

民生加银中证港股通高股息精选指数证券  
投资基金  
2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 民生加银中证港股通指数                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 004532                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金合同生效日    | 2017 年 6 月 2 日                                                                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 24,175,965.42 份                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。                                                                                                                                                                        |
| 投资策略       | 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于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%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。 |
| 业绩比较基准     | 中证港股通高股息精选指数收益率（使用估值汇率折算） $\times 95\% +$ 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征     | 本基金是股票指数基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资                                                                                                             |

|                 |                                   |                |
|-----------------|-----------------------------------|----------------|
|                 | 环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的<br>特有风险。 |                |
| 基金管理人           | 民生加银基金管理有限公司                      |                |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司                      |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 民生加银中证港股通指数 A                     | 民生加银中证港股通指数 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 004532                            | 004533         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,391,865.36 份                   | 8,784,100.06 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 民生加银中证港股通指数 A                       | 民生加银中证港股通指数 C |
| 1. 本期已实现收益      | 621,585.49                          | 357,884.77    |
| 2. 本期利润         | -312,597.44                         | -180,743.01   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0203                             | -0.0198       |
| 4. 期末基金资产净值     | 14,295,845.33                       | 8,034,507.15  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9288                              | 0.9147        |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银中证港股通指数 A

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标<br>准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -2.04% | 1.16%         | -6.65%         | 1.30%                 | 4.61% | -0.14% |
| 过去六个月 | 1.55%  | 1.24%         | -2.58%         | 1.31%                 | 4.13% | -0.07% |
| 过去一年  | -6.81% | 1.42%         | -9.92%         | 1.47%                 | 3.11% | -0.05% |
| 过去三年  | 5.99%  | 1.36%         | 3.70%          | 1.38%                 | 2.29% | -0.02% |
| 过去五年  | -6.94% | 1.35%         | -10.74%        | 1.37%                 | 3.80% | -0.02% |

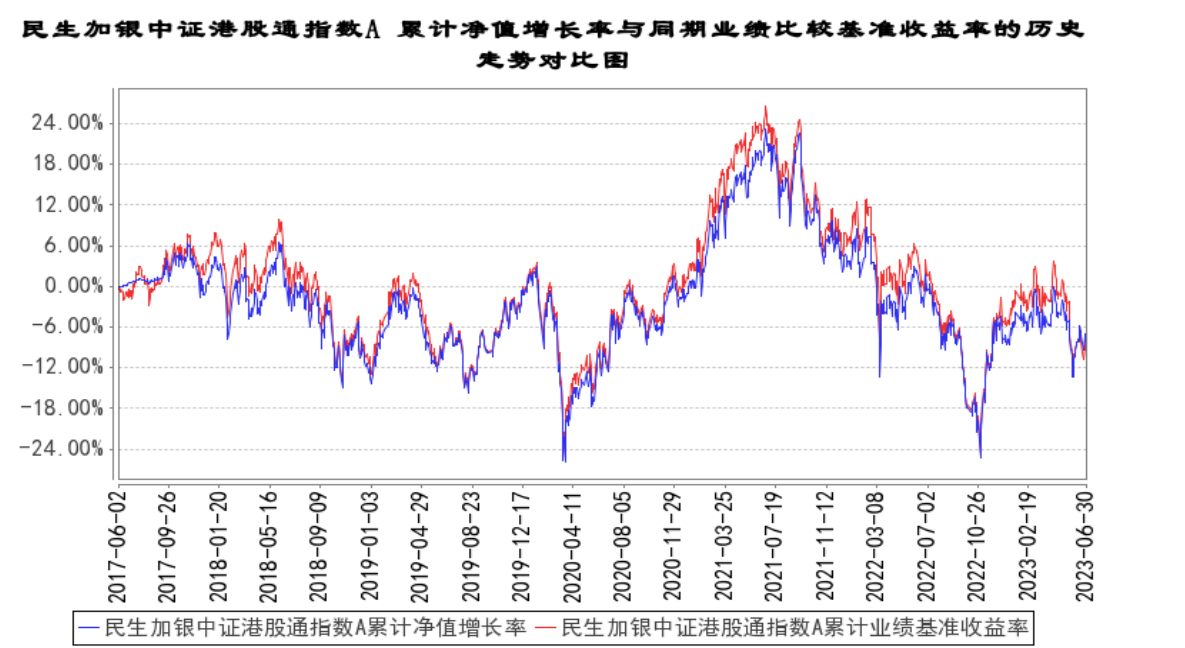
|                |        |       |        |       |       |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | -7.12% | 1.28% | -8.21% | 1.31% | 1.09% | -0.03% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|

民生加银中证港股通指数 C

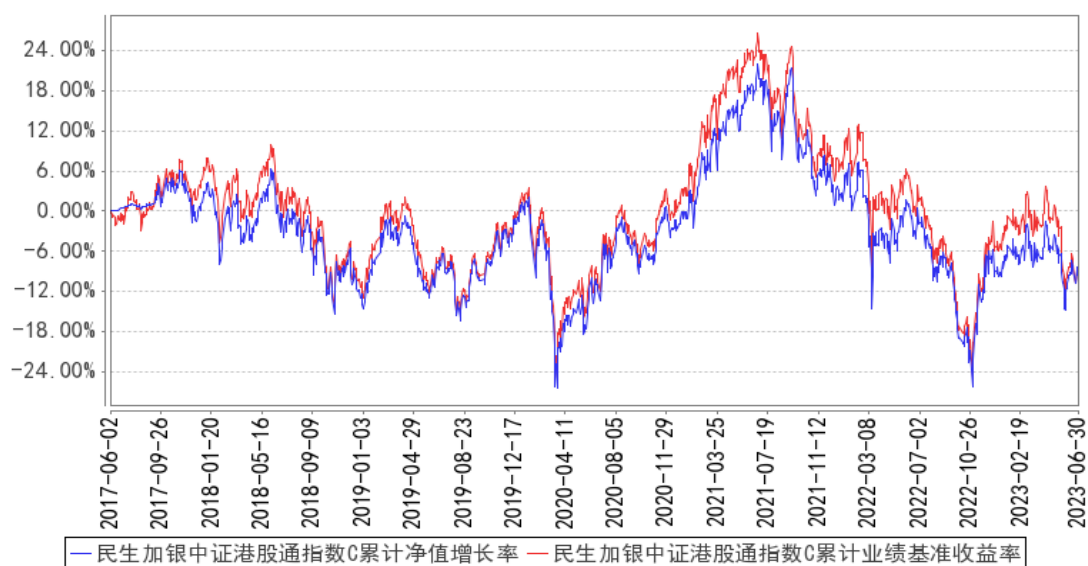
| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -2.11% | 1.16%         | -6.65%         | 1.30%                 | 4.54%  | -0.14% |
| 过去六个月          | 1.42%  | 1.23%         | -2.58%         | 1.31%                 | 4.00%  | -0.08% |
| 过去一年           | -7.05% | 1.42%         | -9.92%         | 1.47%                 | 2.87%  | -0.05% |
| 过去三年           | 5.19%  | 1.36%         | 3.70%          | 1.38%                 | 1.49%  | -0.02% |
| 过去五年           | -8.10% | 1.35%         | -10.74%        | 1.37%                 | 2.64%  | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -8.53% | 1.28%         | -8.21%         | 1.31%                 | -0.32% | -0.03% |

注：业绩比较基准=中证港股通高股息精选指数收益率（使用估值汇率折算）×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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



民生加银中证港股通指数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 2017 年 06 月 02 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----|---------|----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期           | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 蔡晓 | 本基金基金经理 | 2017 年 6 月 2 日 | —    | 19 年   | 中国科学院半导体研究所微电子与固体电子学硕士, 19 年证券从业经历。自 2004 年 7 月至 2006 年 8 月在中信建投证券股份有限公司(前身为华夏证券股份有限公司)行业与上市公司一部、研究发展部任分析师; 自 2006 年 9 月至 2008 年 4 月在新华资产管理股份有限公司研究部担任研究员; 自 2008 年 4 月至 2014 年 10 月在建信基金管理有限责任公司先后担任研究员、总监助理、策略组长和专户投委会成员。2014 年 10 月加入民生加银基金管理有限公司, 现任权益资产条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2017 年 6 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理; 自 2018 年 3 月至今担任民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 自 2021 年 12 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。 |

|    |                 |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|----|-----------------|-----------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                 |                 |   |      | 理；自 2022 年 12 月至今担任民生加银优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 5 月至今担任民生加银均衡优选混合型证券投资基金基金经理。自 2016 年 1 月至 2021 年 4 月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 2021 年 3 月至 2022 年 6 月担任民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；自 2016 年 5 月至 2023 年 3 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 何江 | 本基金基金经理、量化投资部总监 | 2022 年 2 月 28 日 | - | 18 年 | 清华大学流体力学硕士，18 年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、公司投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2019 年 12 月至今担任民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 3 月至今担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 周帅 | 本基金基金经理 | 2023 年 6 月 13 日 | - | 6 年 | 南开大学数量经济学硕士，6 年证券从业经历。自 2017 年 7 月至 2019 年 7 月，在中信建投基金管理有限公司任产品经理助理。2019 年 7 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任 PCF 专岗、基金经理助理，现任基金经理。自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |

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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

的公平交易执行体系。

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

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

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，港股市场呈现普遍回调的情况。港股大盘风格依旧占优，恒生大中型指数相对跑赢恒生中小型股指数；行业方面，各行业同样呈现出较显著的结构性差异，能源业、电讯业、金融业等行业表现相对强势，而医药保健业、资讯科技业、地产建筑业、必需性消费、建材等板块表现相对较弱。

投资运作上我们根据成分股调整、停复牌以及基金申赎情况，保持对中证港股通高股息指数的紧密跟踪。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银中证港股通指数 A 的基金份额净值为 0.9288 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.04%，同期业绩比较基准收益率为-6.65%；截至本报告期末民生加银中证港股通指数 C 的基金份额净值为 0.9147 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.11%，同期业绩比较基准收益率为-6.65%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本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的情形，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。



## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 20,777,391.48 | 89.63        |
|    | 其中：股票             | 20,777,391.48 | 89.63        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,215,428.55  | 5.24         |
|    | 其中：债券             | 1,215,428.55  | 5.24         |
|    | 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      | 164,056.51    | 0.71         |
| 8  | 其他资产              | 1,023,751.81  | 4.42         |
| 9  | 合计                | 23,180,628.35 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 20,777,391.48 元，占基金资产净值比例 93.05%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料      | 1,882,141.78 | 8.43         |
| 非日常生活消费品 | 1,858,936.64 | 8.32         |
| 日常消费品    | 1,572,409.23 | 7.04         |
| 能源       | 5,557,709.26 | 24.89        |
| 金融       | 795,825.48   | 3.56         |
| 医疗保健     | 576,458.78   | 2.58         |
| 工业       | 4,754,045.86 | 21.29        |
| 信息科技     | 1,829,835.26 | 8.19         |
| 电信业务     | 1,092,477.15 | 4.89         |
| 公用事业     | 857,552.04   | 3.84         |

|     |               |       |
|-----|---------------|-------|
| 房地产 | -             | -     |
| 合计  | 20,777,391.48 | 93.05 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 00316 | 东方海外国<br>际 | 19,000  | 1,841,101.86 | 8.24         |
| 2  | 01088 | 中国神华       | 72,500  | 1,600,903.02 | 7.17         |
| 3  | 00857 | 中国石油股<br>份 | 284,000 | 1,419,185.37 | 6.36         |
| 4  | 01888 | 建滔积层板      | 184,500 | 1,253,676.13 | 5.61         |
| 5  | 02343 | 太平洋航运      | 557,000 | 1,222,232.01 | 5.47         |
| 6  | 00941 | 中国移动       | 18,500  | 1,092,477.15 | 4.89         |
| 7  | 01171 | 兖矿能源       | 50,000  | 1,034,922.55 | 4.63         |
| 8  | 00883 | 中国海洋石<br>油 | 92,000  | 950,008.19   | 4.25         |
| 9  | 01308 | 海丰国际       | 72,000  | 949,270.61   | 4.25         |
| 10 | 06881 | 中国银河       | 206,500 | 795,825.48   | 3.56         |

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 1,215,428.55 | 5.44         |
| 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        | 1,215,428.55 | 5.44         |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | 019688 | 22 国债 23 | 5,000 | 505,596.30 | 2.26         |
| 2  | 019694 | 23 国债 01 | 4,000 | 404,438.58 | 1.81         |
| 3  | 019679 | 22 国债 14 | 3,000 | 305,393.67 | 1.37         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 本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。

#### 5.11.2 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

报告期内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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 124.89       |
| 2  | 应收证券清算款 | 96,608.07    |
| 3  | 应收股利    | 887,546.58   |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 39,472.27    |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 1,023,751.81 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告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未存在流通受限的情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 民生加银中证港股通指数 A | 民生加银中证港股通指数 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 15,347,833.77 | 9,999,658.78  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,404,638.18  | 6,798,146.54  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,360,606.59  | 8,013,705.26  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 15,391,865.36 | 8,784,100.06  |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内无基金管理人持有本基金份额的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本基金管理人发布了如下公告：

- 2023 年 4 月 21 日 民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告
- 2023 年 4 月 21 日 民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告
- 2023 年 6 月 8 日 关于旗下部分开放式基金增加上海陆享基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告
- 2023 年 6 月 13 日 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变更公告
- 2023 年 6 月 16 日 民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新

6 2023 年 6 月 16 日 民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新

7 2023 年 6 月 16 日 民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 1 号)

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予基金注册的文件；
- (2) 《民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银中证港股通高股息精选指数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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

2023 年 7 月 21 日