

民生加银中证全指指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：中泰证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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
§ 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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
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 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	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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 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
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
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	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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	民生加银中证全指指数增强	
基金主代码	023119	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 20 日	
基金管理人	民生加银基金管理有限公司	
基金托管人	中泰证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	19,271,693.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	民生加银中证全指指数增强 A	民生加银中证全指指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	023119	023120
报告期末下属分级 基金的份额总额	5,946,839.52 份	13,324,853.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、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。其中：1、资产配置策略。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。2、股票投资策略。本基金为股票指数增强型基金，主要利用量化选股模型，在保持对中证全指指数有效跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×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。本基金若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。同时本基金为指数增强基金，通过采用量化增强投资策略跟踪标的指数表现，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。

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		中泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘静	王秀荣
	联系电话	0755-23999841	0531-68889484
	电子邮箱	liujing@msjyfund.com.cn	wangxr01@zts.com.cn
客户服务电话		400-8888-388	95538
传真		0755-23999800	0531-68889445
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	济南市高新区经十路 7000 号汉 峪金融商务中心五区 3 号楼
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	山东省济南市经十路 7000 号汉 峪金融商务中心五区 3 号楼 35 层
邮政编码		518038	250101
法定代表人		李业弟	王洪

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.msjyfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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	民生加银基金管理有限公司	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

§ 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	民生加银中证全指指数增强 A	民生加银中证全指指数增强 C
本期已实现收益	654,812.30	2,330,698.44
本期利润	737,980.90	2,513,254.43
加权平均基金份 额本期利润	0.1368	0.1379
本期加权平均净 值利润率	10.22%	10.37%
本期基金份额净 值增长率	11.42%	11.26%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	2, 273, 449. 45	5, 023, 440. 96
期末可供分配基金份额利润	0. 3823	0. 3770
期末基金资产净值	8, 311, 543. 45	18, 551, 753. 31
期末基金份额净值	1. 3976	1. 3923
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	39. 76%	39. 23%

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

民生加银中证全指指数增强 A

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
过去三个月	10. 15%	1. 24%	11. 53%	1. 30%	-1. 38%	-0. 06%
过去六个月	11. 42%	1. 21%	10. 19%	1. 26%	1. 23%	-0. 05%
过去一年	32. 68%	1. 04%	30. 53%	1. 09%	2. 15%	-0. 05%
自基金合同生效起至今	39. 76%	0. 95%	28. 33%	1. 14%	11. 43%	-0. 19%

民生加银中证全指指数增强 C

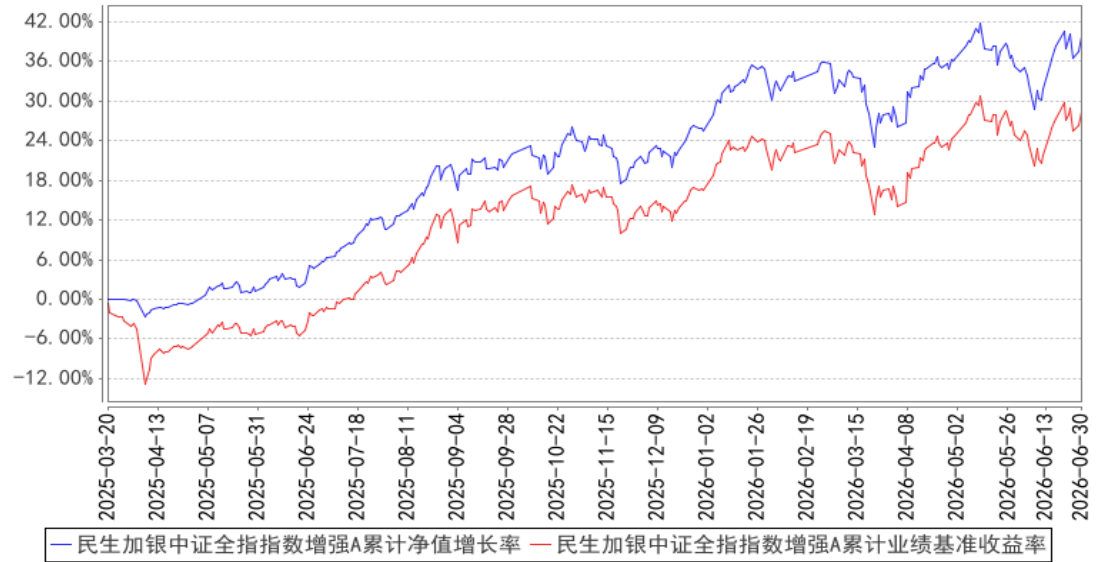
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	10.08%	1.24%	11.53%	1.30%	-1.45%	-0.06%
过去六个月	11.26%	1.21%	10.19%	1.26%	1.07%	-0.05%
过去一年	32.29%	1.04%	30.53%	1.09%	1.76%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	39.23%	0.95%	28.33%	1.14%	10.90%	-0.19%

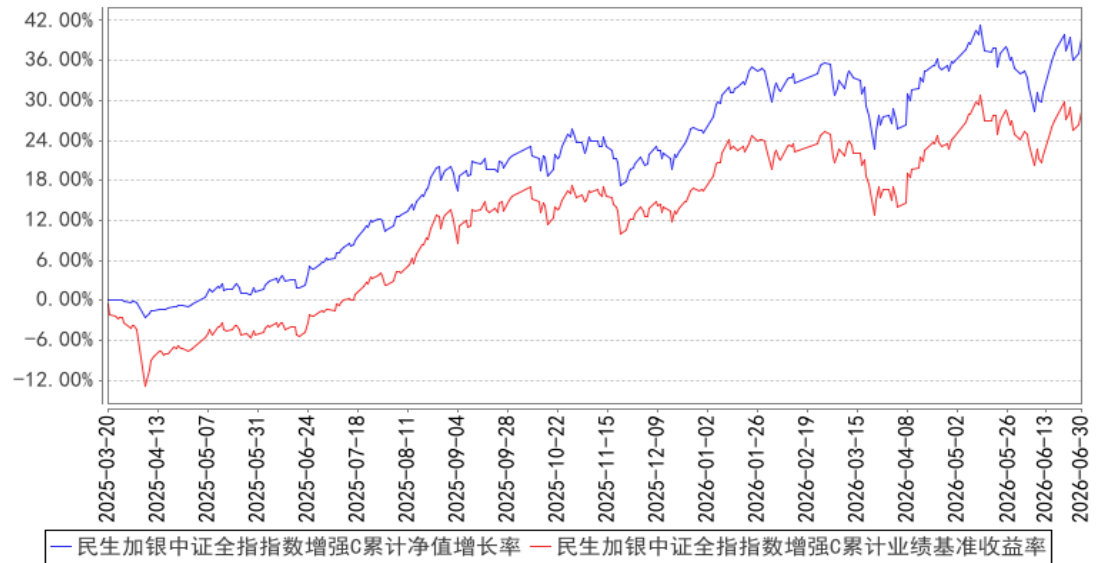
注：业绩比较基准=中证全指指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

民生加银中证全指指数增强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



民生加银中证全指指数增强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 2025 年 3 月 20 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会[2008]1187 号文批准,于 2008 年 11 月 3 日在深圳正式成立,2012 年注册资本增加至 3 亿元人民币。公司股东为中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和陕西省国际信托股份有限公司,三方股东持股比例分别为 63.33%、30%、6.67%。

截至 2026 年 6 月 30 日,公司旗下共管理 107 只基金,涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型,为投资者提供丰富的选择。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江	本基金的基金经理、量化投资部总监	2025 年 3 月 20 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 2026 年 6 月担任民生加银创业板综合指数增强型证券投资基金基金经理。自 2020 年 12 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理；自 2022 年 2 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2022 年 6 月至 2023 年 6 月担任民生加银中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；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 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

2026 年上半年，全球经济呈现“脆弱的增长”态势，地缘政治冲突加剧与贸易保护主义持续升级共同抑制增长。中东局势紧张导致国际能源价格大幅波动，全球通胀再度升温，部分国家央行已转向重新加息。主要国际机构普遍下调 2026 年经济增长预期。上半年，国内 GDP 同比增长 4.7%，经济运行总体平稳，但面临外部不确定性上升和内部结构性挑战。工业生产保持增长，出口保持强劲，新动能快速增长，高端制造业持续向好，但消费和投资增长承压，房地产市场持续调整。

2026 年上半年，万得全 A 指数上涨超过 10%。电子、通信和建材等行业涨跌幅靠前，消费者服务、综合金融和综合等行业涨跌幅靠后，成长风格占优。

报告期内，本基金根据量化多因子模型构建股票组合。组合在阿尔法因子层面上进行优化配置，并严格控制行业、市值等风险暴露，做好跟踪误差的控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末民生加银中证全指指数增强 A 的基金份额净值为 1.3976 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.42%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%；截至本报告期末民生加银中证全指指数增强 C 的基金份额净值为 1.3923 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.26%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%。

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 2026 年下半年，全球贸易环境仍面临较多不确定因素，地缘政治风险与贸易保护主义政策扰动或将持续。AI 投资热潮有望延续，算力基础设施建设、半导体周期上行和智能终端创新或

将继续为重要驱动力。国内方面，“十五五”规划开局之年政策红利将持续释放，生产好于需求、外需好于内需、新动能好于旧动能的结构性特征或将持续。中国将持续受益于 AI 技术变革浪潮下的硬件制造链的扩张。

2026 年 6 月底，中证全指的市净率在 1.9 倍水平。估值或将不是行情下一阶段的主要驱动因素，基本面和趋势因素将更占主导。

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研究人员。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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人已向中国证监会报送解决方案。

报告期内，自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§ 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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真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，认为其真实、准确和完整。

§ 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：民生加银中证全指指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,828,232.90	2,600,043.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	25,180,573.18	29,025,767.80
其中：股票投资		25,180,573.18	29,025,767.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		84,096.41	557,294.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-

资产总计		27,092,902.49	32,183,105.59
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		205,617.62	1,165,825.72
应付管理人报酬		17,268.89	22,573.14
应付托管费		2,158.63	2,821.65
应付销售服务费		4,464.89	6,902.54
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	95.70	10,150.68
负债合计		229,605.73	1,208,273.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	19,271,693.21	24,740,868.93
未分配利润	6.4.7.12	7,591,603.55	6,233,962.93
净资产合计		26,863,296.76	30,974,831.86
负债和净资产总计		27,092,902.49	32,183,105.59

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 19,271,693.21 份，其中民生加银中证全指指数增强 A 的基金份额净值为 1.3976 元，份额总额为 5,946,839.52 份；其中民生加银中证全指指数增强 C 的基金份额净值为 1.3923 元，份额总额为 13,324,853.69 份。

6.2 利润表

会计主体：民生加银中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,428,337.53	5,039,201.16
1. 利息收入		3,326.10	229,751.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,326.10	32,208.27
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		-	197,542.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,151,281.81	4,103,360.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,943,535.18	3,339,369.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	130,550.49
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	207,746.63	633,440.99
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	265,724.59	595,730.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,005.03	110,358.80
减：二、营业总支出		177,102.20	611,673.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	125,217.47	417,985.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,652.25	52,248.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	36,232.48	130,190.70
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	-	11,248.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,251,235.33	4,427,527.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,251,235.33	4,427,527.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,251,235.33	4,427,527.89

6.3 净资产变动表

会计主体：民生加银中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	24,740,868.93	-	6,233,962.93	30,974,831.86
二、本期期初净资产	24,740,868.93	-	6,233,962.93	30,974,831.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,469,175.72	-	1,357,640.62	-4,111,535.10
(一)、综合收益总额	-	-	3,251,235.33	3,251,235.33
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-5,469,175.72	-	-1,893,594.71	-7,362,770.43
其中：1. 基金申购款	24,967,491.52	-	8,208,463.29	33,175,954.81
2. 基金赎回款	-30,436,667.24	-	-10,102,058.00	-40,538,725.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	19,271,693.21	-	7,591,603.55	26,863,296.76
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2025 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,984,035.89	-	-	351,984,035.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-313,125,048.90	-	2,048,128.74	-311,076,920.16
(一)、综合收益总额	-	-	4,427,527.89	4,427,527.89
(二)、本期基金份额交易产生的	-313,125,048.9	-	-2,379,399.15	-315,504,448.05

净资产变动数 （净资产减少以 “-”号填列）	0			
其中：1. 基金申 购款	5,682,988.26	-	130,668.74	5,813,657.00
2. 基金赎 回款	-318,808,037.1 6	-	-2,510,067.89	-321,318,105.05
（三）、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动（净资 产减少以“-”号 填列）	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	38,858,986.99	-	2,048,128.74	40,907,115.73

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

基金管理人负责人

丁辉

主管会计工作负责人

蔡海峰

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银中证全指指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”、“民生加银中证全指指数增强”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予民生加银中证全指指数增强型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]1851号)准予注册，由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》、《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定发售，基金合同于 2025 年 3 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 351,984,035.89 份基金份额，上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证。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”)，基金托管人为中泰证券股份有限公司(以下简称“中泰证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证全指指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同），其他非标的指数成份股（包含主板、创业板及其他

国内依法发行上市的股票、港股通标的股票、存托凭证）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货）、货币市场工具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相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和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。本基金以标的指数（中证全指指数）成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于中证全指指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和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 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

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《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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》、中投信 (2021) 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税 [2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》、财税 [2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按

照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对本基金从上市公司、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，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。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	142,094.86
等于：本金	142,069.65
加：应计利息	25.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	1,686,138.04
等于：本金	1,686,103.94
加：应计利息	34.10
合计	1,828,232.90

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		23,981,658.21	-	25,180,573.18	1,198,914.97
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		23,981,658.21	-	25,180,573.18	1,198,914.97

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20.10

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	75.60
合计	95.70

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

民生加银中证全指指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,781,932.85	4,781,932.85
本期申购	3,972,161.58	3,972,161.58
本期赎回（以“-”号填列）	-2,807,254.91	-2,807,254.91
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	5,946,839.52	5,946,839.52

民生加银中证全指指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,958,936.08	19,958,936.08
本期申购	20,995,329.94	20,995,329.94
本期赎回（以“-”号填列）	-27,629,412.33	-27,629,412.33
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	13,324,853.69	13,324,853.69

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

民生加银中证全指指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,214,908.05	1,373.76	1,216,281.81

本期期初	1, 214, 908. 05	1, 373. 76	1, 216, 281. 81
本期利润	654, 812. 30	83, 168. 60	737, 980. 90
本期基金份额交易产生的变动数	403, 729. 10	6, 712. 12	410, 441. 22
其中：基金申购款	1, 348, 935. 42	-6, 956. 98	1, 341, 978. 44
基金赎回款	-945, 206. 32	13, 669. 10	-931, 537. 22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2, 273, 449. 45	91, 254. 48	2, 364, 703. 93

民生加银中证全指指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5, 012, 259. 97	5, 421. 15	5, 017, 681. 12
本期期初	5, 012, 259. 97	5, 421. 15	5, 017, 681. 12
本期利润	2, 330, 698. 44	182, 555. 99	2, 513, 254. 43
本期基金份额交易产生的变动数	-2, 319, 517. 45	15, 481. 52	-2, 304, 035. 93
其中：基金申购款	6, 849, 066. 51	17, 418. 34	6, 866, 484. 85
基金赎回款	-9, 168, 583. 96	-1, 936. 82	-9, 170, 520. 78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5, 023, 440. 96	203, 458. 66	5, 226, 899. 62

6. 4. 7. 13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2, 523. 41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	802. 69
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	3, 326. 10

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2, 943, 535. 18
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	2, 943, 535. 18

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	116,458,233.92
减：卖出股票成本总额	113,398,756.68
减：交易费用	115,942.06
买卖股票差价收入	2,943,535.18

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	207,746.63
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	207,746.63

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	265,724.59
股票投资	265,724.59
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	-
权证投资	-
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	265,724.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,832.83
基金转换费收入	1,172.20
合计	8,005.03

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

注：无。

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、关联关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金销售机构、基金管理人的中方投资者

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年3月20日（基金合同生效日） 至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中泰证券	49,713,531.55	22.02	922,051,740.38	75.51

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
中泰证券	-	-	202,878,609.20	97.96

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
中泰证券	-	-	763,243,000.00	86.91

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中泰证券	9,495.83	21.99	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年3月20日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中泰证券	177,277.40	75.56	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	125,217.47	417,985.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,233.35	96,569.75
应支付基金管理人的净管理费	78,984.12	321,415.92

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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,652.25	52,248.22

注：支付基金托管人中泰证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银中证全指指数增强 A	民生加银中证全指指数增强 C	合计
中国民生银行	—	2,132.25	2,132.25
中泰证券	—	8,579.03	8,579.03
合计	—	10,711.28	10,711.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	民生加银中证全指指数增强 A	民生加银中证全指指数增强 C	合计
民生加银基金公司	—	—	—
中国民生银行	—	1,713.07	1,713.07
中泰证券	—	74,390.32	74,390.32
合计	—	76,103.39	76,103.39

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。本基金 C 类基金份额支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

民生加银中证全指指数增强 C 日基金销售服务费 = 前一日 C 类份额基金资产净值 $\times$ 0.30% / 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：无。

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：无。

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：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况，于本期末及上年度末亦未持有本基金份额。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

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：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。除前述事项外，本基金本报告期内及上年度可比期间均无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：1) 本基金于本期末进行利润分配。

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

6.4.12 期末（2026 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

注：无。

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
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	200	1,980.36	1,810.00	-
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	200	66,647.04	175,906.00	-

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：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2026 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。

本基金的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。

本基金的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。本基金的货币资金存放在信用良好的金融机构，与该货币资金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的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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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：本基金于本报告期末及上年度末均未持有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未持有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

本基金的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，本基金的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。本基金所持证券均可在证券交易所或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 2026 年 06 月 30 日，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(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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金。

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，并按照合约规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 2026年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,828,173.59	-	-	-	-	59.31	1,828,232.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,180,573.18	25,180,573.18
应收申购款	-	-	-	-	-	84,096.41	84,096.41
资产总计	1,828,173.59	-	-	-	-	25,264,728.90	27,092,902.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	205,617.62	205,617.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,268.89	17,268.89
应付托管费	-	-	-	-	-	2,158.63	2,158.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,464.89	4,464.89
其他负债	-	-	-	-	-	95.70	95.70
负债总计	-	-	-	-	-	229,605.73	229,605.73
利率敏感度缺口	1,828,173.59	-	-	-	-	25,035,123.17	26,863,296.76
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,599,948.81	-	-	-	-	94.70	2,600,043.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	29,025,767.80	29,025,767.80
应收申购款	-	-	-	-	-	557,294.28	557,294.28
资产总计	2,599,948.81	-	-	-	-	29,583,156.78	32,183,105.59

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,165,825.72	1,165,825.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,573.14	22,573.14
应付托管费	-	-	-	-	-	2,821.65	2,821.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,902.54	6,902.54
其他负债	-	-	-	-	-	10,150.68	10,150.68
负债总计	-	-	-	-	-	1,208,273.73	1,208,273.73
利率敏感度缺口	2,599,948.81	-	-	-	-	28,374,883.05	30,974,831.86

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，并且本基金的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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	25,180,573.18	93.74	29,025,767.80	93.71
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	25,180,573.18	93.74	29,025,767.80	93.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	1,267,669.77	958,322.85
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-1,267,669.77	-958,322.85

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	25,002,857.18	28,947,580.80
第二层次	177,716.00	78,187.00

第三层次	-	-
合计	25,180,573.18	29,025,767.80

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 2026 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 (2025 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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 2026 年 6 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 (2025 年 12 月 31 日：无)。

§ 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	25,180,573.18	92.94
	其中：股票	25,180,573.18	92.94
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	1,828,232.90	6.75
8	其他各项资产	84,096.41	0.31
9	合计	27,092,902.49	100.00

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	-	-
B	采矿业	848,210.00	3.16
C	制造业	18,073,949.46	67.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,538.00	0.93
E	建筑业	293,055.00	1.09
F	批发和零售业	252,212.00	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	436,603.00	1.63
H	住宿和餐饮业	3,276.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,470,107.00	5.47
J	金融业	2,501,976.00	9.31
K	房地产业	95,660.00	0.36
L	租赁和商务服务业	54,867.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	513,711.72	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	265,985.00	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,520.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	78,173.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	25,152,843.18	93.63

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	27,730.00	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

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	-	-
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	27,730.00	0.10

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	300308	中际旭创	500	635,000.00	2.36
2	300750	宁德时代	1,500	589,515.00	2.19
3	300502	新易盛	660	400,620.00	1.49
4	600519	贵州茅台	300	355,647.00	1.32
5	688256	寒武纪	200	319,110.00	1.19
6	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	1.15
7	601318	中国平安	6,400	305,536.00	1.14
8	000333	美的集团	3,400	256,802.00	0.96
9	601899	紫金矿业	10,100	253,914.00	0.95
10	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.91
11	300476	胜宏科技	700	242,501.00	0.90
12	600036	招商银行	5,900	209,450.00	0.78
13	601166	兴业银行	12,300	203,688.00	0.76
14	600030	中信证券	6,900	198,237.00	0.74
15	601328	交通银行	30,700	197,401.00	0.73
16	688012	中微公司	400	187,400.00	0.70
17	603259	药明康德	1,500	186,765.00	0.70
18	600150	中国船舶	5,400	182,466.00	0.68
19	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.65
20	688981	中芯国际	1,000	158,820.00	0.59

21	002384	东山精密	600	157,410.00	0.59
22	000338	潍柴动力	5,600	152,600.00	0.57
23	002460	赣锋锂业	2,300	150,420.00	0.56
24	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.55
25	688041	海光信息	400	148,120.00	0.55
26	000776	广发证券	6,200	145,080.00	0.54
27	301308	江波龙	200	140,760.00	0.52
28	600276	恒瑞医药	2,500	130,100.00	0.48
29	600919	江苏银行	11,900	128,282.00	0.48
30	600183	生益科技	700	121,380.00	0.45
31	300857	协创数据	340	115,566.00	0.43
32	601138	工业富联	1,600	115,440.00	0.43
33	300394	天孚通信	380	115,018.40	0.43
34	300390	天华新能	1,200	112,212.00	0.42
35	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.41
36	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.41
37	600028	中国石化	24,000	107,040.00	0.40
38	002475	立讯精密	1,500	105,600.00	0.39
39	300059	东方财富	5,100	103,938.00	0.39
40	688167	炬光科技	290	102,720.90	0.38
41	300223	北京君正	400	99,560.00	0.37
42	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.37
43	300033	同花顺	410	98,810.00	0.37
44	300014	亿纬锂能	1,500	97,545.00	0.36
45	600104	上汽集团	9,900	96,624.00	0.36
46	600019	宝钢股份	17,600	95,568.00	0.36
47	300274	阳光电源	600	95,412.00	0.36
48	300681	英搏尔	3,200	91,584.00	0.34
49	600887	伊利股份	3,800	91,048.00	0.34
50	688120	华海清科	280	90,210.40	0.34
51	000651	格力电器	2,400	90,000.00	0.34
52	000922	佳电股份	6,400	89,344.00	0.33
53	002371	北方华创	100	88,456.00	0.33
54	600801	华新建材	5,400	84,240.00	0.31
55	300408	三环集团	500	83,450.00	0.31
56	688343	云天励飞	1,000	81,660.00	0.30
57	688110	东芯股份	400	81,480.00	0.30
58	603256	宏和科技	300	79,599.00	0.30
59	688271	联影医疗	778	78,756.94	0.29
60	601211	国泰海通	4,200	76,440.00	0.28
61	002463	沪电股份	500	76,400.00	0.28
62	002240	盛新锂能	1,700	76,211.00	0.28
63	688073	毕得医药	1,396	75,132.72	0.28

64	002008	大族激光	500	75,055.00	0.28
65	002283	天润工业	7,700	74,305.00	0.28
66	300037	新宙邦	800	74,280.00	0.28
67	000858	五 粮 液	1,000	74,000.00	0.28
68	601872	招商轮船	4,200	73,794.00	0.27
69	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.27
70	688416	恒烁股份	520	72,800.00	0.27
71	603679	华体科技	3,600	72,648.00	0.27
72	601601	中国太保	2,500	71,300.00	0.27
73	603991	领先股份	500	70,575.00	0.26
74	300619	金银河	2,210	68,753.10	0.26
75	601995	中金公司	1,900	68,685.00	0.26
76	300604	长川科技	200	68,284.00	0.25
77	301191	菲菱科思	600	68,130.00	0.25
78	002756	永兴材料	1,200	67,968.00	0.25
79	300748	金力永磁	2,200	67,870.00	0.25
80	688062	迈威生物	2,400	67,800.00	0.25
81	688678	福立旺	2,800	67,676.00	0.25
82	688559	海目星	800	67,136.00	0.25
83	301087	可孚医疗	1,400	66,710.00	0.25
84	300438	鹏辉能源	800	66,280.00	0.25
85	000810	创维数字	4,900	64,925.00	0.24
86	301536	星辰科技	500	64,355.00	0.24
87	301281	科源制药	1,300	64,090.00	0.24
88	000960	锡业股份	1,500	64,035.00	0.24
89	601878	浙商证券	6,700	63,650.00	0.24
90	002414	高德红外	4,800	63,648.00	0.24
91	301357	北方长龙	800	63,272.00	0.24
92	688779	五矿新能	7,800	63,258.00	0.24
93	300323	华灿光电	3,100	63,240.00	0.24
94	300277	汽轮科技	4,200	63,168.00	0.24
95	688097	博众精工	1,000	63,050.00	0.23
96	002080	中材科技	700	63,000.00	0.23
97	688046	药康生物	2,600	62,920.00	0.23
98	601766	中国中车	12,100	62,920.00	0.23
99	002805	丰元股份	2,200	62,898.00	0.23
100	301086	鸿富瀚	300	62,784.00	0.23
101	002266	浙富控股	12,400	62,744.00	0.23
102	300207	欣旺达	3,300	62,667.00	0.23
103	002906	华阳集团	2,500	62,400.00	0.23
104	000155	川能动力	5,200	62,296.00	0.23
105	300858	科拓生物	4,100	62,279.00	0.23
106	002389	航天彩虹	3,500	62,195.00	0.23

107	301421	波长光电	600	62,130.00	0.23
108	002405	四维图新	9,600	62,112.00	0.23
109	688609	九联科技	5,600	61,656.00	0.23
110	300098	高新兴	13,400	61,506.00	0.23
111	300602	飞荣达	1,200	61,440.00	0.23
112	002050	三花智控	1,400	61,362.00	0.23
113	000581	威孚高科	3,600	61,272.00	0.23
114	000967	盈峰环境	5,800	61,074.00	0.23
115	301510	固高科技	1,900	60,667.00	0.23
116	002191	劲嘉股份	15,500	60,605.00	0.23
117	603776	永安行	2,900	60,523.00	0.23
118	300443	金雷股份	2,800	60,424.00	0.22
119	600323	瀚蓝环境	2,200	60,412.00	0.22
120	300291	百纳千成	12,500	60,375.00	0.22
121	600110	诺德股份	4,000	60,360.00	0.22
122	688084	晶品特装	1,200	60,336.00	0.22
123	603218	日月股份	5,900	60,298.00	0.22
124	600072	中船科技	7,100	60,279.00	0.22
125	000917	电广传媒	9,000	60,210.00	0.22
126	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.22
127	002516	旷达科技	10,700	59,706.00	0.22
128	003022	联泓新科	2,300	59,570.00	0.22
129	601069	西部黄金	2,700	59,400.00	0.22
130	600971	恒源煤电	8,600	59,340.00	0.22
131	603507	振江股份	1,800	59,202.00	0.22
132	600026	中远海能	3,300	59,202.00	0.22
133	600195	中牧股份	10,000	59,000.00	0.22
134	300664	鹏鹞环保	13,900	58,936.00	0.22
135	001266	宏英智能	1,200	58,920.00	0.22
136	000552	甘肃能化	26,300	58,912.00	0.22
137	600031	三一重工	3,400	58,752.00	0.22
138	600428	中远海特	7,500	58,575.00	0.22
139	002154	报喜鸟	16,400	58,384.00	0.22
140	002641	公元股份	15,100	58,286.00	0.22
141	301296	新巨丰	9,900	58,212.00	0.22
142	002838	道恩股份	1,900	58,178.00	0.22
143	603276	恒兴新材	3,800	58,178.00	0.22
144	688530	欧莱新材	600	58,140.00	0.22
145	002702	海欣食品	13,000	57,850.00	0.22
146	301392	汇成真空	200	57,728.00	0.21
147	002440	闰土股份	5,600	57,400.00	0.21
148	300765	石药创新	2,100	57,183.00	0.21
149	300227	光韵达	4,800	57,120.00	0.21

150	300930	屹通新材	2,000	57,000.00	0.21
151	301219	腾远钴业	1,040	56,992.00	0.21
152	300008	天海防务	9,200	55,752.00	0.21
153	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.21
154	000988	华工科技	300	55,383.00	0.21
155	002312	川发龙蟒	6,000	55,020.00	0.20
156	600309	万华化学	800	54,728.00	0.20
157	600487	亨通光电	500	54,670.00	0.20
158	601088	中国神华	1,400	54,656.00	0.20
159	000792	盐湖股份	1,800	54,342.00	0.20
160	603629	利通电子	300	53,643.00	0.20
161	688700	东威科技	600	53,640.00	0.20
162	603019	中科曙光	500	53,615.00	0.20
163	603030	全筑股份	26,800	53,332.00	0.20
164	301358	湖南裕能	700	53,109.00	0.20
165	002738	中矿资源	900	53,091.00	0.20
166	300124	汇川技术	800	53,064.00	0.20
167	601398	工商银行	7,500	53,025.00	0.20
168	002028	思源电气	300	51,900.00	0.19
169	688001	华兴源创	600	51,420.00	0.19
170	688235	百济神州	200	50,922.00	0.19
171	601061	中信金属	4,700	50,619.00	0.19
172	603061	金海通	100	50,222.00	0.19
173	300136	信维通信	400	47,700.00	0.18
174	001389	广合科技	200	47,450.00	0.18
175	601688	华泰证券	2,300	47,426.00	0.18
176	688180	君实生物	1,400	47,348.00	0.18
177	688036	传音控股	800	47,160.00	0.18
178	002653	海思科	700	46,438.00	0.17
179	002532	天山铝业	4,300	46,139.00	0.17
180	601077	渝农商行	7,500	45,825.00	0.17
181	603035	常熟汽饰	4,300	45,666.00	0.17
182	600775	南京熊猫	4,700	44,932.00	0.17
183	605289	罗曼股份	300	43,500.00	0.16
184	688111	金山办公	200	42,610.00	0.16
185	600233	圆通速递	2,700	42,525.00	0.16
186	000100	TCL 科技	7,200	41,904.00	0.16
187	002142	宁波银行	1,400	41,566.00	0.15
188	601288	农业银行	6,800	41,276.00	0.15
189	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.15
190	002415	海康威视	1,200	41,040.00	0.15
191	300760	迈瑞医疗	300	40,749.00	0.15
192	002487	大金重工	700	40,579.00	0.15

193	601699	潞安环能	2,800	39,984.00	0.15
194	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.15
195	605111	新洁能	400	39,656.00	0.15
196	688628	优利德	400	39,576.00	0.15
197	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.15
198	003816	中国广核	9,900	38,709.00	0.14
199	000657	中钨高新	400	38,288.00	0.14
200	000001	平安银行	3,800	38,190.00	0.14
201	601668	中国建筑	8,700	37,758.00	0.14
202	601009	南京银行	3,800	37,582.00	0.14
203	300433	蓝思科技	700	37,562.00	0.14
204	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.14
205	601985	中国核电	4,100	37,023.00	0.14
206	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.14
207	600498	烽火通信	500	36,800.00	0.14
208	002466	天齐锂业	600	36,792.00	0.14
209	688472	阿特斯	3,400	36,788.00	0.14
210	301297	富乐德	600	36,744.00	0.14
211	600176	中国巨石	500	36,440.00	0.14
212	603931	格林达	600	35,640.00	0.13
213	301045	天禄科技	400	35,632.00	0.13
214	301328	维峰电子	500	35,600.00	0.13
215	601108	财通证券	4,100	35,465.00	0.13
216	601208	东材科技	500	35,395.00	0.13
217	600938	中国海油	1,300	35,295.00	0.13
218	000703	恒逸石化	2,600	35,282.00	0.13
219	600050	中国联通	8,800	35,200.00	0.13
220	688388	嘉元科技	800	35,200.00	0.13
221	601857	中国石油	4,000	34,720.00	0.13
222	601225	陕西煤业	1,700	34,595.00	0.13
223	601658	邮储银行	7,000	34,510.00	0.13
224	600489	中金黄金	1,900	34,295.00	0.13
225	300853	申昊科技	1,100	33,979.00	0.13
226	605196	华通线缆	1,300	33,930.00	0.13
227	601818	光大银行	11,700	33,813.00	0.13
228	002643	万润股份	1,600	33,520.00	0.12
229	002851	麦格米特	200	33,436.00	0.12
230	002972	科安达	1,700	33,252.00	0.12
231	002236	大华股份	2,000	32,980.00	0.12
232	601012	隆基绿能	2,500	32,800.00	0.12
233	600392	盛和资源	1,100	32,747.00	0.12
234	688081	兴图新科	800	32,704.00	0.12
235	301526	国际复材	700	32,669.00	0.12

236	600690	海尔智家	1,600	32,656.00	0.12
237	603223	恒通股份	2,500	32,625.00	0.12
238	601877	正泰电器	1,300	32,591.00	0.12
239	600989	宝丰能源	1,600	32,528.00	0.12
240	600884	杉杉股份	2,400	32,520.00	0.12
241	688620	安凯微	2,000	32,400.00	0.12
242	603092	德力佳	600	32,382.00	0.12
243	688045	必易微	400	32,312.00	0.12
244	000783	长江证券	3,300	32,175.00	0.12
245	001979	招商蛇口	5,000	32,150.00	0.12
246	688435	英方软件	1,000	32,000.00	0.12
247	002273	水晶光电	900	31,932.00	0.12
248	600641	先导基电	800	31,888.00	0.12
249	601456	国联民生	3,600	31,824.00	0.12
250	688236	春立医疗	2,200	31,812.00	0.12
251	002245	蔚蓝锂芯	1,700	31,807.00	0.12
252	300567	精测电子	100	31,760.00	0.12
253	601788	光大证券	2,200	31,746.00	0.12
254	601126	四方股份	500	31,600.00	0.12
255	002079	苏州固锔	2,100	31,563.00	0.12
256	601677	明泰铝业	1,900	31,540.00	0.12
257	600497	驰宏锌锗	2,600	31,486.00	0.12
258	300740	水羊股份	1,700	31,297.00	0.12
259	688653	康希通信	1,800	31,284.00	0.12
260	002001	新 和 成	1,100	31,262.00	0.12
261	002352	顺丰控股	1,000	31,260.00	0.12
262	000951	中国重汽	1,600	31,216.00	0.12
263	300358	楚天科技	3,900	31,200.00	0.12
264	002454	松芝股份	6,520	31,165.60	0.12
265	002120	韵达股份	4,900	31,164.00	0.12
266	688398	赛特新材	1,200	31,092.00	0.12
267	002057	中钢天源	2,500	31,075.00	0.12
268	600741	华域汽车	2,000	31,040.00	0.12
269	688581	安杰思	600	31,026.00	0.12
270	002379	宏桥控股	2,100	31,017.00	0.12
271	301632	广东建科	2,000	30,960.00	0.12
272	001314	亿道信息	500	30,900.00	0.12
273	000932	华菱钢铁	8,900	30,883.00	0.11
274	002271	东方雨虹	2,600	30,862.00	0.11
275	002237	恒邦股份	2,100	30,849.00	0.11
276	002768	国恩股份	592	30,819.52	0.11
277	601000	唐山港	7,400	30,710.00	0.11
278	601156	东航物流	1,900	30,628.00	0.11

279	603519	立霸股份	2,000	30,600.00	0.11
280	688372	伟测科技	164	30,504.00	0.11
281	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.11
282	002025	航天电器	400	30,488.00	0.11
283	002134	天津普林	1,000	30,420.00	0.11
284	002947	恒铭达	400	30,420.00	0.11
285	301280	珠城科技	600	30,342.00	0.11
286	688683	莱尔科技	800	30,336.00	0.11
287	000682	东方电子	2,400	30,312.00	0.11
288	002488	金固股份	3,400	30,294.00	0.11
289	600660	福耀玻璃	600	30,264.00	0.11
290	688156	路德科技	1,000	30,250.00	0.11
291	300999	金龙鱼	1,300	30,238.00	0.11
292	002918	蒙娜丽莎	3,000	30,150.00	0.11
293	603833	欧派家居	1,000	30,110.00	0.11
294	300938	信测标准	600	29,928.00	0.11
295	301057	汇隆新材	1,300	29,900.00	0.11
296	603990	麦迪科技	1,400	29,806.00	0.11
297	300606	金太阳	700	29,792.00	0.11
298	688575	亚辉龙	3,400	29,784.00	0.11
299	601155	新城控股	2,900	29,754.00	0.11
300	688101	三达膜	1,800	29,754.00	0.11
301	605117	德业股份	280	29,730.40	0.11
302	600894	广日股份	3,900	29,718.00	0.11
303	300439	美康生物	3,700	29,711.00	0.11
304	301273	瑞晨环保	940	29,619.40	0.11
305	600502	安徽建工	6,800	29,580.00	0.11
306	600098	广州发展	5,000	29,550.00	0.11
307	301295	美硕科技	700	29,526.00	0.11
308	301189	奥尼电子	500	29,465.00	0.11
309	002541	鸿路钢构	1,700	29,444.00	0.11
310	688096	京源环保	2,200	29,392.00	0.11
311	000683	博源化工	5,100	29,376.00	0.11
312	300478	杭州高新	800	29,352.00	0.11
313	300371	汇中股份	3,000	29,340.00	0.11
314	603933	睿能科技	1,300	29,315.00	0.11
315	003012	东鹏控股	6,700	29,212.00	0.11
316	002545	东方铁塔	1,800	29,196.00	0.11
317	600606	绿地控股	24,000	29,040.00	0.11
318	600295	鄂尔多斯	2,700	28,944.00	0.11
319	600827	百联股份	3,900	28,899.00	0.11
320	600909	华安证券	2,600	28,886.00	0.11
321	301006	迈拓股份	2,300	28,865.00	0.11

322	301190	善水科技	1,800	28,854.00	0.11
323	601107	四川成渝	5,900	28,792.00	0.11
324	000421	南京公用	5,800	28,768.00	0.11
325	301072	中捷精工	700	28,707.00	0.11
326	600883	博闻科技	4,100	28,700.00	0.11
327	000599	青岛双星	6,800	28,696.00	0.11
328	600841	动力新科	4,700	28,670.00	0.11
329	603205	健尔康	1,400	28,644.00	0.11
330	000301	东方盛虹	2,500	28,625.00	0.11
331	301371	敷尔佳	1,100	28,600.00	0.11
332	002151	北斗星通	900	28,575.00	0.11
333	301172	君逸数码	1,100	28,545.00	0.11
334	002763	汇洁股份	4,200	28,518.00	0.11
335	301075	多瑞医药	500	28,505.00	0.11
336	001323	慕思股份	1,800	28,440.00	0.11
337	605180	华生科技	2,400	28,440.00	0.11
338	002803	吉宏股份	1,100	28,424.00	0.11
339	301372	科净源	900	28,359.00	0.11
340	603150	万朗磁塑	400	28,320.00	0.11
341	601598	中国外运	5,700	28,272.00	0.11
342	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.11
343	605186	健麾信息	900	28,224.00	0.11
344	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.10
345	001311	多利科技	1,720	27,743.60	0.10
346	300700	岱勒新材	1,300	27,664.00	0.10
347	600562	国睿科技	1,300	27,586.00	0.10
348	001373	翔腾新材	900	27,135.00	0.10
349	603919	金徽酒	1,800	27,090.00	0.10
350	301353	普莱得	1,620	26,908.20	0.10
351	688710	益诺思	400	26,880.00	0.10
352	300395	菲利华	200	26,746.00	0.10
353	300953	震裕科技	200	26,740.00	0.10
354	603059	倍加洁	1,100	26,675.00	0.10
355	688183	生益电子	200	26,480.00	0.10
356	688060	云涌科技	800	26,312.00	0.10
357	688275	万润新能	200	25,510.00	0.09
358	600292	电投水电	2,100	25,284.00	0.09
359	001359	平安电工	200	25,050.00	0.09
360	300442	润泽科技	300	24,921.00	0.09
361	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.09
362	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.09
363	603317	天味食品	1,900	24,719.00	0.09
364	601127	赛力斯	400	24,500.00	0.09

365	002497	雅化集团	1,200	24,444.00	0.09
366	301021	英诺激光	200	24,380.00	0.09
367	688309	恒誉环保	400	24,352.00	0.09
368	301329	信音电子	1,000	24,290.00	0.09
369	601998	中信银行	3,500	24,255.00	0.09
370	603799	华友钴业	500	24,130.00	0.09
371	688126	沪硅产业	600	23,934.00	0.09
372	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.09
373	688777	中控技术	200	23,500.00	0.09
374	600511	国药股份	900	23,436.00	0.09
375	603288	海天味业	700	23,212.00	0.09
376	301002	崧盛股份	600	23,160.00	0.09
377	603659	璞泰来	800	23,144.00	0.09
378	000938	紫光股份	800	23,088.00	0.09
379	603826	坤彩科技	900	23,004.00	0.09
380	603190	亚通精工	1,000	22,620.00	0.08
381	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.08
382	688323	瑞华泰	400	22,600.00	0.08
383	603366	日出东方	3,100	22,537.00	0.08
384	603186	华正新材	100	22,530.00	0.08
385	000807	云铝股份	1,000	22,140.00	0.08
386	300270	中威电子	1,700	22,117.00	0.08
387	601390	中国中铁	5,300	22,101.00	0.08
388	301265	华新科技	800	22,040.00	0.08
389	300058	蓝色光标	1,600	22,016.00	0.08
390	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.08
391	601607	上海医药	1,400	21,560.00	0.08
392	301170	锡南科技	1,000	21,510.00	0.08
393	688213	思特威	200	21,414.00	0.08
394	600879	航天电子	1,000	21,290.00	0.08
395	301502	华阳智能	300	20,856.00	0.08
396	600418	江淮汽车	800	20,664.00	0.08
397	000715	中兴商业	4,400	20,416.00	0.08
398	300450	先导智能	500	20,360.00	0.08
399	688677	海泰新光	200	20,226.00	0.08
400	688396	华润微	200	19,510.00	0.07
401	688469	芯联集成	1,800	19,098.00	0.07
402	603032	德新科技	700	18,830.00	0.07
403	600585	海螺水泥	1,100	18,645.00	0.07
404	300346	南大光电	200	18,530.00	0.07
405	688035	德邦科技	200	18,360.00	0.07
406	300803	指南针	200	18,334.00	0.07
407	002027	分众传媒	3,700	17,908.00	0.07

408	688232	新点软件	1,000	17,780.00	0.07
409	601169	北京银行	3,600	17,640.00	0.07
410	000032	深桑达 A	700	17,465.00	0.07
411	688599	天合光能	1,200	16,944.00	0.06
412	002602	世纪华通	1,200	16,920.00	0.06
413	002558	巨人网络	600	16,536.00	0.06
414	300015	爱尔眼科	2,000	16,520.00	0.06
415	600118	中国卫星	200	16,410.00	0.06
416	600547	山东黄金	700	16,163.00	0.06
417	300418	昆仑万维	400	16,144.00	0.06
418	600066	宇通客车	600	16,086.00	0.06
419	300613	富瀚微	200	16,016.00	0.06
420	600900	长江电力	600	15,882.00	0.06
421	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.06
422	603816	顾家家居	700	15,652.00	0.06
423	603406	天富龙	600	15,570.00	0.06
424	603868	飞科电器	500	15,400.00	0.06
425	600826	兰生股份	1,700	14,943.00	0.06
426	300072	海新能科	4,300	14,620.00	0.05
427	002966	苏州银行	2,100	14,616.00	0.05
428	600438	通威股份	1,200	14,532.00	0.05
429	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.05
430	603298	杭叉集团	600	14,316.00	0.05
431	300017	网宿科技	1,100	14,311.00	0.05
432	300458	全志科技	360	14,205.60	0.05
433	600141	兴发集团	300	14,091.00	0.05
434	300115	长盈精密	500	13,970.00	0.05
435	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.05
436	688187	时代电气	200	13,732.00	0.05
437	300414	中光防雷	1,200	13,224.00	0.05
438	600833	第一医药	1,400	12,628.00	0.05
439	300322	硕贝德	500	12,600.00	0.05
440	688122	西部超导	200	12,562.00	0.05
441	300496	中科创达	200	12,358.00	0.05
442	603993	洛阳钼业	700	12,285.00	0.05
443	300474	景嘉微	200	12,096.00	0.05
444	300316	晶盛机电	200	12,080.00	0.04
445	603979	金诚信	200	11,806.00	0.04
446	002722	物产金轮	1,000	11,790.00	0.04
447	301122	采纳股份	400	11,764.00	0.04
448	603110	东方材料	500	11,585.00	0.04
449	300759	康龙化成	400	11,572.00	0.04
450	002128	电投能源	500	11,560.00	0.04

451	300339	润和软件	300	11,553.00	0.04
452	600029	南方航空	2,200	11,396.00	0.04
453	002555	三七互娱	600	11,322.00	0.04
454	688218	江苏北人	200	10,992.00	0.04
455	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.04
456	300054	鼎龙股份	100	10,597.00	0.04
457	002709	天赐材料	200	10,286.00	0.04
458	601111	中国国航	1,700	10,285.00	0.04
459	688114	华大智造	200	10,216.00	0.04
460	000975	山金国际	600	10,200.00	0.04
461	002078	太阳纸业	800	9,992.00	0.04
462	601231	环旭电子	300	9,720.00	0.04
463	300024	机器人	500	9,665.00	0.04
464	300073	当升科技	200	9,608.00	0.04
465	300347	泰格医药	200	9,600.00	0.04
466	688065	凯赛生物	200	9,570.00	0.04
467	300255	常山药业	400	9,368.00	0.03
468	300762	上海瀚讯	200	9,130.00	0.03
469	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.03
470	603049	中策橡胶	200	8,962.00	0.03
471	000895	双汇发展	400	8,960.00	0.03
472	300844	山水比德	400	8,884.00	0.03
473	002049	紫光国微	100	8,875.00	0.03
474	300918	南山智尚	800	8,576.00	0.03
475	688223	晶科能源	1,800	8,550.00	0.03
476	301236	软通动力	200	8,490.00	0.03
477	688728	格科微	400	8,416.00	0.03
478	600060	海信视像	300	8,361.00	0.03
479	688297	中无人机	200	8,310.00	0.03
480	688568	中科星图	200	8,294.00	0.03
481	000589	贵州轮胎	2,000	8,120.00	0.03
482	603511	爱慕股份	700	8,050.00	0.03
483	601777	千里科技	900	7,344.00	0.03
484	600298	安琪酵母	200	7,240.00	0.03
485	300364	中文在线	300	7,077.00	0.03
486	300724	捷佳伟创	100	7,060.00	0.03
487	300002	神州泰岳	900	7,029.00	0.03
488	300251	光线传媒	600	6,654.00	0.02
489	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.02
490	002517	恺英网络	400	6,500.00	0.02
491	600612	老凤祥	200	6,430.00	0.02
492	601881	中国银河	500	6,285.00	0.02
493	001287	中电港	200	6,230.00	0.02

494	601577	长沙银行	700	6,097.00	0.02
495	601918	新集能源	700	6,013.00	0.02
496	000830	鲁西化工	500	6,000.00	0.02
497	300003	乐普医疗	500	5,925.00	0.02
498	300122	智飞生物	500	5,845.00	0.02
499	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.02
500	600901	江苏金租	1,000	5,750.00	0.02
501	688538	和辉光电	2,200	5,720.00	0.02
502	600398	海澜之家	1,000	5,230.00	0.02
503	601665	齐鲁银行	900	5,193.00	0.02
504	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.02
505	002831	裕同科技	140	4,978.40	0.02
506	300106	西部牧业	500	4,920.00	0.02
507	301638	南网数字	200	4,810.00	0.02
508	688009	中国通号	1,000	4,760.00	0.02
509	300413	芒果超媒	300	4,389.00	0.02
510	601666	平煤股份	600	4,290.00	0.02
511	300144	宋城演艺	700	4,067.00	0.02
512	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.01
513	600389	江山股份	200	3,904.00	0.01
514	603127	昭衍新药	100	3,822.00	0.01
515	603619	中曼石油	200	3,742.00	0.01
516	688303	大全能源	200	3,486.00	0.01
517	600391	航发科技	100	3,345.00	0.01
518	002922	伊戈尔	100	3,280.00	0.01
519	600258	首旅酒店	300	3,276.00	0.01
520	688349	三一重能	200	3,036.00	0.01
521	000528	柳 工	400	3,020.00	0.01
522	688681	科汇股份	200	2,796.00	0.01
523	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.01
524	300129	泰胜风能	300	2,565.00	0.01
525	300569	天能重工	500	2,410.00	0.01
526	002832	比音勒芬	100	2,064.00	0.01
527	688616	西力科技	200	2,020.00	0.01
528	000680	山推股份	200	2,010.00	0.01
529	600578	京能电力	300	1,935.00	0.01
530	603506	南都物业	200	1,868.00	0.01
531	601369	陕鼓动力	200	1,810.00	0.01
532	000600	建投能源	200	1,750.00	0.01
533	601600	中国铝业	200	1,644.00	0.01
534	002345	潮宏基	100	917.00	0.00

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	688775	影石创新	200	27,730.00	0.10

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	601318	中国平安	606,579.00	1.96
2	600150	中国船舶	564,942.00	1.82
3	688256	寒武纪	524,570.00	1.69
4	300750	宁德时代	515,390.00	1.66
5	601899	紫金矿业	515,205.00	1.66
6	601328	交通银行	484,785.00	1.57
7	603259	药明康德	483,173.00	1.56
8	603986	兆易创新	472,330.00	1.52
9	300308	中际旭创	465,970.00	1.50
10	601166	兴业银行	453,305.00	1.46
11	600028	中国石化	418,956.00	1.35
12	601600	中国铝业	417,429.00	1.35
13	600519	贵州茅台	414,035.00	1.34
14	002475	立讯精密	407,481.00	1.32
15	000333	美的集团	378,770.00	1.22
16	600036	招商银行	372,420.00	1.20
17	600104	上汽集团	370,832.00	1.20
18	688073	毕得医药	370,360.00	1.20
19	002460	赣锋锂业	365,723.00	1.18
20	688008	澜起科技	351,958.00	1.14

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	601899	紫金矿业	700,767.00	2.26
2	603259	药明康德	641,470.41	2.07
3	688256	寒武纪	580,400.00	1.87
4	300308	中际旭创	563,976.00	1.82
5	600036	招商银行	546,891.00	1.77
6	000333	美的集团	532,626.60	1.72
7	601318	中国平安	522,342.00	1.69
8	002475	立讯精密	517,720.00	1.67
9	603986	兆易创新	508,132.00	1.64
10	300750	宁德时代	498,657.00	1.61

11	601600	中国铝业	488,104.00	1.58
12	601166	兴业银行	446,804.00	1.44
13	600519	贵州茅台	411,686.00	1.33
14	601939	建设银行	387,779.00	1.25
15	300502	新易盛	385,907.00	1.25
16	601328	交通银行	376,761.00	1.22
17	600150	中国船舶	372,048.99	1.20
18	688073	毕得医药	361,613.89	1.17
19	600690	海尔智家	355,039.00	1.15
20	601138	工业富联	354,812.00	1.15

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	109,287,837.47
卖出股票收入（成交）总额	116,458,233.92

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。

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。

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。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：无。

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本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	84,096.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,096.41

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

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。

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

份额单位：份

份额级别	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 (%)
民生加银 中证全指 指数增强 A	360	16,519.00	—	—	5,946,839.52	100.00
民生加银 中证全指 指数增强 C	717	18,584.18	340,042.50	2.55	12,984,811.19	97.45
合计	1,077	17,893.87	340,042.50	1.76	18,931,650.71	98.24

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	民生加银中证全指指数增强 A	32,951.95	0.5541
	民生加银中证全指指数增强 C	42,027.44	0.3154
	合计	74,979.39	0.3891

8.3 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	份额级别	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	民生加银中证全指指数增强 A	0~10
	民生加银中证全指指数增强	0

基金	C	
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	民生加银中证全指指数增强 A	0~10
	民生加银中证全指指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	民生加银中证全指指数增强 A	民生加银中证全指指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 3 月 20 日) 基金份额总额	53,583,834.43	298,400,201.46
本报告期期初基金份 额总额	4,781,932.85	19,958,936.08
本报告期基金总申购 份额	3,972,161.58	20,995,329.94
减：本报告期基金总 赎回份额	2,807,254.91	27,629,412.33
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	5,946,839.52	13,324,853.69

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

- 1、本基金管理人于 2026 年 1 月 22 日披露了《民生加银基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，会议审议《关于持续运作民生加银中证全指指数增强型证券投资基金的议案》。

2、本基金管理人于 2026 年 2 月 28 日披露了《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会参会情况统计结果的公告》，本次基金份额持有人大会未达到《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》关于“以通讯方式召开基金份额持有人大会”的有效开会条件。

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

报告期内，基金管理人、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、公募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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
联储证券	2	127,027,713.04	56.27	24,279.58	56.21	-
中泰证券	3	49,713,531.55	22.02	9,495.83	21.99	-
财通证券	3	49,004,826.80	21.71	9,415.86	21.80	-

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本基金使用证券公司交易结算模式。本期选择中泰证券、联储证券、财通证券作为证券经纪商。

②本基金管理人负责选择证券公司，选择标准如下：

i 具备证券经纪业务资格；

- ii 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- 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，具备完善的风险管理与健全的内部控制制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；
- v 最近两年未发生重大风险、最近三年无重大违法违规记录且未处于立案调查过程中；
- vi 具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合处理投资组合进行证券交易的要求，并能为基金公司投资提供全面的信息服务。

③基金的证券公司选择程序如下：

- i 本基金管理人根据上述标准建立券商准入评价流程，通过实施充分的业务隔离机制，依据评价得分结果，确定拟准入的证券公司；
- ii 本基金管理人与准入证券公司签署证券经纪服务协议，并按公司制度对合作券商进行定期评价及动态管理。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
联储证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于以通讯开会方式召开民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	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	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
4	关于以通讯开会方式召开民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 23 日
5	关于以通讯开会方式召开民生加银中	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 24 日

	证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
6	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会参会情况统计结果的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 28 日
7	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 20 日
8	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2026 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 20 日
9	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 20 日
10	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	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 30 日
11	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 30 日
12	民生加银中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
13	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
14	民生加银基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级划分规则及公募基金产品风险等级评定结果的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 29 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

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。

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) 《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- (3) 《民生加银中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《民生加银中证全指指数增强型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

2026 年 8 月 31 日