

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 清算报告

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告出具日期：2026 年 7 月 15 日

报告送出日期：2026 年 7 月 24 日

一、重要提示

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（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2021】3078号文准予注册，《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合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于2022年6月13日正式生效。本基金基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

依据《基金合同》“第二十一部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之“二、《基金合同》的终止事由”约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；……”。

经本基金的基金管理人民生加银基金管理有限公司与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，本基金以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，并于2026年7月2日计票并审议通过了《关于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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，即同意终止本基金《基金合同》及终止上市，并授权基金管理人按约定办理本次终止《基金合同》、终止上市、进行基金财产的清算。基金管理人于2026年7月3日在规定媒介进行了公告，详见《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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2026年7月3日起进入清算程序。本基金清算期为2026年7月3日至2026年7月15日，由本基金管理人民生加银基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由容诚会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	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
基金简称	核心 50ETF
基金主代码	560650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 13 日
2026 年 7 月 2 日（最后运作日）日终基金份额总额	7,919,193.00 份
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	本基金的股票投资策略为：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 and 成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。除股票投资策略外，本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、债券投资策略、参与转融通证券出借业务策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证企业核心竞争力 50 指数
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。
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

三、 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2021】3078 号《关于准予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注册的批复》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》和《基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模共人民币 507,419,193.00 元。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2022 年 6 月 13 日正式生效。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《基金合同》以及基金管理人民生加银基金管理有限公司于 2026 年 7 月 3 日发布的《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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次基金份额持有人大会于 2026 年 7 月 2 日表决通过了《关于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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。本基金的最后运作日为 2026 年 7 月 2 日，自 2026 年 7 月 3 日起进入基金财产清算程序，本基金清算期为 2026 年 7 月 3 日至 2026 年 7 月 15 日。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：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

报告截止日：2026 年 7 月 2 日

单位：人民币元

项目	2026 年 7 月 2 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	160,070.20
存出保证金	3,741.14
交易性金融资产	8,083,072.58
其中：股票投资	8,083,072.58
资产总计	8,246,883.92
负债和净资产	
负 债：	
应付管理人报酬	3,175.49
应付托管费	635.12
其他负债	1,963.81
负债合计	5,774.42
净资产：	
实收基金	7,919,193.00
未分配利润	321,916.50
净资产合计	8,241,109.50
负债和净资产总计	8,246,883.92

注 1：报告截止日 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日），基金份额总额为 7,919,193.00 份，基金份额净值 1.0407 元。

注 2：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《资产管理产品相关会计处理规定》等的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报本基金全体基金份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、 清算情况

本基金的最后运作日为 2026 年 7 月 2 日，清算期间为 2026 年 7 月 3 日至 2026 年 7 月 15 日（基金清算结束日）。

1. 清算费用

根据《基金合同》的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2. 资产处置情况

(1) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）的货币资金余额为 160,070.20 元，其中包括：托管账户活期存款本金为 160,047.06 元，存款应计利息 23.14 元。于清算期间，托管账户活期存款流入 8,206,387.37 元，流出 56,820.59 元，计提活期存款利息 733.87 元。于 2026 年 7 月 15 日（基金清算结束日），本基金的货币资金余额为 8,310,370.85 元，其中包括：托管账户活期存款本金 8,309,613.84 元，存款应计利息 757.01 元。应计利息中未结息的部分将由本基金的基金管理人民生加银基金管理有限公司先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(2) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）结算备付金余额为人民币 0.00 元，于清算期间，结算备付金流入 46,381.18 元，计提结算备付金利息 3.60 元。于 2026 年 7 月 15 日（基金清算结束日）结算备付金余额为人民币 46,384.78 元。

(3) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）存出保证金余额为人民币 3,741.14 元，于清算期间，计提存出保证金利息 0.39 元。于 2026 年 7 月 15 日（基金清算结束日）存出保证金余额为人民币 3,741.53 元。

3. 负债清偿情况

(1) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）的应付管理人报酬为 3,175.49 元，已于 2026 年 7 月 14 日支付完毕。

(2) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）的应付托管费为 635.12 元，已于 2026 年 7 月 14 日支付完毕。

(3) 本基金于 2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）的其他负债为 1,963.81 元，均为应付交易费用，已于 2026 年 7 月 10 日支付完毕。本基金于 2026 年 7 月 15 日（清算日结束日）的其他负债为 200.00 元，系清算期间预提汇划手续费，预计在资金分配前完成支付。

4. 清算期间 2026 年 7 月 3 日（清算开始日）至 2026 年 7 月 15 日（清算结束日）止期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、收入	119,407.66
1、利息收入（注 1）	737.86
2、投资收益（注 2）	15,085.83
3、公允价值变动损益（注 3）	103,583.97
减：二、费用	220.00

三、利润总额(损失以“-”填列)	119,187.66
减：所得税费用	-
四、净收益(损失以“-”填列)	119,187.66

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2026 年 7 月 3 日（清算开始日）至 2026 年 7 月 15 日（清算结束日）止清算期间的利息收入，其中托管账户银行存款产生利息收入 733.87 元，结算备付金产生利息收入 3.60 元，存出保证金产生利息收入 0.39 元。

注 2：投资收益系清算期间股票股利收入及卖出股票产生的差价收入扣除处置过程中发生的交易费用。

注 3：公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产产生的，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

5.清算期间 2026 年 7 月 3 日（清算开始日）至 2026 年 7 月 15 日（清算结束日）的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、2026 年 7 月 2 日（基金最后运作日）基金净资产	8,241,109.50
加：清算期间净收益(损失以“-”填列)	119,187.66
二、2026 年 7 月 15 日（清算结束日）基金净资产	8,360,297.16

截止 2026 年 7 月 15 日（基金清算结束日），本基金剩余财产 8,360,297.16 元。根据《基金合同》的约定，本基金将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、 备查文件

1、备查文件目录

（1）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清算财务报表及审计报告

（2）关于《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清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅

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财产清算小组

2026 年 7 月 15 日