

民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银沪深 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	52,199,186.00 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

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，扩位简称为“民生加银 300ETF”。

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	邢颖	秦一楠
	联系电话	010-88566571	010-66060069
	电子邮箱	xingying@msjfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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	张焕南	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	http://www.msjyfund.com.cn
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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	33,665,076.61
本期利润	13,760,621.44
加权平均基金份额本期利润	0.2917
本期加权平均净值利润率	4.97%
本期基金份额净值增长率	5.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	103,568,683.44
期末可供分配基金份额利润	1.9841
期末基金资产净值	313,560,472.62
期末基金份额净值	6.0070
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.32%

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

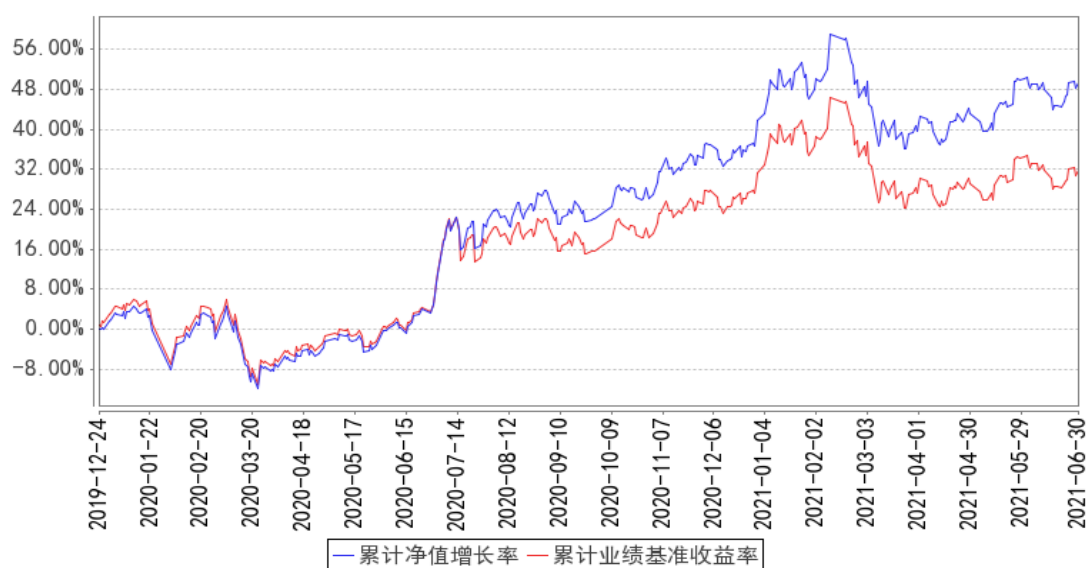
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.53%	0.81%	-2.02%	0.80%	1.49%	0.01%
过去三个月	7.00%	0.97%	3.48%	0.98%	3.52%	-0.01%
过去六个月	5.37%	1.31%	0.24%	1.31%	5.13%	0.00%
过去一年	42.59%	1.31%	25.46%	1.33%	17.13%	-0.02%
自基金合同生效起至今	49.32%	1.36%	31.68%	1.39%	17.64%	-0.03%

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

建仓期结束及本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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”）是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。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。

截至2021年6月30日，民生加银基金管理有限公司管理88只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银和鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫福灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫安纯债债券型证券投资基金、民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫享债券型证券投资基金、民生加银前沿科技灵活配置混合型证券投资基金、民生加银腾元宝货币市场基金、民生加银鑫喜灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫升纯债债券型证券投资基金、民生加银汇鑫一年定期开放债券型证券投资基金、民生加银中证港股通高股息精选指数型证券投资基金、民生加银鑫元纯债债券型

证券投资基金、民生加银智造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、民生加银家盈半年定期宝理财债券型证券投资基金、民生加银鹏程混合型证券投资基金、民生加银恒益纯债债券型证券投资基金、民生加银新兴成长混合型证券投资基金、民生加银创新成长混合型证券投资基金、民生加银睿通 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银兴盈债券型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、民生加银中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、民生加银聚益纯债债券型证券投资基金、民生加银添鑫纯债债券型证券投资基金、民生加银聚鑫三年定期开放债券型证券投资基金、民生加银持续成长混合型证券投资基金、民生加银嘉盈债券型证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、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、民生加银聚享 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、民生加银卓越配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银丰鑫债券型证券投资基金、民生加银龙头优选股票型证券投资基金、民生加银鑫通债券型证券投资基金、民生加银瑞夏一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银品质消费股票型证券投资基金、民生加银睿智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银新动能一年定期开放混合型证券投资基金、民生加银高等级信用债债券型证券投资基金、民生加银家盈 6 个月持有期债券型证券投资基金、民生加银嘉益债券型证券投资基金、民生加银瑞盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银医药健康股票型证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银康宁平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银新兴产业混合型证券投资基金、民生加银康利混合型证券投资基金、民生加银成长优选股票型证券投资基金、民生加银恒泽债券型证券投资基金、民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银质量领先混合型证券投资基金、民生加银汇智 3 个月定期开放债券型证券投资基金、民生加银汇利混合型证券投资基金、民生加银稳健配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银价值发现一年持有期混合型证券投资基金、民生加银瑞利混合型证券投资基金、民生加银润利混合型证券投资基金、民生加银兴利混合型证券投资基金、民生加银内核驱动混合型证券投资基金、民生加银价值优选 6 个月持有期股票型证券投资基金、民生加银周期优选混合型证券投资基金。

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		

武杰	本基金基金经理	2019 年 12 月 24 日	-	9 年	北京大学工程硕士，9 年证券从业经历，2012 年 3 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任高级研究员、基金经理助理，现任基金经理。自 2018 年 11 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、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 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。
何江	本基金基金经理、量化投资部总监	2019 年 12 月 24 日	-	16.0 年	清华大学流体力学硕士，16 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、大类资产配置条线投资决策委员会联席主席、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 2020 年 12 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。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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中的公平交易程序，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 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

上半年 A 股冲高回落后宽幅震荡，结构分化仍是市场的主旋律。上半年市场风格出现较大漂移，春节前大盘成长引领市场，春节后一段时间价值股表现强势，成长价值均衡后小盘股持续走强，创业板相关指数在整个上半年涨幅领先，而上证 50、中证 100 等大盘指数出现一定幅度调整。行业方面，基础化工、钢铁、煤炭、有色石化等周期板块持续走强，非银金融、家电地产等行业则是持续疲软，电力设备新能源、电子和汽车等行业尽管一季度出现较大幅度调整但二季度走强后不断创出年内新高。

本基金是指数基金，以沪深 300 指数为跟踪标的，医药、电力设备新能源、电子等行业对指数上涨贡献较大，金融板块等拖累指数下行。

本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股配股等事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标均控制在合同规定范围之内。

报告期内本基金积极参与 A 股打新，在保证流动性的基础上使基金收益得以增强。

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 6.0070 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.37%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历春节前后的调整后，成长和估值的匹配度将是未来一段时间决定市场走势的核心因素，成长和估值的匹配度是一个动态的过程，具体表现为分化轮动将成为市场的常态；缺乏明显大机会的背景下，公募等机构资金的行为对市场的影响也将更为突出。而从上述两个角度出发，沪深 300 指数的配置优势仍将存在，我们继续看好沪深 300 指数未来一段的表现。

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、固定收益部、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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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合规守信、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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	5,163,285.20	3,932,002.40
结算备付金		1,140,880.30	208,264.16
存出保证金		445,199.99	109,577.25
交易性金融资产	6.4.7.2	306,482,236.93	282,790,613.00
其中：股票投资		306,482,236.93	282,790,613.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		526,482.51	4,840,424.41
应收利息	6.4.7.5	1,621.65	1,180.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		313,835,322.82	291,882,061.85
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,891,511.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		38,234.90	33,264.25
应付托管费		12,744.95	11,088.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	59,938.62	39,857.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	163,931.73	601,475.00
负债合计		274,850.20	4,577,196.11
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	209,991,789.18	202,750,580.08
未分配利润	6.4.7.10	103,568,683.44	84,554,285.66
所有者权益合计		313,560,472.62	287,304,865.74
负债和所有者权益总计		313,835,322.82	291,882,061.85

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 6.0070 元，基金份额总额 52,199,186.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		14,564,322.55	22,283,401.05
1. 利息收入		22,962.43	21,791.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,962.43	21,791.08
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		-	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,407,555.09	10,238,276.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,758,011.98	7,142,480.74
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-405,000.00	-
股利收益	6.4.7.16	2,054,543.11	3,095,795.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-19,904,455.17	11,638,917.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	38,260.20	384,416.33
减：二、费用		803,701.11	853,964.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	205,920.23	231,143.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,640.02	77,047.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	249,668.64	319,758.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	279,472.22	226,014.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,760,621.44	21,429,436.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,760,621.44	21,429,436.08

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	202,750,580.08	84,554,285.66	287,304,865.74
二、本期经营活	-	13,760,621.44	13,760,621.44

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	7,241,209.10	5,253,776.34	12,494,985.44
其中：1. 基金申购款	108,618,136.48	51,826,895.53	160,445,032.01
2. 基金赎回款	-101,376,927.38	-46,573,119.19	-147,950,046.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	209,991,789.18	103,568,683.44	313,560,472.62
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	362,057,180.00	6,974,140.20	369,031,320.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,429,436.08	21,429,436.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-94,135,718.13	-15,762,555.58	-109,898,273.71
其中：1. 基金申购款	333,095,618.40	-13,688,261.57	319,407,356.83
2. 基金赎回款	-427,231,336.53	-2,074,294.01	-429,305,630.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	267,921,461.87	12,641,020.70	280,562,482.57
---------------------	----------------	---------------	----------------

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：

李操纲

朱永明

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（“中国证监会”）《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》（证监许可[2019]1599 号文）核准，由民生加银基金管理有限公司依照国家相关法律法规的规定、《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》、《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》及《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》的规定发售，基金合同于 2019 年 12 月 24 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 362,057,180.00 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”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

根据《民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》，经上海证券交易所自律监管决定书[2020]26 号文审核同意，本基金 89,999,186.00 份基金份额于 2020 年 2 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《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》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板、及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购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的相关规定）。本基金可根据法律法规规定参与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。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如

法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为标的指数收益率。

民生加银基金公司以本基金为目标 ETF，于 2019 年 12 月 26 日募集成立了民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“民生加银沪深 300ETF 联接基金”）。民生加银沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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的要求，同时按照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》及中国证监会颁布的《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>》进行了信息披露。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况、2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

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 [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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局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》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 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费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,163,285.20
定期存款	—
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	—
合计	5,163,285.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	288,340,074.15	306,482,236.93	18,142,162.78
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	288,340,074.15	306,482,236.93	18,142,162.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	2,905,980.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,905,980.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,905,980.00	-	-	

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期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

6.4.7.4 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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,108.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	480.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.00
合计	1,621.65

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	59,938.62
银行间市场应付交易费用	-
合计	59,938.62

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
应付指数使用费	35,000.00
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
预提 IOPV 服务费	49,588.57
合计	163,931.73

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,399,186.00	202,750,580.08
本期申购	27,000,000.00	108,618,136.48
本期赎回（以“-”号填列）	-25,200,000.00	-101,376,927.38
- 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	52,199,186.00	209,991,789.18

6.4.7.10 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	73,474,666.10	11,079,619.56	84,554,285.66
本期利润	33,665,076.61	-19,904,455.17	13,760,621.44
本期基金份额交易产生的变动数	5,754,793.16	-501,016.82	5,253,776.34
其中：基金申购款	50,679,336.30	1,147,559.23	51,826,895.53
基金赎回款	-44,924,543.14	-1,648,576.05	-46,573,119.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,894,535.87	-9,325,852.43	103,568,683.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	16,252.05
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	6,119.71
其他	590.67
合计	22,962.43

注：其他是结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	23,803,630.17
股票投资收益——赎回差价收入	8,954,381.81
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	32,758,011.98

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	117,470,779.38
减：卖出股票成本总额	93,667,149.21
买卖股票差价收入	23,803,630.17

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	147,950,046.57
减：现金支付赎回款总额	58,246,039.57
减：赎回股票成本总额	80,749,625.19
赎回差价收入	8,954,381.81

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-405,000.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,054,543.11
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,054,543.11

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-20,098,315.17
股票投资	-20,098,315.17
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	193,860.00
权证投资	-
期货投资	193,860.00
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	-19,904,455.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	38,260.20
合计	38,260.20

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购（或赎回）本基金时，买入（或卖出）被替代股票的实际成本与确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	249,668.64
银行间市场交易费用	-
合计	249,668.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	6,156.73
指数使用费	70,000.00
登记结算费	74,383.76
IOPV 服务费	49,588.57
合计	279,472.22

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 年费率计提，逐日累计，按季支付。如日均基金资产净值大于 5000 万元时，指数许可使用费的收取下限金额为每季度 35,000 元；如日均基金资产净值小于 5000 万元时，指数许可使用费不设下限。

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，本基金无需要披露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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
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：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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

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：本基金本报告期末及上年度末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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	205,920.23	231,143.80
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	68,640.02	77,047.99

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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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：本基金于本期及上年度可比期间均未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：本基金于本期及上年度可比期间均不存在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：本基金于本期及上年度可比期间均不存在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：基金管理人于本期及上年度可比期间均无运用固有资金投资本基金的情况。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	3,855,129.00	7.39	8,275,529.00	16.42

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	5,163,285.20	16,252.05	1,827,170.62	13,860.31

注：本基金通过“农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 370,679.28 元（2020 年 12 月 31

日：人民币 208,264.16 元）。

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：本基金于本期及上年度可比期间均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

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

		日	日							
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 08 月 25 日	新股流 通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流 通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同	2021 年	2021 年	新股流	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

	药业	3 月 31 日	10 月 11 日	通受限						
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	28.28	115.71	249	7,041.72	28,811.79	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	33.22	87.50	273	9,069.06	23,887.50	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	224	5,577.60	5,557.44	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流 通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流 通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流 通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股流 通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流 通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688359	三孚新科	2021 年 5 月 14	2021 年 11 月	新股流 通受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-

		日	22 日							
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 01 月 03 日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688606	奥泰生物	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	133.67	139.31	1,216	162,542.72	169,400.96	-
688656	浩欧博	2021 年 1 月 6 日	2021 年 7 月 13 日	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	新股流通受限	5.44	7.26	12,263	66,710.72	89,029.38	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 07 月 02 日	新股流通受限	24.60	163.00	278	6,838.80	45,314.00	-

注：①根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

②上述流通受限证券的“可流通日”是根据证券上市公告书估算的流通日期，最终可流通日期以证券解禁上市流通的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项停牌	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	52,800	433,884.49	295,152.00	-

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：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2021 年 06 月 30 日，本基金无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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无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均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均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均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均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：本基金于本报告期末及上年度末均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，另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。

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，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。

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。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）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 2021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							
银行存款	5,163,285.2	-	-	-	-	-	5,163,285.

	0						20
结算备付金	1,140,880.30	-	-	-	-	-	1,140,880.30
存出保证金	445,199.99	-	-	-	-	-	445,199.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	306,482,236.93	306,482,236.93
应收利息	-	-	-	-	-	1,621.65	1,621.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	526,482.51	526,482.51
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	6,749,365.49	-	-	-	-	307,085,957.33	313,835,322.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,234.90	38,234.90
应付托管费	-	-	-	-	-	12,744.95	12,744.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	59,938.62	59,938.62
其他负债	-	-	-	-	-	163,931.73	163,931.73
负债总计	-	-	-	-	-	274,850.20	274,850.20
利率敏感度缺口	6,749,365.49	-	-	-	-	306,811,107.13	313,560,472.62
上年度末 2020 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							
银行存款	3,932,002.40	-	-	-	-	-	3,932,002.40
结算备付金	208,264.16	-	-	-	-	-	208,264.16
存出保证金	109,577.25	-	-	-	-	-	109,577.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	282,790,613.00	282,790,613.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,180.63	1,180.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,840,424.41	4,840,424.41
资产总计	4,249,843.81	-	-	-	-	287,632,218.04	291,882,061.85
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,264.25	33,264.25
应付托管费	-	-	-	-	-	11,088.07	11,088.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,891,511.60	3,891,511.60

应付交易费用	-	-	-	-	-	39,857.19	39,857.19
其他负债	-	-	-	-	-	601,475.00	601,475.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,577,196.11	4,577,196.11
利率敏感度缺口	4,249,843.81	-	-	-	-	283,055,021.93	287,304,865.74

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

于 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	306,482,236.93	97.74	282,790,613.00	98.43
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	306,482,236.93	97.74	282,790,613.00	98.43

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。		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	15,554,333.74	13,350,650.43
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-15,554,333.74	-13,350,650.43

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 305,036,845.25 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 277,446,348.90 元），划分为第二层次的余额为人民币 1,445,391.68 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 5,344,264.10 元），无划分为第三层次余额（2020 年 12 月 31 日：无）。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售

期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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 (2020 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.2 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 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	306,482,236.93	97.66
	其中：股票	306,482,236.93	97.66
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	6,304,165.50	2.01
8	其他各项资产	1,048,920.39	0.33
9	合计	313,835,322.82	100.00

注：上表中股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 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	3,196,705.76	1.02
B	采矿业	6,450,020.60	2.06
C	制造业	168,896,383.78	53.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,383,393.00	1.72
E	建筑业	3,692,750.00	1.18

F	批发和零售业	2,189,399.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	8,924,736.20	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,989,937.04	3.19
J	金融业	71,989,683.87	22.96
K	房地产业	6,283,814.80	2.00
L	租赁和商务服务业	5,553,719.00	1.77
M	科学研究和技术服务业	4,358,866.76	1.39
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	553,585.00	0.18
Q	卫生和社会工作	6,501,265.66	2.07
R	文化、体育和娱乐业	1,269,390.94	0.40
S	综合	-	-
	合计	305,233,651.41	97.34

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,091,093.46	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	26,888.58	0.01
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	42,333.89	0.01
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	44,438.33	0.01

0	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	1,248,585.52	0.40

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	9,000	18,510,300.00	5.90
2	601318	中国平安	154,670	9,942,187.60	3.17
3	600036	招商银行	176,700	9,575,373.00	3.05
4	000858	五粮液	27,700	8,251,553.00	2.63
5	601012	隆基股份	61,780	5,488,535.20	1.75
6	000333	美的集团	70,344	5,020,451.28	1.60
7	600276	恒瑞医药	63,878	4,341,787.66	1.38
8	002415	海康威视	66,608	4,296,216.00	1.37
9	601166	兴业银行	207,500	4,264,125.00	1.36
10	601888	中国中免	13,900	4,171,390.00	1.33
11	603259	药明康德	25,564	4,003,066.76	1.28
12	300059	东方财富	118,136	3,873,679.44	1.24
13	000651	格力电器	68,696	3,579,061.60	1.14
14	600900	长江电力	162,200	3,347,808.00	1.07
15	002594	比亚迪	12,900	3,237,900.00	1.03
16	002475	立讯精密	69,778	3,209,788.00	1.02
17	600887	伊利股份	86,900	3,200,527.00	1.02
18	000001	平安银行	138,386	3,130,291.32	1.00
19	600030	中信证券	121,600	3,032,704.00	0.97
20	000725	京东方A	483,400	3,016,416.00	0.96
21	300015	爱尔眼科	38,617	2,741,034.66	0.87
22	601398	工商银行	500,200	2,586,034.00	0.82
23	000568	泸州老窖	10,500	2,477,370.00	0.79
24	600031	三一重工	84,800	2,465,136.00	0.79
25	600309	万华化学	22,400	2,437,568.00	0.78
26	603501	韦尔股份	7,400	2,382,800.00	0.76

27	603288	海天味业	18,064	2,329,352.80	0.74
28	000002	万 科A	97,100	2,311,951.00	0.74
29	002714	牧原股份	37,538	2,283,061.16	0.73
30	600809	山西汾酒	5,000	2,240,000.00	0.71
31	300122	智飞生物	11,400	2,128,722.00	0.68
32	601919	中远海控	69,100	2,110,314.00	0.67
33	002142	宁波银行	51,373	2,002,005.81	0.64
34	600436	片仔癀	4,351	1,950,553.30	0.62
35	601328	交通银行	391,600	1,918,840.00	0.61
36	601899	紫金矿业	197,300	1,911,837.00	0.61
37	002304	洋河股份	8,600	1,781,920.00	0.57
38	002812	恩捷股份	7,600	1,779,160.00	0.57
39	002352	顺丰控股	26,000	1,760,200.00	0.56
40	002230	科大讯飞	25,350	1,713,153.00	0.55
41	300014	亿纬锂能	16,200	1,683,666.00	0.54
42	300274	阳光电源	14,600	1,679,876.00	0.54
43	600000	浦发银行	167,800	1,678,000.00	0.54
44	600438	通威股份	38,600	1,670,222.00	0.53
45	300124	汇川技术	22,050	1,637,433.00	0.52
46	600837	海通证券	137,800	1,584,700.00	0.51
47	000661	长春高新	4,000	1,548,000.00	0.49
48	000100	TCL 科技	200,300	1,532,295.00	0.49
49	601816	京沪高铁	280,500	1,483,845.00	0.47
50	000063	中兴通讯	44,100	1,465,443.00	0.47
51	002241	歌尔股份	34,100	1,457,434.00	0.46
52	300347	泰格医药	7,500	1,449,750.00	0.46
53	603986	兆易创新	7,612	1,430,294.80	0.46
54	601601	中国太保	48,800	1,413,736.00	0.45
55	600585	海螺水泥	34,300	1,408,015.00	0.45
56	600690	海尔智家	54,100	1,401,731.00	0.45
57	002271	东方雨虹	25,250	1,396,830.00	0.45
58	002460	赣锋锂业	11,500	1,392,535.00	0.44
59	601668	中国建筑	299,200	1,391,280.00	0.44
60	002027	分众传媒	146,900	1,382,329.00	0.44
61	603799	华友钴业	12,100	1,381,820.00	0.44
62	300142	沃森生物	22,300	1,375,910.00	0.44
63	600016	民生银行	299,900	1,322,559.00	0.42
64	600763	通策医疗	3,200	1,315,200.00	0.42
65	601288	农业银行	409,700	1,241,391.00	0.40
66	600196	复星医药	17,200	1,240,636.00	0.40
67	600048	保利地产	102,700	1,236,508.00	0.39
68	600703	三安光电	38,400	1,230,720.00	0.39

69	000338	潍柴动力	67,700	1,209,799.00	0.39
70	600919	江苏银行	168,650	1,197,415.00	0.38
71	002129	中环股份	30,300	1,169,580.00	0.37
72	601229	上海银行	142,100	1,165,220.00	0.37
73	601688	华泰证券	73,500	1,161,300.00	0.37
74	600050	中国联通	266,100	1,149,552.00	0.37
75	600660	福耀玻璃	20,000	1,117,000.00	0.36
76	600570	恒生电子	11,888	1,108,556.00	0.35
77	601211	国泰君安	64,400	1,103,816.00	0.35
78	600104	上汽集团	50,100	1,100,697.00	0.35
79	601766	中国中车	173,400	1,054,272.00	0.34
80	601169	北京银行	211,800	1,031,466.00	0.33
81	688111	金山办公	2,600	1,026,480.00	0.33
82	600999	招商证券	52,870	1,005,587.40	0.32
83	002311	海大集团	11,900	971,040.00	0.31
84	002371	北方华创	3,500	970,830.00	0.31
85	600019	宝钢股份	126,800	968,752.00	0.31
86	002049	紫光国微	6,100	940,559.00	0.30
87	601988	中国银行	300,500	925,540.00	0.30
88	600406	国电南瑞	39,640	921,233.60	0.29
89	002410	广联达	13,500	920,700.00	0.29
90	601088	中国神华	47,100	919,392.00	0.29
91	300498	温氏股份	63,580	913,644.60	0.29
92	601818	光大银行	236,092	892,427.76	0.28
93	300601	康泰生物	5,900	879,100.00	0.28
94	600745	闻泰科技	8,900	862,410.00	0.28
95	000625	长安汽车	32,400	851,472.00	0.27
96	000538	云南白药	7,300	844,756.00	0.27
97	600028	中国石化	191,000	832,760.00	0.27
98	600893	航发动力	15,300	813,807.00	0.26
99	601628	中国人寿	23,800	806,582.00	0.26
100	300450	先导智能	13,400	805,876.00	0.26
101	600346	恒力石化	30,100	789,824.00	0.25
102	002821	凯莱英	2,100	782,460.00	0.25
103	601658	邮储银行	155,100	778,602.00	0.25
104	600588	用友网络	23,330	775,955.80	0.25
105	601390	中国中铁	145,700	763,468.00	0.24
106	601633	长城汽车	17,400	758,466.00	0.24
107	300595	欧普康视	7,300	755,915.00	0.24
108	601009	南京银行	71,800	755,336.00	0.24
109	002493	荣盛石化	43,350	748,654.50	0.24
110	601377	兴业证券	76,600	739,956.00	0.24

111	601857	中国石油	138,600	733,194.00	0.23
112	688036	传音控股	3,400	712,300.00	0.23
113	300413	芒果超媒	10,100	692,860.00	0.22
114	601225	陕西煤业	57,200	677,820.00	0.22
115	600132	重庆啤酒	3,400	673,030.00	0.21
116	600584	长电科技	17,700	666,936.00	0.21
117	002601	龙佰集团	19,100	660,478.00	0.21
118	600009	上海机场	13,700	659,381.00	0.21
119	300408	三环集团	15,517	658,231.14	0.21
120	600426	华鲁恒升	21,100	653,045.00	0.21
121	601100	恒立液压	7,504	644,743.68	0.21
122	600111	北方稀土	31,100	643,770.00	0.21
123	603882	金域医学	4,000	639,080.00	0.20
124	000776	广发证券	42,200	638,908.00	0.20
125	601939	建设银行	95,970	638,200.50	0.20
126	002001	新 和 成	22,000	630,960.00	0.20
127	688012	中微公司	3,800	630,496.00	0.20
128	000895	双汇发展	19,718	627,032.40	0.20
129	300433	蓝思科技	21,300	626,433.00	0.20
130	002179	中航光电	7,900	624,258.00	0.20
131	600926	杭州银行	42,300	623,925.00	0.20
132	002050	三花智控	25,570	613,168.60	0.20
133	000166	申万宏源	128,600	601,848.00	0.19
134	002841	视源股份	4,800	596,592.00	0.19
135	600958	东方证券	59,600	595,404.00	0.19
136	600741	华域汽车	22,525	591,731.75	0.19
137	600600	青岛啤酒	5,100	589,815.00	0.19
138	300003	乐普医疗	18,100	581,372.00	0.19
139	000963	华东医药	12,500	575,125.00	0.18
140	002007	华兰生物	15,640	573,675.20	0.18
141	000786	北新建材	14,500	569,125.00	0.18
142	000157	中联重科	60,800	561,792.00	0.18
143	603806	福斯特	5,300	557,189.00	0.18
144	601006	大秦铁路	84,600	556,668.00	0.18
145	002607	中公教育	26,500	553,585.00	0.18
146	601901	方正证券	58,900	551,304.00	0.18
147	601336	新华保险	11,900	546,329.00	0.17
148	600029	南方航空	90,600	545,412.00	0.17
149	600015	华夏银行	88,100	545,339.00	0.17
150	002236	大华股份	25,639	540,982.90	0.17
151	600143	金发科技	25,800	538,188.00	0.17
152	601989	中国重工	130,300	536,836.00	0.17

153	601155	新城控股	12,900	536,640.00	0.17
154	600176	中国巨石	34,418	533,823.18	0.17
155	601138	工业富联	42,700	529,907.00	0.17
156	000768	中航西飞	19,800	520,344.00	0.17
157	603993	洛阳钼业	100,800	520,128.00	0.17
158	601877	正泰电器	15,401	514,085.38	0.16
159	600352	浙江龙盛	37,200	511,128.00	0.16
160	600010	宝钢股份	326,800	506,540.00	0.16
161	688169	石头科技	400	504,400.00	0.16
162	600760	中航沈飞	8,360	504,108.00	0.16
163	300529	健帆生物	5,800	500,888.00	0.16
164	601788	光大证券	27,900	499,131.00	0.16
165	001979	招商蛇口	45,400	497,130.00	0.16
166	601600	中国铝业	93,700	496,610.00	0.16
167	600547	山东黄金	25,780	495,491.60	0.16
168	002008	大族激光	12,200	492,758.00	0.16
169	601186	中国铁建	65,700	488,151.00	0.16
170	603369	今世缘	9,000	487,440.00	0.16
171	002202	金风科技	39,700	482,752.00	0.15
172	601916	浙商银行	119,700	475,209.00	0.15
173	000876	新希望	32,100	470,907.00	0.15
174	002555	三七互娱	19,147	459,910.94	0.15
175	601799	星宇股份	2,000	451,440.00	0.14
176	003816	中国广核	168,600	450,162.00	0.14
177	603899	晨光文具	5,300	448,168.00	0.14
178	000938	紫光股份	20,300	444,164.00	0.14
179	002736	国信证券	41,100	441,825.00	0.14
180	000069	华侨城A	58,600	435,984.00	0.14
181	600109	国金证券	34,300	435,267.00	0.14
182	601066	中信建投	13,800	433,734.00	0.14
183	600989	宝丰能源	31,300	428,184.00	0.14
184	603160	汇顶科技	3,300	427,779.00	0.14
185	000425	徐工机械	67,000	426,790.00	0.14
186	300136	信维通信	13,800	426,144.00	0.14
187	600150	中国船舶	25,500	421,005.00	0.13
188	601669	中国电建	108,500	419,895.00	0.13
189	603659	璞泰来	3,000	409,800.00	0.13
190	000977	浪潮信息	14,500	407,885.00	0.13
191	600795	国电电力	167,400	406,782.00	0.13
192	002384	东山精密	19,500	406,380.00	0.13
193	000783	长江证券	55,200	404,064.00	0.13
194	601238	广汽集团	31,100	402,745.00	0.13

195	603019	中科曙光	14,520	400,897.20	0.13
196	600085	同仁堂	9,800	400,330.00	0.13
197	688008	澜起科技	6,400	399,232.00	0.13
198	002624	完美世界	16,490	394,275.90	0.13
199	600079	人福医药	13,900	392,953.00	0.13
200	601838	成都银行	31,000	391,840.00	0.12
201	300677	英科医疗	3,100	386,880.00	0.12
202	600183	生益科技	16,400	383,924.00	0.12
203	600886	国投电力	39,900	383,439.00	0.12
204	000596	古井贡酒	1,600	383,200.00	0.12
205	300558	贝达药业	3,500	378,840.00	0.12
206	601985	中国核电	74,800	378,488.00	0.12
207	000703	恒逸石化	31,640	378,098.00	0.12
208	601108	财通证券	35,900	376,591.00	0.12
209	300144	宋城演艺	22,300	374,640.00	0.12
210	601360	三六零	30,600	373,626.00	0.12
211	603517	绝味食品	4,400	370,876.00	0.12
212	002600	领益智造	40,300	370,357.00	0.12
213	601555	东吴证券	44,170	368,377.80	0.12
214	002414	高德红外	13,320	367,365.60	0.12
215	000066	中国长城	25,000	365,000.00	0.12
216	603833	欧派家居	2,560	363,417.60	0.12
217	002252	上海莱士	47,800	358,022.00	0.11
218	002044	美年健康	39,100	356,201.00	0.11
219	300676	华大基因	3,000	355,800.00	0.11
220	002938	鹏鼎控股	9,900	355,212.00	0.11
221	601077	渝农商行	87,900	350,721.00	0.11
222	600522	中天科技	35,000	350,000.00	0.11
223	300033	同花顺	3,080	347,362.40	0.11
224	000728	国元证券	43,520	346,854.40	0.11
225	601607	上海医药	16,300	344,419.00	0.11
226	002602	世纪华通	53,020	340,388.40	0.11
227	688396	华润微	3,700	336,774.00	0.11
228	600161	天坛生物	9,800	335,650.00	0.11
229	600332	白云山	9,900	335,115.00	0.11
230	600872	中炬高新	7,940	333,638.80	0.11
231	601111	中国国航	42,700	332,206.00	0.11
232	600362	江西铜业	14,800	331,224.00	0.11
233	600383	金地集团	32,000	327,680.00	0.10
234	300628	亿联网络	3,900	326,820.00	0.10
235	601800	中国交建	50,400	326,592.00	0.10
236	600845	宝信软件	6,370	324,233.00	0.10

237	600115	中国东航	63,800	324,104.00	0.10
238	002508	老板电器	6,800	316,200.00	0.10
239	000860	顺鑫农业	7,400	312,132.00	0.10
240	002916	深南电路	2,800	311,164.00	0.10
241	600061	国投资本	36,576	310,530.24	0.10
242	601727	上海电气	73,200	310,368.00	0.10
243	601618	中国中冶	101,800	303,364.00	0.10
244	601162	天风证券	61,920	300,931.20	0.10
245	000708	中信特钢	14,300	298,012.00	0.10
246	601021	春秋航空	5,200	295,880.00	0.09
247	600705	中航产融	76,300	295,281.00	0.09
248	002024	苏宁易购	52,800	295,152.00	0.09
249	601878	浙商证券	22,200	290,376.00	0.09
250	603939	益丰药房	5,100	286,059.00	0.09
251	600606	绿地控股	52,000	283,400.00	0.09
252	688363	华熙生物	1,000	277,860.00	0.09
253	601990	南京证券	26,300	276,676.00	0.09
254	002456	欧菲光	30,800	273,504.00	0.09
255	002157	正邦科技	22,600	270,070.00	0.09
256	002463	沪电股份	17,300	267,631.00	0.09
257	600011	华能国际	62,800	265,016.00	0.08
258	000656	金科股份	45,500	263,445.00	0.08
259	603392	万泰生物	1,000	259,180.00	0.08
260	600521	华海药业	12,400	258,912.00	0.08
261	601933	永辉超市	54,700	258,731.00	0.08
262	600655	豫园股份	22,100	256,139.00	0.08
263	600118	中国卫星	8,500	248,710.00	0.08
264	601216	君正集团	48,700	247,883.00	0.08
265	601696	中银证券	11,900	245,021.00	0.08
266	600848	上海临港	13,660	244,514.00	0.08
267	600489	中金黄金	27,700	238,774.00	0.08
268	600018	上港集团	49,500	236,115.00	0.08
269	002558	巨人网络	17,300	230,090.00	0.07
270	601995	中金公司	3,700	227,550.00	0.07
271	601998	中信银行	44,000	224,400.00	0.07
272	002120	韵达股份	16,500	223,245.00	0.07
273	603195	公牛集团	1,100	222,200.00	0.07
274	601872	招商轮船	46,360	214,183.20	0.07
275	601319	中国人保	35,800	212,294.00	0.07
276	002673	西部证券	25,700	212,025.00	0.07
277	688009	中国通号	36,969	210,353.61	0.07
278	688126	沪硅产业	7,100	207,178.00	0.07

279	603338	浙江鼎力	3,500	205,415.00	0.07
280	002739	万达电影	12,786	201,890.94	0.06
281	601881	中国银河	18,500	199,430.00	0.06
282	603658	安图生物	2,480	187,909.60	0.06
283	600233	圆通速递	18,300	183,183.00	0.06
284	603233	大参林	3,400	173,774.00	0.06
285	600482	中国动力	9,400	163,748.00	0.05
286	601231	环旭电子	9,500	159,695.00	0.05
287	600025	华能水电	26,200	151,698.00	0.05
288	002153	石基信息	6,440	151,404.40	0.05
289	002032	苏泊尔	2,300	146,717.00	0.05
290	600340	华夏幸福	27,970	146,562.80	0.05
291	002939	长城证券	13,100	145,803.00	0.05
292	000800	一汽解放	13,100	141,742.00	0.05
293	601236	红塔证券	10,300	139,668.00	0.04
294	601808	中海油服	8,400	120,624.00	0.04
295	002773	康弘药业	5,200	120,276.00	0.04
296	600918	中泰证券	10,600	114,692.00	0.04
297	601698	中国卫通	6,200	100,378.00	0.03
298	603087	甘李药业	900	95,922.00	0.03
299	600299	安迪苏	5,700	68,172.00	0.02
300	002945	华林证券	3,900	53,898.00	0.02

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	688606	奥泰生物	1,216	169,400.96	0.05
2	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.03
3	688660	电气风电	12,263	89,029.38	0.03
4	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
5	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.02
6	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
7	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
8	300919	中伟股份	278	45,314.00	0.01
9	300973	立高食品	249	28,811.79	0.01
10	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
11	300979	华利集团	273	23,887.50	0.01
12	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
13	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
14	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
15	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
16	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01

17	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
18	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
19	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
20	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
21	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
22	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
23	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
24	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
25	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
26	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
27	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
28	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
29	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
30	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
31	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
32	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
33	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
34	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
35	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
36	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
37	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
38	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
39	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
43	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
44	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
45	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
46	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
47	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
48	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
49	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
50	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
51	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
52	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
53	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
54	300985	致远新能	224	5,557.44	0.00
55	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
56	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
57	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
58	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
59	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

60	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
61	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
62	301012	扬电科技	170	4,124.20	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	000858	五 粮 液	5,394,766.67	1.88
2	600519	贵州茅台	4,817,548.00	1.68
3	000333	美的集团	4,071,535.00	1.42
4	000651	格力电器	2,713,446.00	0.94
5	002415	海康威视	2,685,121.00	0.93
6	300059	东方财富	2,260,423.80	0.79
7	000001	平安银行	2,081,657.00	0.72
8	000725	京东方 A	2,037,273.00	0.71
9	002475	立讯精密	1,944,985.00	0.68
10	000568	泸州老窖	1,828,809.00	0.64
11	000002	万 科 A	1,823,644.00	0.63
12	002714	牧原股份	1,697,141.00	0.59
13	000661	长春高新	1,673,439.00	0.58
14	300122	智飞生物	1,579,139.00	0.55
15	002594	比亚迪	1,512,806.00	0.53
16	300015	爱尔眼科	1,498,844.00	0.52
17	002304	洋河股份	1,474,648.00	0.51
18	300274	阳光电源	1,446,807.00	0.50
19	002352	顺丰控股	1,414,125.00	0.49
20	000963	华东医药	1,364,447.00	0.47

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	000858	五 粮 液	5,210,705.00	1.81
2	688981	中芯国际	4,237,617.33	1.47
3	000333	美的集团	4,024,342.01	1.40
4	000651	格力电器	2,737,127.00	0.95
5	300059	东方财富	2,094,645.00	0.73
6	000001	平安银行	1,971,451.00	0.69
7	000002	万 科 A	1,837,275.00	0.64
8	002415	海康威视	1,770,392.00	0.62
9	000568	泸州老窖	1,744,105.00	0.61

10	002714	牧原股份	1,722,757.00	0.60
11	000661	长春高新	1,677,032.00	0.58
12	002594	比亚迪	1,605,332.00	0.56
13	002352	顺丰控股	1,521,977.00	0.53
14	002475	立讯精密	1,484,539.00	0.52
15	000725	京东方 A	1,404,388.00	0.49
16	002304	洋河股份	1,381,353.00	0.48
17	000963	华东医药	1,302,931.20	0.45
18	000100	TCL 科技	1,175,283.00	0.41
19	300122	智飞生物	1,102,217.00	0.38
20	601318	中国平安	996,751.00	0.35

注：“本期累计卖出金额”均按卖出成交金额（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	126,033,568.56
卖出股票收入（成交）总额	117,470,779.38

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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF2109	IF2109	2	3,099,840.00	193,860.00	-
公允价值变动总额合计（元）					193,860.00

股指期货投资本期收益（元）	-405,000.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	193,860.00

7.10.2 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 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。

7.11.3 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。

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

招商银行因违法违规被银保监会处罚（银保监罚决字(2021)16号，作出处罚决定日期：2021年5月17日）。

兴业银行因违法违规被中国人民银行福州中心支行处罚（福银罚字(2020)35号，作出处罚决定日期：2020年9月4日）。

兴业银行因违法违规被银保监会福建监管局处罚（闽银保监罚决字(2020)24号，作出处罚决定日期：2020年8月31日）。

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

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。

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	445,199.99
2	应收证券清算款	526,482.51
3	应收股利	—
4	应收利息	1,621.65
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	75,616.24
8	其他	—
9	合计	1,048,920.39

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不存在流通受限的情况。

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	688606	奥泰生物	169,400.96	0.05	新股锁定
2	688656	浩欧博	99,534.60	0.03	新股锁定
3	688660	电气风电	89,029.38	0.03	新股锁定
4	688499	利元亨	83,488.65	0.03	新股未上市
5	688113	联测科技	69,745.35	0.02	新股锁定

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 (%)
661	78,970.02	37,006,659.00	70.90	15,192,527.00	29.10

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	3,855,129.00	7.39

放式指数证券投资基金联接基金		
----------------	--	--

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	华西证券股份有限公司	8,336,771.00	15.97
2	浙商证券股份有限公司	6,548,400.00	12.55
3	闫鹏	5,500,000.00	10.54
4	北京磐沣投资管理合伙企业(有限合伙)-磐沣固收增强私募证券投资基金	4,071,500.00	7.80
5	国金证券-工商银行-国金金创鑫 1 号集合资产管理计划	4,051,200.00	7.76
6	嘉兴灏象投资管理合伙企业(有限合伙)-嘉兴灏象量化 CTA 一号私募证券投资基金	2,207,800.00	4.23
7	辽宁金樟资本管理有限公司-金樟混合动力 2 号私募证券投资基金	1,833,500.00	3.51
8	广发证券股份有限公司	1,612,365.00	3.09
9	华泰证券股份有限公司	1,127,428.00	2.16
10	李林晖	968,100.00	1.85
11	中国农业银行股份有限公司-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	3,855,129.00	7.39

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

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、基金投资和研究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）	362,057,180.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	50,399,186.00
本报告期基金总申购份额	27,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	52,199,186.00

§ 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略中增加了存托凭证投资策略。

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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚的情况。

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	236,578,684.61	100.00%	90,479.24	100.00%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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，能及时为基金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，并能根据基金投资的特定要求，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，并能满足基金运作高度保密的要求；

v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商评价表》

ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案；

iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见；

iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议；

v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计；

vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续；

vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试；

viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息；

ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金本报告期内新增天风证券交易单元两个。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 15 日
2	民生加银基金管理有限公司关于暂停使用招商银行卡办理网上直销部分业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 20 日
3	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第四季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 21 日
4	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第四季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 1 月 21 日
5	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
6	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 3 月 30 日
7	民生加银基金管理有限公司旗下 7 只公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号指数基金指引》修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日

8	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	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 3 月 31 日
9	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 1 号)	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 6 日
10	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要(更新)	公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 6 日
11	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
12	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第一季度报告	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 4 月 21 日
13	民生加银基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份资料信息的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 30 日
14	关于民生加银基金管理有限公司旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、证监会基金电子披露网站、深圳证券交易所网站、上海证券交易所网站	2021 年 6 月 30 日
15	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	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 6 月 30 日
16	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	公司网站、证监会基金电子披露网站、上海证券交易所网站	2021 年 6 月 30 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	20210406~2021	8,558,671.00	9,758,671.00	9,980,571.00	8,336,771.00	15.97

		10518				
产品特有风险						
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，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。						

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募集注册的文件；
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、基金托管人的住所或基金管理人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

2021 年 8 月 30 日