

民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
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	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 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	23,399,186.00 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	010-68960037
	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	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.msjfund.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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,933,041.07
本期利润	1,624,999.69
加权平均基金份额本期利润	0.0622
本期加权平均净值利润率	1.25%
本期基金份额净值增长率	0.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	18,089,096.28
期末可供分配基金份额利润	0.7731
期末基金资产净值	112,221,539.91
期末基金份额净值	4.7960
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.22%

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

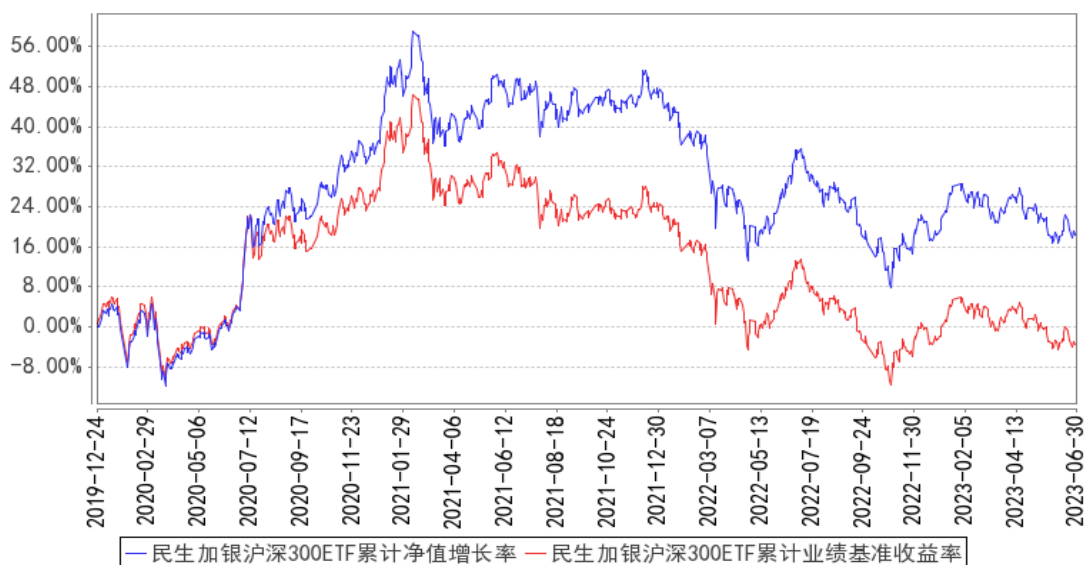
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.08%	0.86%	1.16%	0.87%	0.92%	-0.01%
过去三个月	-3.96%	0.82%	-5.15%	0.83%	1.19%	-0.01%
过去六个月	0.45%	0.83%	-0.75%	0.84%	1.20%	-0.01%
过去一年	-11.93%	0.97%	-14.33%	0.99%	2.40%	-0.02%
过去三年	13.85%	1.18%	-7.72%	1.20%	21.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.22%	1.23%	-3.14%	1.24%	22.36%	-0.01%

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”）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。

基金管理情况：2023 年 6 月 30 日，民生加银基金管理有限公司管理 98 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、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、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、民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金、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、民生加银聚利 6 个月持有期混合型证券投资基金、民生加银科技创新混合型证券投



资基金（LOF）、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、民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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、民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银康泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金、民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金、民生加银聚优精选混合型证券投资基金、民生加银核心资产股票型证券投资基金、民生加银优享 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF-LOF）、民生加银中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、民生加银双核动力混合型证券投资基金、民生加银恒祥债券型证券投资基金、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、民生加银金融优选混合型证券投资基金、民生加银月月乐 30 天持有期短债债券型证券投资基金、民生加银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金、民生加银瑞丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银恒宁债券型证券投资基金、民生加银瑞华绿色债券一年定期开放债券型发起式证券投资基金、民生加银均衡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		
何江	本基金基金经理、量化投资部总监	2019 年 12 月 24 日	-	18 年	清华大学流体力学硕士，18 年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分

				<p>析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019 年 4 月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、公司投资决策委员会成员、大类资产配置条线投资决策委员会成员、基金经理。自 2019 年 12 月至今担任民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2021 年 9 月至今担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至今担任民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 3 月至今担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2020 年 12 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 6 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2023 年上半年，主要发达经济体的央行继续维持紧缩的货币政策，加息效应持续显现，欧美等国家的通胀水平从高点逐渐回落，同时欧美经济体景气度下行。上半年，国内 GDP 同比增长 5.5%，经济复苏动能偏弱，总需求较弱仍然是经济的主要问题，房地产投资持续疲弱对经济增长形成拖累。

2023 年上半年，万得全 A 指数上涨 3.06%。通信、传媒和计算机等行业涨幅靠前，消费者服务、房地产和综合等行业跌幅靠前。稳定与成长风格相对占优。

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) 指数成分股调整等。

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 4.7960 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.45%，业绩比较基准收益率为-0.75%。

### 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 2023 年下半年，随着前期美联储等加息效应的持续发生作用，欧美经济体未来是否衰退以及衰退的程度仍具有较大的不确定性。国内经济在目前经济动能较弱的背景下，政策层面有望发挥逆周期调节的作用，财政政策或将进一步发力，但同时会保持战略定力，以稳定为主。中

国经济自身有较强的韧性，预计整体经济将在调结构的过程中保持较为平稳的增长速度。

ChatGPT 等大语言模型技术取得了突破性的进展，人工智能技术的发展将深刻地改变各行各业。算力是人工智能发展的基础，而算力对于能源的要求很高。市场对于未来电力及其他能源的需求预测仍然偏重于基于历史信息的线性外推而可能低估，我们总体认为未来十年全球能源供需偏紧，并且存在结构性问题。中长期角度继续看好大能源大资源板块，以及人工智能、高端制造、生物科技等高景气、高成长性方向。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

## 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,未发现有关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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,041,400.70	5,086,994.28
结算备付金		1,626,089.38	1,841,847.36
存出保证金		844,433.76	719,835.59
交易性金融资产	6.4.7.2	104,145,293.60	126,114,565.97
其中：股票投资		104,145,293.60	126,109,594.05
基金投资		-	-
债券投资		-	4,971.92
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		53,386.54	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-
资产总计		112,786,220.22	133,763,243.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		13,801.88	17,604.83
应付托管费		4,600.62	5,868.27
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	546,277.81	538,324.45
负债合计		564,680.31	561,797.55
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	94,132,443.63	112,235,466.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,089,096.28	20,965,979.27
净资产合计		112,221,539.91	133,201,445.65
负债和净资产总计		112,786,220.22	133,763,243.20

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.7960 元，基金份额总额 23,399,186.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,030,774.64	-26,029,537.05
1. 利息收入		32,526.64	24,202.61
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,526.64	24,202.61
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）		-2,670,682.94	-20,907,438.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,737,939.95	-21,989,636.07
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	-223,083.91	-119,170.70
股利收益	6.4.7.19	1,289,063.02	1,201,367.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	4,558,040.76	-5,123,534.88
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	110,890.18	-22,765.96
<b>减：二、营业总支出</b>		405,774.95	455,705.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	96,850.41	133,391.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,283.47	44,463.80
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		985.43	-
8. 其他费用	6.4.7.23	275,655.64	277,850.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,624,999.69	-26,485,242.94

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,624,999.69	-26,485,242.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,624,999.69	-26,485,242.94

### 6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	112,235,466.38	-	20,965,979.27	133,201,445.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	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基金净值	-18,103,022.75	-	-4,501,882.68	-22,604,905.43



变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
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 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	94,132,443.63	-	18,089,096.28	112,221,539.91
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基 金净值)	173,785,743.74	-	82,441,125.67	256,226,869.41
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	173,785,743.74	-	82,441,125.67	256,226,869.41
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-76,032,695.55	-	-47,868,394.74	-123,901,090.29
(一)、 综合收 益总额	-	-	-26,485,242.94	-26,485,242.94
(二)、 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)	-76,032,695.55	-	-21,383,151.80	-97,415,847.35
其中:1. 基金申 购款	68,791,486.45	-	20,750,659.67	89,542,146.12
2 .基金 赎回 款	-144,824,182.00	-	-42,133,811.47	-186,957,993.47
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	97,753,048.19	-	34,572,730.93	132,325,779.12

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（“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）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。为更好的实现投资目标，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）、存托凭证、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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况、2023 年 01 月 01 日至 2023 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他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

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、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》、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》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。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	6,041,400.70
等于：本金	6,040,309.40
加：应计利息	1,091.30
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	6,041,400.70

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	115,065,715.65	-	104,145,293.60	-10,920,422.05
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	115,065,715.65	-	104,145,293.60	-10,920,422.05

#### 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 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	

权益衍生工具	6,943,020.00	-	-
其中：股指期货投资	6,943,020.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	6,943,020.00	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则，《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 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
IF2307	IF2307	3.00	3,447,360.00	-23,640.00
IF2309	IF2309	3.00	3,455,100.00	-16,920.00
合计				-40,560.00
减：可抵销期货暂收款				-40,560.00
净额				0.00

#### 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：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。



## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	8,641.06
其中：交易所市场	8,641.06
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	35,000.00
预提审计费	19,835.79
应退替代款	173,705.02
预提 IOPV 服务费	249,588.57
预提信息披露费	59,507.37
合计	546,277.81

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	27,899,186.00	112,235,466.38
本期申购	7,200,000.00	28,964,836.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-11,700,000.00	-47,067,859.15
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	23,399,186.00	94,132,443.63

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,576,306.28	-22,610,327.01	20,965,979.27
本期利润	-2,933,041.07	4,558,040.76	1,624,999.69
本期基金份额交易产生的变动数	-6,782,529.48	2,280,646.80	-4,501,882.68
其中：基金申购款	10,948,638.83	-4,528,940.47	6,419,698.36
基金赎回款	-17,731,168.31	6,809,587.27	-10,921,581.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,860,735.73	-15,771,639.45	18,089,096.28

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,832.54
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	14,572.87
其他	121.23
合计	32,526.64

注：其他为保证金利息收入。

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,506,965.07
股票投资收益——赎回差价收入	-1,230,974.88
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	-3,737,939.95

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	28,426,131.18
减：卖出股票成本总额	30,887,751.22
减：交易费用	45,345.03
买卖股票差价收入	-2,506,965.07

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	57,989,440.19
减：现金支付赎回款总额	24,503,374.19
减：赎回股票成本总额	34,717,040.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,230,974.88

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,276.64
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,277.90

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,282.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应计利息总额	5.18
减：交易费用	0.22
买卖债券差价收入	1,276.64

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无权证差价收入。

## 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	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-223,083.91

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,289,063.02
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,289,063.02

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,494,020.76
股票投资	4,494,988.76
债券投资	-968.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	64,020.00
权证投资	-
期货投资	64,020.00
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	4,558,040.76

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	110,890.18

合计	110,890.18
----	------------

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,340.15
指数使用费	70,000.00
中登登记结算费	74,383.76
IOPV 服务费	49,588.57
合计	275,655.64

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人民币 5,000 万元时，指数许可使用费的收取下限金额为每季度人民币 35,000 元；如日均基金资产净值小于人民币 5,000 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

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

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司（“民生加银基金公司”）	基金管理人
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：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	96,850.41	133,391.42
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	32,283.47	44,463.80

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自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 2023年6月30日		上年度末 2022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	8,744,829.00	37.3724	7,136,029.00	25.5779

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	6,041,400.70	17,832.54	6,153,528.78	16,012.35

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

本基金本报告期末因指数投资而持有的关联方证券：

1、“农业银行”（股票代码 601288）持仓数量为 175,700.00 股，市值占基金资产净值的比例为 0.55%（2022 年 12 月 31 日：持仓数量为 214,900.00 股，市值占基金资产净值的比例为 0.47%）；

2、“民生银行”（股票代码 600016）持仓数量为 136,800.00 股，市值占基金资产净值的比例为 0.46%（2022 年 12 月 31 日：持仓数量为 167,200.00 股，市值占基金资产净值的比例为 0.43%）。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1）本基金于本期末未进行利润分配。

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

#### 6.4.12 期末（2023 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
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	386	2,539.88	2,925.88	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	145	1,502.20	1,716.80	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	127	1,480.82	1,557.02	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	45	1,169.10	1,103.85	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	130	2,314.00	2,325.70	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	99	1,574.10	1,691.91	-

		日									
688146	中船特 气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	36.15	38.13	136	4,916.40	5,185.68		-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.16	16.21	213	3,016.08	3,452.73		-
688352	硕中科 技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流 通受限	12.10	12.07	374	4,525.40	4,514.18		-
688429	时创能 源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	19.20	25.53	108	2,073.60	2,757.24		-
688433	华曙高 科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流 通受限	26.66	31.50	126	3,359.16	3,969.00		-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	11.10	17.04	418	4,639.80	7,122.72		-
688478	晶升股 份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	32.52	42.37	153	4,975.56	6,482.61		-
688479	友车科 技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	33.99	29.49	89	3,025.11	2,624.61		-
688484	南芯科 技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	39.99	36.71	133	5,318.67	4,882.43		-
688535	华海诚 科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	35.00	51.23	86	3,010.00	4,405.78		-
688543	国科军 工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	43.67	53.05	72	3,144.24	3,819.60		-
688562	航天软 件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	12.68	22.31	267	3,385.56	5,956.77		-
688570	天玛智 控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	30.26	25.33	135	4,085.10	3,419.55		-
688576	西山科 技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	135.80	120.41	46	6,246.80	5,538.86		-
688582	芯动联 科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	26.74	40.68	116	3,101.84	4,718.88		-
688603	天承科 技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股流 通受限	55.00	55.00	500	27,500.00	27,500.00		-

		日								
688603	天承科技	2023年 6月30 日	6个月	新股流 通受限	55.00	55.00	56	3,080.00	3,080.00	-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股流 通受限	10.68	12.34	316	3,374.88	3,899.44	-
688623	双元科 技	2023年 5月31 日	6个月	新股流 通受限	125.88	86.79	28	3,524.64	2,430.12	-
688629	华丰科 技	2023年 6月16 日	6个月	新股流 通受限	9.26	18.59	256	2,370.56	4,759.04	-
688631	莱斯信 息	2023年 6月19 日	6个月	新股流 通受限	25.28	29.87	83	2,098.24	2,479.21	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 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 2023 年 06 月 30 日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

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

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10% 。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并

采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	4,971.92
未评级	-	-
合计	-	4,971.92

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，

其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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 2023 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	6,040,309.40	-	-	-	-	1,091.30	6,041,400.70
结算备付金	1,625,412.27	-	-	-	-	677.11	1,626,089.38
存出保证金	16,131.26	-	-	-	-	828,302.50	844,433.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	104,145,293.60	104,145,293.60
应收清算款	-	-	-	-	-	53,386.54	53,386.54
其他资产	-	-	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	7,681,852.93	-	-	-	-	105,104,367.29	112,786,220.22
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,801.88	13,801.88
应付托管费	-	-	-	-	-	4,600.62	4,600.62
其他负债	-	-	-	-	-	546,277.81	546,277.81
负债总计	-	-	-	-	-	564,680.31	564,680.31
利率敏感度缺口	7,681,852.93	-	-	-	-	-104,539,686.98	112,221,539.91
上年度末 2022 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	5,085,877.68	-	-	-	-	1,116.60	5,086,994.28
结算备付金	1,841,017.91	-	-	-	-	829.45	1,841,847.36
存出保证金	20,345.58	-	-	-	-	699,490.01	719,835.59
交易性金融资产	-	-	-	-	4,968.00	126,109,597.97	126,114,565.97
资产总计	6,947,241.17	-	-	-	4,968.00	126,811,034.03	133,763,243.20
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,604.83	17,604.83
应付托管费	-	-	-	-	-	5,868.27	5,868.27
其他负债	-	-	-	-	-	538,324.45	538,324.45
负债总计	-	-	-	-	-	561,797.55	561,797.55
利率敏感度缺口	6,947,241.17	-	-	-	4,968.00	126,249,236.48	133,201,445.65

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	104,145,293.60	92.80	126,109,594.05	94.68
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	104,145,293.60	92.80	126,109,594.05	94.68

#### 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	5,532,355.57	6,553,210.37
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-5,532,355.57	-6,553,210.37

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元



公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	104,020,973.99	125,967,684.76
第二层次	124,319.61	146,881.21
第三层次	-	-
合计	104,145,293.60	126,114,565.97

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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 (2022 年 12 月 31 日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	104,145,293.60	92.34
	其中：股票	104,145,293.60	92.34
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	7,667,490.08	6.80
8	其他各项资产	973,436.54	0.86

9	合计	112,786,220.22	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	1,163,799.70	1.04
B	采矿业	4,057,470.40	3.62
C	制造业	58,811,011.01	52.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,105,099.00	2.77
E	建筑业	2,467,830.45	2.20
F	批发和零售业	344,877.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	3,243,669.00	2.89
H	住宿和餐饮业	105,850.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,170,263.90	4.61
J	金融业	21,268,288.54	18.95
K	房地产业	1,560,473.00	1.39
L	租赁和商务服务业	976,179.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	1,013,435.84	0.90
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	592,466.15	0.53
R	文化、体育和娱乐业	140,261.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	104,020,973.99	92.69

### 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	103,631.48	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,248.93	0.00

F	批发和零售业	2,925.88	0.00
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	11,060.59	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	3,452.73	0.00
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,319.61	0.11

### 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	3,500	5,918,500.00	5.27
2	300750	宁德时代	14,520	3,322,030.80	2.96
3	601318	中国平安	59,672	2,768,780.80	2.47
4	600036	招商银行	68,200	2,234,232.00	1.99
5	000858	五粮液	10,700	1,750,199.00	1.56
6	000333	美的集团	27,044	1,593,432.48	1.42
7	002594	比亚迪	5,000	1,291,350.00	1.15
8	601166	兴业银行	80,100	1,253,565.00	1.12
9	600900	长江电力	53,900	1,189,034.00	1.06
10	600276	恒瑞医药	24,578	1,177,286.20	1.05
11	601899	紫金矿业	90,700	1,031,259.00	0.92
12	600030	中信证券	51,650	1,021,637.00	0.91
13	600887	伊利股份	35,100	994,032.00	0.89
14	300059	东方财富	69,893	992,480.60	0.88

15	601012	隆基绿能	33,432	958,495.44	0.85
16	601398	工商银行	193,200	931,224.00	0.83
17	600309	万华化学	10,400	913,536.00	0.81
18	000651	格力电器	24,796	905,301.96	0.81
19	002475	立讯精密	27,478	891,661.10	0.79
20	601328	交通银行	151,500	878,700.00	0.78
21	000568	泸州老窖	4,100	859,237.00	0.77
22	002415	海康威视	25,808	854,502.88	0.76
23	000725	京东方 A	206,600	844,994.00	0.75
24	300760	迈瑞医疗	2,700	809,460.00	0.72
25	000063	中兴通讯	17,600	801,504.00	0.71
26	601816	京沪高铁	135,100	710,626.00	0.63
27	603259	药明康德	11,264	701,859.84	0.63
28	002230	科大讯飞	10,250	696,590.00	0.62
29	600028	中国石化	104,800	666,528.00	0.59
30	300274	阳光电源	5,700	664,791.00	0.59
31	601668	中国建筑	115,500	662,970.00	0.59
32	300124	汇川技术	10,250	658,152.50	0.59
33	002714	牧原股份	15,038	633,851.70	0.56
34	601288	农业银行	175,700	620,221.00	0.55
35	002352	顺丰控股	13,500	608,715.00	0.54
36	000001	平安银行	53,486	600,647.78	0.54
37	601888	中国中免	5,400	596,862.00	0.53
38	002129	TCL 中环	17,750	589,300.00	0.53
39	000792	盐湖股份	29,900	573,183.00	0.51
40	601088	中国神华	18,200	559,650.00	0.50
41	002142	宁波银行	21,780	551,034.00	0.49
42	688981	中芯国际	10,800	545,616.00	0.49
43	600031	三一重工	32,800	545,464.00	0.49
44	300498	温氏股份	28,880	529,948.00	0.47
45	000002	万 科 A	37,500	525,750.00	0.47
46	600048	保利发展	39,500	514,685.00	0.46
47	600016	民生银行	136,800	513,000.00	0.46
48	600406	国电南瑞	22,162	511,942.20	0.46
49	600438	通威股份	14,900	511,219.00	0.46
50	600050	中国联通	105,200	504,960.00	0.45
51	600809	山西汾酒	2,660	492,286.20	0.44
52	601601	中国太保	18,900	491,022.00	0.44
53	600837	海通证券	53,100	489,582.00	0.44
54	600690	海尔智家	20,800	488,384.00	0.44
55	601728	中国电信	85,600	481,928.00	0.43
56	600919	江苏银行	65,050	478,117.50	0.43
57	600089	特变电工	21,400	477,006.00	0.43

58	002371	北方华创	1,500	476,475.00	0.42
59	300015	爱尔眼科	25,673	476,234.15	0.42
60	600436	片仔癀	1,651	472,780.36	0.42
61	688111	金山办公	1,000	472,220.00	0.42
62	601138	工业富联	18,700	471,240.00	0.42
63	600000	浦发银行	64,700	468,428.00	0.42
64	600941	中国移动	5,000	466,500.00	0.42
65	601857	中国石油	62,400	466,128.00	0.42
66	601988	中国银行	116,100	453,951.00	0.40
67	603501	韦尔股份	4,590	450,003.60	0.40
68	002304	洋河股份	3,344	439,234.40	0.39
69	601766	中国中车	67,000	435,500.00	0.39
70	603288	海天味业	9,220	431,957.00	0.38
71	601390	中国中铁	56,600	429,028.00	0.38
72	600905	三峡能源	78,800	423,156.00	0.38
73	300014	亿纬锂能	6,800	411,400.00	0.37
74	600150	中国船舶	12,300	404,793.00	0.36
75	000938	紫光股份	12,600	401,310.00	0.36
76	002466	天齐锂业	5,700	398,487.00	0.36
77	603986	兆易创新	3,712	394,400.00	0.35
78	601688	华泰证券	28,300	389,691.00	0.35
79	601225	陕西煤业	21,300	387,447.00	0.35
80	002027	分众传媒	55,700	379,317.00	0.34
81	002459	晶澳科技	9,060	377,802.00	0.34
82	601169	北京银行	81,500	377,345.00	0.34
83	002460	赣锋锂业	6,180	376,732.80	0.34
84	688012	中微公司	2,400	375,480.00	0.33
85	000338	潍柴动力	29,900	372,554.00	0.33
86	600570	恒生电子	8,398	371,947.42	0.33
87	601985	中国核电	52,100	367,305.00	0.33
88	600104	上汽集团	25,800	365,586.00	0.33
89	002050	三花智控	11,870	359,186.20	0.32
90	000625	长安汽车	27,368	353,868.24	0.32
91	002049	紫光国微	3,780	352,485.00	0.31
92	601211	国泰君安	24,800	346,952.00	0.31
93	600111	北方稀土	13,900	333,322.00	0.30
94	601919	中远海控	35,210	330,974.00	0.29
95	603019	中科曙光	6,460	328,814.00	0.29
96	000100	TCL 科技	82,760	326,074.40	0.29
97	603799	华友钴业	7,020	322,288.20	0.29
98	601628	中国人寿	9,200	321,632.00	0.29
99	002179	中航光电	7,030	318,810.50	0.28
100	600660	福耀玻璃	8,800	315,480.00	0.28

101	601229	上海银行	54,800	315,100.00	0.28
102	601818	光大银行	102,292	314,036.44	0.28
103	600585	海螺水泥	13,200	313,368.00	0.28
104	600893	航发动力	7,400	312,724.00	0.28
105	600009	上海机场	6,800	308,856.00	0.28
106	601989	中国重工	62,700	302,214.00	0.27
107	002271	东方雨虹	11,050	301,223.00	0.27
108	601658	邮储银行	61,100	298,779.00	0.27
109	002555	三七互娱	8,547	298,119.36	0.27
110	300122	智飞生物	6,600	291,720.00	0.26
111	600958	东方证券	28,876	280,097.20	0.25
112	002812	恩捷股份	2,900	279,415.00	0.25
113	600999	招商证券	20,470	277,777.90	0.25
114	000977	浪潮信息	5,700	276,450.00	0.25
115	600019	宝钢股份	49,000	275,380.00	0.25
116	600760	中航沈飞	6,104	274,680.00	0.24
117	300896	爱美客	600	266,970.00	0.24
118	688036	传音控股	1,816	266,952.00	0.24
119	002709	天赐材料	6,400	263,616.00	0.23
120	688599	天合光能	6,100	259,921.00	0.23
121	300316	晶盛机电	3,600	255,240.00	0.23
122	600426	华鲁恒升	8,200	251,166.00	0.22
123	601186	中国铁建	25,300	249,205.00	0.22
124	688008	澜起科技	4,300	246,906.00	0.22
125	601360	三六零	19,600	245,784.00	0.22
126	000661	长春高新	1,800	245,340.00	0.22
127	601006	大秦铁路	32,800	243,704.00	0.22
128	600584	长电科技	7,800	243,126.00	0.22
129	601600	中国铝业	43,800	240,462.00	0.21
130	002410	广联达	7,380	239,776.20	0.21
131	000776	广发证券	16,300	239,773.00	0.21
132	600745	闻泰科技	4,800	234,720.00	0.21
133	600547	山东黄金	9,980	234,330.40	0.21
134	002241	歌尔股份	13,200	234,300.00	0.21
135	002920	德赛西威	1,500	233,715.00	0.21
136	601377	兴业证券	38,130	233,355.60	0.21
137	300142	沃森生物	8,800	232,760.00	0.21
138	600588	用友网络	11,330	232,265.00	0.21
139	601939	建设银行	37,070	232,058.20	0.21
140	000166	申万宏源	49,700	229,614.00	0.20
141	601009	南京银行	28,500	228,000.00	0.20
142	600010	包钢股份	125,300	224,287.00	0.20
143	600011	华能国际	24,200	224,092.00	0.20

144	001979	招商蛇口	17,100	222,813.00	0.20
145	000596	古井贡酒	900	222,642.00	0.20
146	600085	同仁堂	3,800	218,728.00	0.19
147	601669	中国电建	38,100	218,694.00	0.19
148	300408	三环集团	7,417	217,688.95	0.19
149	300450	先导智能	6,000	217,020.00	0.19
150	600196	复星医药	7,000	216,300.00	0.19
151	002311	海大集团	4,600	215,464.00	0.19
152	601800	中国交建	19,600	213,836.00	0.19
153	603659	璞泰来	5,580	213,267.60	0.19
154	000963	华东医药	4,800	208,176.00	0.19
155	603993	洛阳钼业	39,000	207,870.00	0.19
156	000538	云南白药	3,960	207,820.80	0.19
157	600886	国投电力	16,400	207,460.00	0.18
158	600600	青岛啤酒	2,000	207,260.00	0.18
159	300033	同花顺	1,180	206,830.40	0.18
160	000768	中航西飞	7,700	205,975.00	0.18
161	300782	卓胜微	2,080	200,990.40	0.18
162	600845	宝信软件	3,937	200,038.97	0.18
163	002493	荣盛石化	16,750	194,970.00	0.17
164	002252	上海莱士	25,900	194,509.00	0.17
165	601689	拓普集团	2,400	193,680.00	0.17
166	000733	振华科技	2,000	191,700.00	0.17
167	600926	杭州银行	16,300	191,525.00	0.17
168	600015	华夏银行	35,000	189,350.00	0.17
169	600795	国电电力	49,100	188,053.00	0.17
170	600176	中国巨石	13,218	187,166.88	0.17
171	300347	泰格医药	2,900	187,166.00	0.17
172	601100	恒立液压	2,904	186,814.32	0.17
173	600732	爱旭股份	6,020	185,115.00	0.16
174	002180	纳思达	5,400	184,950.00	0.16
175	000157	中联重科	27,400	184,950.00	0.16
176	603369	今世缘	3,500	184,800.00	0.16
177	600674	川投能源	12,200	183,610.00	0.16
178	002236	大华股份	9,139	180,495.25	0.16
179	600115	中国东航	37,600	178,976.00	0.16
180	600029	南方航空	29,500	177,885.00	0.16
181	000425	徐工机械	26,000	176,020.00	0.16
182	000301	东方盛虹	14,600	172,572.00	0.15
183	601633	长城汽车	6,800	171,156.00	0.15
184	601995	中金公司	4,800	170,496.00	0.15
185	601788	光大证券	10,700	170,023.00	0.15
186	601336	新华保险	4,600	169,142.00	0.15

187	601066	中信建投	6,900	166,980.00	0.15
188	601868	中国能建	71,300	166,842.00	0.15
189	601117	中国化学	20,100	166,428.00	0.15
190	600346	恒力石化	11,600	166,228.00	0.15
191	300496	中科创达	1,725	166,203.75	0.15
192	601877	正泰电器	5,901	163,162.65	0.15
193	002074	国轩高科	5,900	162,958.00	0.15
194	002202	金风科技	15,200	161,424.00	0.14
195	002821	凯莱英	1,360	160,289.60	0.14
196	600741	华域汽车	8,625	159,217.50	0.14
197	300454	深信服	1,400	158,550.00	0.14
198	601111	中国国航	19,200	158,208.00	0.14
199	688126	沪硅产业	7,565	158,108.50	0.14
200	002001	新和成	10,200	157,080.00	0.14
201	601618	中国中冶	39,300	156,021.00	0.14
202	600989	宝丰能源	12,200	153,842.00	0.14
203	002841	视源股份	2,300	153,732.00	0.14
204	688223	晶科能源	10,883	153,014.98	0.14
205	600188	兖矿能源	5,100	152,592.00	0.14
206	603806	福斯特	4,096	152,330.24	0.14
207	688396	华润微	2,900	151,989.00	0.14
208	601838	成都银行	12,300	150,183.00	0.13
209	601615	明阳智能	8,800	148,544.00	0.13
210	601901	方正证券	22,600	147,804.00	0.13
211	000876	新希望	12,500	146,000.00	0.13
212	300661	圣邦股份	1,755	144,138.15	0.13
213	605117	德业股份	960	143,568.00	0.13
214	600460	士兰微	4,700	142,269.00	0.13
215	603392	万泰生物	2,127	142,019.79	0.13
216	688303	大全能源	3,500	141,575.00	0.13
217	600039	四川路桥	14,420	141,460.20	0.13
218	300413	芒果超媒	4,100	140,261.00	0.12
219	000895	双汇发展	5,718	140,033.82	0.12
220	002736	国信证券	15,900	138,807.00	0.12
221	600233	圆通速递	9,500	138,320.00	0.12
222	002648	卫星化学	9,240	138,230.40	0.12
223	601607	上海医药	6,100	136,701.00	0.12
224	002007	华兰生物	6,040	135,356.40	0.12
225	000786	北新建材	5,500	134,805.00	0.12
226	003816	中国广核	43,100	134,041.00	0.12
227	300207	欣旺达	8,200	133,824.00	0.12
228	603260	合盛硅业	1,900	133,038.00	0.12
229	300999	金龙鱼	3,300	131,967.00	0.12



230	002601	龙佰集团	7,900	130,350.00	0.12
231	300769	德方纳米	1,180	130,071.40	0.12
232	300751	迈为股份	760	128,728.80	0.11
233	300433	蓝思科技	10,900	128,184.00	0.11
234	601238	广汽集团	12,200	127,124.00	0.11
235	601021	春秋航空	2,200	126,434.00	0.11
236	600383	金地集团	17,500	126,175.00	0.11
237	300759	康龙化成	3,250	124,410.00	0.11
238	600332	白云山	3,900	124,332.00	0.11
239	600132	重庆啤酒	1,300	119,808.00	0.11
240	600219	南山铝业	38,800	117,176.00	0.10
241	600763	通策医疗	1,200	116,232.00	0.10
242	600875	东方电气	6,200	115,630.00	0.10
243	300223	北京君正	1,300	114,803.00	0.10
244	300763	锦浪科技	1,100	114,510.00	0.10
245	002756	永兴材料	1,820	113,950.20	0.10
246	000983	山西焦煤	12,500	113,750.00	0.10
247	600362	江西铜业	5,700	108,186.00	0.10
248	601865	福莱特	2,800	107,828.00	0.10
249	000723	美锦能源	14,300	107,822.00	0.10
250	601699	潞安环能	6,600	107,712.00	0.10
251	603290	斯达半导	500	107,600.00	0.10
252	600754	锦江酒店	2,500	105,850.00	0.09
253	600918	中泰证券	15,300	105,723.00	0.09
254	601878	浙商证券	10,600	104,728.00	0.09
255	601872	招商轮船	17,900	103,641.00	0.09
256	601319	中国人保	17,500	102,200.00	0.09
257	603486	科沃斯	1,300	101,101.00	0.09
258	601998	中信银行	16,900	101,062.00	0.09
259	600061	国投资本	14,176	100,933.12	0.09
260	000617	中油资本	13,900	100,497.00	0.09
261	000408	藏格矿业	4,400	99,308.00	0.09
262	000069	华侨城 A	22,500	99,000.00	0.09
263	601799	星宇股份	800	98,880.00	0.09
264	688363	华熙生物	1,100	98,076.00	0.09
265	600803	新奥股份	5,100	96,798.00	0.09
266	300628	亿联网络	2,760	96,793.20	0.09
267	600884	杉杉股份	6,200	93,868.00	0.08
268	300601	康泰生物	3,660	92,927.40	0.08
269	002938	鹏鼎控股	3,800	92,302.00	0.08
270	603833	欧派家居	960	91,968.00	0.08
271	688005	容百科技	1,700	91,834.00	0.08
272	600183	生益科技	6,400	90,880.00	0.08

273	300919	中伟股份	1,500	90,375.00	0.08
274	603899	晨光股份	2,000	89,280.00	0.08
275	000708	中信特钢	5,600	88,704.00	0.08
276	601898	中煤能源	10,000	84,400.00	0.08
277	002916	深南电路	1,100	82,907.00	0.07
278	601881	中国银河	7,100	82,431.00	0.07
279	603185	弘元绿能	1,100	82,005.00	0.07
280	600018	上港集团	15,400	80,850.00	0.07
281	688561	奇安信	1,500	77,715.00	0.07
282	601216	君正集团	18,700	76,670.00	0.07
283	000877	天山股份	9,400	76,516.00	0.07
284	002120	韵达股份	8,000	76,480.00	0.07
285	002064	华峰化学	10,900	74,774.00	0.07
286	002414	高德红外	9,396	73,006.92	0.07
287	601155	新城控股	5,000	72,050.00	0.06
288	600025	华能水电	10,000	71,300.00	0.06
289	688065	凯赛生物	1,120	69,731.20	0.06
290	600606	绿地控股	23,035	63,346.25	0.06
291	300957	贝泰妮	700	62,216.00	0.06
292	603195	公牛集团	640	61,478.40	0.05
293	688187	时代电气	1,400	58,604.00	0.05
294	601808	中海油服	3,300	45,804.00	0.04
295	601698	中国卫通	2,300	45,724.00	0.04
296	000800	一汽解放	5,100	42,687.00	0.04
297	300979	华利集团	800	38,992.00	0.03
298	601236	红塔证券	5,200	38,740.00	0.03
299	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.03
300	001289	龙源电力	900	20,250.00	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	688603	天承科技	556	30,580.00	0.03
2	688472	阿特斯	418	7,122.72	0.01
3	688478	晶升股份	153	6,482.61	0.01
4	688562	航天软件	267	5,956.77	0.01
5	688576	西山科技	46	5,538.86	0.00
6	688146	中船特气	136	5,185.68	0.00
7	688484	南芯科技	133	4,882.43	0.00
8	688629	华丰科技	256	4,759.04	0.00
9	688582	芯动联科	116	4,718.88	0.00
10	688352	颀中科技	374	4,514.18	0.00
11	688535	华海诚科	86	4,405.78	0.00
12	688433	华曙高科	126	3,969.00	0.00

13	688620	安凯微	316	3,899.44	0.00
14	688543	国科军工	72	3,819.60	0.00
15	688334	西高院	213	3,452.73	0.00
16	688570	天玛智控	135	3,419.55	0.00
17	601061	中信金属	386	2,925.88	0.00
18	688429	时创能源	108	2,757.24	0.00
19	688479	友车科技	89	2,624.61	0.00
20	688631	莱斯信息	83	2,479.21	0.00
21	688623	二元科技	28	2,430.12	0.00
22	603135	中重科技	130	2,325.70	0.00
23	601065	江盐集团	145	1,716.80	0.00
24	603137	恒尚节能	99	1,691.91	0.00
25	601133	柏诚股份	127	1,557.02	0.00
26	603125	常青科技	45	1,103.85	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	300750	宁德时代	985,557.60	0.74
2	000858	五粮液	601,019.00	0.45
3	000333	美的集团	471,989.00	0.35
4	000568	泸州老窖	419,657.00	0.32
5	002594	比亚迪	403,626.00	0.30
6	300059	东方财富	386,363.00	0.29
7	002415	海康威视	338,459.00	0.25
8	002371	北方华创	319,959.00	0.24
9	000651	格力电器	300,168.00	0.23
10	000725	京东方 A	286,638.00	0.22
11	002352	顺丰控股	258,905.00	0.19
12	002475	立讯精密	258,884.00	0.19
13	601728	中国电信	247,954.00	0.19
14	300760	迈瑞医疗	246,647.00	0.19
15	000792	盐湖股份	235,607.00	0.18
16	002714	牧原股份	230,871.00	0.17
17	000001	平安银行	224,136.00	0.17
18	300124	汇川技术	215,432.00	0.16
19	002129	TCL 中环	202,936.00	0.15
20	000002	万科 A	202,768.00	0.15

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	1,794,520.00	1.35
2	000858	五粮液	1,019,539.00	0.77
3	000333	美的集团	814,271.00	0.61
4	002594	比亚迪	720,484.00	0.54
5	300059	东方财富	647,625.00	0.49
6	000568	泸州老窖	592,980.00	0.45
7	002415	海康威视	543,034.00	0.41
8	600519	贵州茅台	506,267.00	0.38
9	000651	格力电器	481,248.00	0.36
10	000725	京东方 A	456,192.00	0.34
11	300760	迈瑞医疗	437,199.00	0.33
12	002475	立讯精密	435,755.00	0.33
13	002352	顺丰控股	417,855.00	0.31
14	000001	平安银行	380,366.00	0.29
15	002371	北方华创	371,613.00	0.28
16	000792	盐湖股份	368,202.00	0.28
17	002714	牧原股份	362,736.00	0.27
18	300124	汇川技术	355,801.00	0.27
19	002142	宁波银行	343,499.00	0.26
20	000002	万科 A	333,365.00	0.25

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	18,863,587.46
卖出股票收入（成交）总额	28,426,131.18

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：

兴业银行股份有限公司因违法违规被中国银行保险监督管理委员会处罚；

招商银行股份有限公司因违法违规被中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会处罚；

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	844,433.76
2	应收清算款	53,386.54
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	973,436.54

#### 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	688603	天承科技	30,580.00	0.03	新股流通受限
2	688472	阿特斯	7,122.72	0.01	新股流通受限
3	688478	晶升股份	6,482.61	0.01	新股流通受限
4	688562	航天软件	5,956.77	0.01	新股流通受限
5	688576	西山科技	5,538.86	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 (%)
1,535	15,243.77	13,043,070.00	55.74	10,356,116.00	44.26

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 (%)
中国农业银行股份有限公司	8,744,829.00	37.3724

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

### 8.2 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	中信建投证券股份有限公司	2,252,247.00	9.63
2	广发证券股份有限公司	1,093,245.00	4.67
3	张巍	568,700.00	2.43
4	华泰证券股份有限公司	473,657.00	2.02
5	中信证券股份有限公司	384,292.00	1.64
6	单艳宏	381,600.00	1.63
7	肖若臻	222,000.00	0.95
8	谷连飞	158,700.00	0.68
9	陈欧	154,300.00	0.66
10	杨水生	148,581.00	0.63
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	8,744,829.00	37.37

### 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	27,899,186.00
本报告期基金总申购份额	7,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额

23,399,186.00

## § 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 2023 年 4 月 11 日发布公告，自 2023 年 4 月 10 日起于善辉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：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	38,720,656.65	84.38	8,724.09	69.61	-
长江证券	2	7,168,502.13	15.62	3,808.64	30.39	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
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	5,282.04	100.00	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
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。

## 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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
4	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
5	民生加银沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
6	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20230101~20230630	7,136,029.00	3,881,900.00	2,273,100.00	8,744,829.00	37.37
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

2023 年 8 月 30 日