

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 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	6
§ 4 管理人报告	7
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	33
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43

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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 盈利投资者数量占比	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金
基金简称	农银大盘蓝筹混合
基金主代码	660006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 1 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	72,882,866.47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票，通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期取得基金资产的长期理性增值。
投资策略	本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。首先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析，对未来股票市场和债券市场的走势进行科学的分析，并以此为基础对大类资产配置进行确定。在“自下而上”的层面，本基金将严格执行备选股票库制度，在建立大盘蓝筹股票库的基础上，综合运用定性和定量的手段，筛选出具有良好基本面和发展前景的蓝筹股票进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	王小飞
	联系电话	021-61095588	021-60637103
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61095599	021-60637228
传真		021-61095556	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		黄涛	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,299,778.21
本期利润	15,217,835.77
加权平均基金份额本期利润	0.2001
本期加权平均净值利润率	13.50%
本期基金份额净值增长率	14.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	47,069,236.38
期末可供分配基金份额利润	0.6458
期末基金资产净值	119,952,102.85
期末基金份额净值	1.6458
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	64.58%

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

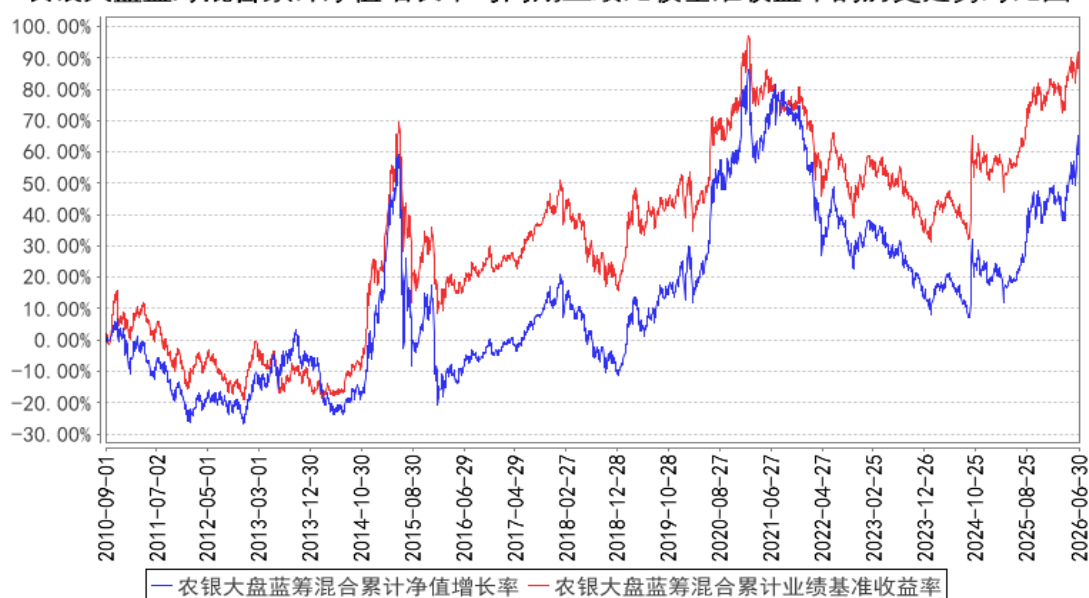
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月	18.96%	1.41%	9.25%	0.94%	9.71%	0.47%
过去六个月	14.19%	1.21%	6.33%	0.85%	7.86%	0.36%
过去一年	35.89%	1.14%	20.06%	0.76%	15.83%	0.38%
过去三年	28.90%	1.00%	26.70%	0.83%	2.20%	0.17%
过去五年	-6.94%	0.99%	3.68%	0.83%	— 10.62%	0.16%
过去七年	53.24%	1.05%	34.68%	0.87%	18.56%	0.18%
过去十年	79.50%	1.00%	61.22%	0.86%	18.28%	0.14%
自基金合同生效 起至今	64.58%	1.22%	89.83%	1.01%	— 25.25%	0.21%

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

农银大盘蓝筹混合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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%，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（2010 年 9 月 1 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 96 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、农银汇理中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、农银汇理平衡价值混合型证券投资基金、农银汇理中证红利低波动 100 指数型证券投资基金、农银汇理创业板指数型证券投资基金、农银汇理致远价值混合型证券投资基金、农银汇理瑞恒债券型证券投资基金、农银汇理消费启航混合型证券投资基金、农银汇理安泽多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金。

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	2015 年 12 月 2 日	—	18 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

26 年上半年市场震荡为向上，中间经历了美伊战争对市场的冲击，随后市场风险偏好升高，以 AI 为主线的成长股和科技股开启了主升浪。市场结构分化比较严重，通信、电子、建筑材料上涨较多，商贸零售、传媒、美容护理等下跌较多。整个上半年经济增速尚可，二季度经济稍弱。整个经济也出现一种 K 型分化，消费偏弱，科技制造偏强。国外 AI 投资的高速增长和国内 AI 投资的热情使得整个市场对 AI 成长股给出了较高的估值，基本面的强劲让市场资金涌入这一赛道，但其它行业偏弱，在 6 月份市场出现了资金抽离效应。本基金主要投资于大盘股，在运作期内配置了部分科技股票和成长股。

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 1.6458 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.19%，业

绩比较基准收益率为 6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 26 下半年，上半年 GDP 增速为 4.7%，全年的经济增长目标在 4.5%-5%之间，大概率可以实现。预计中美关系下半年不会紧张，双方领导人的沟通对缓和两国关系还是大有裨益的。从当下看地产和消费依然处于偏弱状态，而科技和制造业的投入较多，尤其 AI 的投资增速不错，对经济有一定的拉动。整体看地缘竞争加剧，而 AI 竞争在逐渐取代人的竞争，中美两国在 AI 的投资方兴未艾，基本上短期内不会有大的变化，但 A 股市场对基本面的提前透支，使得股价在短期内产生一定回调，后续需要等待基本面的进一步验证。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定等文件，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。

估值委员会成员由各业务相关的投资岗、研究岗、运营岗、风控岗和合规岗人员组成，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。参与估值流程各方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。

本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,765,523.98	7,823,850.02
结算备付金		147,510.45	182,544.42
存出保证金		25,718.73	25,942.12
交易性金融资产	6.4.7.2	115,449,769.57	106,529,956.53
其中：股票投资		107,405,227.65	100,498,805.30
基金投资		—	—
债券投资		8,044,541.92	6,031,151.23
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		7,055.51	199.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		120,395,578.24	114,562,492.35
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	793,866.90
应付赎回款		204,182.74	55,848.60
应付管理人报酬		113,195.62	115,108.67
应付托管费		18,865.91	19,184.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		226.46	174.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	107,004.66	184,179.25
负债合计		443,475.39	1,168,362.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	72,882,866.47	78,672,610.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	47,069,236.38	34,721,519.44
净资产合计		119,952,102.85	113,394,129.90
负债和净资产总计		120,395,578.24	114,562,492.35

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6458 元，基金份额总额 72,882,866.47 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,069,899.27	-693,073.36

1. 利息收入		16,551.71	17,810.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,551.71	17,810.70
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）		6,133,649.63	1,037,499.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,408,624.91	-112,503.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	27,309.37	31,081.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	697,715.35	1,118,921.79
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	9,918,057.56	-1,751,188.37
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	1,640.37	2,804.54
减：二、营业总支出		852,063.50	792,173.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	669,641.28	618,642.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	111,606.84	103,107.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		113.04	-
8. 其他费用	6.4.7.23	70,702.34	70,424.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,217,835.77	-1,485,246.79
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,217,835.77	-1,485,246.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,217,835.77	-1,485,246.79

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	78,672,610.46	-	34,721,519.44	113,394,129.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	78,672,610.46	-	34,721,519.44	113,394,129.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,789,743.99	-	12,347,716.94	6,557,972.95
（一）、综合收益总额	-	-	15,217,835.77	15,217,835.77
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,789,743.99	-	-2,870,118.83	-8,659,862.82
其中：1. 基金申购款	1,993,684.69	-	964,222.89	2,957,907.58
2. 基金赎回款	-7,783,428.68	-	-3,834,341.72	-11,617,770.40
（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	72,882,866.47	-	47,069,236.38	119,952,102.85
项目	上年度可比期间 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	88,565,256.38	-	20,143,994.42	108,709,250.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	88,565,256.38	-	20,143,994.42	108,709,250.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,329,287.91	-	-2,150,607.35	-5,479,895.26
(一)、综合收益总额	-	-	-1,485,246.79	-1,485,246.79
(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)	-3,329,287.91	-	-665,360.56	-3,994,648.47
其中：1. 基金申购款	1,680,315.98	-	325,754.99	2,006,070.97
2. 基金赎回款	-5,009,603.89	-	-991,115.55	-6,000,719.44
(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	85,235,968.47	-	17,993,387.07	103,229,355.54

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：

孙建坤

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

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金(原名为“农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金”,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[2010]第 807 号《关于同意农银汇理大盘蓝筹股票型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《农银汇理大盘蓝筹股票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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,916,524,336.73 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(2010)第 230 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,917,182,128.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 657,791.91 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日更名为农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%,其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 80%,除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-40%,其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%,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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数 $\times$ 75%+中证全债指数 $\times$ 25%。

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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、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[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[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。

对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,免征增值税直至债券到期。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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,765,523.98
等于: 本金	4,765,053.80
加: 应计利息	470.18
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	4,765,523.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		84,235,742.52	-	107,405,227.65	23,169,485.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000,400.00	42,741.92	8,044,541.92	1,400.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,000,400.00	42,741.92	8,044,541.92	1,400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		92,236,142.52	42,741.92	115,449,769.57	23,170,885.13

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	33.70
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	37,546.60
其中：交易所市场	37,546.60
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	69,424.36
合计	107,004.66

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	78,672,610.46	78,672,610.46
本期申购	1,993,684.69	1,993,684.69
本期赎回（以“-”号填列）	-7,783,428.68	-7,783,428.68
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	72,882,866.47	72,882,866.47

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	52,186,985.72	-17,465,466.28	34,721,519.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	52,186,985.72	-17,465,466.28	34,721,519.44
本期利润	5,299,778.21	9,918,057.56	15,217,835.77
本期基金份额交易产生的变动数	-4,099,533.87	1,229,415.04	-2,870,118.83
其中：基金申购款	1,424,936.33	-460,713.44	964,222.89
基金赎回款	-5,524,470.20	1,690,128.48	-3,834,341.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,387,230.06	-6,317,993.68	47,069,236.38

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,178.59
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	323.60
其他	49.52
合计	16,551.71

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	106,735,564.98
减：卖出股票成本总额	101,168,251.60
减：交易费用	158,688.47
买卖股票差价收入	5,408,624.91

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	34,950.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,641.33
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	27,309.37

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	68,356,395.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	68,039,456.33
减：应计利息总额	324,580.53
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-7,641.33

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	697,715.35
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	697,715.35

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,918,057.56
股票投资	9,912,591.23
债券投资	5,466.33
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	9,918,057.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,510.29
基金转换费收入	130.08
合计	1,640.37

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	1,277.98
合计	70,702.34

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、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

理”)	
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	669,641.28	618,642.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	237,073.65	219,132.58
应支付基金管理人的净管理费	432,567.63	399,509.45

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×1.20%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	111,606.84	103,107.04

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.20\%$ 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：日托管费=前一日基金资产净值 $\times 0.20\%$ /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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
建设银行	4,765,523.98	16,178.59	14,038,962.59	17,463.17

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	500	362,247.04	439,765.00	-

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

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。董事会及其下设的风控与合规管理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与内部控制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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	8,044,541.92	3,012,528.22
合计	8,044,541.92	3,012,528.22

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	—	3,018,623.01
合计	—	3,018,623.01

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。

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、以及组合在短期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 2026 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	4,765,523.98	-	-	-	4,765,523.98
结算备付金	147,510.45	-	-	-	147,510.45
存出保证金	25,718.73	-	-	-	25,718.73
交易性金融资产	8,044,541.92	-	-	107,405,227.65	115,449,769.57
应收申购款	-	-	-	7,055.51	7,055.51
资产总计	12,983,295.08	-	-	107,412,283.16	120,395,578.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	204,182.74	204,182.74
应付管理人报酬	-	-	-	113,195.62	113,195.62
应付托管费	-	-	-	18,865.91	18,865.91
应交税费	-	-	-	226.46	226.46
其他负债	-	-	-	107,004.66	107,004.66
负债总计	-	-	-	443,475.39	443,475.39
利率敏感度缺口	12,983,295.08	-	-	106,968,807.77	119,952,102.85
上年度末 2025 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	7,823,850.02	-	-	-	7,823,850.02
结算备付金	182,544.42	-	-	-	182,544.42

存出保证金	25,942.12	-	-	-	25,942.12
交易性金融资产	3,012,528.22	3,018,623.01	-	-100,498,805.30	106,529,956.53
应收申购款	-	-	-	199.26	199.26
资产总计	11,044,864.78	3,018,623.01	-	-100,499,004.56	114,562,492.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,848.60	55,848.60
应付管理人报酬	-	-	-	115,108.67	115,108.67
应付托管费	-	-	-	19,184.78	19,184.78
应付清算款	-	-	-	793,866.90	793,866.90
应交税费	-	-	-	174.25	174.25
其他负债	-	-	-	184,179.25	184,179.25
负债总计	-	-	-	1,168,362.45	1,168,362.45
利率敏感度缺口	11,044,864.78	3,018,623.01	-	-99,330,642.11	113,394,129.90

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-11,737.93	-24,544.70
	市场利率平行下降 25 个基点	11,737.93	24,544.70

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	107,405,227.65	89.54	100,498,805.30	88.63
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	107,405,227.65	89.54	100,498,805.30	88.63

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	8,531,930.05	7,523,204.90
	业绩比较基准下降 5%	-8,531,930.05	-7,523,204.90

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	106,965,462.65	100,005,984.54
第二层次	8,484,306.92	6,523,971.99
第三层次	—	—
合计	115,449,769.57	106,529,956.53

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	107,405,227.65	89.21
	其中：股票	107,405,227.65	89.21
2	基金投资	—	—

3	固定收益投资	8,044,541.92	6.68
	其中：债券	8,044,541.92	6.68
	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	4,913,034.43	4.08
8	其他各项资产	32,774.24	0.03
9	合计	120,395,578.24	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	401,788.00	0.33
B	采矿业	2,988,778.46	2.49
C	制造业	80,983,888.33	67.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,721,187.00	1.43
E	建筑业	808,588.00	0.67
F	批发和零售业	106,108.80	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,508,894.14	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,938,350.14	5.78
J	金融业	10,536,252.58	8.78
K	房地产业	180,392.00	0.15
L	租赁和商务服务业	321,363.20	0.27
M	科学研究和技术服务业	771,962.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,642.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	41,033.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	107,405,227.65	89.54

7.2.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	4,660	5,918,200.00	4.93
2	300502	新易盛	9,496	5,764,072.00	4.81
3	603986	兆易创新	5,532	4,508,580.00	3.76
4	688256	寒武纪	2,390	3,813,364.50	3.18
5	601138	工业富联	47,300	3,412,695.00	2.85
6	688498	源杰科技	1,800	3,394,800.00	2.83
7	300750	宁德时代	6,580	2,586,005.80	2.16
8	002384	东山精密	9,200	2,413,620.00	2.01
9	300394	天孚通信	7,860	2,379,064.80	1.98
10	688041	海光信息	5,468	2,024,800.40	1.69
11	688981	中芯国际	12,600	2,001,132.00	1.67
12	688008	澜起科技	6,208	1,923,859.20	1.60
13	300433	蓝思科技	35,749	1,918,291.34	1.60
14	002916	深南电路	3,728	1,707,051.20	1.42
15	688082	盛美上海	3,500	1,512,000.00	1.26
16	002475	立讯精密	18,768	1,321,267.20	1.10
17	300476	胜宏科技	3,700	1,281,791.00	1.07
18	300373	扬杰科技	8,000	1,257,840.00	1.05
19	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	0.99
20	600176	中国巨石	16,044	1,169,286.72	0.97
21	600036	招商银行	31,000	1,100,500.00	0.92
22	688630	芯碁微装	2,000	1,098,780.00	0.92
23	600522	中天科技	17,800	1,080,104.00	0.90
24	601899	紫金矿业	41,300	1,038,282.00	0.87
25	002371	北方华创	1,150	1,017,244.00	0.85
26	300442	润泽科技	12,100	1,005,147.00	0.84
27	600183	生益科技	5,700	988,380.00	0.82
28	000333	美的集团	12,200	921,466.00	0.77
29	000725	京东方 A	104,300	905,324.00	0.75
30	601398	工商银行	127,700	902,839.00	0.75
31	688012	中微公司	1,874	877,969.00	0.73
32	300316	晶盛机电	13,600	821,440.00	0.68
33	600900	长江电力	30,700	812,629.00	0.68
34	603259	药明康德	6,200	771,962.00	0.64
35	300274	阳光电源	4,640	737,852.80	0.62
36	600030	中信证券	24,545	705,177.85	0.59
37	601166	兴业银行	42,400	702,144.00	0.59
38	600487	亨通光电	6,000	656,040.00	0.55
39	300059	东方财富	31,664	645,312.32	0.54

40	300567	精测电子	2,000	635,200.00	0.53
41	300408	三环集团	3,800	634,220.00	0.53
42	002028	思源电气	3,600	622,800.00	0.52
43	600276	恒瑞医药	11,199	582,795.96	0.49
44	002463	沪电股份	3,800	580,640.00	0.48
45	002594	比亚迪	6,750	537,975.00	0.45
46	601988	中国银行	93,100	532,532.00	0.44
47	601211	国泰海通	28,300	515,060.00	0.43
48	002281	光迅科技	2,000	513,880.00	0.43
49	300570	太辰光	2,000	493,420.00	0.41
50	688300	联瑞新材	2,000	488,800.00	0.41
51	603019	中科曙光	4,380	469,667.40	0.39
52	000988	华工科技	2,500	461,525.00	0.38
53	688120	华海清科	1,400	451,052.00	0.38
54	688072	拓荆科技	500	439,765.00	0.37
55	601328	交通银行	66,900	430,167.00	0.36
56	301308	江波龙	600	422,280.00	0.35
57	000651	格力电器	11,186	419,475.00	0.35
58	688521	芯原股份	1,100	408,254.00	0.34
59	600919	江苏银行	36,770	396,380.60	0.33
60	603993	洛阳钼业	21,900	384,345.00	0.32
61	600150	中国船舶	11,300	381,827.00	0.32
62	600887	伊利股份	15,879	380,460.84	0.32
63	600584	长电科技	3,600	372,780.00	0.31
64	600309	万华化学	5,420	370,782.20	0.31
65	000338	潍柴动力	13,500	367,875.00	0.31
66	601816	京沪高铁	73,600	333,408.00	0.28
67	300124	汇川技术	4,795	318,052.35	0.27
68	002415	海康威视	9,150	312,930.00	0.26
69	000100	TCL 科技	52,110	303,280.20	0.25
70	601688	华泰证券	14,700	303,114.00	0.25
71	600111	北方稀土	6,300	302,715.00	0.25
72	002008	大族激光	2,000	300,220.00	0.25
73	000063	中兴通讯	8,100	293,139.00	0.24
74	600031	三一重工	16,900	292,032.00	0.24
75	600000	浦发银行	33,356	287,195.16	0.24
76	600089	特变电工	12,690	285,525.00	0.24
77	601857	中国石油	32,500	282,100.00	0.24
78	601088	中国神华	6,900	269,376.00	0.22
79	002142	宁波银行	8,333	247,406.77	0.21
80	300014	亿纬锂能	3,800	247,114.00	0.21
81	601601	中国太保	8,600	245,272.00	0.20
82	002050	三花智控	5,585	244,790.55	0.20

83	000001	平安银行	24,320	244,416.00	0.20
84	000792	盐湖股份	8,000	241,520.00	0.20
85	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.20
86	002714	牧原股份	6,800	237,932.00	0.20
87	600406	国电南瑞	10,138	231,653.30	0.19
88	002353	杰瑞股份	1,500	228,750.00	0.19
89	601668	中国建筑	51,800	224,812.00	0.19
90	000657	中钨高新	2,300	220,156.00	0.18
91	601229	上海银行	24,900	216,132.00	0.18
92	601919	中远海控	15,700	208,182.00	0.17
93	300760	迈瑞医疗	1,500	203,745.00	0.17
94	300033	同花顺	840	202,440.00	0.17
95	601728	中国电信	38,900	201,891.00	0.17
96	600660	福耀玻璃	4,000	201,760.00	0.17
97	600016	民生银行	62,200	200,284.00	0.17
98	601012	隆基绿能	15,200	199,424.00	0.17
99	603501	豪威集团	2,100	199,185.00	0.17
100	600941	中国移动	2,300	198,099.00	0.17
101	601225	陕西煤业	9,700	197,395.00	0.16
102	600999	招商证券	9,300	196,230.00	0.16
103	002230	科大讯飞	4,753	194,112.52	0.16
104	600690	海尔智家	9,400	191,854.00	0.16
105	000425	徐工机械	23,400	189,306.00	0.16
106	002352	顺丰控股	6,000	187,560.00	0.16
107	601985	中国核电	20,600	186,018.00	0.16
108	000977	浪潮信息	2,645	185,150.00	0.15
109	002709	天赐材料	3,600	185,148.00	0.15
110	600938	中国海油	6,800	184,620.00	0.15
111	603799	华友钴业	3,800	183,388.00	0.15
112	002460	赣锋锂业	2,800	183,120.00	0.15
113	601169	北京银行	37,140	181,986.00	0.15
114	600160	巨化股份	3,400	180,234.00	0.15
115	002938	鹏鼎控股	1,700	179,146.00	0.15
116	000776	广发证券	7,400	173,160.00	0.14
117	600926	杭州银行	11,440	165,308.00	0.14
118	000938	紫光股份	5,720	165,079.20	0.14
119	002202	金风科技	6,900	164,910.00	0.14
120	300498	温氏股份	13,300	163,856.00	0.14
121	601600	中国铝业	19,900	163,578.00	0.14
122	688126	沪硅产业	4,100	163,549.00	0.14
123	600028	中国石化	36,500	162,790.00	0.14
124	300661	圣邦股份	1,130	162,132.40	0.14
125	002600	领益智造	9,200	159,528.00	0.13

126	002466	天齐锂业	2,600	159,432.00	0.13
127	601766	中国中车	30,500	158,600.00	0.13
128	600460	士兰微	2,900	158,514.00	0.13
129	600050	中国联通	39,200	156,800.00	0.13
130	603288	海天味业	4,701	155,885.16	0.13
131	601009	南京银行	15,456	152,859.84	0.13
132	002837	英维克	1,900	151,164.00	0.13
133	002049	紫光国微	1,700	150,875.00	0.13
134	688111	金山办公	700	149,135.00	0.12
135	601628	中国人寿	4,196	148,328.60	0.12
136	002179	中航光电	3,187	147,239.40	0.12
137	605117	德业股份	1,343	142,599.74	0.12
138	601872	招商轮船	8,100	142,317.00	0.12
139	002241	歌尔股份	6,200	139,686.00	0.12
140	000568	泸州老窖	1,800	139,536.00	0.12
141	000408	藏格矿业	2,000	138,640.00	0.12
142	601006	大秦铁路	29,900	137,839.00	0.11
143	601658	邮储银行	27,600	136,068.00	0.11
144	601100	恒立液压	1,256	135,095.36	0.11
145	601818	光大银行	46,500	134,385.00	0.11
146	600809	山西汾酒	1,220	133,431.40	0.11
147	600905	三峡能源	35,800	132,818.00	0.11
148	688271	联影医疗	1,308	132,408.84	0.11
149	600489	中金黄金	7,300	131,765.00	0.11
150	601888	中国中免	2,400	128,904.00	0.11
151	000630	铜陵有色	20,200	128,472.00	0.11
152	688396	华润微	1,300	126,815.00	0.11
153	600893	航发动力	3,300	126,522.00	0.11
154	600010	宝钢股份	56,660	126,351.80	0.11
155	601336	新华保险	2,100	125,286.00	0.10
156	601689	拓普集团	2,210	124,688.20	0.10
157	600958	东方证券	13,096	123,626.24	0.10
158	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.10
159	601127	赛力斯	2,000	122,500.00	0.10
160	002027	分众传媒	25,280	122,355.20	0.10
161	600019	宝钢股份	21,768	118,200.24	0.10
162	000807	云铝股份	5,200	115,128.00	0.10
163	600760	中航沈飞	2,792	114,751.20	0.10
164	601838	成都银行	6,400	113,280.00	0.09
165	600362	江西铜业	2,600	112,580.00	0.09
166	600104	上汽集团	11,500	112,240.00	0.09
167	600989	宝丰能源	5,500	111,815.00	0.09
168	300450	先导智能	2,700	109,944.00	0.09

169	002001	新 和 成	3,860	109,701.20	0.09
170	600875	东方电气	3,800	109,326.00	0.09
171	601825	沪农商行	14,500	108,605.00	0.09
172	002422	科伦药业	2,800	107,856.00	0.09
173	601390	中国中铁	25,700	107,169.00	0.09
174	688183	生益电子	800	105,920.00	0.09
175	600547	山东黄金	4,544	104,920.96	0.09
176	601377	兴业证券	17,330	104,673.20	0.09
177	600795	国电电力	22,400	104,608.00	0.09
178	000538	云南白药	2,160	102,319.20	0.09
179	600585	海螺水泥	6,000	101,700.00	0.08
180	601669	中国电建	21,600	101,520.00	0.08
181	603296	华勤技术	1,360	101,007.20	0.08
182	600426	华鲁恒升	4,200	100,464.00	0.08
183	601916	浙商银行	37,800	99,414.00	0.08
184	002648	卫星化学	4,200	98,658.00	0.08
185	300015	爱尔眼科	11,700	96,642.00	0.08
186	601066	中信建投	3,300	95,931.00	0.08
187	603893	瑞芯微	500	94,180.00	0.08
188	600346	恒力石化	5,300	93,863.00	0.08
189	601868	中国能建	35,100	93,717.00	0.08
190	002311	海大集团	2,100	93,681.00	0.08
191	300418	昆仑万维	2,300	92,828.00	0.08
192	601998	中信银行	13,300	92,169.00	0.08
193	605499	东鹏饮料	745	91,955.35	0.08
194	600482	中国动力	2,800	91,840.00	0.08
195	002558	巨人网络	3,300	90,948.00	0.08
196	000625	长安汽车	12,442	89,209.14	0.07
197	600066	宇通客车	3,300	88,473.00	0.07
198	688506	百利天恒	300	88,209.00	0.07
199	600436	片仔癀	800	87,424.00	0.07
200	000157	中联重科	12,400	86,428.00	0.07
201	600011	华能国际	11,000	83,490.00	0.07
202	600048	保利发展	18,000	83,340.00	0.07
203	300803	指南针	900	82,503.00	0.07
204	600438	通威股份	6,800	82,348.00	0.07
205	601077	渝农商行	13,300	81,263.00	0.07
206	600115	中国东航	21,300	81,153.00	0.07
207	688036	传音控股	1,371	80,820.45	0.07
208	002236	大华股份	4,900	80,801.00	0.07
209	002493	荣盛石化	7,500	80,625.00	0.07
210	600570	恒生电子	3,800	80,522.00	0.07
211	600886	国投电力	6,000	79,860.00	0.07

212	600188	兖矿能源	4,450	79,076.50	0.07
213	688047	龙芯中科	500	77,335.00	0.06
214	003816	中国广核	19,700	77,027.00	0.06
215	002736	国信证券	7,700	76,923.00	0.06
216	601360	三六零	8,800	76,472.00	0.06
217	601058	赛轮轮胎	6,600	76,098.00	0.06
218	000301	东方盛虹	6,600	75,570.00	0.06
219	600026	中远海能	4,200	75,348.00	0.06
220	002074	国轩高科	2,700	74,277.00	0.06
221	600196	复星医药	3,200	71,904.00	0.06
222	000768	中航西飞	3,506	71,802.88	0.06
223	600009	上海机场	3,100	71,610.00	0.06
224	000975	山金国际	4,200	71,400.00	0.06
225	601111	中国国航	11,700	70,785.00	0.06
226	600415	小商品城	6,900	70,104.00	0.06
227	600029	南方航空	13,500	69,930.00	0.06
228	600674	川投能源	4,900	69,433.00	0.06
229	600219	南山铝业	17,300	69,027.00	0.06
230	601186	中国铁建	11,500	68,425.00	0.06
231	301236	软通动力	1,600	67,920.00	0.06
232	601881	中国银河	5,400	67,878.00	0.06
233	600233	圆通速递	4,300	67,725.00	0.06
234	601877	正泰电器	2,700	67,689.00	0.06
235	601117	中国化学	9,200	67,620.00	0.06
236	600372	中航机载	6,100	66,185.00	0.06
237	601878	浙商证券	6,900	65,550.00	0.05
238	601021	春秋航空	1,383	63,037.14	0.05
239	000963	华东医药	2,240	62,988.80	0.05
240	300866	安克创新	600	62,700.00	0.05
241	600741	华域汽车	4,000	62,080.00	0.05
242	301269	华大九天	500	59,710.00	0.05
243	000895	双汇发展	2,600	58,240.00	0.05
244	001979	招商蛇口	9,000	57,870.00	0.05
245	002304	洋河股份	1,500	57,225.00	0.05
246	002920	德赛西威	700	57,050.00	0.05
247	601898	中煤能源	4,600	56,028.00	0.05
248	601319	中国人保	8,000	54,080.00	0.05
249	600023	浙能电力	10,100	53,126.00	0.04
250	600039	四川路桥	6,500	50,830.00	0.04
251	601800	中国交建	8,900	50,819.00	0.04
252	688223	晶科能源	10,300	48,925.00	0.04
253	600600	青岛啤酒	900	47,007.00	0.04
254	600588	用友网络	5,100	46,818.00	0.04

255	601633	长城汽车	3,100	46,779.00	0.04
256	603369	今世缘	1,900	45,049.00	0.04
257	600027	华电国际	9,900	44,055.00	0.04
258	300628	亿联网络	1,300	43,966.00	0.04
259	601618	中国中冶	17,900	43,676.00	0.04
260	603260	合盛硅业	900	43,434.00	0.04
261	601607	上海医药	2,800	43,120.00	0.04
262	300832	新产业	1,000	42,000.00	0.04
263	600025	华能水电	4,700	41,783.00	0.03
264	000617	中油资本	6,300	41,517.00	0.03
265	300251	光线传媒	3,700	41,033.00	0.03
266	688472	阿特斯	3,700	40,034.00	0.03
267	600515	海南机场	14,300	39,182.00	0.03
268	601059	信达证券	2,400	38,856.00	0.03
269	600085	同仁堂	1,665	38,478.15	0.03
270	300896	爱美客	440	38,368.00	0.03
271	600845	宝信软件	2,244	37,317.72	0.03
272	000999	华润三九	1,654	37,198.46	0.03
273	600803	新奥股份	2,300	36,340.00	0.03
274	300999	金龙鱼	1,500	34,890.00	0.03
275	000596	古井贡酒	400	31,920.00	0.03
276	000708	中信特钢	2,500	31,550.00	0.03
277	688009	中国通号	6,500	30,940.00	0.03
278	601238	广汽集团	5,580	28,346.40	0.02
279	300413	芒果超媒	1,870	27,358.10	0.02
280	001280	中国铀业	400	26,680.00	0.02
281	301165	锐捷网络	300	24,135.00	0.02

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	002028	思源电气	3,136,262.00	2.77
2	600489	中金黄金	2,640,254.00	2.33
3	300394	天孚通信	2,588,416.00	2.28
4	601988	中国银行	2,564,400.00	2.26
5	603439	三力制药	2,529,872.00	2.23
6	601138	工业富联	2,452,234.00	2.16
7	603986	兆易创新	2,425,844.00	2.14
8	002384	东山精密	2,401,031.00	2.12
9	600547	山东黄金	2,334,174.12	2.06
10	300502	新易盛	2,020,167.00	1.78
11	002545	东方铁塔	1,952,610.00	1.72

12	000858	五 粮 液	1,880,509.00	1.66
13	688472	阿特斯	1,879,339.33	1.66
14	688256	寒武纪	1,768,008.86	1.56
15	300442	润泽科技	1,715,268.00	1.51
16	300433	蓝思科技	1,503,429.00	1.33
17	688498	源杰科技	1,440,822.60	1.27
18	688385	复旦微电	1,383,686.29	1.22
19	600309	万华化学	1,357,221.00	1.20
20	300476	胜宏科技	1,335,796.00	1.18

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	688498	源杰科技	3,756,316.58	3.31
2	002028	思源电气	3,631,730.00	3.20
3	601988	中国银行	2,745,981.00	2.42
4	601318	中国平安	2,734,577.00	2.41
5	688630	芯碁微装	2,526,229.10	2.23
6	603439	三力制药	2,426,615.00	2.14
7	000858	五 粮 液	2,358,647.00	2.08
8	600489	中金黄金	2,353,104.00	2.08
9	600547	山东黄金	1,955,103.00	1.72
10	300394	天孚通信	1,945,042.00	1.72
11	002545	东方铁塔	1,811,153.00	1.60
12	688472	阿特斯	1,558,817.93	1.37
13	601398	工商银行	1,494,060.00	1.32
14	601899	紫金矿业	1,484,526.00	1.31
15	600030	中信证券	1,481,423.00	1.31
16	300476	胜宏科技	1,481,136.00	1.31
17	601166	兴业银行	1,449,184.00	1.28
18	688256	寒武纪	1,445,136.00	1.27
19	600309	万华化学	1,421,568.00	1.25
20	600519	贵州茅台	1,406,779.00	1.24

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	98,162,082.72
卖出股票收入（成交）总额	106,735,564.98

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	8,044,541.92	6.71
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	8,044,541.92	6.71

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	019835	26 国债 09	40,000	4,006,583.01	3.34
2	019792	25 国债 19	30,000	3,031,476.99	2.53
3	019827	26 国债 01	10,000	1,006,481.92	0.84

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。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

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约定的备选股票库

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	25,718.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,055.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,774.24

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

本基金本报告期末不存在前十名股票中有流通受限的情况。

§ 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

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 (%)
5,505	13,239.39	405,202.52	0.56	72,477,663.95	99.44

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年 (2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比 (%)	99.35

8.3 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	1,524.54	0.0021

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 9 月 1 日) 基金份额总额	3,917,182,128.64
本报告期期初基金份额总额	78,672,610.46
本报告期基金总申购份额	1,993,684.69
减：本报告期基金总赎回份额	7,783,428.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	72,882,866.47

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”）第六届董事会第六次会议决议，孙建坤先生自 2026 年 6 月 5 日起担任本公司总经理职务。程昆先生自 2026 年 6 月 5 日起不再担任公司总经理，黄涛先生自 2026 年 6 月 5 日起不再代为履行总经理职务。

本公司已于 2026 年 6 月 6 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

本报告期内，未发生影响基金管理人公司经营或基金财产的诉讼。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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无因托管业务受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国金证券	2	53,100,770.46	25.92	23,890.19	25.92	—
东方证券	2	44,649,447.65	21.79	20,088.22	21.79	—
广发证券	2	44,463,266.27	21.70	20,004.38	21.70	—
国泰海通证券	4	30,598,067.49	14.93	13,766.36	14.93	—
中信证券	2	22,394,088.12	10.93	10,075.41	10.93	—
申万宏源证券	2	9,692,007.71	4.73	4,360.42	4.73	—
国投证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国金证券	39,031,360.00	28.27	-	-	-	-
东方证券	29,010,160.00	21.01	-	-	-	-
广发证券	41,004,970.00	29.70	-	-	-	-
国泰海通证券	16,011,020.00	11.60	-	-	-	-
中信证券	6,003,700.00	4.35	-	-	-	-
申万宏源证券	7,003,195.00	5.07	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 21 日
2	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 30 日
3	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 21 日

4	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金—招募说明书更新—2026 年第 1 次	中国证监会规定的媒介	2026 年 6 月 29 日
5	农银汇理大盘蓝筹混合型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	2026 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理大盘蓝筹混合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

2026 年 8 月 28 日