

农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
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	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
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 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	农银中证 1000 指数增强	
基金主代码	017323	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 18 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,679,484.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017323	017324
报告期末下属分级基金的份额总额	30,997,045.91 份	23,682,438.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化及基本面选股方法进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金作为指数增强型基金，以跟踪中证 1000 指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过数量化方法对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。 1、股票投资策略：（1）指数投资策略。（2）指数增强策略。2、债券投资策略。3、资产支持证券投资策略。4、参与融资及转融通证券出借业务策略。5、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券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		农银汇理基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	翟爱东	郭明

负责人	联系电话	021-61095588	010-66105799
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		黄涛	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-2,706,188.10	-966,466.43
本期利润	-4,750,817.42	-2,540,239.37
加权平均基金份额 本期利润	-0.1439	-0.1663
本期加权平均净 值利润率	-15.81%	-18.37%
本期基金份额净 值增长率	-14.61%	-14.78%
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	-4,207,885.91	-3,292,312.32
期末可供分配基金份额利润	-0.1358	-0.1390
期末基金资产净值	26,789,160.00	20,390,126.65
期末基金份额净值	0.8642	0.8610
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	-13.58%	-13.90%

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

农银中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.16%	1.10%	-8.15%	1.36%	1.99%	-0.26%
过去三个月	-6.07%	1.20%	-9.51%	1.42%	3.44%	-0.22%
过去六个月	-14.61%	1.64%	-15.97%	1.87%	1.36%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-13.58%	1.18%	-23.67%	1.50%	10.09%	-0.32%

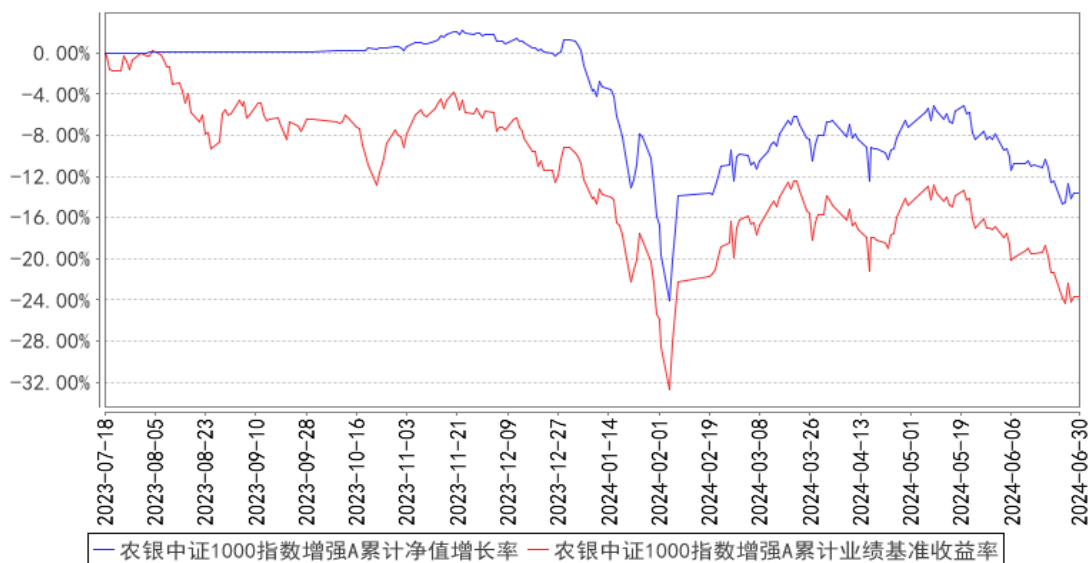
农银中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.18%	1.10%	-8.15%	1.36%	1.97%	-0.26%
过去三个月	-6.15%	1.20%	-9.51%	1.42%	3.36%	-0.22%

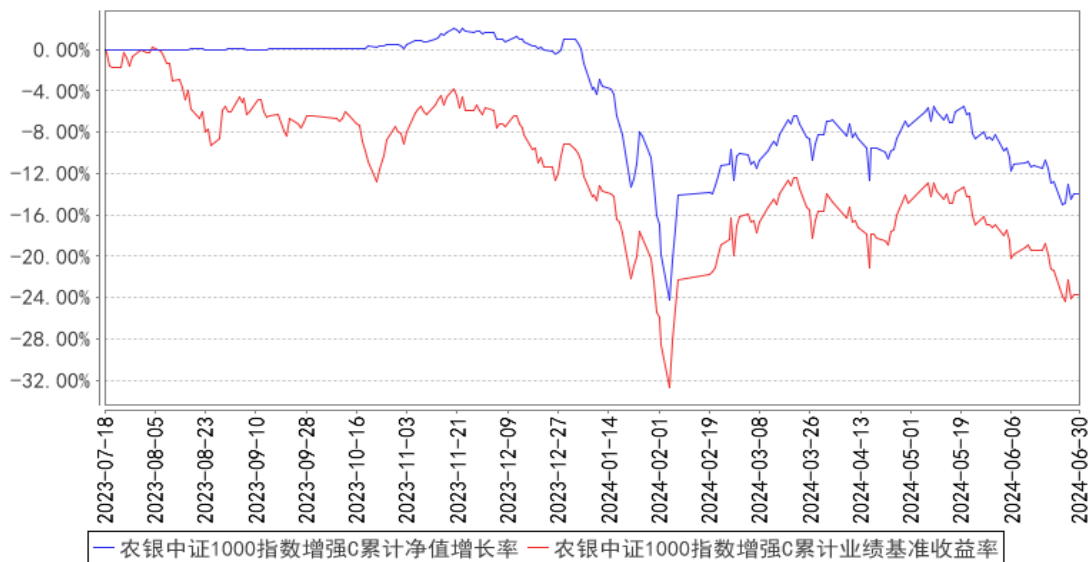
过去六个月	-14.78%	1.64%	-15.97%	1.87%	1.19%	-0.23%
自基金合同生效起至今	-13.90%	1.18%	-23.67%	1.50%	9.77%	-0.32%

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

农银中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金建仓期为基金合同生效日（2023 年 7 月 18 日）起 6 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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 83 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、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金、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、农银汇理国企优选混合型证券投资基金、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。

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	2023 年 7 月 18 日	-	16 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，进行基金日常交易和操作操作，针对市场偏弱的状态，本基金采取适当偏低仓位策略。增强方面根据多因子策略进行了组合操作，整体看，对市场的走势判断基本正确，上半年市场基本上处于震荡下跌的过程，基金的操作也获取了部分超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 基金份额净值为 0.8642 元，本报告期基金份额净值增长率为 -14.61%，同期业绩比较基准收益率为 -15.97%；截至本报告期末本基金 C 基金份额净值为 0.8610 元，本报告期基金份额净值增长率为 -14.78%，同期业绩比较基准收益率为 -15.97%。

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 1000 指数的指数增强型产品，我们将坚持指数被动化投资理念，同时通过运用定量分析技术，结合基本面分析，在控制基金的跟踪误差的前提下，获得超过标的指数的收益率，从而为投资者提供一个增强型的指数投资工具。

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、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

本基金从 2024 年 1 月 3 日至 2024 年 3 月 18 日, 从 2024 年 3 月 26 日至 2024 年 6 月 3 日, 分别连续 20 个工作日以上出现基金资产净值低于 5000 万的情形, 根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件, 予以披露。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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

本报告期内，本基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,849,021.13	11,242,604.57
结算备付金		193,739.13	275,506.15
存出保证金		10,565.06	5,713.26
交易性金融资产	6.4.7.2	38,623,295.27	45,226,346.00
其中：股票投资		37,605,104.86	45,226,346.00
基金投资		-	-
债券投资		1,018,190.41	-
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		134,346.23	108,822.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		47,810,966.82	56,858,992.42
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,519,836.46
应付赎回款		408,880.02	721,503.90
应付管理人报酬		31,317.18	30,730.61
应付托管费		5,872.00	5,761.99
应付销售服务费		6,587.22	4,062.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	179,023.70	157,589.94
负债合计		631,680.17	5,439,485.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	54,679,484.88	50,834,960.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-7,500,198.23	584,546.27
净资产合计		47,179,286.65	51,419,506.98
负债和净资产总计		47,810,966.82	56,858,992.42

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 54,679,484.88 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8642 元，基金份额总额 30,997,045.91 份；下属 C 类基金份额净值 0.8610 元，基金份额总额 23,682,438.97 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		-7,005,324.71
1. 利息收入		11,882.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,728.24
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		154.47
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,478,458.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,984,875.96
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	11,090.41
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	495,327.51
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	-3,618,402.26
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	79,652.88
减：二、营业总支出		285,732.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	174,346.21
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,690.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,217.64
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	51,478.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,291,056.79
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,291,056.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-7,291,056.79

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金

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、上期期末净资产	50,834,960.71	-	584,546.27	51,419,506.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	50,834,960.71	-	584,546.27	51,419,506.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,844,524.17	-	-8,084,744.50	-4,240,220.33
（一）、综合收益总额	-	-	-7,291,056.79	-7,291,056.79
（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）	3,844,524.17	-	-793,687.71	3,050,836.46
其中：1. 基金申购款	56,271,868.55	-	-4,737,322.33	51,534,546.22
2. 基金赎回款	-52,427,344.38	-	3,943,634.62	-48,483,709.76
（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	54,679,484.88	-	-7,500,198.23	47,179,286.65

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>程昆</u>	<u>毕宏燕</u>	<u>丁煜琼</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

农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金(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[2022]2727 号《关于准予农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,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 1000 指数增强型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 223,126,939.07 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0302 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,274,293.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,354.47 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费、赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费、赎回时收取赎回费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。各类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证 1000 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含主板、创业板及其他经中国证监会

核准、注册上市的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[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[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	8,849,021.13
等于：本金	8,848,321.40
加：应计利息	699.73
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	8,849,021.13

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	40,854,517.18	-	37,605,104.86	-3,249,412.32	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,001,770.00	15,690.41	1,018,190.41	730.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,001,770.00	15,690.41	1,018,190.41	730.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	41,856,287.18	15,690.41	38,623,295.27	-3,248,682.32	

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
----	-----

	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	129,297.66
其中：交易所市场	129,297.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,726.04
合计	179,023.70

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银中证 1000 指数增强 A

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	34,491,781.96	34,491,781.96
本期申购	16,876,425.58	16,876,425.58
本期赎回（以“-”号填列）	-20,371,161.63	-20,371,161.63
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	30,997,045.91	30,997,045.91

农银中证 1000 指数增强 C

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	16,343,178.75	16,343,178.75
本期申购	39,395,442.97	39,395,442.97
本期赎回（以“-”号填列）	-32,056,182.75	-32,056,182.75
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	23,682,438.97	23,682,438.97

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

农银中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	88,397.98	327,752.38	416,150.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	88,397.98	327,752.38	416,150.36
本期利润	-2,706,188.10	-2,044,629.32	-4,750,817.42
本期基金份额交易产生的变动数	128,114.42	-1,333.27	126,781.15
其中：基金申购款	-1,108,543.15	-312,442.07	-1,420,985.22
基金赎回款	1,236,657.57	311,108.80	1,547,766.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,489,675.70	-1,718,210.21	-4,207,885.91

农银中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,306.07	155,089.84	168,395.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,306.07	155,089.84	168,395.91
本期利润	-966,466.43	-1,573,772.94	-2,540,239.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,030,202.36	109,733.50	-920,468.86
其中：基金申购款	-3,103,006.19	-213,330.92	-3,316,337.11
基金赎回款	2,072,803.83	323,064.42	2,395,868.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,983,362.72	-1,308,949.60	-3,292,312.32

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	10,223.22
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	1,411.26
其他	93.76
合计	11,728.24

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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	111,449,814.72
减：卖出股票成本总额	115,154,124.67
减：交易费用	280,566.01
买卖股票差价收入	-3,984,875.96

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	11,090.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	11,090.41

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	495,327.51
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	495,327.51

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	-3,618,402.26
股票投资	-3,619,132.26
债券投资	730.00
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	-3,618,402.26

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	79,592.31
基金转换费收入	60.57
合计	79,652.88

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	1,752.18
合计	51,478.22

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金管理人的股东、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 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	174,346.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	84,864.49
应支付基金管理人的净管理费	89,481.72

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 0.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	32,690.01

注：支付基金托管人工商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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银中证 1000 指数 增强 A	农银中证 1000 指数 增强 C	合计
农业银行	0.00	24,275.32	24,275.32
合计	0.00	24,275.32	24,275.32

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给农银汇理，再由农银汇理计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

本基金本报告期末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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	8,849,021.13	10,223.22

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

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（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

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

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,018,190.41	-
合计	1,018,190.41	-

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

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 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

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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、流通受限制的投资品种比例、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。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	8,849,021.13	-	-	-	8,849,021.13
结算备付金	193,739.13	-	-	-	193,739.13
存出保证金	10,565.06	-	-	-	10,565.06
交易性金融资产	1,018,190.41	-	-	37,605,104.86	38,623,295.27
应收申购款	-	-	-	134,346.23	134,346.23
资产总计	10,071,515.73	-	-	37,739,451.09	47,810,966.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	408,880.02	408,880.02
应付管理人报酬	-	-	-	31,317.18	31,317.18
应付托管费	-	-	-	5,872.00	5,872.00
应付销售服务费	-	-	-	6,587.22	6,587.22
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	179,023.70	179,023.70
负债总计	-	-	-	631,680.17	631,680.17
利率敏感度缺口	10,071,515.73	-	-	37,107,770.92	47,179,286.65
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	11,242,604.57	-	-	-	11,242,604.57
结算备付金	275,506.15	-	-	-	275,506.15
存出保证金	5,713.26	-	-	-	5,713.26
交易性金融资产	-	-	-	45,226,346.00	45,226,346.00
应收申购款	-	-	-	108,822.44	108,822.44
资产总计	11,523,823.98	-	-	45,335,168.44	56,858,992.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	721,503.90	721,503.90
应付管理人报酬	-	-	-	30,730.61	30,730.61
应付托管费	-	-	-	5,761.99	5,761.99
应付清算款	-	-	-	4,519,836.46	4,519,836.46
应付销售服务费	-	-	-	4,062.54	4,062.54
其他负债	-	-	-	157,589.94	157,589.94
负债总计	-	-	-	5,439,485.44	5,439,485.44
利率敏感度缺口	11,523,823.98	-	-	39,895,683.00	51,419,506.98

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-826.01	-
市场利率下降 25 个基点	826.01	-	

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 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	37,605,104.86	79.71	45,226,346.00	87.96
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	37,605,104.86	79.71	45,226,346.00	87.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至本报告期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期末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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	37,605,104.86	45,226,346.00
第二层次	1,018,190.41	-
第三层次	-	-
合计	38,623,295.27	45,226,346.00

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	37,605,104.86	78.65
	其中：股票	37,605,104.86	78.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,018,190.41	2.13
	其中：债券	1,018,190.41	2.13
	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	9,042,760.26	18.91
8	其他各项资产	144,911.29	0.30
9	合计	47,810,966.82	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	18,186.00	0.04
B	采矿业	1,549,947.00	3.29
C	制造业	21,483,553.00	45.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	966,304.46	2.05
E	建筑业	301,904.00	0.64
F	批发和零售业	2,099,567.00	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	1,694,771.00	3.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,537,194.30	3.26
J	金融业	875,986.90	1.86
K	房地产业	461,812.00	0.98
L	租赁和商务服务业	774,508.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	88,500.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	704,690.00	1.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,447.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	430,277.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	33,056,647.66	70.07

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,879,137.00	6.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	204,638.00	0.43
E	建筑业	128,160.00	0.27
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	809,283.00	1.72
J	金融业	312,596.00	0.66
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	10,099.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	204,544.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,548,457.20	9.64

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	603328	依顿电子	46,700	367,062.00	0.78
2	002745	木林森	43,800	353,028.00	0.75

3	002249	大洋电机	71,200	336,776.00	0.71
4	601311	骆驼股份	41,800	335,236.00	0.71
5	002274	华昌化工	44,700	331,674.00	0.70
6	603919	金徽酒	17,100	310,707.00	0.66
7	600835	上海机电	26,000	299,260.00	0.63
8	600601	方正科技	99,300	297,900.00	0.63
9	600475	华光环能	33,600	292,656.00	0.62
10	002139	拓邦股份	27,200	288,864.00	0.61
11	600711	盛屯矿业	69,200	253,964.00	0.54
12	002993	奥海科技	6,800	252,960.00	0.54
13	300303	聚飞光电	51,700	251,262.00	0.53
14	603995	甬金股份	14,200	248,784.00	0.53
15	300428	立中集团	13,200	245,388.00	0.52
16	000019	深粮控股	41,800	239,932.00	0.51
17	002583	海能达	58,900	239,723.00	0.51
18	002020	京新药业	22,800	238,716.00	0.51
19	600717	天津港	55,900	238,693.00	0.51
20	600864	哈投股份	49,200	233,700.00	0.50
21	600125	铁龙物流	39,000	232,830.00	0.49
22	002191	劲嘉股份	64,400	232,484.00	0.49
23	002267	陕天然气	30,300	229,068.00	0.49
24	000088	盐田港	49,900	226,047.00	0.48
25	603299	苏盐井神	23,500	223,250.00	0.47
26	300841	康华生物	4,400	222,816.00	0.47
27	603730	岱美股份	21,840	217,089.60	0.46
28	600933	爱柯迪	14,500	214,455.00	0.45
29	002004	华邦健康	56,200	213,560.00	0.45
30	002283	天润工业	49,300	211,497.00	0.45
31	603103	横店影视	14,900	206,216.00	0.44
32	603368	柳药集团	11,700	204,750.00	0.43
33	000951	中国重汽	14,100	201,912.00	0.43
34	000811	冰轮环境	20,800	200,720.00	0.43
35	002978	安宁股份	7,200	200,592.00	0.43
36	300674	宇信科技	17,600	195,008.00	0.41
37	000062	深圳华强	21,500	191,350.00	0.41
38	603113	金能科技	34,800	190,356.00	0.40
39	601163	三角轮胎	12,400	188,728.00	0.40
40	600267	海正药业	26,700	187,434.00	0.40
41	600323	瀚蓝环境	8,800	183,920.00	0.39
42	600971	恒源煤电	15,300	182,682.00	0.39
43	600595	中孚实业	73,300	182,517.00	0.39
44	601952	苏垦农发	20,200	182,204.00	0.39
45	002390	信邦制药	54,600	180,726.00	0.38

46	000030	富奥股份	36,400	178,724.00	0.38
47	600623	华谊集团	30,800	178,024.00	0.38
48	600929	雪天盐业	33,500	177,550.00	0.38
49	605589	圣泉集团	8,600	174,494.00	0.37
50	601777	力帆科技	45,400	174,336.00	0.37
51	000061	农产品	35,200	171,072.00	0.36
52	601886	江河集团	34,800	169,824.00	0.36
53	603881	数据港	13,130	166,882.30	0.35
54	002318	久立特材	7,100	165,643.00	0.35
55	605090	九丰能源	5,700	165,300.00	0.35
56	600285	羚锐制药	6,700	162,207.00	0.34
57	300679	电连技术	4,000	160,920.00	0.34
58	300741	华宝股份	10,400	158,496.00	0.34
59	601333	广深铁路	48,800	158,112.00	0.34
60	002233	塔牌集团	21,300	155,703.00	0.33
61	300130	新国都	9,100	151,424.00	0.32
62	002773	康弘药业	6,900	149,385.00	0.32
63	600575	淮河能源	37,800	147,042.00	0.31
64	000758	中色股份	28,800	146,304.00	0.31
65	601222	林洋能源	23,300	146,091.00	0.31
66	600420	国药现代	13,400	143,112.00	0.30
67	300170	汉得信息	23,100	141,834.00	0.30
68	000860	顺鑫农业	8,400	140,616.00	0.30
69	600012	皖通高速	10,000	139,700.00	0.30
70	600916	中国黄金	14,500	139,490.00	0.30
71	300470	中密控股	4,100	138,621.00	0.29
72	601801	皖新传媒	20,000	138,600.00	0.29
73	688408	中信博	1,500	138,120.00	0.29
74	600507	方大特钢	36,900	138,006.00	0.29
75	601326	秦港股份	43,100	136,627.00	0.29
76	600459	贵研铂业	10,100	136,451.00	0.29
77	002701	奥瑞金	32,700	136,032.00	0.29
78	600120	浙江东方	40,600	135,604.00	0.29
79	002215	诺普信	18,200	135,590.00	0.29
80	300123	亚光科技	29,200	135,488.00	0.29
81	600057	厦门象屿	19,900	135,320.00	0.29
82	601101	昊华能源	14,700	135,093.00	0.29
83	605507	国邦医药	8,100	134,865.00	0.29
84	002221	东华能源	16,300	133,823.00	0.28
85	601702	华峰铝业	7,300	133,298.00	0.28
86	000034	神州数码	5,800	132,762.00	0.28
87	600007	中国国贸	6,000	131,760.00	0.28
88	002204	大连重工	30,800	131,516.00	0.28

89	603323	苏农银行	27,300	131,313.00	0.28
90	300596	利安隆	4,800	130,224.00	0.28
91	300134	大富科技	19,000	129,580.00	0.27
92	603983	丸美股份	4,700	129,391.00	0.27
93	300224	正海磁材	13,900	128,714.00	0.27
94	600366	宁波韵升	24,400	127,368.00	0.27
95	603071	物产环能	10,000	125,300.00	0.27
96	002913	奥士康	4,600	123,326.00	0.26
97	601969	海南矿业	19,300	122,362.00	0.26
98	600812	华北制药	29,500	121,540.00	0.26
99	600691	阳煤化工	70,500	120,555.00	0.26
100	002183	怡亚通	42,400	120,416.00	0.26
101	000058	深赛格	22,400	120,288.00	0.25
102	601609	金田股份	21,200	119,992.00	0.25
103	002697	红旗连锁	25,900	119,917.00	0.25
104	600295	鄂尔多斯	12,000	119,040.00	0.25
105	600776	东方通信	12,100	118,943.00	0.25
106	600643	爱建集团	31,400	118,378.00	0.25
107	603187	海容冷链	10,100	117,766.00	0.25
108	002489	浙江永强	49,600	117,552.00	0.25
109	002434	万里扬	23,700	116,130.00	0.25
110	600997	开滦股份	16,900	115,934.00	0.25
111	002034	旺能环境	8,900	115,789.00	0.25
112	002287	奇正藏药	5,900	115,522.00	0.24
113	688388	嘉元科技	11,800	115,050.00	0.24
114	000049	德赛电池	4,900	114,905.00	0.24
115	300319	麦捷科技	12,300	114,759.00	0.24
116	600966	博汇纸业	24,000	114,720.00	0.24
117	603877	太平鸟	8,200	112,586.00	0.24
118	601015	陕西黑猫	39,500	110,600.00	0.23
119	601677	明泰铝业	9,500	109,820.00	0.23
120	600963	岳阳林纸	29,700	108,999.00	0.23
121	000761	本钢板材	43,400	108,934.00	0.23
122	603583	捷昌驱动	5,300	108,014.00	0.23
123	301316	慧博云通	7,300	107,164.00	0.23
124	002402	和而泰	10,000	107,100.00	0.23
125	300770	新媒股份	3,200	106,816.00	0.23
126	603678	火炬电子	4,300	106,167.00	0.23
127	600587	新华医疗	6,710	105,615.40	0.22
128	300755	华致酒行	7,700	105,182.00	0.22
129	600850	电科数字	5,800	104,980.00	0.22
130	600562	国睿科技	7,600	103,816.00	0.22
131	603888	新华网	4,700	101,097.00	0.21

132	000902	新洋丰	8,400	99,708.00	0.21
133	600480	凌云股份	10,100	99,283.00	0.21
134	600821	金开新能	19,200	98,688.00	0.21
135	600729	重庆百货	4,400	98,384.00	0.21
136	600064	南京高科	16,200	98,334.00	0.21
137	300747	锐科激光	5,500	97,625.00	0.21
138	000012	南玻 A	19,200	96,768.00	0.21
139	601678	滨化股份	27,800	96,744.00	0.21
140	000727	冠捷科技	46,800	96,408.00	0.20
141	600409	三友化工	19,200	96,384.00	0.20
142	000927	中国铁物	40,300	95,914.00	0.20
143	600797	浙大网新	20,700	95,841.00	0.20
144	600621	华鑫股份	7,800	95,628.00	0.20
145	002171	楚江新材	14,500	95,555.00	0.20
146	600123	兰花科创	10,600	94,870.00	0.20
147	600037	歌华有线	15,800	94,484.00	0.20
148	002237	恒邦股份	8,200	94,382.00	0.20
149	600273	嘉化能源	13,200	94,248.00	0.20
150	603043	广州酒家	5,900	94,223.00	0.20
151	603118	共进股份	14,000	93,800.00	0.20
152	600888	新疆众和	13,200	93,324.00	0.20
153	300039	上海凯宝	17,400	93,090.00	0.20
154	000795	英洛华	16,800	93,072.00	0.20
155	600710	苏美达	11,400	92,910.00	0.20
156	600197	伊力特	5,200	92,612.00	0.20
157	300777	中简科技	4,300	92,450.00	0.20
158	002960	青鸟消防	7,300	92,272.00	0.20
159	000582	北部湾港	12,400	92,256.00	0.20
160	000990	诚志股份	12,300	91,512.00	0.19
161	000090	天健集团	22,700	91,254.00	0.19
162	002276	万马股份	12,700	91,059.00	0.19
163	601200	上海环境	10,700	90,950.00	0.19
164	002053	云南能投	7,500	90,675.00	0.19
165	002038	双鹭药业	12,300	90,651.00	0.19
166	002048	宁波华翔	7,000	90,580.00	0.19
167	002226	江南化工	20,200	90,496.00	0.19
168	603229	奥翔药业	9,000	90,450.00	0.19
169	000028	国药一致	2,800	90,244.00	0.19
170	688289	圣湘生物	5,100	89,658.00	0.19
171	600662	外服控股	22,300	89,423.00	0.19
172	000828	东莞控股	9,900	89,199.00	0.19
173	600508	上海能源	6,300	89,145.00	0.19
174	000650	仁和药业	15,100	89,090.00	0.19

175	000968	蓝焰控股	14,000	89,040.00	0.19
176	002967	广电计量	7,500	88,500.00	0.19
177	301219	腾远钴业	2,300	87,998.00	0.19
178	603936	博敏电子	10,400	87,360.00	0.19
179	002545	东方铁塔	12,800	87,168.00	0.18
180	002643	万润股份	8,700	87,000.00	0.18
181	002158	汉钟精机	5,200	86,944.00	0.18
182	600810	神马股份	14,000	86,800.00	0.18
183	688366	昊海生科	1,400	86,352.00	0.18
184	601811	新华文轩	6,100	85,461.00	0.18
185	002302	西部建设	16,400	85,280.00	0.18
186	600618	氯碱化工	9,700	85,166.00	0.18
187	000550	江铃汽车	3,900	84,669.00	0.18
188	002498	汉缆股份	25,700	84,553.00	0.18
189	000552	甘肃能化	24,300	84,321.00	0.18
190	600223	福瑞达	11,900	84,133.00	0.18
191	603093	南华期货	9,700	84,002.00	0.18
192	603013	亚普股份	6,200	83,514.00	0.18
193	000597	东北制药	21,500	83,205.00	0.18
194	000718	苏宁环球	49,300	82,824.00	0.18
195	688127	蓝特光学	4,400	80,916.00	0.17
196	688508	芯朋微	2,200	80,014.00	0.17
197	600649	城投控股	23,900	79,348.00	0.17
198	600456	宝钛股份	3,100	79,143.00	0.17
199	000885	城发环境	6,400	77,888.00	0.17
200	000567	海德股份	13,790	77,361.90	0.16
201	605376	博迁新材	3,400	76,738.00	0.16
202	601515	东峰集团	20,600	75,190.00	0.16
203	603301	振德医疗	3,600	75,096.00	0.16
204	002727	一心堂	4,900	73,941.00	0.16
205	002782	可立克	6,600	73,128.00	0.16
206	000025	特力A	5,400	72,576.00	0.15
207	603033	三维股份	6,200	72,540.00	0.15
208	600782	新钢股份	21,400	71,048.00	0.15
209	600169	太原重工	38,800	71,004.00	0.15
210	300203	聚光科技	7,000	70,630.00	0.15
211	002911	佛燃能源	7,689	70,277.46	0.15
212	000767	晋控电力	30,000	69,900.00	0.15
213	600604	市北高新	20,100	69,546.00	0.15
214	002275	桂林三金	5,600	69,496.00	0.15
215	600577	精达股份	17,500	69,475.00	0.15
216	688526	科前生物	4,600	67,574.00	0.14
217	002265	建设工业	7,800	67,314.00	0.14

218	688321	微芯生物	3,800	66,880.00	0.14
219	002250	联化科技	13,800	66,240.00	0.14
220	600903	贵州燃气	10,600	66,144.00	0.14
221	603938	三孚股份	5,600	65,800.00	0.14
222	300869	康泰医学	5,000	65,350.00	0.14
223	600861	北京人力	4,000	65,280.00	0.14
224	605222	起帆电缆	4,200	64,428.00	0.14
225	600787	中储股份	13,300	63,973.00	0.14
226	300382	斯莱克	10,800	63,828.00	0.14
227	688158	优刻得	6,200	63,426.00	0.13
228	605009	豪悦护理	1,600	63,104.00	0.13
229	600110	诺德股份	19,800	60,390.00	0.13
230	000016	深康佳 A	28,200	60,066.00	0.13
231	002549	凯美特气	11,600	59,276.00	0.13
232	002537	海联金汇	10,800	55,836.00	0.12
233	000913	钱江摩托	3,200	50,432.00	0.11
234	600163	中闽能源	10,400	50,128.00	0.11
235	600179	安通控股	20,500	47,765.00	0.10
236	003006	百亚股份	2,000	47,400.00	0.10
237	600740	山西焦化	11,400	44,688.00	0.09
238	002043	兔宝宝	4,200	43,554.00	0.09
239	300323	华灿光电	10,000	43,500.00	0.09
240	600006	东风汽车	6,800	43,452.00	0.09
241	002378	章源钨业	7,500	43,050.00	0.09
242	000603	盛达资源	3,600	42,588.00	0.09
243	000415	渤海租赁	16,500	42,075.00	0.09
244	603595	东尼电子	2,000	41,180.00	0.09
245	603699	纽威股份	2,400	41,088.00	0.09
246	600259	广晟有色	1,500	41,010.00	0.09
247	600491	龙元建设	14,900	40,826.00	0.09
248	300077	国民技术	4,600	40,158.00	0.09
249	300855	图南股份	1,500	39,660.00	0.08
250	603565	中谷物流	4,500	39,330.00	0.08
251	002534	西子洁能	3,900	39,039.00	0.08
252	300579	数字认证	2,000	39,000.00	0.08
253	605333	沪光股份	1,400	38,990.00	0.08
254	688696	极米科技	500	38,620.00	0.08
255	600395	盘江股份	6,400	38,464.00	0.08
256	688686	奥普特	600	38,418.00	0.08
257	002467	二六三	11,500	38,410.00	0.08
258	688001	华兴源创	1,700	38,386.00	0.08
259	300671	富满微	1,500	38,130.00	0.08
260	300151	昌红科技	2,400	37,968.00	0.08

261	300358	楚天科技	5,100	37,944.00	0.08
262	300821	东岳硅材	5,500	37,620.00	0.08
263	603871	嘉友国际	2,100	37,149.00	0.08
264	300143	盈康生命	4,900	36,897.00	0.08
265	300768	迪普科技	3,100	36,735.00	0.08
266	603989	艾华集团	2,600	36,556.00	0.08
267	601869	长飞光纤	1,500	36,495.00	0.08
268	688268	华特气体	700	36,127.00	0.08
269	300332	天壕能源	6,800	36,108.00	0.08
270	002421	达实智能	15,400	35,882.00	0.08
271	002101	广东鸿图	3,400	35,802.00	0.08
272	000557	西部创业	9,400	35,344.00	0.07
273	688298	东方生物	1,300	35,295.00	0.07
274	002488	金固股份	8,000	35,120.00	0.07
275	600750	江中药业	1,500	34,665.00	0.07
276	002516	旷达科技	9,500	34,580.00	0.07
277	300587	天铁股份	8,500	34,340.00	0.07
278	300811	铂科新材	780	34,242.00	0.07
279	002190	成飞集成	2,400	33,888.00	0.07
280	600780	通宝能源	5,700	33,630.00	0.07
281	600217	中再资环	8,900	33,464.00	0.07
282	603055	台华新材	3,300	33,429.00	0.07
283	600400	红豆股份	15,300	33,201.00	0.07
284	600058	五矿发展	5,000	33,000.00	0.07
285	000503	国新健康	4,900	32,683.00	0.07
286	002219	新里程	17,500	32,550.00	0.07
287	001338	永顺泰	3,300	32,340.00	0.07
288	601908	京运通	12,500	31,625.00	0.07
289	603718	海利生物	5,100	31,467.00	0.07
290	603566	普莱柯	2,300	31,234.00	0.07
291	300188	国投智能	2,800	31,108.00	0.07
292	603666	亿嘉和	1,900	29,982.00	0.06
293	603489	八方股份	1,100	29,678.00	0.06
294	000688	国城矿业	3,100	29,512.00	0.06
295	002396	星网锐捷	2,200	29,062.00	0.06
296	601011	宝泰隆	18,100	28,960.00	0.06
297	688368	晶丰明源	500	27,700.00	0.06
298	300263	隆华科技	4,500	25,200.00	0.05
299	601619	嘉泽新能	7,000	21,210.00	0.04
300	000735	罗牛山	4,200	18,186.00	0.04
301	300267	尔康制药	6,400	13,312.00	0.03
302	002597	金禾实业	600	11,934.00	0.03
303	603713	密尔克卫	200	10,704.00	0.02

304	600874	创业环保	1,800	10,062.00	0.02
305	301217	铜冠铜箔	300	2,880.00	0.01
306	300183	东软载波	200	2,316.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002823	凯中精密	11,700	142,740.00	0.30
2	300743	天地数码	10,300	139,462.00	0.30
3	300872	天阳科技	10,500	139,125.00	0.29
4	002600	领益智造	19,300	137,416.00	0.29
5	603088	宁波精达	17,400	131,022.00	0.28
6	600284	浦东建设	24,000	128,160.00	0.27
7	603683	晶华新材	15,900	126,246.00	0.27
8	300250	初灵信息	11,400	124,260.00	0.26
9	600967	内蒙一机	17,100	123,120.00	0.26
10	002998	优彩资源	21,500	121,905.00	0.26
11	603228	景旺电子	3,700	117,660.00	0.25
12	688480	赛恩斯	4,200	117,012.00	0.25
13	688273	麦澜德	5,900	116,820.00	0.25
14	002852	道道全	16,200	116,640.00	0.25
15	002996	顺博合金	19,880	116,298.00	0.25
16	605369	拱东医疗	2,900	115,710.00	0.25
17	600617	国新能源	45,920	114,800.00	0.24
18	600261	阳光照明	41,500	112,050.00	0.24
19	300396	迪瑞医疗	5,500	111,705.00	0.24
20	000063	中兴通讯	3,500	97,895.00	0.21
21	603927	中科软	5,200	94,068.00	0.20
22	688151	华强科技	7,500	93,375.00	0.20
23	300383	光环新网	11,000	92,950.00	0.20
24	600346	恒力石化	6,600	92,070.00	0.20
25	300377	赢时胜	18,000	91,440.00	0.19
26	601318	中国平安	2,200	90,992.00	0.19
27	603053	成都燃气	9,300	89,838.00	0.19
28	600015	华夏银行	13,800	88,320.00	0.19
29	603239	浙江仙通	6,400	87,744.00	0.19
30	300388	节能国祯	15,800	87,532.00	0.19
31	300760	迈瑞医疗	300	87,273.00	0.18
32	300441	鲍斯股份	14,700	87,171.00	0.18
33	600517	国网英大	19,800	85,734.00	0.18
34	600535	天士力	6,800	85,544.00	0.18
35	600742	一汽富维	11,400	84,930.00	0.18
36	300559	佳发教育	8,400	80,388.00	0.17

37	603811	诚意药业	12,400	77,500.00	0.16
38	000156	华数传媒	12,100	75,988.00	0.16
39	300644	南京聚隆	2,200	44,836.00	0.10
40	600941	中国移动	400	43,000.00	0.09
41	600801	华新水泥	3,000	41,250.00	0.09
42	600276	恒瑞医药	1,000	38,460.00	0.08
43	300497	富祥药业	4,300	38,399.00	0.08
44	300792	壹网壹创	2,400	36,120.00	0.08
45	601229	上海银行	4,900	35,574.00	0.08
46	300710	万隆光电	2,300	34,891.00	0.07
47	603408	建霖家居	2,500	32,975.00	0.07
48	605338	巴比食品	2,400	31,800.00	0.07
49	600300	维维股份	12,000	28,800.00	0.06
50	300002	神州泰岳	3,300	26,796.00	0.06
51	300449	汉邦高科	5,400	22,626.00	0.05
52	002392	北京利尔	4,600	14,490.00	0.03
53	300009	安科生物	1,500	12,810.00	0.03
54	000959	首钢股份	4,600	12,512.00	0.03
55	002945	华林证券	1,200	11,976.00	0.03
56	688133	泰坦科技	640	10,099.20	0.02
57	300271	华宇软件	1,100	5,148.00	0.01
58	300194	福安药业	800	2,992.00	0.01

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	601330	绿色动力	736,091.00	1.43
2	601311	骆驼股份	576,302.00	1.12
3	600075	新疆天业	563,603.00	1.10
4	002249	大洋电机	542,829.00	1.06
5	600787	中储股份	506,664.00	0.99
6	600811	东方集团	504,581.00	0.98
7	601101	昊华能源	498,875.00	0.97
8	600007	中国国贸	486,405.00	0.95
9	600835	上海机电	466,695.00	0.91
10	601952	苏垦农发	464,096.00	0.90
11	002745	木林森	462,456.00	0.90
12	600717	天津港	450,718.00	0.88
13	603995	甬金股份	445,557.00	0.87
14	601777	力帆科技	441,734.00	0.86
15	002516	旷达科技	440,643.00	0.86
16	601222	林洋能源	434,882.00	0.85

17	600997	开滦股份	433,552.00	0.84
18	002267	陕天然气	432,174.00	0.84
19	300841	康华生物	426,635.00	0.83
20	002158	汉钟精机	422,529.00	0.82

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	601330	绿色动力	759,701.00	1.48
2	600075	新疆天业	602,391.00	1.17
3	002987	京北方	552,743.80	1.07
4	603693	江苏新能	548,907.00	1.07
5	000915	华特达因	538,551.00	1.05
6	600400	红豆股份	516,737.00	1.00
7	603881	数据港	515,450.00	1.00
8	688100	威胜信息	495,241.43	0.96
9	600575	淮河能源	485,968.00	0.95
10	600508	上海能源	476,155.00	0.93
11	600888	新疆众和	473,747.00	0.92
12	002434	万里扬	470,260.00	0.91
13	002091	江苏国泰	470,002.00	0.91
14	601019	山东出版	469,020.00	0.91
15	600562	国睿科技	462,610.00	0.90
16	000718	苏宁环球	460,712.00	0.90
17	603678	火炬电子	458,393.00	0.89
18	688128	中国电研	453,678.72	0.88
19	002643	万润股份	451,771.00	0.88
20	600811	东方集团	451,754.00	0.88

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	111,152,015.79
卖出股票收入（成交）总额	111,449,814.72

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	1,018,190.41	2.16

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	1,018,190.41	2.16

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	019727	23 国债 24	10,000	1,018,190.41	2.16

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

本基金投资的前十名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	10,565.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	134,346.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,911.29

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
农银中证1000指数增强A	966	32,088.04	109,193.04	0.35	30,887,852.87	99.65
农银中证1000指数增强C	533	44,432.34	4,433,115.37	18.72	19,249,323.60	81.28
合计	1,499	36,477.31	4,542,308.41	8.31	50,137,176.47	91.69

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	农银中证 1000 指数增强 A	3,083.92	0.0099
	农银中证 1000 指数增强 C	5,201.78	0.0220
	合计	8,285.70	0.0152

注：从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	农银中证 1000 指数增强 A	0
	农银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	农银中证 1000 指数增强 A	0
	农银中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 7 月 18 日）基金份额总额	184,108,237.70	39,166,055.84
本报告期期初基金份额总额	34,491,781.96	16,343,178.75
本报告期基金总申购份额	16,876,425.58	39,395,442.97
减：本报告期基金总赎回份额	20,371,161.63	32,056,182.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	30,997,045.91	23,682,438.97
-------------	---------------	---------------

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

本报告期内，根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第五届董事会第十五次会议决议，高国鹏先生自 2024 年 6 月 27 日离任本公司副总经理职务。

本公司已于 2024 年 6 月 29 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期，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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 2 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	行政监管措施。 公司：责令改正；高级管理人员：警示函。
受到稽查或处罚等措施的原因	内部控制不健全，违反《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已按照法律法规及监管要求及时完成整改工作。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
申万宏源证券	2	215,950,891.42	97.01	204,265.43	97.01	-
中金公司	2	6,650,939.09	2.99	6,290.62	2.99	-

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 (%)
申万宏源证券	-	-	3,000,000.00	100.00	-	-
中金公司	1,001,770.00	100.00	-	-	-	-

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 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
2	关于农银汇理中证 1000 指数增强型	证券日报、基金管理人	2024 年 2 月 22 日

	证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	网站	
3	关于农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 3 月 7 日
4	关于农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第三次提示性公告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 3 月 14 日
5	农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 3 月 28 日
6	农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 4 月 18 日
7	关于农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 5 月 14 日
8	关于农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 5 月 28 日
9	关于农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第三次提示性公告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 6 月 4 日
10	农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
11	农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金-招募说明书更新-2024 年第 1 次	证券日报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-03-19 至 2024-03-25	0.00	12,666,380.42	12,666,380.42	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：</p> <p>(一) 赎回申请延期办理的风险</p> <p>单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理或延缓支付的风险。</p>							

(二) 基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入（或舍去尾数）等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

(三) 基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

(四) 基金合同提前终止的风险

单一投资者大额赎回后可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将面临根据基金合同的约定终止基金合同、清算或转型等风险。

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、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 1000 指数增强型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、营业执照；
- 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

2024 年 8 月 29 日