

民生加银中证 500 指数增强型发起式证券
投资基金
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 22 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 民生加银中证 500 指数增强发起式 |
| 基金主代码 | 012926 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 8 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 64,063,262.63 份 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略、融资及转融通证券出借业务等，详见基金合同或招募说明书。</p> <p>其中：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> |

| | | |
|-----------------|---|----------------------|
| | 本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 民生加银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 民生加银中证 500 指数增强发起式 A | 民生加银中证 500 指数增强发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012926 | 012927 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 35,275,909.86 份 | 28,787,352.77 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------------|
| | 民生加银中证 500 指数增强发起式 A | 民生加银中证 500 指数增强发起式 C |
| 1. 本期已实现收益 | 3,320,012.13 | 2,704,778.09 |
| 2. 本期利润 | 748,148.31 | 229,245.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0231 | 0.0084 |
| 4. 期末基金资产净值 | 35,056,626.08 | 28,211,270.83 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9938 | 0.9800 |

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

民生加银中证 500 指数增强发起式 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.59% | 1.49% | 1.97% | 1.59% | 0.62% | -0.10% |
| 过去六个月 | 2.65% | 1.28% | 2.69% | 1.39% | -0.04% | -0.11% |
| 过去一年 | 31.77% | 1.22% | 28.51% | 1.31% | 3.26% | -0.09% |
| 过去三年 | 16.63% | 1.29% | 19.53% | 1.36% | -2.90% | -0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | -0.62% | 1.24% | 9.29% | 1.29% | -9.91% | -0.05% |

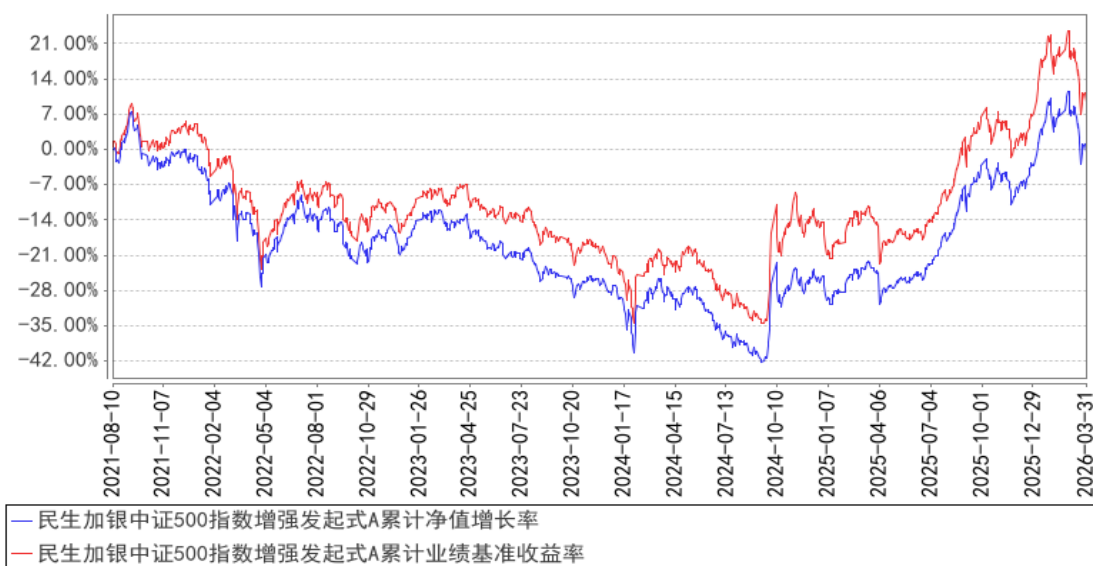
民生加银中证 500 指数增强发起式 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 2.52% | 1.49% | 1.97% | 1.59% | 0.55% | -0.10% |
| 过去六个月 | 2.50% | 1.28% | 2.69% | 1.39% | -0.19% | -0.11% |
| 过去一年 | 31.37% | 1.22% | 28.51% | 1.31% | 2.86% | -0.09% |
| 过去三年 | 15.58% | 1.29% | 19.53% | 1.36% | -3.95% | -0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | -2.00% | 1.24% | 9.29% | 1.29% | -11.29% | -0.05% |

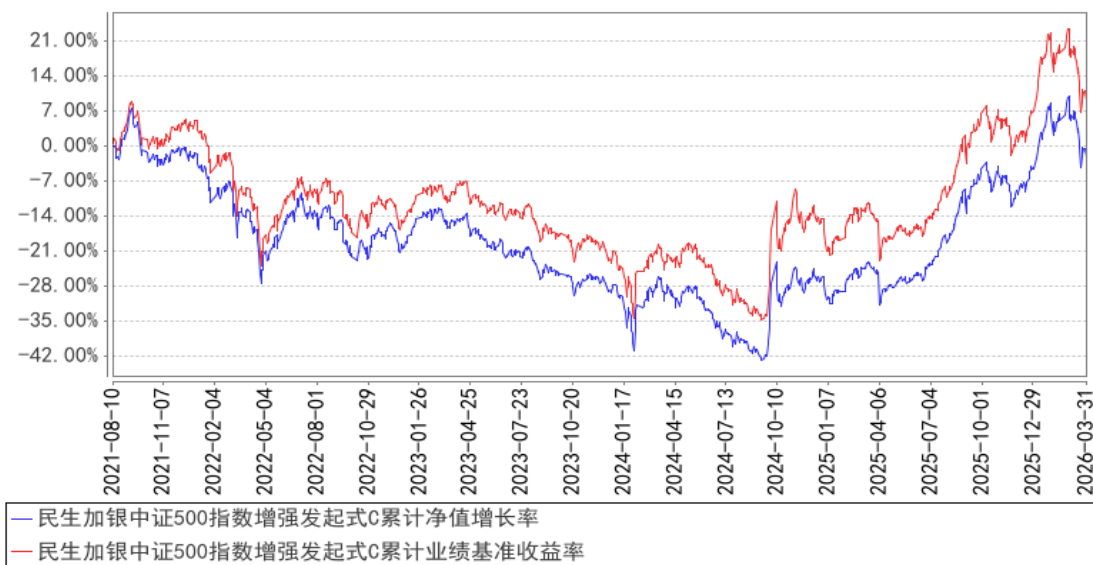
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

民生加银中证500指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



民生加银中证500指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2021 年 8 月 10 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 周帅 | 本基金基金经理 | 2023年6月20日 | - | 9年 | 南开大学数量经济学硕士。自 2017 年 7 月至 2019 年 7 月，在中信建投基金管理有限公司任产品经理助理。2019 年 7 月 |

| | | | | | |
|----|------------------|----------------|---|---|--|
| | | | | 加入民生加银基金管理有限公司，曾任 PCF 专岗、基金经理助理，现任基金经理。自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证港股通高股息精选指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银专精特新智选混合型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 6 月至今担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 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 2026 年 2 月至今担任民生加银质量领先混合型证券投资基金基金经理。自 2023 年 6 月至 2024 年 1 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。 | |
| 何江 | 本基金的基金经理、量化投资部总监 | 2025 年 6 月 6 日 | - | 21 年 | 清华大学流体力学硕士。自 2003 年 7 月至 2004 年 5 月在北京色诺芬信息服务有限公司担任合伙人、研究部负责人；自 2004 年 5 月至 2005 年 5 月在北京方速信融有限公司担任高级分析师；自 2005 年 6 月至 2005 年 11 月在金诚国际信用评估有限公司担任信用分析师；自 2005 年 11 月至 2014 年 10 月在工银瑞信基金管理有限公司担任风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管，指数投资部基金经理、副总监；自 2014 年 11 月至 2019 年 3 月在上海海狮资产管理有限公司担任投资总监、副总经理。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 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 2024 年 3 月至今担任民生加银国证 2000 指数增强型证 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 券投资基金基金经理；自 2025 年 1 月至今担任民生加银中证 A500 指数型证券投资基金基金经理；自 2025 年 3 月至今担任民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 6 月至今担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2025 年 7 月至今担任民生加银养老服务灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2025 年 10 月至今担任民生加银智选成长股票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；自 2021 年 9 月至 2024 年 10 月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 2024 年 10 月担任民生加银中证 800 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 12 月至 2025 年 2 月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 2025 年 2 月担任民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2025 年 11 月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。 |
|--|--|--|--|---|

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严

格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，市场在内部支撑与外部冲击的共同作用下，整体呈现出区间震荡、结构分化的行情特征。从主要指数表现来看，市场各核心指数普遍出现小幅收跌，但投资者交投情绪依然较为活跃，一季度全 A 日均成交量较去年四季度出现显著提升。与此同时，市场结构性分化特征较为突出，其中资源品以及部分科技细分领域的表现尤为亮眼。从市场运行的节奏来看，在春节行情的驱动下，A 股主要指数在 1 月至 2 月期间出现较为显著的上行行情；进入 3 月初，受外部冲击因素影响，投资者风险偏好有所回落，A 股市场随之跟随全球市场同步回调。整体来看，一季度主要指数整体呈现出前高后低的走势特征。

从风格层面来看，一季度市值风格仍存在一定分化，小盘风格整体继续保持着一定的超额收

益。与此同时，价值风格的表现相对成长风格更为强势，红利风格自年初以来也取得了较为不错的表现。

从行业表现来看，煤炭、石油化工、电力及公用事业、建材、电力设备及新能源等行业表现相对领先；而非银金融、消费者服务、商贸零售、计算机、农林牧渔等行业则出现较为明显的下跌。

投资策略方面，本基金作为股票型指数增强基金，基于对公司及行业基本面的持续跟踪，通过量化选股模型，从行业、规模、估值、成长、盈利、一致预期、量价指标等角度进行股票优选，并在兼顾基准指数的风险收益特征和组合风格暴露的基础下对策略进行优化，构建最终的股票投资组合，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银中证 500 指数增强发起式 A 的基金份额净值为 0.9938 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%；截至本报告期末民生加银中证 500 指数增强发起式 C 的基金份额净值为 0.9800 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.52%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 57,986,290.59 | 88.82 |
| | 其中：股票 | 57,986,290.59 | 88.82 |
| 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 | 6,865,925.75 | 10.52 |

| | | | |
|---|------|---------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 430,875.71 | 0.66 |
| 9 | 合计 | 65,283,092.05 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 227,392.00 | 0.36 |
| B | 采矿业 | 2,766,048.00 | 4.37 |
| C | 制造业 | 36,334,132.82 | 57.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,769,091.00 | 2.80 |
| E | 建筑业 | 258,320.00 | 0.41 |
| F | 批发和零售业 | 1,278,802.00 | 2.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,182,030.00 | 1.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,606,259.85 | 5.70 |
| J | 金融业 | 3,523,145.00 | 5.57 |
| K | 房地产业 | 466,445.00 | 0.74 |
| L | 租赁和商务服务业 | 404,327.00 | 0.64 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 633,516.00 | 1.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 350,040.00 | 0.55 |
| 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 | 279,723.00 | 0.44 |
| S | 综合 | 128,775.00 | 0.20 |
| | 合计 | 53,208,046.67 | 84.10 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 78,528.00 | 0.12 |
| C | 制造业 | 2,951,388.92 | 4.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 81,120.00 | 0.13 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 250,327.00 | 0.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,293.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术 | 457,500.00 | 0.72 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| | 服务业 | | |
| J | 金融业 | 661,587.00 | 1.05 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 59,792.00 | 0.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 161,292.00 | 0.25 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 70,416.00 | 0.11 |
| 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 | 4,778,243.92 | 7.55 |

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 600988 | 赤峰黄金 | 16,000 | 690,400.00 | 1.09 |
| 2 | 002281 | 光迅科技 | 6,600 | 556,380.00 | 0.88 |
| 3 | 600549 | 厦门钨业 | 10,000 | 556,200.00 | 0.88 |
| 4 | 000426 | 兴业银锡 | 13,700 | 551,014.00 | 0.87 |
| 5 | 002202 | 金风科技 | 19,000 | 499,700.00 | 0.79 |
| 6 | 000657 | 中钨高新 | 10,200 | 486,642.00 | 0.77 |
| 7 | 300373 | 扬杰科技 | 6,900 | 465,543.00 | 0.74 |
| 8 | 600499 | 科达制造 | 29,100 | 462,399.00 | 0.73 |
| 9 | 600885 | 宏发股份 | 16,460 | 456,929.60 | 0.72 |
| 10 | 603379 | 三美股份 | 7,400 | 456,062.00 | 0.72 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 002142 | 宁波银行 | 11,300 | 344,085.00 | 0.54 |
| 2 | 601869 | 长飞光纤 | 300 | 92,847.00 | 0.15 |
| 3 | 001239 | 永达股份 | 5,600 | 88,816.00 | 0.14 |
| 4 | 300502 | 新易盛 | 200 | 88,568.00 | 0.14 |
| 5 | 601677 | 明泰铝业 | 5,600 | 85,344.00 | 0.13 |

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 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 |
|-------------------|--------|--------------|--------------|---------------|-------------|
| IC2604 | IC2604 | 1 | 1,518,280.00 | -104,440.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -104,440.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 198,616.92 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -190,340.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚如下：

科达制造股份有限公司因违法违规被中国证券监督管理委员会广东监管局处罚。

除上述发行主体外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 182,193.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 248,682.11 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 430,875.71 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 民生加银中证 500 指数增强发起式 A | 民生加银中证 500 指数增强发起式 C |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 34,085,244.99 | 25,151,756.83 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 18,458,097.09 | 13,597,192.93 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 17,267,432.22 | 9,961,596.99 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 35,275,909.86 | 28,787,352.77 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 民生加银中证 500 指数增强发起式 A | 民生加银中证 500 指数增强发起式 C |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 3,307,267.26 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 3,307,267.26 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 5.16 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：基金管理人本报告期末运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|------------|
| 基金管理人自有资金 | 3,307,267.26 | 5.16 | 3,307,267.26 | 5.16 | 不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | 不少于 3 年 |

| | | | | | |
|---------|--------------|------|--------------|------|---------|
| 基金经理等人员 | 104,146.79 | 0.16 | - | - | 不少于 3 年 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | 不少于 3 年 |
| 其他 | - | - | - | - | 不少于 3 年 |
| 合计 | 3,411,414.05 | 5.33 | 3,307,267.26 | 5.16 | - |

注：本基金成立后有 10,002,500.25 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为不少于 3 年，自 2021 年 8 月 10 日起至 2024 年 8 月 10 日止。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本基金管理人发布了如下公告：

- 1 2026 年 1 月 22 日 民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告
- 2 2026 年 1 月 22 日 民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告
- 3 2026 年 3 月 30 日 民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告
- 4 2026 年 3 月 30 日 民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予基金注册的文件；
- (2) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银中证 500 指数增强型发起式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。

10.2 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。

10.3 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

2026 年 4 月 22 日