

民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	民生加银沪深 300ETF
场内简称	民生 300
基金主代码	515350
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 24 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,499,186.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 7 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制法，跟踪标的指数的表现，即按照成份股在标的指数中的权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘静
	联系电话	0755-23999841
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn
客户服务电话	400-8888-388	95599
传真	0755-23999800	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518038	100031
法定代表人	郑智军	谷澍

## 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,740,588.74
本期利润	2,328,540.64
加权平均基金份额本期利润	0.0955
本期加权平均净值利润率	2.16%
本期基金份额净值增长率	1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	9,173,871.80
期末可供分配基金份额利润	0.4077
期末基金资产净值	99,685,710.87
期末基金份额净值	4.4306
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	10.14%

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。

### 3.2 基金净值表现

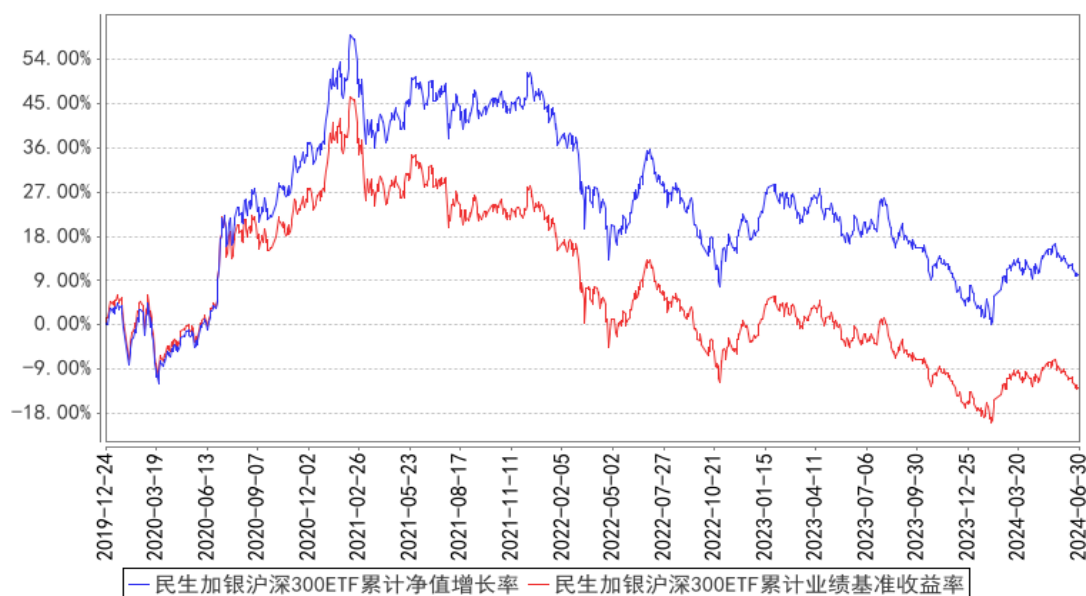
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.55%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.75%	0.00%
过去三个月	-1.09%	0.75%	-2.14%	0.76%	1.05%	-0.01%
过去六个月	1.97%	0.89%	0.89%	0.90%	1.08%	-0.01%
过去一年	-7.62%	0.86%	-9.91%	0.87%	2.29%	-0.01%
过去三年	-26.24%	1.03%	-33.74%	1.05%	7.50%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.14%	1.15%	-12.74%	1.17%	22.88%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

#### 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

民生加银沪深300ETF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 2019 年 12 月 24 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会[2008]1187 号文批准，于 2008 年 11 月 3 日在深圳正式成立，2012 年注册资本增加至 3 亿元人民币。公司股东为中国民生银行

股份有限公司、加拿大皇家银行和陕西省国际信托股份有限公司，三方股东持股比例分别为 63.33%、30%、6.67%。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	本基金基金经理、量化投资部总监	2019 年 12 月 24 日	-	19 年	清华大学流体力学硕士，19 年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、公司投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2019 年 12 月至今担任民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 3 月至今担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2024 年 3 月至今担任民生加银国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理。自 2020 年 12 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 500 指数增强型发起



					式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 6 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

本报告期内，本基金跟踪误差产生的主要来源是：1) 申购赎回的影响；2) 成份股票的停牌；

3) 指数成份股调整等。

本基金为指数型基金，基金管理人将继续按照基金合同的要求，坚持指数化投资策略，通过运用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 4.4306 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.97%，业绩比较基准收益率为 0.89%。

#### 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。本基金管理人为确保估值工作的合规开展，已通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；并建立了负责估值工作决策和执行的专门机构即估值委员会，组成人员包括分管投研的公司领导、督察长、分管运营的公司领导、运营管理部、交易部、研究各部门、投资各部门、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究各部门参加人员应包含相关行业研究员及固定收益信评人员。分管运营的公司领导任估值委员会主席。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—民生加银基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,498,228.19	4,813,479.92
结算备付金		583,144.90	531,308.18
存出保证金		384,400.68	384,426.21

交易性金融资产	6.4.7.2	95,286,027.67	111,878,366.46
其中：股票投资		95,286,027.67	111,878,366.46
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		6,578.11	17,306.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,409.12	-
资产总计		99,833,788.67	117,624,887.17
<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>上年度末 2023年12月31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		-	-
应付管理人报酬		12,462.52	13,406.31
应付托管费		4,154.18	4,468.76
应付销售服务费		-	-
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	131,461.10	291,679.96
负债合计		148,077.80	309,555.03
<b>净 资 产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	90,511,839.07	108,614,861.82
未分配利润	6.4.7.12	9,173,871.80	8,700,470.32
净资产合计		99,685,710.87	117,315,332.14
负债和净资产总计		99,833,788.67	117,624,887.17

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.4306 元，基金份额总额 22,499,186.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,675,840.59	2,030,774.64
1. 利息收入		20,649.16	32,526.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,649.16	32,526.64
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,428,444.00	-2,670,682.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,691,050.38	-3,737,939.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,277.90
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	135,263.82	-223,083.91
股利收益	6.4.7.19	1,127,342.56	1,289,063.02
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	6,069,129.38	4,558,040.76
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	14,506.05	110,890.18
<b>减：二、营业总支出</b>		347,299.95	405,774.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	80,541.15	96,850.41
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,847.07	32,283.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		873. 64	985. 43
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	239, 038. 09	275, 655. 64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 328, 540. 64	1, 624, 999. 69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 328, 540. 64	1, 624, 999. 69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2, 328, 540. 64	1, 624, 999. 69

### 6.3 净资产变动表

会计主体：民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	108, 614, 861. 82	-	8, 700, 470. 32	117, 315, 332. 14
二、本期期初净资产	108, 614, 861. 82	-	8, 700, 470. 32	117, 315, 332. 14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18, 103, 022. 75	-	473, 401. 48	-17, 629, 621. 27
（一）、综合收益总额	-	-	2, 328, 540. 64	2, 328, 540. 64
（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）	-18, 103, 022. 75	-	-1, 855, 139. 16	-19, 958, 161. 91
其中：1. 基金申购款	10, 861, 813. 65	-	583, 839. 82	11, 445, 653. 47
2. 基金赎回款	-28, 964, 836. 40	-	-2, 438, 978. 98	-31, 403, 815. 38
（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	90,511,839.07	-	9,173,871.80	99,685,710.87
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	112,235,466.38	-	20,965,979.27	133,201,445.65
二、本期期初净资产	112,235,466.38	-	20,965,979.27	133,201,445.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,103,022.75	-	-2,876,882.99	-20,979,905.74
(一)、综合收益总额	-	-	1,624,999.69	1,624,999.69
(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)	-18,103,022.75	-	-4,501,882.68	-22,604,905.43
其中：1. 基金申购款	28,964,836.40	-	6,419,698.36	35,384,534.76
2. 基金赎回款	-47,067,859.15	-	-10,921,581.04	-57,989,440.19
(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	94,132,443.63	-	18,089,096.28	112,221,539.91

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

王国栋

洪锐珠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管

理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1599号《关于准予民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模共人民币 362,057,180.00 元。经向中国证监会备案,《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通



知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管

理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	3,498,228.19
等于：本金	3,497,553.48
加：应计利息	674.71
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,498,228.19

##### 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	106,107,014.68	-	95,286,027.67	-10,820,987.01
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	106,107,014.68	-	95,286,027.67	-10,820,987.01

##### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,130,500.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,130,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,130,500.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2407	IF2407	3.00	3,093,300.00	-37,200.00
合计				-37,200.00
减：可抵销期货暂收款				-37,200.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

## 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	3,563.75
其中：交易所市场	3,563.75
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	35,000.00
预提审计费	14,918.54

预提 IOPV 服务费	18,306.47
预提信息披露费	59,672.34
合计	131,461.10

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,999,186.00	108,614,861.82
本期申购	2,700,000.00	10,861,813.65
本期赎回（以“-”号填列）	-7,200,000.00	-28,964,836.40
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	22,499,186.00	90,511,839.07

#### 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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,939,063.16	-25,238,592.84	8,700,470.32
本期期初	33,939,063.16	-25,238,592.84	8,700,470.32
本期利润	-3,740,588.74	6,069,129.38	2,328,540.64
本期基金份额交易产生的变动数	-5,172,156.49	3,317,017.33	-1,855,139.16
其中：基金申购款	3,221,651.36	-2,637,811.54	583,839.82
基金赎回款	-8,393,807.85	5,954,828.87	-2,438,978.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,026,317.93	-15,852,446.13	9,173,871.80

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	10,271.16
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	10,261.13	
其他	116.87	
合计	20,649.16	

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,323,390.88
股票投资收益——赎回差价收入	-1,367,659.50
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	-4,691,050.38

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	15,057,526.89
减：卖出股票成本总额	18,364,120.34
减：交易费用	16,797.43
买卖股票差价收入	-3,323,390.88

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	31,403,815.38
减：现金支付赎回款总额	12,092,527.38
减：赎回股票成本总额	20,678,947.50
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,367,659.50

## 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.14.5 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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	135,263.82

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,127,342.56
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	1,127,342.56

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,150,909.38
股票投资	6,150,909.38
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-81,780.00
权证投资	-
期货投资	-81,780.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	6,069,129.38

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	14,506.05
合计	14,506.05

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-



银行费用	1,549.86
指数使用费	70,000.00
中登登记结算费	74,590.88
IOPV 服务费	18,306.47
合计	239,038.09

#### 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

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金管理人的股东
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	本基金的联接基金

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	80,541.15	96,850.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	80,541.15	96,850.41

注：支付基金管理人民生加银基金公司的管理费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,847.07	32,283.47

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均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及上年度可比期间均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固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未持有本基金。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
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	8,149,329.00	36.2206	8,703,529.00	32.2363

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,498,228.19	10,271.16	6,041,400.70	17,832.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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

于2024年6月30日，本基金：

1、持有 170,900.00 股中国农业银行的普通股，成本总额为人民币 569,268.17 元，估值总额为人民币 745,124.00 元，占基金净资产的比例为 0.75% (2023 年 12 月 31 日：持有 206,400.00 股中国农业银行的普通股，成本总额为人民币 672,539.35 元，估值总额为人民币 751,296.00 元，占基金净资产的比例为 0.64%)。

2、持有 113,900.00 股中国民生银行的普通股，成本总额为人民币 434,549.13 元，估值总额为人民币 431,681.00 元，占基金净资产的比例为 0.43% (2023 年 12 月 31 日：持有 160,500.00 股中国民生银行的普通股，成本总额为人民币 611,320.99 元，估值总额为人民币 600,270.00 元，占基金净资产的比例为 0.51%)。

### 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

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
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	141	2,284.20	2,250.36	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	47	1,000.16	1,386.03	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内（含）	新股流通受限	18.65	18.65	453	8,448.45	8,448.45	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	51	951.15	951.15	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	39	1,131.78	989.04	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	18	1,304.28	1,225.08	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	58	1,112.44	1,314.28	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内（含）	新股流通受限	20.56	20.56	456	9,375.36	9,375.36	-

603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	51	1,048.56	1,048.56	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	29	1,107.22	1,128.10	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	43	1,004.05	1,080.59	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	270	2,592.00	4,347.00	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	162	3,670.92	2,574.18	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	121	2,403.06	5,143.71	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	35	3,043.60	6,122.55	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	118	2,646.74	3,722.90	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	209	3,279.21	3,927.11	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股流通受限	55.66	47.02	1,439	80,094.74	67,661.78	-

#### 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：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：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

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

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在托管人和其他有资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额将在一年以内到期且计息（该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风



险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,497,553.48	-	-	-	-	674.71	3,498,228.19
结算备付金	582,902.11	-	-	-	-	242.79	583,144.90
存出保证金	13,198.78	-	-	-	-	371,201.90	384,400.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	95,286,027.67	95,286,027.67
应收清算款	-	-	-	-	-	6,578.11	6,578.11
其他资产	-	-	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	4,093,654.37	-	-	-	-	95,740,134.30	99,833,788.67
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,462.52	12,462.52
应付托管费	-	-	-	-	-	4,154.18	4,154.18
其他负债	-	-	-	-	-	131,461.10	131,461.10
负债总计	-	-	-	-	-	148,077.80	148,077.80
利率敏感度缺口	4,093,654.37	-	-	-	-	95,592,056.50	99,685,710.87
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,812,422.40	-	-	-	-	1,057.52	4,813,479.92
结算备付金	528,778.45	-	-	-	-	2,529.73	531,308.18
存出保证金	12,921.32	-	-	-	-	371,504.89	384,426.21
交易性金融资产	-	-	-	-	-	111,878,366.46	111,878,366.46
应收清算款	-	-	-	-	-	17,306.40	17,306.40
资产总计	5,354,122.17	-	-	-	-	112,270,765.00	117,624,887.17
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,406.31	13,406.31
应付托管费	-	-	-	-	-	4,468.76	4,468.76
其他负债	-	-	-	-	-	291,679.96	291,679.96
负债总计	-	-	-	-	-	309,555.03	309,555.03
利率敏感度缺口	5,354,122.17	-	-	-	-	111,961,209.97	117,315,332.14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	95,286,027.67	95.59	111,878,366.46	95.37
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	95,286,027.67	95.59	111,878,366.46	95.37

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）

1. 本基金业绩比较 基准上升 5%	4,944,663.51	5,780,852.23
2. 本基金业绩比较 基准下降 5%	-4,944,663.51	-5,780,852.23

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	95,163,331.44	111,667,849.69
第二层次	122,696.23	210,516.77
第三层次	-	-
合计	95,286,027.67	111,878,366.46

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	95,286,027.67	95.44
	其中：股票	95,286,027.67	95.44
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	4,081,373.09	4.09
8	其他各项资产	466,387.91	0.47
9	合计	99,833,788.67	100.00

注：上表中股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 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	1,202,690.40	1.21
B	采矿业	5,795,658.90	5.81
C	制造业	49,571,252.71	49.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,461,545.00	4.48
E	建筑业	2,126,184.80	2.13
F	批发和零售业	245,367.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	3,561,898.90	3.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和	4,298,879.92	4.31

	信息技术服务业		
J	金融业	21,224,746.84	21.29
K	房地产业	875,276.00	0.88
L	租赁和商务服务业	761,868.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	756,372.66	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	257,721.36	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,139,462.49	95.44

### 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	-	-
C	制造业	129,325.66	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,989.16	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,250.36	0.00
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	146,565.18	0.15

### 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	600519	贵州茅台	3,400	4,989,126.00	5.00
2	300750	宁德时代	14,120	2,542,023.60	2.55
3	601318	中国平安	57,572	2,381,177.92	2.39
4	600036	招商银行	66,300	2,266,797.00	2.27
5	600900	长江电力	65,500	1,894,260.00	1.90
6	000333	美的集团	26,144	1,686,288.00	1.69
7	601899	紫金矿业	88,200	1,549,674.00	1.55
8	601166	兴业银行	77,900	1,372,598.00	1.38
9	000858	五粮液	10,400	1,331,616.00	1.34
10	002594	比亚迪	4,800	1,201,200.00	1.20
11	601328	交通银行	147,100	1,098,837.00	1.10
12	601398	工商银行	187,600	1,069,320.00	1.07
13	002475	立讯精密	26,878	1,056,574.18	1.06
14	600030	中信证券	52,250	952,517.50	0.96
15	000651	格力电器	24,096	945,045.12	0.95
16	300760	迈瑞医疗	3,200	930,912.00	0.93
17	600276	恒瑞医药	23,878	918,347.88	0.92
18	600887	伊利股份	34,100	881,144.00	0.88
19	600309	万华化学	10,100	816,686.00	0.82
20	000725	京东方 A	197,900	809,411.00	0.81
21	601088	中国神华	17,700	785,349.00	0.79
22	601288	农业银行	170,900	745,124.00	0.75
23	300059	东方财富	67,593	713,782.08	0.72
24	601816	京沪高铁	131,400	705,618.00	0.71
25	300308	中际旭创	4,840	667,339.20	0.67
26	002714	牧原股份	14,638	638,216.80	0.64
27	601857	中国石油	60,700	626,424.00	0.63
28	002415	海康威视	20,008	618,447.28	0.62
29	601668	中国建筑	111,400	591,534.00	0.59
30	600919	江苏银行	78,550	583,626.50	0.59
31	601138	工业富联	21,300	583,620.00	0.59
32	600690	海尔智家	20,300	576,114.00	0.58

33	300498	温氏股份	28,480	564,473.60	0.57
34	600809	山西汾酒	2,660	560,940.80	0.56
35	000568	泸州老窖	3,900	559,611.00	0.56
36	002371	北方华创	1,700	543,813.00	0.55
37	601985	中国核电	50,500	538,330.00	0.54
38	601225	陕西煤业	20,800	536,016.00	0.54
39	600406	国电南瑞	21,462	535,691.52	0.54
40	603259	药明康德	13,564	531,573.16	0.53
41	601919	中远海控	34,110	528,363.90	0.53
42	000001	平安银行	51,986	527,657.90	0.53
43	600031	三一重工	31,800	524,700.00	0.53
44	601988	中国银行	112,800	521,136.00	0.52
45	600000	浦发银行	62,900	517,667.00	0.52
46	600941	中国移动	4,800	516,000.00	0.52
47	300124	汇川技术	10,050	515,565.00	0.52
48	601728	中国电信	83,100	511,065.00	0.51
49	601601	中国太保	18,300	509,838.00	0.51
50	000792	盐湖股份	29,100	507,795.00	0.51
51	600028	中国石化	78,200	494,224.00	0.50
52	601766	中国中车	65,100	488,901.00	0.49
53	688981	中芯国际	10,600	488,660.00	0.49
54	600150	中国船舶	12,000	488,520.00	0.49
55	600050	中国联通	102,100	479,870.00	0.48
56	300274	阳光电源	7,720	478,871.60	0.48
57	000063	中兴通讯	17,100	478,287.00	0.48
58	000338	潍柴动力	29,100	472,584.00	0.47
59	002352	顺丰控股	13,100	467,539.00	0.47
60	601169	北京银行	79,200	462,528.00	0.46
61	603501	韦尔股份	4,590	456,108.30	0.46
62	601012	隆基绿能	32,432	454,696.64	0.46
63	600837	海通证券	51,700	442,552.00	0.44
64	000100	TCL 科技	100,560	434,419.20	0.44
65	600016	民生银行	113,900	431,681.00	0.43
66	002230	科大讯飞	9,950	427,352.50	0.43
67	600660	福耀玻璃	8,600	411,940.00	0.41
68	002142	宁波银行	17,680	390,020.80	0.39
69	601229	上海银行	53,200	386,232.00	0.39
70	600089	特变电工	27,020	374,767.40	0.38
71	600938	中国海油	11,200	369,600.00	0.37
72	601390	中国中铁	55,000	358,600.00	0.36
73	000625	长安汽车	26,568	356,808.24	0.36
74	688041	海光信息	5,000	351,600.00	0.35
75	603986	兆易创新	3,612	345,379.44	0.35

76	600104	上汽集团	24,800	343,728.00	0.34
77	600436	片仔癀	1,651	342,037.67	0.34
78	601688	华泰证券	27,400	339,486.00	0.34
79	600048	保利发展	38,500	337,260.00	0.34
80	601006	大秦铁路	47,000	336,520.00	0.34
81	600905	三峡能源	76,600	333,976.00	0.34
82	002027	分众传媒	54,100	327,846.00	0.33
83	601211	国泰君安	24,100	326,555.00	0.33
84	603019	中科曙光	7,860	326,190.00	0.33
85	601888	中国中免	5,200	324,948.00	0.33
86	688012	中微公司	2,300	324,898.00	0.33
87	601600	中国铝业	42,400	323,512.00	0.32
88	603993	洛阳钼业	37,800	321,300.00	0.32
89	600019	宝钢股份	47,400	315,210.00	0.32
90	601818	光大银行	99,392	315,072.64	0.32
91	603288	海天味业	8,920	307,472.40	0.31
92	600585	海螺水泥	12,800	301,952.00	0.30
93	601658	邮储银行	59,400	301,158.00	0.30
94	601989	中国重工	61,000	300,730.00	0.30
95	600886	国投电力	16,000	291,840.00	0.29
96	601009	南京银行	27,700	287,803.00	0.29
97	600795	国电电力	47,700	285,723.00	0.29
98	688008	澜起科技	4,900	280,084.00	0.28
99	600438	通威股份	14,500	277,095.00	0.28
100	600999	招商证券	19,870	276,391.70	0.28
101	601628	中国人寿	8,900	276,345.00	0.28
102	688111	金山办公	1,200	273,000.00	0.27
103	000938	紫光股份	12,200	272,670.00	0.27
104	000425	徐工机械	38,000	271,700.00	0.27
105	601939	建设银行	35,970	266,178.00	0.27
106	600547	山东黄金	9,680	265,038.40	0.27
107	300014	亿纬锂能	6,600	263,472.00	0.26
108	002304	洋河股份	3,244	261,920.56	0.26
109	002179	中航光电	6,830	259,881.50	0.26
110	600893	航发动力	7,100	259,505.00	0.26
111	300015	爱尔眼科	24,973	257,721.36	0.26
112	601669	中国电建	46,100	257,699.00	0.26
113	000002	万科A	36,400	252,252.00	0.25
114	002241	歌尔股份	12,800	249,728.00	0.25
115	600926	杭州银行	19,000	247,950.00	0.25
116	600584	长电科技	7,700	244,167.00	0.24
117	000538	云南白药	4,760	243,474.00	0.24
118	688256	寒武纪	1,200	238,404.00	0.24



119	600760	中航沈飞	5,904	236,750.40	0.24
120	600111	北方稀土	13,500	232,200.00	0.23
121	600489	中金黄金	15,600	230,880.00	0.23
122	002050	三花智控	11,970	228,387.60	0.23
123	600011	华能国际	23,600	227,032.00	0.23
124	002252	上海莱士	28,500	222,870.00	0.22
125	601916	浙商银行	80,700	222,732.00	0.22
126	600015	华夏银行	34,100	218,240.00	0.22
127	600009	上海机场	6,700	216,075.00	0.22
128	600426	华鲁恒升	8,000	213,120.00	0.21
129	600958	东方证券	27,976	212,617.60	0.21
130	002311	海大集团	4,500	211,725.00	0.21
131	601186	中国铁建	24,600	210,822.00	0.21
132	300408	三环集团	7,217	210,664.23	0.21
133	000166	申万宏源	48,300	208,173.00	0.21
134	600989	宝丰能源	11,800	204,494.00	0.21
135	000157	中联重科	26,600	204,288.00	0.20
136	601901	方正证券	26,400	204,072.00	0.20
137	000977	浪潮信息	5,500	200,035.00	0.20
138	688271	联影医疗	1,800	197,460.00	0.20
139	300433	蓝思科技	10,700	195,275.00	0.20
140	600674	川投能源	10,400	195,000.00	0.20
141	003816	中国广核	42,100	194,923.00	0.20
142	002049	紫光国微	3,680	193,568.00	0.19
143	000776	广发证券	15,800	192,286.00	0.19
144	002001	新和成	9,900	190,080.00	0.19
145	000596	古井贡酒	900	189,963.00	0.19
146	601377	兴业证券	37,030	187,371.80	0.19
147	688036	传音控股	2,402	183,849.08	0.18
148	601111	中国国航	24,900	183,762.00	0.18
149	600115	中国东航	45,800	183,658.00	0.18
150	300122	智飞生物	6,400	179,392.00	0.18
151	000768	中航西飞	7,400	177,822.00	0.18
152	002460	赣锋锂业	6,080	174,192.00	0.17
153	001979	招商蛇口	19,400	170,526.00	0.17
154	600029	南方航空	28,900	170,221.00	0.17
155	600010	宝钢股份	121,500	170,100.00	0.17
156	601800	中国交建	19,000	169,860.00	0.17
157	601633	长城汽车	6,700	169,510.00	0.17
158	600188	兖矿能源	7,350	167,065.50	0.17
159	002601	龙佰集团	8,900	165,273.00	0.17
160	002466	天齐锂业	5,500	164,505.00	0.17
161	002236	大华股份	10,539	162,932.94	0.16

162	002648	卫星化学	9,040	162,539.20	0.16
163	601117	中国化学	19,600	161,504.00	0.16
164	000786	北新建材	5,400	160,164.00	0.16
165	603799	华友钴业	7,220	159,778.60	0.16
166	600346	恒力石化	11,300	157,635.00	0.16
167	603369	今世缘	3,400	157,080.00	0.16
168	002493	荣盛石化	16,250	156,975.00	0.16
169	000983	山西焦煤	15,200	156,712.00	0.16
170	000661	长春高新	1,700	156,009.00	0.16
171	600372	中航机载	13,000	155,610.00	0.16
172	600161	天坛生物	6,360	155,184.00	0.16
173	601838	成都银行	10,200	154,938.00	0.16
174	300782	卓胜微	1,980	153,925.20	0.15
175	601788	光大证券	10,500	153,510.00	0.15
176	600023	浙能电力	21,500	152,865.00	0.15
177	688223	晶科能源	21,383	151,819.30	0.15
178	600196	复星医药	6,800	150,552.00	0.15
179	002129	TCL 中环	17,350	150,077.50	0.15
180	000807	云铝股份	11,100	149,961.00	0.15
181	300418	昆仑万维	4,600	148,304.00	0.15
182	601868	中国能建	69,400	147,128.00	0.15
183	002938	鹏鼎控股	3,700	147,112.00	0.15
184	601872	招商轮船	17,400	147,030.00	0.15
185	600845	宝信软件	4,604	147,005.72	0.15
186	601360	三六零	19,100	146,688.00	0.15
187	601021	春秋航空	2,600	146,458.00	0.15
188	300661	圣邦股份	1,755	145,278.90	0.15
189	300896	爱美客	840	144,564.00	0.15
190	600233	圆通速递	9,200	143,980.00	0.14
191	600219	南山铝业	37,600	143,256.00	0.14
192	600570	恒生电子	8,098	143,010.68	0.14
193	600176	中国巨石	12,818	141,638.90	0.14
194	600085	同仁堂	3,700	141,377.00	0.14
195	002180	纳思达	5,300	140,026.00	0.14
196	601995	中金公司	4,700	139,167.00	0.14
197	600600	青岛啤酒	1,900	138,263.00	0.14
198	600741	华域汽车	8,425	138,001.50	0.14
199	300347	泰格医药	2,800	136,080.00	0.14
200	601100	恒立液压	2,904	135,268.32	0.14
201	601336	新华保险	4,500	135,135.00	0.14
202	601066	中信建投	7,000	134,680.00	0.14
203	601689	拓普集团	2,500	134,025.00	0.13
204	002736	国信证券	15,400	133,826.00	0.13

205	603392	万泰生物	2,027	133,538.76	0.13
206	600745	闻泰科技	4,700	132,775.00	0.13
207	600183	生益科技	6,300	132,678.00	0.13
208	002271	东方雨虹	10,750	132,655.00	0.13
209	600362	江西铜业	5,600	132,608.00	0.13
210	000895	双汇发展	5,518	131,162.86	0.13
211	000963	华东医药	4,700	130,707.00	0.13
212	002920	德赛西威	1,500	130,635.00	0.13
213	001965	招商公路	11,000	130,460.00	0.13
214	605499	东鹏饮料	600	129,450.00	0.13
215	600027	华电国际	18,200	126,308.00	0.13
216	601881	中国银河	11,600	125,976.00	0.13
217	300033	同花顺	1,180	122,366.00	0.12
218	601898	中煤能源	9,800	122,304.00	0.12
219	688126	沪硅产业	8,823	121,845.63	0.12
220	002459	晶澳科技	10,660	119,392.00	0.12
221	601618	中国中冶	38,200	118,420.00	0.12
222	002916	深南电路	1,100	116,347.00	0.12
223	000999	华润三九	2,730	116,243.40	0.12
224	601699	潞安环能	6,400	116,032.00	0.12
225	600026	中远海能	7,400	115,514.00	0.12
226	600515	海南机场	36,700	115,238.00	0.12
227	601607	上海医药	6,000	114,660.00	0.12
228	300832	新产业	1,700	114,648.00	0.12
229	000301	东方盛虹	14,200	113,174.00	0.11
230	000876	新希望	12,200	111,508.00	0.11
231	601878	浙商证券	10,400	111,488.00	0.11
232	600332	白云山	3,800	111,454.00	0.11
233	600039	四川路桥	14,020	110,617.80	0.11
234	601877	正泰电器	5,801	110,567.06	0.11
235	601998	中信银行	16,500	110,550.00	0.11
236	600588	用友网络	11,030	110,300.00	0.11
237	002074	国轩高科	5,700	109,155.00	0.11
238	600415	小商品城	14,700	109,074.00	0.11
239	002555	三七互娱	8,347	108,928.35	0.11
240	002709	天赐材料	6,200	108,872.00	0.11
241	600875	东方电气	5,900	108,855.00	0.11
242	600803	新奥股份	5,000	104,000.00	0.10
243	600025	华能水电	9,600	103,488.00	0.10
244	000408	藏格矿业	4,200	101,094.00	0.10
245	688396	华润微	2,700	101,088.00	0.10
246	300316	晶盛机电	3,500	100,555.00	0.10
247	300223	北京君正	1,800	99,792.00	0.10

248	688599	天合光能	5,800	98,136.00	0.10
249	300450	先导智能	5,900	98,117.00	0.10
250	002812	恩捷股份	3,100	98,115.00	0.10
251	300142	沃森生物	8,600	97,868.00	0.10
252	300628	亿联网络	2,660	97,808.20	0.10
253	600460	士兰微	5,300	92,803.00	0.09
254	605117	德业股份	1,244	92,478.96	0.09
255	301269	华大九天	1,200	92,460.00	0.09
256	002007	华兰生物	5,840	92,213.60	0.09
257	601238	广汽集团	11,900	92,106.00	0.09
258	300751	迈为股份	760	90,804.80	0.09
259	601799	星宇股份	800	89,632.00	0.09
260	603260	合盛硅业	1,900	88,749.00	0.09
261	300759	康龙化成	4,775	88,719.50	0.09
262	601319	中国人保	17,100	88,065.00	0.09
263	300496	中科创达	1,925	87,760.75	0.09
264	300999	金龙鱼	3,200	87,520.00	0.09
265	000733	振华科技	2,100	87,213.00	0.09
266	600018	上港集团	15,000	86,700.00	0.09
267	600918	中泰证券	14,900	84,483.00	0.08
268	300413	芒果超媒	4,000	83,600.00	0.08
269	002821	凯莱英	1,260	82,908.00	0.08
270	688009	中国通号	13,800	82,800.00	0.08
271	601865	福莱特	4,100	82,410.00	0.08
272	603806	福斯特	5,594	82,231.80	0.08
273	603659	璞泰来	5,680	80,258.40	0.08
274	600132	重庆啤酒	1,300	78,910.00	0.08
275	603195	公牛集团	1,018	78,508.16	0.08
276	300919	中伟股份	2,520	78,094.80	0.08
277	600061	国投资本	13,776	77,834.40	0.08
278	000617	中油资本	13,500	74,520.00	0.07
279	601059	信达证券	5,200	73,892.00	0.07
280	000708	中信特钢	5,400	73,278.00	0.07
281	688303	大全能源	3,400	69,326.00	0.07
282	688187	时代电气	1,400	69,132.00	0.07
283	002603	以岭药业	4,500	68,985.00	0.07
284	002410	广联达	7,180	68,784.40	0.07
285	002841	视源股份	2,300	67,919.00	0.07
286	300442	润泽科技	2,800	67,060.00	0.07
287	300454	深信服	1,300	65,689.00	0.07
288	603899	晨光股份	2,000	62,560.00	0.06
289	688363	华熙生物	1,100	62,227.00	0.06
290	601808	中海油服	3,200	55,040.00	0.06

291	600732	爱旭股份	5,920	53,576.00	0.05
292	603833	欧派家居	960	51,417.60	0.05
293	601236	红塔证券	7,600	48,792.00	0.05
294	300979	华利集团	800	48,680.00	0.05
295	601698	中国卫通	3,400	47,906.00	0.05
296	300957	贝泰妮	900	43,488.00	0.04
297	688082	盛美上海	500	42,255.00	0.04
298	000800	一汽解放	5,000	39,150.00	0.04
299	603296	华勤技术	500	27,615.00	0.03
300	001289	龙源电力	800	13,800.00	0.01

### 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	688717	艾罗能源	1,439	67,661.78	0.07
2	688584	上海合晶	1,613	26,443.13	0.03
3	603350	安乃达	507	10,423.92	0.01
4	603285	键邦股份	504	9,399.60	0.01
5	688692	达梦数据	35	6,122.55	0.01
6	688691	灿芯股份	121	5,143.71	0.01
7	688530	欧莱新材	270	4,347.00	0.00
8	688709	成都华微	209	3,927.11	0.00
9	688695	中创股份	118	3,722.90	0.00
10	601033	永兴股份	141	2,250.36	0.00
11	603082	北自科技	47	1,386.03	0.00
12	603344	星德胜	58	1,314.28	0.00
13	603325	博隆技术	18	1,225.08	0.00
14	603375	盛景微	29	1,128.10	0.00
15	603381	永臻股份	43	1,080.59	0.00
16	603312	西典新能	39	989.04	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	600900	长江电力	367,630.00	0.31
2	600519	贵州茅台	334,208.00	0.28
3	300750	宁德时代	309,500.00	0.26
4	000333	美的集团	223,991.00	0.19
5	000858	五粮液	196,559.00	0.17
6	601998	中信银行	178,500.00	0.15
7	002371	北方华创	176,373.00	0.15
8	600161	天坛生物	167,003.00	0.14

9	000807	云铝股份	160,728.00	0.14
10	300418	昆仑万维	158,348.00	0.13
11	300760	迈瑞医疗	141,674.00	0.12
12	002594	比亚迪	132,515.00	0.11
13	600027	华电国际	129,766.00	0.11
14	601006	大秦铁路	125,070.00	0.11
15	001965	招商公路	124,740.00	0.11
16	300059	东方财富	124,737.00	0.11
17	300832	新产业	123,858.00	0.11
18	600026	中远海能	121,804.00	0.10
19	600415	小商品城	121,716.00	0.10
20	000651	格力电器	121,302.00	0.10

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	300750	宁德时代	835,020.00	0.71
2	000333	美的集团	591,466.00	0.50
3	000858	五粮液	481,224.00	0.41
4	600519	贵州茅台	336,060.00	0.29
5	002594	比亚迪	331,895.00	0.28
6	300124	汇川技术	322,676.00	0.28
7	000651	格力电器	321,200.00	0.27
8	300760	迈瑞医疗	318,014.00	0.27
9	300059	东方财富	315,485.00	0.27
10	000725	京东方 A	292,305.00	0.25
11	000568	泸州老窖	263,364.00	0.22
12	002475	立讯精密	259,886.00	0.22
13	002142	宁波银行	241,009.00	0.21
14	002415	海康威视	224,628.04	0.19
15	002371	北方华创	219,996.00	0.19
16	002714	牧原股份	200,007.00	0.17
17	300498	温氏股份	190,980.00	0.16
18	000001	平安银行	182,957.00	0.16
19	002352	顺丰控股	177,028.00	0.15
20	300274	阳光电源	169,816.00	0.14

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	9,382,286.67
卖出股票收入（成交）总额	15,057,526.89

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

#### 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在报告编制日前一年内受到处罚如下：

招商银行股份有限公司因违法违规被国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局处罚。

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	384,400.68
2	应收清算款	6,578.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	466,387.91

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688717	艾罗能源	67,661.78	0.07	新股流通受限
2	603350	安乃达	10,423.92	0.01	新股流通受限
3	603285	键邦股份	9,399.60	0.01	新股流通受限
4	688692	达梦数据	6,122.55	0.01	新股流通受限
5	688584	上海合晶	2,574.18	0.00	新股流通受限

### 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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
1,383	16,268.39	11,518,895.00	51.20	10,980,291.00	48.80

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
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	8,149,329.00	36.22

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券股份有限公司	898,723.00	3.99
2	广发证券股份有限公司	804,401.00	3.58
3	中信建投证券股份有限公司	679,013.00	3.02
4	中信证券股份有限公司	635,729.00	2.83
5	张巍	448,400.00	1.99
6	单艳宏	381,600.00	1.70
7	深圳锦洋投资基金管理有限公司-锦洋金谷叁号私募证券投资基金	348,100.00	1.55
8	姜博涵	265,200.00	1.18
9	周晓凌	204,200.00	0.91
10	肖若臻	182,000.00	0.81
11	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	8,149,329.00	36.22

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	0.00	0.0000

**8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2019年12月24日）基金份额总额	362,057,180.00
本报告期期初基金份额总额	26,999,186.00
本报告期基金总申购份额	2,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,499,186.00

**§ 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、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期基金投资策略没有改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	4	17,648,242.88	73.06	4,166.69	53.98	-
长江证券	2	6,507,905.01	26.94	3,552.83	46.02	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为投资组合提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据投资组合投资的特定要求，提供专门研究报告；
- iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- iv 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；
- v 具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理投资组合进行证券交易的要求，并能为基金公司投资提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
- ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

③本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

## 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	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
4	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
5	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
6	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
7	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金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(%)
民生加银沪深 300 交	1	20240101~20240630	8,703,529.00	494,800.00	1,049,000.00	8,149,329.00	36.22

易型开 放式指 数证券 投资基 金联接 基金							
产品特有风险							
<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%，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险和基金净值波动风险；如个别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约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 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) 《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银沪深 300 交易型开放式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。

### 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