
17	600967	内蒙一机	9,100	65,520.00	0.24
18	603041	美思德	6,500	65,000.00	0.24
19	002415	海康威视	2,100	64,911.00	0.24
20	600082	海泰发展	32,400	64,800.00	0.24
21	600707	彩虹股份	9,500	64,695.00	0.24
22	603839	安正时尚	14,800	64,676.00	0.24
23	600941	中国移动	600	64,500.00	0.23
24	688660	电气风电	22,300	64,224.00	0.23
25	603928	兴业股份	8,180	64,049.40	0.23
26	002282	博深股份	10,000	63,900.00	0.23
27	301303	真兰仪表	5,540	63,820.80	0.23
28	001231	农心科技	4,500	63,315.00	0.23
29	301256	华融化学	10,300	63,242.00	0.23
30	605060	联德股份	4,400	63,228.00	0.23
31	300801	泰和科技	4,200	63,210.00	0.23
32	301006	迈拓股份	5,400	63,126.00	0.23
33	603010	万盛股份	7,000	63,070.00	0.23
34	600623	华谊集团	10,900	63,002.00	0.23
35	603330	天洋新材	13,100	62,749.00	0.23
36	002661	克明食品	8,400	62,748.00	0.23
37	603282	亚光股份	3,700	62,382.00	0.23
38	300192	科德教育	6,300	61,866.00	0.23
39	301029	怡合达	3,100	60,946.00	0.22
40	688011	新光光电	4,000	60,600.00	0.22
41	301227	森鹰窗业	3,200	60,192.00	0.22
42	688079	美迪凯	8,100	60,102.00	0.22
43	605369	拱东医疗	1,500	59,850.00	0.22
44	688251	井松智能	3,200	59,424.00	0.22
45	300866	安克创新	800	56,968.00	0.21
46	688276	百克生物	2,000	56,740.00	0.21
47	603726	朗迪集团	4,200	56,280.00	0.20
48	688788	科思科技	2,400	55,800.00	0.20
49	688475	萤石网络	1,600	54,576.00	0.20
50	002745	木林森	6,300	50,778.00	0.18
51	601006	大秦铁路	4,600	32,936.00	0.12

52	600104	上汽集团	2,300	31,878.00	0.12
53	000987	越秀资本	5,800	28,768.00	0.10
54	300980	祥源新材	1,800	28,368.00	0.10
55	301309	万得凯	1,100	28,116.00	0.10
56	300610	晨化股份	3,200	28,064.00	0.10
57	002062	宏润建设	7,600	26,448.00	0.10
58	002727	一心堂	1,600	24,144.00	0.09
59	688330	宏力达	1,000	20,390.00	0.07
60	600802	福建水泥	7,300	20,294.00	0.07
61	688265	南模生物	900	18,756.00	0.07
62	600128	苏豪弘业	2,500	15,925.00	0.06
63	600295	鄂尔多斯	1,600	15,872.00	0.06
64	002691	冀凯股份	3,600	15,804.00	0.06
65	301185	鸥玛软件	1,100	15,763.00	0.06
66	300861	美畅股份	600	11,610.00	0.04
67	002384	东山精密	300	6,210.00	0.02
68	600406	国电南瑞	200	4,992.00	0.02
69	688098	申联生物	600	2,502.00	0.01
70	001228	永泰运	100	2,108.00	0.01
71	601857	中国石油	200	2,064.00	0.01
72	000738	航发控制	100	2,007.00	0.01
73	002399	海普瑞	200	1,734.00	0.01
74	603587	地素时尚	100	1,228.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002441	众业达	567,927.00	2.07
2	000045	深纺织 A	510,296.00	1.86
3	002026	山东威达	459,719.00	1.67
4	002106	莱宝高科	437,420.00	1.59
5	000551	创元科技	425,033.00	1.55
6	600713	南京医药	417,259.00	1.52
7	002390	信邦制药	407,372.00	1.48
8	601200	上海环境	394,981.64	1.44
9	300440	运达科技	386,603.00	1.41
10	300994	久祺股份	382,710.00	1.39
11	601512	中新集团	379,175.00	1.38
12	603630	拉芳家化	367,725.00	1.34
13	600861	北京人力	363,848.00	1.33
14	600618	氯碱化工	353,684.00	1.29
15	605068	明新旭腾	345,224.00	1.26

16	600216	浙江医药	331,397.00	1.21
17	600742	一汽富维	326,634.00	1.19
18	600308	华泰股份	321,089.00	1.17
19	301087	可孚医疗	320,095.00	1.17
20	000055	方大集团	317,220.00	1.16

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002106	莱宝高科	382,075.00	1.39
2	002441	众业达	364,524.00	1.33
3	300994	久祺股份	337,177.00	1.23
4	002026	山东威达	316,055.00	1.15
5	600308	华泰股份	302,605.00	1.10
6	000045	深纺织 A	293,606.00	1.07
7	002583	海能达	292,083.00	1.06
8	603639	海利尔	284,789.00	1.04
9	003038	鑫铂股份	279,660.00	1.02
10	600713	南京医药	277,560.00	1.01
11	600216	浙江医药	273,604.00	1.00
12	688061	灿瑞科技	253,289.28	0.92
13	601200	上海环境	251,754.00	0.92
14	600618	氯碱化工	249,539.00	0.91
15	300440	运达科技	246,200.00	0.90
16	688030	山石网科	244,801.29	0.89
17	002390	信邦制药	242,922.00	0.88
18	301087	可孚医疗	241,620.00	0.88
19	300241	瑞丰光电	241,394.00	0.88
20	601512	中新集团	238,683.00	0.87

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	93,131,113.83
卖出股票收入（成交）总额	66,578,111.38

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	101,073.07	0.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,073.07	0.37

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	1,000	101,073.07	0.37

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,202,957.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,202,957.87

### 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	167	142,623.35	19,480,501.39	81.79	4,337,598.44	18.21

A						
民生加银国证 2000 指数增强 C	309	18,498.71	0.00	0.00	5,716,100.75	100.00
合计	476	62,046.64	19,480,501.39	65.96	10,053,699.19	34.04

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	民生加银国证 2000 指数增强 A	998.34	0.0042
	民生加银国证 2000 指数增强 C	12,132.59	0.2123
	合计	13,130.93	0.0445

## 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	0~10
	民生加银国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	民生加银国证 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
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	22,305,506.04	38,300,615.31
减：基金合同生效日	37,715,453.62	216,589,785.73

起至报告期期末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,818,099.83	5,716,100.75

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、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

本基金合同于 2024 年 3 月 19 日生效，聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）向本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
招商证券	2	158,499,661.05	99.24	89,411.43	99.54	-
华林证券	2	1,209,564.16	0.76	411.74	0.46	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为投资组合提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据投资组合投资的特定要求，提供专门研究报告；

iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

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

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；

ii 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

③本基金合同于 2024 年 3 月 19 日生效，本基金使用券商结算模式，根据以上标准，本期选择了上表列示的券商作为证券经纪商。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券	500,478.00	83.31	87,066,000.00	100.00	-	-
华林证券	100,261.00	16.69	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

## 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	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 20 日
2	民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 25 日
3	关于民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 18 日
4	关于民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 1 日
5	关于民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 8 日
6	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	2024 年 6 月 24 日
7	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	2024 年 6 月 24 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20240617~20240630	0.00	15,325,431.70	0.00	15,325,431.70	51.89
	2	20240412~20240428	6,001,970.00	4,155,069.69	6,001,970.00	4,155,069.69	14.07
	3	20240319~20240326	50,018,000.00	0.00	50,018,000.00	0.00	0.00
	4	20240617~20240623	0.00	13,291,074.53	13,291,074.53	0.00	0.00
	5	20240614~20240616	7,500,337.50	7,673,419.28	15,173,756.78	0.00	0.00
	6	20240614~20240616	0.00	10,231,225.70	10,231,225.70	0.00	0.00
个人	1	20240509~20240509	1,494,226.00	0.00	1,494,226.00	0.00	0.00

		40515	. 18		. 18	
产品特有风险						
<p>1、大额赎回风险</p> <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>2、大额申购风险</p> <p>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。</p>						

## 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

2024 年 8 月 30 日