

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  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	38

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 .....	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>43</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 .....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	生物科技 ETF 基金
场内简称	生科 ETF
基金主代码	516930
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 5 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,139,567.00 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	2021 年 8 月 18 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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资其他经中国证监会允许的衍生金融产品，及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具等。为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证生物科技主题指数收益率
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	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘静	朱志明
	联系电话	0755-23999841	4008-888-108
	电子邮箱	liujing@msjfund.com.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-8888-388	95587
传真		0755-23999800	010-56162085
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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 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	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层, 北京市朝阳区光华路 10 号 院中信大厦 82 层
邮政编码		518038	100010
法定代表人		郑智军	王常青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.msjfund.com.cn">http://www.msjfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,113,783.80
本期利润	-9,563,352.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1312
本期加权平均净值利润率	-27.32%
本期基金份额净值增长率	-23.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-41,924,073.90
期末可供分配基金份额利润	-0.5732

期末基金资产净值	31,215,493.10
期末基金份额净值	0.4268
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-57.32%

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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

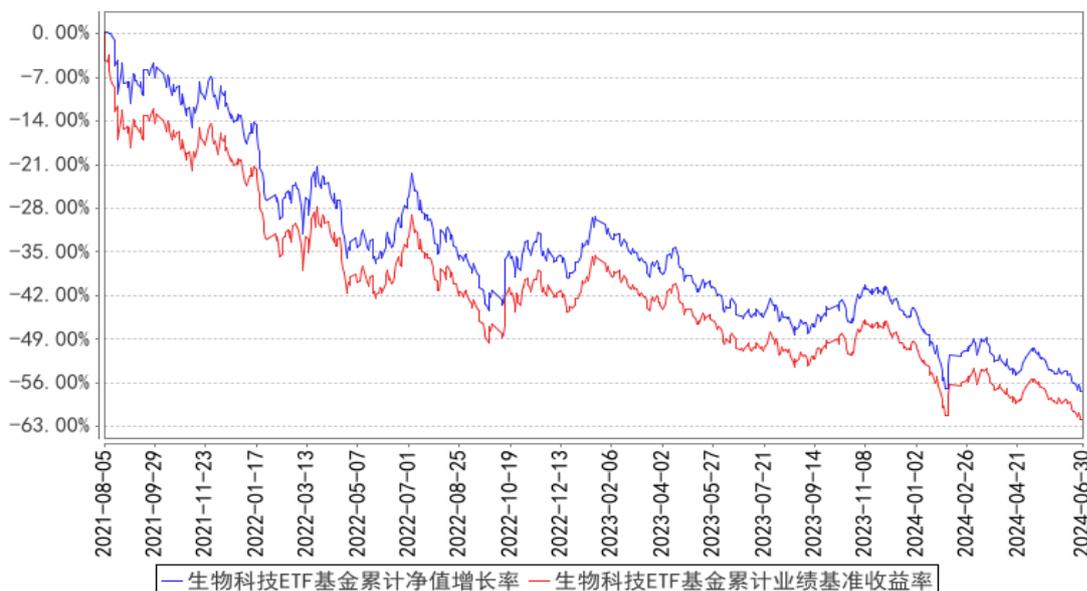
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.34%	1.03%	-6.80%	1.04%	0.46%	-0.01%
过去三个月	-10.49%	1.14%	-11.24%	1.18%	0.75%	-0.04%
过去六个月	-23.73%	1.60%	-24.61%	1.66%	0.88%	-0.06%
过去一年	-22.36%	1.43%	-23.01%	1.48%	0.65%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-57.32%	1.60%	-61.83%	1.66%	4.51%	-0.06%

注：本基金的业绩比较基准为：中证生物科技主题指数收益率。

### 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

生物科技ETF基金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5日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周帅	本基金基金经理	2023年6月20日	-	7年	南开大学数量经济学硕士，7年证券从业经历。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

					<p>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 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。</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

上半年，国内经济整体维持继续复苏态势，但结构上有所分化，外需较强而内需相对较弱。外需在新兴市场资本开支及欧美补库存拉动下持续复苏，强劲的出口推动国内工业增加值、制造业投资维持在较高增速。但从地产、社零等数据来看，内需仍相对疲软，虽然地产销售价格及销量趋势在政策密集落地有所改善，但地产投资端的数据依然偏弱，同时社零数据的增速也反映了当前国内需求仍缺乏弹性。

上半年市场表现波动较大，1 月市场在避险情绪的驱动下出现较大幅度下跌，投资者配置方向由去年的红利+微盘的“杠铃”策略，转向为红利的极致防守风格。2-3 月，在市场资金面压力释放后，叠加政策端措施的强力出台，市场预期逐步修正，指数层面迎来了一定的反弹，开始逐渐修复前期的跌幅。4 月初新“国九条”的发布，提升了投资者对于上市公司质量、市场稳定性等方面的长期预期，市场风险偏好得到进一步提振。4 月底-5 月中旬，受地产政策预期升温以及北上资金持续回流的影响，市场延续上行趋势。5 月中旬后，政策出台频率有所减弱，同时市场也在等待前期政策传导效果，市场整体交投活跃度有所下降，相应指数迎来震荡下行。

风格上，上半年市场风格分化较为显著，市场以红利为代表的“确定性”投资为主线，高股息风格整体表现较好，成长、消费板块表现则相对弱势。行业上，银行、煤炭、公用事业等行业上半年涨幅居前，计算机、商贸零售及社会服务等行业表现则较为靠后。

报告期内本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股增发配股等事项，保障基金的正常运作。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) 成份股票的分红等权益变动事宜；3) 指数成份股调整等。

### 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 0.4268 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.73%，业绩比较基准收益率为-24.61%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观基本面修复斜率有望提升，A 股企业盈利状况也有望继续改善。外需在海外补库周期及新兴市场资本开支刚性需求下有望得到持续拉动，而内需则在内地地产市场的企稳下有望得到一定修复；资金面上，美联储降息预期继续升温，海外流动性的改善有望助推外资回流中国资产，为市场带来增量资金；情绪上，当前市场预期定价已较为充分，市场情绪已处在历史底部，下半年市场风险偏好有望在政策持续推动下得到提振，带动 A 股市场回暖。下半年建议以“确定性投资+基本面改善”作为主要配置策略。

投资策略上，我们将严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股增发配股等事项，保障基金的正常运作，继续做好对标的指数的跟踪。

#### 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。本基金管理人为了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

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 2024-01-01 至 2024-06-30，本基金管理人已向中国证监会报送解决方案。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## § 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：民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,143,003.91	1,373,985.76
结算备付金		-	19,315.54
存出保证金		7,797.84	12,069.87
交易性金融资产	6.4.7.2	30,089,184.78	38,858,181.73
其中：股票投资		30,089,184.78	38,858,181.73
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,000.00	-
资产总计		31,314,986.53	40,263,552.90
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		830.75	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,589.21	18,100.85
应付托管费		2,717.85	3,620.17
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	82,355.62	155,475.88
负债合计		99,493.43	177,196.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	73,139,567.00	71,639,567.00
未分配利润	6.4.7.12	-41,924,073.90	-31,553,211.00
净资产合计		31,215,493.10	40,086,356.00
负债和净资产总计		31,314,986.53	40,263,552.90

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.4268 元，基金份额总额 73,139,567.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-9,333,755.58	-6,824,823.58
1. 利息收入		4,970.83	4,776.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,970.83	4,776.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-3,895,432.90	-869,377.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,203,992.72	-1,341,848.99

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	308,559.82	472,471.51
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	-5,449,568.79	-5,959,787.31
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	6,275.28	-435.67
<b>减：二、营业总支出</b>		229,597.01	314,633.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	87,164.18	134,088.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,432.83	26,817.71
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	125,000.00	153,726.92
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-9,563,352.59	-7,139,457.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-9,563,352.59	-7,139,457.02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-9,563,352.59	-7,139,457.02

### 6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	71,639,567.00	-	-31,553,211.00	40,086,356.00

资产				
二、本期期初净资产	71,639,567.00	-	-31,553,211.00	40,086,356.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,500,000.00	-	-10,370,862.90	-8,870,862.90
(一)、综合收益总额	-	-	-9,563,352.59	-9,563,352.59
(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)	1,500,000.00	-	-807,510.31	692,489.69
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-	-6,269,410.92	5,730,589.08
2. 基金赎回款	-10,500,000.00	-	5,461,900.61	-5,038,099.39
(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	73,139,567.00	-	-41,924,073.90	31,215,493.10
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	88,139,567.00	-	-32,310,824.23	55,828,742.77
二、本期期初净资产	88,139,567.00	-	-32,310,824.23	55,828,742.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,500,000.00	-	-6,700,021.40	-8,200,021.40
(一)、综合收益总额	-	-	-7,139,457.02	-7,139,457.02
(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)	-1,500,000.00	-	439,435.62	-1,060,564.38
其中：1. 基金申购款	1,500,000.00	-	-562,151.82	937,848.18

2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-	1,001,587.44	-1,998,412.56
(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	86,639,567.00	-	-39,010,845.63	47,628,721.37

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：

<u>郑智军</u>	<u>王国栋</u>	<u>洪锐珠</u>
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

民生加银中证生物科技主题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”）《关于准予民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可 [2020] 3652 号）核准，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、《民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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招募说明书》的规定发售，基金合同于 2021 年 8 月 5 日生效。本基金为交易型开放式，首次设立募集规模为 284,639,567.00 份基金份额，上述募集资金已由安永华明会计师事务所（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”），基金托管人为中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银中证生物科技主题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允许上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、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。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证生物科技主题指数收益率。

#### 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〈年度报告和中期报告〉》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 2024 年 06 月 30 日的财务状况、2024 年 01 月 01 日至 2024 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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、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》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

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。

(c) 对基金从上市公司、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。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d) 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。

(e) 对基金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 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,143,003.91
等于: 本金	1,142,790.50
加: 应计利息	213.41
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	1,143,003.91

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	50,002,612.59	-	30,089,184.78	-19,913,427.81
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	50,002,612.59	-	30,089,184.78	-19,913,427.81

### 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：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

#### 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：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告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 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,000.00
合计	75,000.00

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,769.94
其中：交易所市场	4,769.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	10,000.00
应退替代款	27,585.68
预提 IOPV 服务费	20,000.00
预提信息披露费	20,000.00
合计	82,355.62

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,639,567.00	71,639,567.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,500,000.00	-10,500,000.00
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	73,139,567.00	73,139,567.00

#### 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	-29,616,918.60	-1,936,292.40	-31,553,211.00
本期期初	-29,616,918.60	-1,936,292.40	-31,553,211.00
本期利润	-4,113,783.80	-5,449,568.79	-9,563,352.59
本期基金份额交易产生的变动数	-602,679.17	-204,831.14	-807,510.31
其中：基金申购款	-5,185,137.94	-1,084,272.98	-6,269,410.92
基金赎回款	4,582,458.77	879,441.84	5,461,900.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,333,381.57	-7,590,692.33	-41,924,073.90

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	4,772.41
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	108.43
其他	89.99
合计	4,970.83

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,330,395.18
股票投资收益——赎回差价收入	-873,597.54
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,203,992.72

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	5,433,242.24
减：卖出股票成本总额	8,754,524.02

减：交易费用	9,113.40
买卖股票差价收入	-3,330,395.18

**6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	5,038,099.39
减：现金支付赎回款总额	2,779,534.39
减：赎回股票成本总额	3,132,162.54
减：交易费用	-
赎回差价收入	-873,597.54

**6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：无。

**6.4.7.15 债券投资收益**

**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金于本期无债券投资收益。

**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：本基金在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衍生工具收益。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	308,559.82
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	308,559.82

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,449,568.79
股票投资	-5,449,568.79
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	-5,449,568.79

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,275.28
合计	6,275.28

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	10,000.00
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	-
中登登记结算费	75,000.00
IOPV 服务费	20,000.00
合计	125,000.00

#### 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
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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 (%)
中信建投	11,672,832.64	100.00	10,725,779.30	100.00

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	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 (%)
中信建投	5,647.98	100.00	4,769.94	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
中信建投	6,887.14	100.00	6,218.25	100.00

注：1、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。

2、根据《证券交易单元租用协议》及补充协议，本基金管理人租用中信建投证券专用交易单元，并从中信建投证券获得符合法律法规及监管规定的各项服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	87,164.18	134,088.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	87,164.18	134,088.81

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 0.5%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×0.5%/当年天数

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,432.83	26,817.71

注：支付基金托管人中信建投证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%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×0.1%/当年天数

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间均未持有本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
中信建投证 券	5,472,057.00	7.4817	5,377,057.00	7.5057

##### 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：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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1) 本基金于本期末进行利润分配。

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

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：于2024年6月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于2024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2024年06月30日止，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为

抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2024 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未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

于本报告期末，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货币资金、结算备付金、存出保证金等。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 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,142,790.50	-	-	-	-	213.41	1,143,003.91
存出保证金	7,794.34	-	-	-	-	3.50	7,797.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	30,089,184.78	30,089,184.78
其他资产	-	-	-	-	-	75,000.00	75,000.00
资产总计	1,150,584.84	-	-	-	-	30,164,401.69	31,314,986.53
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,589.21	13,589.21
应付托管费	-	-	-	-	-	2,717.85	2,717.85
应付清算款	-	-	-	-	-	830.75	830.75
其他负债	-	-	-	-	-	82,355.62	82,355.62
负债总计	-	-	-	-	-	99,493.43	99,493.43
利率敏感度缺口	1,150,584.84	-	-	-	-	30,064,908.26	31,215,493.10

上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,373,680.31	-	-	-	-	305.45	1,373,985.76
结算备付金	19,305.97	-	-	-	-	9.57	19,315.54
存出保证金	12,063.82	-	-	-	-	6.05	12,069.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	38,858,181.73	38,858,181.73
资产总计	1,405,050.10	-	-	-	-	38,858,502.80	40,263,552.90
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,100.85	18,100.85
应付托管费	-	-	-	-	-	3,620.17	3,620.17
其他负债	-	-	-	-	-	155,475.88	155,475.88
负债总计	-	-	-	-	-	177,196.90	177,196.90
利率敏感度缺口	1,405,050.10	-	-	-	-	38,681,305.90	40,086,356.00

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	30,089,184.78	96.39	38,858,181.73	96.94
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	30,089,184.78	96.39	38,858,181.73	96.94

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	1,503,086.05	1,948,713.08
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-1,503,086.05	-1,948,713.08

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	30,089,184.78	38,858,181.73

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	30,089,184.78	38,858,181.73

**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**

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融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 2024 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	30,089,184.78	96.09
	其中：股票	30,089,184.78	96.09
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	1,143,003.91	3.65
8	其他各项资产	82,797.84	0.26
9	合计	31,314,986.53	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,618,152.51	78.87
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	342,333.00	1.10
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	4,898,299.27	15.69
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	230,400.00	0.74
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	30,089,184.78	96.39

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	300760	迈瑞医疗	10,686	3,108,664.26	9.96
2	603259	药明康德	75,633	2,964,057.27	9.50
3	600276	恒瑞医药	76,112	2,927,267.52	9.38
4	002252	上海莱士	203,300	1,589,806.00	5.09
5	300122	智飞生物	45,750	1,282,372.50	4.11
6	000661	长春高新	12,300	1,128,771.00	3.62
7	600161	天坛生物	45,320	1,105,808.00	3.54
8	600196	复星医药	48,643	1,076,956.02	3.45
9	300347	泰格医药	19,900	967,140.00	3.10
10	603392	万泰生物	14,596	961,584.48	3.08
11	300142	沃森生物	61,352	698,185.76	2.24
12	002007	华兰生物	41,900	661,601.00	2.12
13	300759	康龙化成	34,150	634,507.00	2.03
14	002821	凯莱英	9,120	600,096.00	1.92
15	688180	君实生物	20,497	595,437.85	1.91
16	603087	甘李药业	11,501	532,726.32	1.71
17	688235	百济神州	4,400	509,696.00	1.63
18	300529	健帆生物	18,500	503,385.00	1.61
19	000403	派林生物	16,800	447,888.00	1.43
20	600867	通化东宝	53,100	444,447.00	1.42
21	603658	安图生物	8,910	410,483.70	1.31
22	300601	康泰生物	25,620	399,928.20	1.28
23	688266	泽璟制药	7,100	384,962.00	1.23
24	300294	博雅生物	11,600	382,800.00	1.23
25	300009	安科生物	44,800	382,592.00	1.23
26	688114	华大智造	8,000	379,280.00	1.22
27	600739	辽宁成大	40,900	342,333.00	1.10
28	300676	华大基因	9,500	332,595.00	1.07
29	688278	特宝生物	6,100	326,655.00	1.05
30	002773	康弘药业	14,100	305,265.00	0.98
31	688331	荣昌生物	6,652	287,366.40	0.92
32	688139	海尔生物	7,247	269,588.40	0.86
33	688062	迈威生物	9,200	266,248.00	0.85
34	300482	万孚生物	10,900	265,960.00	0.85
35	300357	我武生物	12,000	242,640.00	0.78
36	300244	迪安诊断	19,200	230,400.00	0.74
37	600211	西藏药业	6,240	203,299.20	0.65
38	002038	双鹭药业	27,500	202,675.00	0.65
39	688520	神州细胞	5,100	200,685.00	0.64
40	688739	成大生物	7,900	191,496.00	0.61
41	688366	昊海生科	3,080	189,974.40	0.61
42	002030	达安基因	37,500	187,500.00	0.60

43	688192	迪哲医药	4,700	173,148.00	0.55
44	688276	百克生物	4,700	133,339.00	0.43
45	688690	纳微科技	7,600	132,012.00	0.42
46	600682	南京新百	25,800	128,742.00	0.41
47	002581	未名医药	12,600	121,590.00	0.39
48	688336	三生国健	4,800	97,680.00	0.31
49	688177	百奥泰	4,600	97,152.00	0.31
50	301207	华兰疫苗	4,550	80,398.50	0.26

**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**

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

**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	603259	药明康德	1,161,273.00	2.90
2	300760	迈瑞医疗	711,575.00	1.78
3	688114	华大智造	424,807.88	1.06
4	300122	智飞生物	382,260.00	0.95
5	688062	迈威生物	305,819.62	0.76
6	000661	长春高新	297,711.00	0.74
7	002252	上海莱士	264,147.00	0.66
8	002038	双鹭药业	216,743.00	0.54
9	600161	天坛生物	206,755.00	0.52
10	300142	沃森生物	180,735.00	0.45
11	300347	泰格医药	173,417.00	0.43
12	002821	凯莱英	148,924.00	0.37
13	002007	华兰生物	146,229.00	0.36
14	600682	南京新百	141,486.00	0.35
15	300759	康龙化成	130,469.00	0.33
16	688336	三生国健	106,787.90	0.27
17	000403	派林生物	96,516.00	0.24
18	300601	康泰生物	92,675.00	0.23
19	688180	君实生物	86,486.00	0.22
20	300529	健帆生物	77,152.00	0.19

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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	300760	迈瑞医疗	1,626,967.00	4.06
2	600276	恒瑞医药	595,187.00	1.48
3	300122	智飞生物	342,773.00	0.86
4	000661	长春高新	258,451.00	0.64
5	300841	康华生物	236,330.00	0.59
6	002252	上海莱士	232,506.00	0.58
7	300463	迈克生物	224,833.00	0.56
8	301047	义翘神州	193,955.00	0.48
9	300142	沃森生物	158,142.00	0.39
10	300347	泰格医药	149,190.00	0.37
11	688298	东方生物	139,062.64	0.35
12	002821	凯莱英	134,983.60	0.34
13	002007	华兰生物	127,795.00	0.32
14	300759	康龙化成	110,809.00	0.28
15	688185	康希诺	89,220.00	0.22
16	300482	万孚生物	85,298.00	0.21
17	300601	康泰生物	81,377.00	0.20
18	000403	派林生物	78,596.00	0.20
19	300009	安科生物	68,323.00	0.17
20	300529	健帆生物	67,421.00	0.17

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	6,239,590.40
卖出股票收入（成交）总额	5,433,242.24

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	7,797.84
2	应收清算款	-
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	75,000.00
8	其他	-
9	合计	82,797.84

#### 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未存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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

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 (%)
1,151	63,544.37	16,408,356.00	22.43	56,731,211.00	77.57

### 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	5,472,057.00	7.48
2	刘杰	4,900,000.00	6.70
3	广发证券股份有限公 司	3,335,600.00	4.56
4	宁波鹏源资产管理有 限公司	3,000,000.00	4.10
5	中信证券股份有限公 司	1,924,099.00	2.63
6	叶俊琼	1,400,000.00	1.91
7	蔡宏涛	1,366,000.00	1.87
8	上海凯禹资产管理有 限公司	1,167,300.00	1.60
9	肥城康诚置业有限公 司	1,100,000.00	1.50
10	陈艳梅	1,000,000.00	1.37

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 5 日） 基金份额总额	284,639,567.00
本报告期期初基金份额总额	71,639,567.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	73,139,567.00

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 3 月 5 日发布公告，自 2024 年 3 月 4 日起宋永明先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 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	11,672,832.64	100.00	5,647.98	100.00	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

②券商专用交易单元选择程序：

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

③本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	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 (%)		(%)		的比例 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
2	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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
4	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 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
5	民生加银基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
6	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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
7	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产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 24 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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) 《民生加银中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

- (3) 《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合同》;
- (4) 《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托管协议》;
- (5) 法律意见书;
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (7) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日