

# 农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 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。本半年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 22 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	10
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	11
<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>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 500 指数证券投资基金
基金简称	农银中证 500 指数
基金主代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 29 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,878,599.29 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%×中证 500 指数+5%×同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	方圆
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		黄涛	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

§ 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-356,860.34
本期利润	2,769,052.41
加权平均基金份额本期利润	0.0536
本期加权平均净值利润率	3.61%
本期基金份额净值增长率	3.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,664,548.21
期末可供分配基金份额利润	0.5333
期末基金资产净值	79,543,147.50
期末基金份额净值	1.5333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.33%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 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	4.70%	0.74%	4.09%	0.75%	0.61%	-0.01%
过去三个月	1.72%	1.42%	0.97%	1.43%	0.75%	-0.01%
过去六个月	3.69%	1.29%	3.21%	1.29%	0.48%	0.00%
过去一年	19.87%	1.62%	18.82%	1.64%	1.05%	-0.02%
过去三年	-5.61%	1.27%	-7.62%	1.29%	2.01%	-0.02%

自基金合同生效起至今	53.33%	1.47%	51.20%	1.49%	2.13%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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



注：本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 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

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币壹拾柒亿伍仟万零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。公司法定代表人为黄涛先生。

截止 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 87 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证

500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选



混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债债券型证券投资基金、农银汇理红利甄选混合型证券投资基金、农银汇理中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、农银汇理创新驱动混合型证券投资基金、农银汇理上证 180 指数型证券投资基金、农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金、农银汇理上证科创板 50 成份指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金的基金经理	2014 年 2 月 10 日	-	17 年	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确

保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易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

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0225%，日均偏离度为 0.0152%，报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

#### 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 1.5333 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.69%，业绩比较基准收益率为 3.21%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动化指数产品，我们将坚持指数被动化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责：公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况、

以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化，书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部，运营部参考测算结果对估值调整进行试算，并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督，根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员，均具有基金从业资格，具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求，但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在农银汇理中证 500 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理中证 500 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理中证

500 指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,624,746.80	1,568,424.01
结算备付金		1,710.89	144,614.30
存出保证金		4,063.64	6,014.16
交易性金融资产	6.4.7.2	78,075,401.89	76,123,783.65
其中：股票投资		75,448,136.30	73,474,094.44
基金投资		-	-
债券投资		2,627,265.59	2,649,689.21
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		92,242.75	15,371.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		80,798,165.97	77,858,207.80
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		800,245.94	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		348,082.75	126,012.51
应付管理人报酬		47,405.49	50,709.54
应付托管费		9,481.07	10,141.90
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	49,803.22	148,205.96
负债合计		1,255,018.47	335,069.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	51,878,599.29	52,427,517.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,664,548.21	25,095,620.61
净资产合计		79,543,147.50	77,523,137.89
负债和净资产总计		80,798,165.97	77,858,207.80

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5333 元，基金份额总额 51,878,599.29 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,208,706.01	-3,867,290.08
1. 利息收入		4,193.95	11,177.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,193.95	11,177.56
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）		57,307.90	-1,065,114.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-682,163.98	-1,726,605.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,514.63	-

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	729,957.25	661,490.59
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,125,912.75	-2,819,251.11
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	21,291.41	5,898.00
<b>减：二、营业总支出</b>		439,653.60	407,318.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	284,609.85	194,686.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,921.95	38,937.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		536.58	-
其中：卖出回购金融资产 支出		536.58	-
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	97,585.22	173,694.58
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		2,769,052.41	-4,274,608.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		2,769,052.41	-4,274,608.58
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,769,052.41	-4,274,608.58

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 1 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	52,427,517.28	-	25,095,620.61	77,523,137.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	52,427,517.28	-	25,095,620.61	77,523,137.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-548,917.99	-	2,568,927.60	2,020,009.61
（一）、综合收益总额	-	-	2,769,052.41	2,769,052.41
（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）	-548,917.99	-	-200,124.81	-749,042.80
其中：1. 基金申购款	9,875,297.75	-	4,926,758.69	14,802,056.44
2. 基金赎回款	-10,424,215.74	-	-5,126,883.50	-15,551,099.24
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	51,878,599.29	-	27,664,548.21	79,543,147.50
项目	上年度可比期间 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、上期期末净资产	38,152,996.78	-	14,893,447.45	53,046,444.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,152,996.78	-	14,893,447.45	53,046,444.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,044,792.32	-	-3,952,247.35	-2,907,455.03
(一)、综合收益总额	-	-	-4,274,608.58	-4,274,608.58
(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)	1,044,792.32	-	322,361.23	1,367,153.55
其中：1. 基金申购款	4,428,547.37	-	1,507,716.17	5,936,263.54
2. 基金赎回款	-3,383,755.05	-	-1,185,354.94	-4,569,109.99
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	39,197,789.10	-	10,941,200.10	50,138,989.20

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：

程昆

基金管理人负责人

毕宏燕

主管会计工作负责人

丁煜琼

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理中证 500 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”)证监许可第[1207]号《关于核准农银汇理中证 500 指数证券投资基金募集的批复》核准，由农银汇理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《农银汇



理中证 500 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 711,073,400.42 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 453 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 285,243.88 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数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 500 指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券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。其中：中证 500 指数成份股和备选股的投资比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 同期银行活期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2016]36 号《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《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 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。对基金从上市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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值

税额的适用比例计算缴纳。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,624,746.80
等于：本金	2,624,554.47
加：应计利息	192.33
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	2,624,746.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		74,714,891.68	-	75,448,136.30	733,244.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,601,212.00	27,145.59	2,627,265.59	-1,092.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,601,212.00	27,145.59	2,627,265.59	-1,092.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	77,316,103.68	27,145.59	78,075,401.89	732,152.62
----	---------------	-----------	---------------	------------

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

### 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

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	706.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,465.44
其中：交易所市场	4,465.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	49,803.22

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,427,517.28	52,427,517.28
本期申购	9,875,297.75	9,875,297.75
本期赎回（以“-”号填列）	-10,424,215.74	-10,424,215.74
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	51,878,599.29	51,878,599.29

注：红利再投、转换入及级别调整入份额计入申购，转换出及级别调整出份额计入赎回。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

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	53,579,280.68	-28,483,660.07	25,095,620.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	53,579,280.68	-28,483,660.07	25,095,620.61

本期利润	-356,860.34	3,125,912.75	2,769,052.41
本期基金份额交易产生的变动数	-552,061.43	351,936.62	-200,124.81
其中：基金申购款	10,055,899.01	-5,129,140.32	4,926,758.69
基金赎回款	-10,607,960.44	5,481,076.94	-5,126,883.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,670,358.91	-25,005,810.70	27,664,548.21

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,119.59
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	62.87
其他	11.49
合计	4,193.95

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	15,854,653.30
减：卖出股票成本总额	16,520,709.20
减：交易费用	16,108.08
买卖股票差价收入	-682,163.98

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,905.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,391.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,514.63

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,650,960.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,604,391.06
减：应计利息总额	50,960.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-4,391.06

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

**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**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	729,957.25
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	729,957.25

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,125,912.75
股票投资	3,124,693.69
债券投资	1,219.06
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	3,125,912.75

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19,268.57
基金转换费收入	2,022.84
合计	21,291.41

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。



6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	65.00
账户维护费	9,000.00
指数使用费	43,889.24
合计	97,585.22

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	284,609.85	194,686.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	128,142.76	87,294.78
应支付基金管理人的净管理费	156,467.09	107,391.82

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,921.95	38,937.32

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	2,624,746.80	4,119.59	3,092,986.93	11,085.98

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	公告重 大事项	0.00	-	-	41,300	124,465.48	0.00	-
--------	------	--------------------------	------------	------	---	---	--------	------------	------	---

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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 800,245.94 元，于 2025 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无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

本基金管理人的风险政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。通过事前制定科学合理的制度和业务流程、事中有有效的执行和管控、事后全面的检查和改进，将风险管理贯穿于基金投资运作的整个环节，有效防范和化解基金面临的市场风险、信用风险、流动性风险及投资合规性风险。

本基金管理人建立了“三层架构、三道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了层次明晰、权责统一、监管明确的三道内部控制防线，实现了业务经营部门、风险管理部门、审计部门的分工协作，前、中、后台的相互制约，以及对公司决策层、管理层、操作层的全面监督和控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，

对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,627,265.59	2,649,689.21
合计	2,627,265.59	2,649,689.21

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”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。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

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，主要包括利率风险、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。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。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,624,746.80	-	-	-	2,624,746.80
结算备付金	1,710.89	-	-	-	1,710.89
存出保证金	4,063.64	-	-	-	4,063.64
交易性金融资产	2,627,265.59	-	-	75,448,136.30	78,075,401.89
应收申购款	-	-	-	92,242.75	92,242.75
资产总计	5,257,786.92	-	-	75,540,379.05	80,798,165.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	348,082.75	348,082.75
应付管理人报酬	-	-	-	47,405.49	47,405.49
应付托管费	-	-	-	9,481.07	9,481.07
卖出回购金融资产款	800,245.94	-	-	-	800,245.94
其他负债	-	-	-	49,803.22	49,803.22
负债总计	800,245.94	-	-	454,772.53	1,255,018.47
利率敏感度缺口	4,457,540.98	-	-	75,085,606.52	79,543,147.50
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,568,424.01	-	-	-	1,568,424.01
结算备付金	144,614.30	-	-	-	144,614.30
存出保证金	6,014.16	-	-	-	6,014.16
交易性金融资产	2,649,689.21	-	-	73,474,094.44	76,123,783.65
应收申购款	-	-	-	15,371.68	15,371.68
资产总计	4,368,741.68	-	-	73,489,466.12	77,858,207.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	126,012.51	126,012.51
应付管理人报酬	-	-	-	50,709.54	50,709.54
应付托管费	-	-	-	10,141.90	10,141.90
其他负债	-	-	-	148,205.96	148,205.96
负债总计	-	-	-	335,069.91	335,069.91
利率敏感度缺口	4,368,741.68	-	-	73,154,396.21	77,523,137.89

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。		
	其他市场变量保持不变。		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,525.23	-489.53
	市场利率下降 25 个基点	1,525.23	489.53

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

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	75,448,136.30	94.85	73,474,094.44	94.78
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	75,448,136.30	94.85	73,474,094.44	94.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,928,230.03	3,822,208.42
	业绩比较基准下降 5%	-3,928,230.03	-3,822,208.42

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	75,448,136.30	73,474,094.44
第二层次	2,627,265.59	2,649,689.21
第三层次	—	—



合计	78,075,401.89	76,123,783.65
----	---------------	---------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	75,448,136.30	93.38
	其中：股票	75,448,136.30	93.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,627,265.59	3.25
	其中：债券	2,627,265.59	3.25
	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	2,626,457.69	3.25
8	其他各项资产	96,306.39	0.12
9	合计	80,798,165.97	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	189,282.00	0.24
B	采矿业	2,726,283.50	3.43
C	制造业	47,812,115.56	60.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,159,083.80	2.71
E	建筑业	669,248.00	0.84
F	批发和零售业	1,668,126.84	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,270,400.56	1.60
H	住宿和餐饮业	198,726.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,067,831.06	8.89
J	金融业	7,492,371.22	9.42
K	房地产业	940,683.46	1.18
L	租赁和商务服务业	660,333.60	0.83
M	科学研究和技术服务业	520,235.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	320,859.48	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	156,672.00	0.20
Q	卫生和社会工作	345,726.88	0.43
R	文化、体育和娱乐业	1,068,520.00	1.34
S	综合	181,637.34	0.23
	合计	75,448,136.30	94.85

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	300476	胜宏科技	6,300	846,594.00	1.06
2	000988	华工科技	10,400	488,904.00	0.61
3	600988	赤峰黄金	17,300	430,424.00	0.54
4	300339	润和软件	8,300	421,889.00	0.53
5	002966	苏州银行	46,280	406,338.40	0.51
6	600839	四川长虹	38,200	371,304.00	0.47
7	601555	东吴证券	41,080	359,450.00	0.45
8	601162	天风证券	72,000	354,960.00	0.45
9	688521	芯原股份	3,600	347,400.00	0.44
10	002517	恺英网络	17,700	341,787.00	0.43
11	002340	格林美	53,200	337,820.00	0.42
12	603893	瑞芯微	2,200	334,092.00	0.42
13	002195	岩山科技	59,030	332,338.90	0.42
14	002558	巨人网络	14,000	329,700.00	0.41
15	002156	通富微电	12,600	322,812.00	0.41
16	002261	拓维信息	10,400	321,880.00	0.40
17	688608	恒玄科技	900	313,182.00	0.39
18	600487	亨通光电	20,400	312,120.00	0.39
19	002797	第一创业	43,400	307,272.00	0.39
20	300251	光线传媒	15,100	306,077.00	0.38
21	300207	欣旺达	15,200	304,912.00	0.38
22	688777	中控技术	6,700	300,897.00	0.38
23	300803	指南针	3,725	300,458.50	0.38
24	688213	思特威	2,900	296,438.00	0.37
25	000066	中国长城	20,000	296,000.00	0.37
26	600096	云天化	13,200	290,004.00	0.36
27	600536	中国软件	6,194	289,693.38	0.36
28	600879	航天电子	27,460	287,506.20	0.36
29	601168	西部矿业	17,200	286,036.00	0.36
30	002273	水晶光电	14,315	285,870.55	0.36
31	002465	海格通信	20,500	285,770.00	0.36
32	688120	华海清科	1,692	285,440.40	0.36
33	300450	先导智能	11,300	280,805.00	0.35
34	688235	百济神州	1,200	280,368.00	0.35
35	601099	太平洋	70,800	278,244.00	0.35
36	002294	信立泰	5,800	274,514.00	0.35
37	000831	中国稀土	7,600	274,512.00	0.35
38	600352	浙江龙盛	27,000	274,320.00	0.34
39	300017	网宿科技	25,400	272,288.00	0.34
40	000933	神火股份	16,300	271,232.00	0.34
41	600885	宏发股份	12,053	268,902.43	0.34
42	601108	财通证券	33,800	267,358.00	0.34
43	002185	华天科技	26,400	266,640.00	0.34

44	688002	睿创微纳	3,700	257,964.00	0.32
45	601128	常熟银行	34,480	254,117.60	0.32
46	002130	沃尔核材	10,500	250,110.00	0.31
47	688617	惠泰医疗	841	249,777.00	0.31
48	601577	长沙银行	25,100	249,494.00	0.31
49	002281	光迅科技	5,049	249,016.68	0.31
50	002595	豪迈科技	4,200	248,724.00	0.31
51	688099	晶晨股份	3,500	248,535.00	0.31
52	600079	人福医药	11,800	247,564.00	0.31
53	000423	东阿阿胶	4,700	245,810.00	0.31
54	688469	芯联集成	51,400	245,178.00	0.31
55	688122	西部超导	4,700	243,836.00	0.31
56	002085	万丰奥威	15,300	243,117.00	0.31
57	300223	北京君正	3,500	242,200.00	0.30
58	300058	蓝色光标	36,760	241,145.60	0.30
59	002532	天山铝业	29,000	240,990.00	0.30
60	300002	神州泰岳	20,400	240,720.00	0.30
61	000997	新大陆	7,400	239,612.00	0.30
62	000783	长江证券	34,500	239,085.00	0.30
63	603129	春风动力	1,100	238,150.00	0.30
64	002738	中矿资源	7,400	237,984.00	0.30
65	300474	景嘉微	3,250	237,250.00	0.30
66	600109	国金证券	27,000	236,790.00	0.30
67	002138	顺络电子	8,400	236,208.00	0.30
68	300454	深信服	2,500	235,450.00	0.30
69	002472	双环传动	7,000	234,430.00	0.29
70	300458	全志科技	5,900	234,171.00	0.29
71	002078	太阳纸业	17,300	232,858.00	0.29
72	601933	永辉超市	47,100	230,790.00	0.29
73	002436	兴森科技	17,400	230,376.00	0.29
74	603596	伯特利	4,360	229,728.40	0.29
75	002410	广联达	17,100	229,311.00	0.29
76	688525	佰维存储	3,400	229,160.00	0.29
77	300346	南大光电	7,200	227,808.00	0.29
78	300765	新诺威	4,400	227,436.00	0.29
79	002850	科达利	2,000	226,340.00	0.28
80	600143	金发科技	21,900	225,789.00	0.28
81	002851	麦格米特	4,500	225,630.00	0.28
82	600862	中航高科	8,600	224,288.00	0.28
83	601198	东兴证券	20,100	224,115.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	6,400	224,000.00	0.28
85	300136	信维通信	10,000	224,000.00	0.28
86	002223	鱼跃医疗	6,289	223,888.40	0.28

87	002065	东华软件	23,300	223,680.00	0.28
88	300024	机器人	13,000	223,340.00	0.28
89	600580	卧龙电驱	11,280	223,005.60	0.28
90	603606	东方电缆	4,300	222,353.00	0.28
91	600363	联创光电	3,800	221,654.00	0.28
92	600873	梅花生物	20,700	221,283.00	0.28
93	300054	鼎龙股份	7,700	220,836.00	0.28
94	002673	西部证券	28,000	220,640.00	0.28
95	002202	金风科技	21,500	220,375.00	0.28
96	300395	菲利华	4,300	219,730.00	0.28
97	000034	神州数码	5,800	218,312.00	0.27
98	601615	明阳智能	19,000	218,310.00	0.27
99	600298	安琪酵母	6,200	218,054.00	0.27
100	688072	拓荆科技	1,400	215,194.00	0.27
101	300857	协创数据	2,500	215,150.00	0.27
102	000728	国元证券	27,200	214,608.00	0.27
103	688578	艾力斯	2,300	213,992.00	0.27
104	002624	完美世界	14,100	213,897.00	0.27
105	002008	大族激光	8,700	212,019.00	0.27
106	000021	深科技	11,309	211,930.66	0.27
107	300115	长盈精密	9,900	211,860.00	0.27
108	300496	中科创达	3,700	211,714.00	0.27
109	300383	光环新网	14,800	211,640.00	0.27
110	603605	珀莱雅	2,500	206,975.00	0.26
111	300604	长川科技	4,600	206,586.00	0.26
112	603659	璞泰来	11,000	206,580.00	0.26
113	603160	汇顶科技	2,900	205,987.00	0.26
114	600895	张江高科	8,000	205,600.00	0.26
115	600549	厦门钨业	9,800	205,016.00	0.26
116	688220	翱捷科技	2,616	204,832.80	0.26
117	300012	华测检测	17,500	204,575.00	0.26
118	000426	兴业银锡	12,900	203,820.00	0.26
119	603087	甘李药业	3,700	202,686.00	0.25
120	600171	上海贝岭	5,900	202,075.00	0.25
121	002155	湖南黄金	11,310	201,883.50	0.25
122	300627	华测导航	5,640	197,400.00	0.25
123	000733	振华科技	3,900	195,195.00	0.25
124	601216	君正集团	35,300	194,856.00	0.24
125	605589	圣泉集团	7,000	194,250.00	0.24
126	688361	中科飞测	2,300	193,637.00	0.24
127	300699	光威复材	6,060	191,920.20	0.24
128	688180	君实生物	5,631	191,341.38	0.24
129	000750	国海证券	46,430	191,291.60	0.24

130	600392	盛和资源	14,510	191,096.70	0.24
131	601665	齐鲁银行	30,100	190,232.00	0.24
132	300037	新宙邦	5,400	190,080.00	0.24
133	601997	贵阳银行	30,400	189,696.00	0.24
134	000932	华菱钢铁	43,020	189,288.00	0.24
135	000519	中兵红箭	8,629	188,888.81	0.24
136	002444	巨星科技	7,400	188,774.00	0.24
137	600153	建发股份	18,200	188,734.00	0.24
138	000729	燕京啤酒	14,500	187,485.00	0.24
139	300003	乐普医疗	13,600	187,408.00	0.24
140	601990	南京证券	23,100	186,648.00	0.23
141	601233	桐昆股份	17,600	186,560.00	0.23
142	600060	海信视像	8,100	186,462.00	0.23
143	601717	中创智领	11,200	186,144.00	0.23
144	002821	凯莱英	2,100	185,325.00	0.23
145	601696	中银证券	17,300	184,937.00	0.23
146	300001	特锐德	7,700	184,569.00	0.23
147	000878	云南铜业	14,500	184,440.00	0.23
148	300073	当升科技	4,200	184,254.00	0.23
149	600673	东阳光	15,618	181,637.34	0.23
150	300142	沃森生物	16,500	181,500.00	0.23
151	603979	金诚信	3,900	181,116.00	0.23
152	600369	西南证券	41,400	180,090.00	0.23
153	002414	高德红外	17,500	179,375.00	0.23
154	688065	凯赛生物	3,800	178,980.00	0.23
155	002837	英维克	6,000	178,260.00	0.22
156	600699	均胜电子	10,200	177,888.00	0.22
157	002007	华兰生物	11,300	177,071.00	0.22
158	300373	扬杰科技	3,400	176,460.00	0.22
159	600177	雅戈尔	24,000	175,200.00	0.22
160	000893	亚钾国际	5,800	174,812.00	0.22
161	688052	纳芯微	1,000	174,490.00	0.22
162	600118	中国卫星	6,100	174,277.00	0.22
163	002152	广电运通	12,900	173,376.00	0.22
164	600398	海澜之家	24,900	173,304.00	0.22
165	600521	华海药业	9,300	173,259.00	0.22
166	600704	物产中大	32,600	171,802.00	0.22
167	300748	金力永磁	7,160	170,694.40	0.21
168	600435	北方导航	10,900	169,931.00	0.21
169	600909	华安证券	29,120	169,769.60	0.21
170	600316	洪都航空	4,500	169,650.00	0.21
171	688249	晶合集成	8,300	168,241.00	0.21
172	000738	航发控制	8,100	168,075.00	0.21

173	002044	美年健康	32,500	167,050.00	0.21
174	600038	中直股份	4,300	166,883.00	0.21
175	000623	吉林敖东	9,842	166,821.90	0.21
176	002958	青农商行	46,200	166,782.00	0.21
177	000009	中国宝安	18,720	166,233.60	0.21
178	600497	驰宏锌锗	31,400	166,106.00	0.21
179	600141	兴发集团	8,068	165,636.04	0.21
180	600765	中航重机	9,780	165,086.40	0.21
181	603179	新泉股份	3,500	164,395.00	0.21
182	002409	雅克科技	3,000	164,070.00	0.21
183	600562	国睿科技	5,200	163,748.00	0.21
184	002318	久立特材	7,000	163,730.00	0.21
185	688188	柏楚电子	1,243	163,653.38	0.21
186	603228	景旺电子	3,894	162,924.96	0.20
187	688385	复旦微电	3,303	162,738.81	0.20
188	000528	柳 工	16,900	162,409.00	0.20
189	300919	中伟股份	4,900	161,112.00	0.20
190	603345	安井食品	2,000	160,840.00	0.20
191	600155	华创云信	23,100	160,776.00	0.20
192	002683	广东宏大	4,700	159,518.00	0.20
193	001696	宗申动力	7,100	159,395.00	0.20
194	000400	许继电气	7,300	158,921.00	0.20
195	000960	锡业股份	10,300	157,590.00	0.20
196	300724	捷佳伟创	2,900	157,470.00	0.20
197	002607	中公教育	51,200	156,672.00	0.20
198	600637	东方明珠	20,900	156,123.00	0.20
199	600884	杉杉股份	16,500	156,090.00	0.20
200	600498	烽火通信	7,400	155,622.00	0.20
201	300623	捷捷微电	5,200	154,960.00	0.19
202	603939	益丰药房	6,248	152,888.56	0.19
203	600563	法拉电子	1,400	152,726.00	0.19
204	688568	中科星图	4,200	151,242.00	0.19
205	000039	中集集团	19,240	151,226.40	0.19
206	000415	渤海租赁	45,300	150,849.00	0.19
207	300558	贝达药业	2,600	150,670.00	0.19
208	600529	山东药玻	6,800	150,552.00	0.19
209	002739	万达电影	13,100	149,733.00	0.19
210	002841	视源股份	4,300	148,780.00	0.19
211	600486	扬农化工	2,550	147,900.00	0.19
212	002653	海思科	3,500	147,770.00	0.19
213	600901	江苏金租	24,020	145,561.20	0.18
214	002926	华西证券	16,200	144,828.00	0.18
215	002385	大北农	35,700	144,228.00	0.18

216	002025	航天电器	2,800	143,948.00	0.18
217	300763	锦浪科技	2,500	143,475.00	0.18
218	301358	湖南裕能	4,600	143,474.00	0.18
219	688114	华大智造	2,200	142,626.00	0.18
220	000887	中鼎股份	8,100	142,479.00	0.18
221	300285	国瓷材料	8,200	142,270.00	0.18
222	688582	芯动联科	2,100	141,120.00	0.18
223	300679	电连技术	3,100	140,678.00	0.18
224	600820	隧道股份	23,000	140,300.00	0.18
225	600863	内蒙华电	34,100	140,151.00	0.18
226	603486	科沃斯	2,400	139,752.00	0.18
227	600008	首创环保	46,070	139,131.40	0.17
228	002939	长城证券	16,600	139,108.00	0.17
229	002568	百润股份	5,400	138,294.00	0.17
230	000723	美锦能源	32,000	138,240.00	0.17
231	600132	重庆啤酒	2,500	137,750.00	0.17
232	300144	宋城演艺	16,100	137,655.00	0.17
233	688027	国盾量子	500	137,505.00	0.17
234	688017	绿的谐波	1,100	137,379.00	0.17
235	600390	五矿资本	23,500	137,005.00	0.17
236	000513	丽珠集团	3,798	136,879.92	0.17
237	002080	中材科技	7,000	136,500.00	0.17
238	002064	华峰化学	20,600	136,166.00	0.17
239	688538	和辉光电	57,856	135,383.04	0.17
240	600998	九州通	26,322	135,295.08	0.17
241	300757	罗博特科	900	134,973.00	0.17
242	600516	方大炭素	29,000	134,560.00	0.17
243	603568	伟明环保	7,051	134,533.08	0.17
244	002312	川发龙蟒	11,700	134,316.00	0.17
245	000703	恒逸石化	22,800	134,064.00	0.17
246	688183	生益电子	2,610	133,632.00	0.17
247	600170	上海建工	55,800	133,362.00	0.17
248	600166	福田汽车	48,800	132,248.00	0.17
249	601179	中国西电	21,400	131,396.00	0.17
250	002262	恩华药业	6,300	130,914.00	0.16
251	600312	平高电气	8,500	130,815.00	0.16
252	002500	山西证券	22,360	130,582.40	0.16
253	605358	立昂微	5,600	130,480.00	0.16
254	000683	博源化工	27,200	130,288.00	0.16
255	002203	海亮股份	12,600	130,032.00	0.16
256	300676	华大基因	2,600	129,402.00	0.16
257	600208	衢州发展	43,700	129,352.00	0.16
258	600763	通策医疗	3,121	128,834.88	0.16



259	603589	口子窖	3,700	128,760.00	0.16
260	600021	上海电力	14,600	128,334.00	0.16
261	603816	顾家家居	5,000	127,600.00	0.16
262	601155	新城控股	9,300	127,224.00	0.16
263	600380	健康元	11,472	126,536.16	0.16
264	688728	格科微	8,200	126,280.00	0.16
265	600583	海油工程	23,100	126,126.00	0.16
266	000403	派林生物	6,950	126,003.50	0.16
267	600126	杭钢股份	13,990	125,910.00	0.16
268	600985	淮北矿业	11,100	125,874.00	0.16
269	002244	滨江集团	12,900	125,775.00	0.16
270	300487	蓝晓科技	2,500	125,750.00	0.16
271	600348	华阳股份	18,850	125,541.00	0.16
272	601000	唐山港	30,726	124,747.56	0.16
273	000629	钒钛股份	48,600	124,416.00	0.16
274	603379	三美股份	2,580	124,149.60	0.16
275	002432	九安医疗	3,400	123,862.00	0.16
276	000591	太阳能	28,200	123,798.00	0.16
277	600872	中炬高新	6,500	123,500.00	0.16
278	601991	大唐发电	38,900	123,313.00	0.16
279	000060	中金岭南	26,900	123,202.00	0.15
280	688278	特宝生物	1,700	122,587.00	0.15
281	603885	吉祥航空	9,100	122,577.00	0.15
282	000830	鲁西化工	11,900	122,570.00	0.15
283	600535	天士力	7,800	122,070.00	0.15
284	002984	森麒麟	6,500	121,875.00	0.15
285	002603	以岭药业	8,600	121,260.00	0.15
286	000921	海信家电	4,700	120,790.00	0.15
287	002439	启明星辰	7,500	119,925.00	0.15
288	600816	建元信托	40,400	119,180.00	0.15
289	002056	横店东磁	8,400	118,860.00	0.15
290	600499	科达制造	12,100	118,580.00	0.15
291	603338	浙江鼎力	2,500	118,500.00	0.15
292	300146	汤臣倍健	10,500	118,020.00	0.15
293	601880	辽港股份	78,390	117,585.00	0.15
294	600095	湘财股份	11,700	117,351.00	0.15
295	603927	中科软	6,048	116,968.32	0.15
296	600685	中船防务	4,300	116,917.00	0.15
297	601016	节能风电	40,320	116,524.80	0.15
298	600970	中材国际	13,550	116,259.00	0.15
299	002423	中粮资本	9,500	116,185.00	0.15
300	300390	天华新能	6,060	115,564.20	0.15
301	000062	深圳华强	4,300	115,498.00	0.15

302	603000	人民网	5,700	115,197.00	0.14
303	300567	精测电子	1,900	115,159.00	0.14
304	300212	易华录	5,280	114,892.80	0.14
305	601611	中国核建	12,500	114,875.00	0.14
306	601666	平煤股份	15,500	114,855.00	0.14
307	688301	奕瑞科技	1,310	114,769.10	0.14
308	000636	风华高科	8,300	114,042.00	0.14
309	000155	川能动力	11,600	113,912.00	0.14
310	601456	国联民生	11,000	113,850.00	0.14
311	301308	江波龙	1,300	113,737.00	0.14
312	688520	神州细胞	1,900	113,715.00	0.14
313	000958	电投产融	16,600	113,544.00	0.14
314	600655	豫园股份	20,400	113,220.00	0.14
315	603298	杭叉集团	5,400	113,130.00	0.14
316	600859	王府井	8,140	113,064.60	0.14
317	000598	兴蓉环境	15,600	112,476.00	0.14
318	603737	三棵树	3,052	112,466.20	0.14
319	000563	陕国投 A	31,466	112,333.62	0.14
320	688297	中无人机	2,100	112,140.00	0.14
321	601958	金钼股份	10,200	111,588.00	0.14
322	603077	和邦生物	63,540	111,195.00	0.14
323	600483	福能股份	11,500	110,860.00	0.14
324	600511	国药股份	3,800	110,808.00	0.14
325	600004	白云机场	12,100	110,110.00	0.14
326	603156	养元饮品	5,200	110,032.00	0.14
327	601966	玲珑轮胎	7,500	110,025.00	0.14
328	600663	陆家嘴	12,400	109,864.00	0.14
329	600325	华发股份	22,558	109,857.46	0.14
330	600131	国网信通	6,200	109,740.00	0.14
331	300677	英科医疗	4,580	108,454.40	0.14
332	002756	永兴材料	3,400	107,950.00	0.14
333	000987	越秀资本	15,725	107,873.50	0.14
334	300529	健帆生物	5,000	107,850.00	0.14
335	002507	涪陵榨菜	8,430	107,819.70	0.14
336	000050	深天马 A	12,600	107,352.00	0.13
337	603899	晨光股份	3,700	107,263.00	0.13
338	002773	康弘药业	3,700	107,189.00	0.13
339	300601	康泰生物	7,000	106,330.00	0.13
340	600271	航天信息	11,500	106,260.00	0.13
341	600282	南钢股份	25,300	106,260.00	0.13
342	600378	昊华科技	3,900	105,573.00	0.13
343	000951	中国重汽	6,000	105,480.00	0.13
344	600754	锦江酒店	4,700	105,468.00	0.13

345	688234	天岳先进	1,800	105,390.00	0.13
346	600598	北大荒	7,300	105,266.00	0.13
347	601001	晋控煤业	8,600	105,092.00	0.13
348	600737	中粮糖业	11,100	104,895.00	0.13
349	000559	万向钱潮	13,700	104,805.00	0.13
350	600739	辽宁成大	9,500	104,500.00	0.13
351	300751	迈为股份	1,500	104,340.00	0.13
352	600582	天地科技	17,300	103,627.00	0.13
353	601918	新集能源	15,900	102,714.00	0.13
354	688363	华熙生物	2,000	102,700.00	0.13
355	601333	广深铁路	35,500	102,595.00	0.13
356	301536	星辰科技	1,700	102,510.00	0.13
357	300070	碧水源	22,700	102,150.00	0.13
358	600764	中国海防	3,000	102,000.00	0.13
359	002429	兆驰股份	23,200	101,616.00	0.13
360	601866	中远海发	41,100	101,517.00	0.13
361	003031	中瓷电子	1,900	101,099.00	0.13
362	600867	通化东宝	12,300	100,860.00	0.13
363	300735	光弘科技	4,000	100,400.00	0.13
364	300888	稳健医疗	2,440	100,284.00	0.13
365	600329	达仁堂	3,000	100,080.00	0.13
366	688772	珠海冠宇	7,000	100,030.00	0.13
367	002120	韵达股份	14,900	99,830.00	0.13
368	601231	环旭电子	6,800	99,484.00	0.13
369	600995	南网储能	10,100	98,778.00	0.12
370	603688	石英股份	2,800	98,616.00	0.12
371	601098	中南传媒	7,500	98,400.00	0.12
372	603341	龙旗科技	2,400	97,512.00	0.12
373	600566	济川药业	3,700	97,421.00	0.12
374	002430	杭氧股份	5,000	97,100.00	0.12
375	688676	金盘科技	2,900	97,005.00	0.12
376	600707	彩虹股份	15,000	96,900.00	0.12
377	000027	深圳能源	14,920	95,189.60	0.12
378	601212	白银有色	30,400	95,152.00	0.12
379	688561	奇安信	2,800	95,144.00	0.12
380	688778	厦钨新能	1,700	95,064.00	0.12
381	600578	京能电力	20,900	93,841.00	0.12
382	600258	首旅酒店	6,600	93,258.00	0.12
383	000032	深桑达 A	4,600	93,058.00	0.12
384	002299	圣农发展	6,500	92,885.00	0.12
385	603529	爱玛科技	2,700	92,880.00	0.12
386	000709	河钢股份	42,900	92,664.00	0.12
387	603858	步长制药	5,700	92,568.00	0.12

388	603728	鸣志电器	1,600	91,952.00	0.12
389	688318	财富趋势	800	91,936.00	0.12
390	000967	盈峰环境	13,200	91,740.00	0.12
391	002508	老板电器	4,800	91,248.00	0.11
392	300573	兴齐眼药	1,760	91,150.40	0.11
393	600517	国网英大	17,800	90,780.00	0.11
394	600906	财达证券	13,300	90,706.00	0.11
395	002831	裕同科技	3,860	90,401.20	0.11
396	002670	国盛金控	6,004	90,360.20	0.11
397	000883	湖北能源	20,000	90,200.00	0.11
398	600848	上海临港	9,900	89,793.00	0.11
399	600959	江苏有线	26,000	89,440.00	0.11
400	603290	斯达半导	1,100	89,397.00	0.11
401	601399	国机重装	29,600	88,800.00	0.11
402	601928	凤凰传媒	7,900	88,243.00	0.11
403	600546	山煤国际	10,100	88,173.00	0.11
404	301498	乖宝宠物	800	87,496.00	0.11
405	300595	欧普康视	5,600	85,512.00	0.11
406	000739	普洛药业	6,100	85,400.00	0.11
407	601156	东航物流	6,500	85,085.00	0.11
408	000825	太钢不锈	23,700	85,083.00	0.11
409	600528	中铁工业	11,500	84,870.00	0.11
410	600968	海油发展	20,800	84,864.00	0.11
411	603225	新凤鸣	7,956	84,731.40	0.11
412	600977	中国电影	7,900	84,688.00	0.11
413	600808	马钢股份	24,500	84,525.00	0.11
414	002266	浙富控股	27,330	84,176.40	0.11
415	603565	中谷物流	8,800	84,040.00	0.11
416	601118	海南橡胶	17,800	84,016.00	0.11
417	601636	旗滨集团	16,700	83,667.00	0.11
418	000543	皖能电力	11,900	83,300.00	0.10
419	301301	川宁生物	6,900	83,076.00	0.10
420	601608	中信重工	19,000	83,030.00	0.10
421	002572	索菲亚	5,900	82,659.00	0.10
422	600801	华新水泥	6,936	82,122.24	0.10
423	601598	中国外运	16,600	81,838.00	0.10
424	600056	中国医药	7,900	81,686.00	0.10
425	688387	信科移动	14,400	81,360.00	0.10
426	600062	华润双鹤	4,352	81,208.32	0.10
427	600871	石化油服	41,600	81,120.00	0.10
428	603650	彤程新材	2,500	80,375.00	0.10
429	000582	北部湾港	9,700	80,025.00	0.10
430	601106	中国一重	28,500	79,800.00	0.10

431	000785	居然智家	26,100	79,605.00	0.10
432	300957	贝泰妮	1,800	79,596.00	0.10
433	688702	盛科通信	1,300	79,404.00	0.10
434	688563	航材股份	1,400	79,282.00	0.10
435	600925	苏能股份	14,500	75,835.00	0.10
436	603233	大参林	4,612	75,175.60	0.09
437	600373	中文传媒	7,300	74,971.00	0.09
438	601965	中国汽研	4,200	74,550.00	0.09
439	002153	石基信息	8,608	74,545.28	0.09
440	000429	粤高速 A	5,400	71,982.00	0.09
441	000537	中绿电	8,600	71,896.00	0.09
442	600606	绿地控股	43,800	71,394.00	0.09
443	688281	华秦科技	1,168	70,675.68	0.09
444	002372	伟星新材	6,760	70,033.60	0.09
445	601568	北元集团	16,740	69,471.00	0.09
446	001286	陕西能源	7,900	68,730.00	0.09
447	600361	创新新材	17,200	68,628.00	0.09
448	600098	广州发展	10,900	68,125.00	0.09
449	688425	铁建重工	16,600	67,728.00	0.09
450	603658	安图生物	1,800	67,500.00	0.08
451	003022	联泓新科	4,200	66,486.00	0.08
452	600688	上海石化	22,800	64,980.00	0.08
453	600612	老凤祥	1,300	64,675.00	0.08
454	688349	三一重能	2,570	64,095.80	0.08
455	000937	冀中能源	11,100	63,825.00	0.08
456	601019	山东出版	6,600	62,502.00	0.08
457	301165	锐捷网络	980	60,230.80	0.08
458	000898	鞍钢股份	25,200	58,464.00	0.07
459	600339	中油工程	17,700	57,879.00	0.07
460	601139	深圳燃气	9,100	57,876.00	0.07
461	002608	江苏国信	7,800	57,174.00	0.07
462	600032	浙江新能	7,500	56,700.00	0.07
463	688248	南网科技	1,800	56,628.00	0.07
464	603707	健友股份	5,060	56,419.00	0.07
465	688100	威胜信息	1,500	55,575.00	0.07
466	000959	首钢股份	16,200	55,080.00	0.07
467	003035	南网能源	12,000	55,080.00	0.07
468	600720	中交设计	7,100	54,883.00	0.07
469	600295	鄂尔多斯	6,300	54,873.00	0.07
470	688032	禾迈股份	547	54,623.42	0.07
471	600928	西安银行	13,800	54,096.00	0.07
472	002461	珠江啤酒	4,600	51,934.00	0.07
473	603556	海兴电力	2,000	50,940.00	0.06

474	601228	广州港	15,700	50,711.00	0.06
475	688475	萤石网络	1,600	50,432.00	0.06
476	301267	华夏眼科	2,600	49,842.00	0.06
477	688172	燕东微	2,500	49,150.00	0.06
478	688375	国博电子	796	47,767.96	0.06
479	601061	中信金属	5,700	45,087.00	0.06
480	002563	森马服饰	8,500	44,710.00	0.06
481	603786	科博达	800	44,328.00	0.06
482	600007	中国国贸	2,100	43,218.00	0.05
483	600927	永安期货	2,900	42,949.00	0.05
484	000539	粤电力 A	9,300	42,222.00	0.05
485	600299	安迪苏	4,200	40,530.00	0.05
486	002945	华林证券	2,800	40,236.00	0.05
487	300140	节能环保	6,500	40,105.00	0.05
488	603826	坤彩科技	2,040	39,922.80	0.05
489	688819	天能股份	1,400	38,864.00	0.05
490	001213	中铁特货	9,300	37,758.00	0.05
491	601921	浙版传媒	4,600	37,076.00	0.05
492	601858	中国科传	1,500	29,175.00	0.04
493	601158	重庆水务	6,100	28,304.00	0.04
494	688153	唯捷创芯	900	27,909.00	0.04
495	600956	新天绿能	3,200	24,704.00	0.03
496	001389	广合科技	400	23,508.00	0.03
497	688295	中复神鹰	1,000	20,800.00	0.03
498	603868	飞科电器	500	17,935.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	41,300	0.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688608	恒玄科技	336,838.92	0.43
2	688235	百济神州	311,873.00	0.40
3	000933	神火股份	279,068.00	0.36
4	300450	先导智能	253,497.00	0.33
5	300454	深信服	251,980.00	0.33
6	002130	沃尔核材	245,877.00	0.32
7	300458	全志科技	239,608.00	0.31
8	600363	联创光电	235,400.00	0.30

9	300346	南大光电	219,041.00	0.28
10	002851	麦格米特	217,699.00	0.28
11	300115	长盈精密	209,244.00	0.27
12	300857	协创数据	205,682.60	0.27
13	605589	圣泉集团	191,803.00	0.25
14	600171	上海贝岭	191,757.00	0.25
15	002007	华兰生物	184,679.00	0.24
16	603659	璞泰来	183,661.00	0.24
17	300627	华测导航	182,868.00	0.24
18	002837	英维克	166,935.00	0.22
19	000528	柳 工	164,969.00	0.21
20	600562	国睿科技	157,628.00	0.20

注：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	600418	江淮汽车	839,523.38	1.08
2	002625	光启技术	668,660.00	0.86
3	002384	东山精密	508,985.00	0.66
4	301236	软通动力	360,819.00	0.47
5	302132	中航成飞	275,074.00	0.35
6	300866	安克创新	248,746.80	0.32
7	002128	电投能源	243,362.00	0.31
8	688047	龙芯中科	233,683.20	0.30
9	603444	吉比特	228,103.00	0.29
10	601567	三星医疗	189,611.00	0.24
11	600642	申能股份	188,520.00	0.24
12	002407	多氟多	154,765.40	0.20
13	688331	荣昌生物	150,836.25	0.19
14	688536	思瑞浦	141,895.00	0.18
15	000818	航锦科技	139,002.00	0.18
16	002487	大金重工	132,559.00	0.17
17	600416	湘电股份	116,497.00	0.15
18	000998	隆平高科	114,732.00	0.15
19	688005	容百科技	114,143.69	0.15
20	300009	安科生物	114,047.80	0.15

注：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	15,370,057.37
卖出股票收入（成交）总额	15,854,653.30

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,627,265.59	3.30
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,627,265.59	3.30

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	20,000	2,025,411.51	2.55
2	019773	25 国债 08	6,000	601,854.08	0.76

## 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。



7.12 投资组合报告附注

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

2025 年 4 月 9 日，苏州银行股份有限公司因基金托管业务存在以下问题：一、人员管理方面，个别核心业务岗位人员不具备 2 年托管业务从业经验；二、估值核算方面，针对个别所托管基金估值对账不一致的情况，未及时处理并向基金管理人提示反馈；三、内部控制方面，内控稽核部同时承担投资监督和稽核管理职责；公司资产托管系统个别产品基本信息录入有误，被江苏证监局采取出具警示函的行政监督管理措施。

2025 年 1 月 2 日，东吴证券股份有限公司因财务会计报告违规，信息披露违规，未履行信披义务，内部制度不完善，未依法履行其他职责，涉嫌违反相关法律法规等，被中国证监会责令改正，给予警告，处以罚款 563.6 万元，没收违法所得 772.84 万元。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

其余证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	4,063.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	92,242.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,306.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	0.00	0.00	公告重大事项

## § 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（%）
4,609	11,255.93	297,367.97	0.57	51,581,231.32	99.43

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	39,705.33	0.0765

## 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	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	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	52,427,517.28
本报告期基金总申购份额	9,875,297.75
减：本报告期基金总赎回份额	10,424,215.74
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	51,878,599.29

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内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、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 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

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 (%)	
东方证券	2	16,651,433.44	53.33	3,295.38	53.33	—
高华证券	1	14,573,277.23	46.67	2,883.98	46.67	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—

注：1、交易单元选择标准有：

- (1) 财务状况良好, 注册资本不少于 20 亿元人民币, 最近一个完整年度在证券业协会披露的审计报告被出具无保留意见。
- (2) 交易、研究等服务能力较强, 最近一个完整年度年报披露的佣金席位占比在全市场前 1/2。
- (3) 经营行为规范, 合规风控能力较强, 最近一年未因研究、交易业务违规而在中国证券监督管理委员会及其派出机构网站披露受到行政处罚。
- 2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	2,601,212.00	100.00	5,050,000.00	100.00	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 1 月 21 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 托管协议	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 20 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 基金合同	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 20 日
4	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 招募说明书更新-2025 年第 1 次	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 22 日
5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 22 日
6	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 28 日
7	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2025 年 4 月 21 日
8	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2025 年 6 月 27 日
9	农银汇理中证 500 指数证券投资基金	中国证监会规定的媒介	2025 年 6 月 27 日

	-招募说明书更新-2025 年第 2 次		
--	----------------------	--	--

**§ 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**

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%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、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

**12.2 存放地点**

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

**12.3 查阅方式**

投资者可到基金管理人的住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。

农银汇理基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日