

# 农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	33
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 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49

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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 500 指数证券投资基金
基金简称	农银中证 500 指数
基金主代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 29 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,724,374.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-488,080.20
本期利润	1,651,615.31
加权平均基金份额本期利润	0.0432
本期加权平均净值利润率	2.75%
本期基金份额净值增长率	2.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,649,829.65
期末可供分配基金份额利润	0.5333
期末基金资产净值	59,374,204.45
期末基金份额净值	1.5333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.33%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

### 3.2 基金净值表现

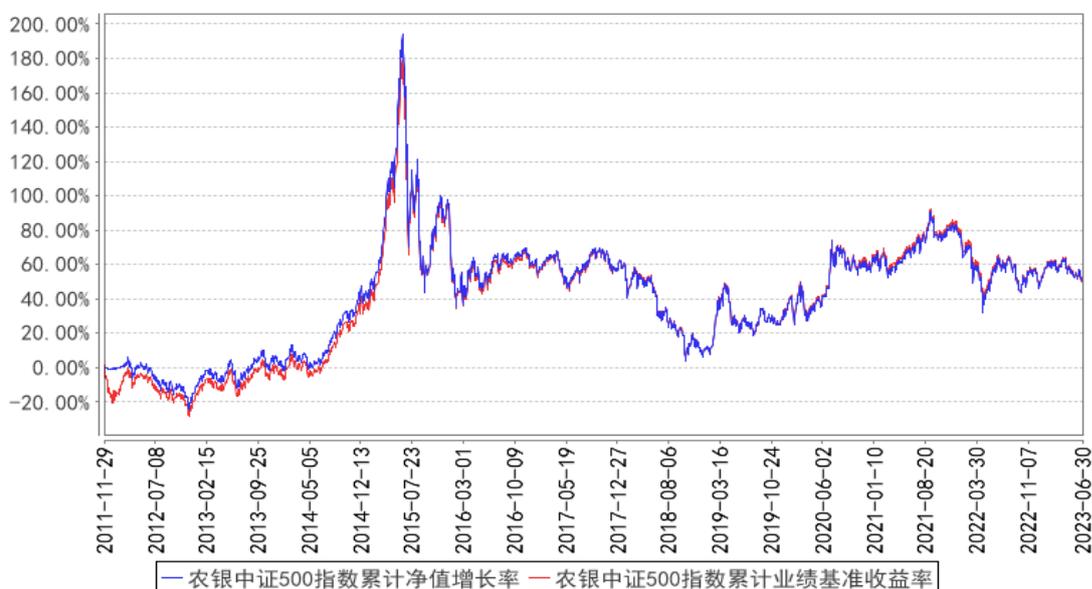
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.18%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.59%	0.01%
过去三个月	-4.26%	0.79%	-5.11%	0.78%	0.85%	0.01%
过去六个月	2.95%	0.75%	2.20%	0.75%	0.75%	0.00%
过去一年	-5.61%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.04%	0.00%
过去三年	3.44%	1.13%	2.46%	1.13%	0.98%	0.00%

自基金合同生效起至今	53.33%	1.48%	52.78%	1.50%	0.55%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

农银中证500指数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：本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 75 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）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金的基金经理	2014 年 2 月 10 日	-	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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0280%，日均偏离度为 0.0156%，报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：

1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5333 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.95%，业绩比较基准收益率为 2.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期本基金不需分配利润。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本报告期内，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理中证 500 指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,327,632.34	2,541,512.25
结算备付金		5,436.80	23,114.51
存出保证金		1,066.72	2,191.24
交易性金融资产	6.4.7.2	56,250,724.89	54,036,703.17
其中：股票投资		56,250,724.89	53,424,577.42
基金投资		-	-
债券投资		-	612,125.75
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		28,010.86	11,802.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		59,612,871.61	56,615,323.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		15,390.34	10,651.62
应付管理人报酬		36,564.11	36,983.24
应付托管费		7,312.79	7,396.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	179,399.92	205,346.89
负债合计		238,667.16	260,378.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	38,724,374.80	37,838,959.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	20,649,829.65	18,515,985.11
净资产合计		59,374,204.45	56,354,944.92
负债和净资产总计		59,612,871.61	56,615,323.29

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5333 元，基金份额总额 38,724,374.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,095,363.68	-6,411,660.15
1. 利息收入		12,526.37	10,385.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,526.37	10,385.77
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-62,674.28	418,932.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-719,106.77	-200,661.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	654.25	3,617.49
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	655,778.24	615,976.46

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	2,139,695.51	-6,849,806.97
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	5,816.08	8,828.64
<b>减：二、营业总支出</b>		443,748.37	423,803.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	223,086.48	208,539.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,617.23	41,707.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	176,044.66	173,556.77
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,651,615.31	-6,835,463.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		1,651,615.31	-6,835,463.74
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,651,615.31	-6,835,463.74

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	37,838,959.81	-	18,515,985.11	56,354,944.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	37,838,959.81	-	18,515,985.11	56,354,944.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	885,414.99	-	2,133,844.54	3,019,259.53
(一)、综合收益总额	-	-	1,651,615.31	1,651,615.31
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	885,414.99	-	482,229.23	1,367,644.22
其中：1. 基金申购款	3,868,503.56	-	2,225,661.71	6,094,165.27
2. 基金赎回款	-2,983,088.57	-	-1,743,432.48	-4,726,521.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	38,724,374.80	-	20,649,829.65	59,374,204.45
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,399,779.37	-	-5,538,416.77	-3,138,637.40

(一)、综合收益总额	-	-	-6,835,463.74	-6,835,463.74
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,399,779.37	-	1,297,046.97	3,696,826.34
其中: 1. 基金申购款	5,881,747.39	-	3,458,683.32	9,340,430.71
2. 基金赎回款	-3,481,968.02	-	-2,161,636.35	-5,643,604.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	36,940,063.65	-	23,068,126.48	60,008,190.13

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 500 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可第[1207]号《关于核准农银汇理中证 500 指数证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 711,073,400.42 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 453 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,243.88 份基金份额。本

基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中：中证 500 指数成份股和备选股的投资比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 同期银行活期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》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

本基金的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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,327,632.34
等于：本金	3,327,011.35
加：应计利息	620.99
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	3,327,632.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,826,623.60	-	56,250,724.89	-2,575,898.71
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,826,623.60	-	56,250,724.89	-2,575,898.71

##### 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资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	28.90
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,426.36
其中：交易所市场	12,426.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	166,944.66
合计	179,399.92

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,838,959.81	37,838,959.81
本期申购	3,868,503.56	3,868,503.56
本期赎回（以“-”号填列）	-2,983,088.57	-2,983,088.57
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	38,724,374.80	38,724,374.80

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	41,801,590.28	-23,285,605.17	18,515,985.11
本期利润	-488,080.20	2,139,695.51	1,651,615.31
本期基金份额交易产生的变动数	975,001.65	-492,772.42	482,229.23
其中：基金申购款	4,264,728.65	-2,039,066.94	2,225,661.71
基金赎回款	-3,289,727.00	1,546,294.52	-1,743,432.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,288,511.73	-21,638,682.08	20,649,829.65

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	12,399.21
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	115.70
其他	11.46
合计	12,526.37

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	7,967,320.02
减：卖出股票成本总额	8,662,984.25
减：交易费用	23,442.54
买卖股票差价收入	-719,106.77

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	414.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	240.00
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	654.25

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	612,600.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	599,760.00
减：应计利息总额	12,600.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	240.00

##### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	655,778.24
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	655,778.24

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,139,695.51
股票投资	2,139,875.51
债券投资	-180.00
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	2,139,695.51

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,786.43
基金转换费收入	29.65
合计	5,816.08

注：1. 本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	100.00

账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	176,044.66

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（以下简称“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	223,086.48	208,539.07
其中：支付销售机构的客户维护 费	100,316.98	93,825.86

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

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	44,617.23	41,707.75

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期间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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,327,632.34	12,399.21	2,822,953.56	10,172.68

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，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(2023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
601298	青岛港	2023年6月28日	公告重大事项	6.97	2023年07月03日	7.40	5,800	33,049.67	40,426.00	-
000540	*ST中天	2023年5月19日	公告重大事项	0.00	-	-	41,300	124,465.48	0.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	-	612,125.75
合计	-	612,125.75

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

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,327,632.34	-	-	-	3,327,632.34
结算备付金	5,436.80	-	-	-	5,436.80
存出保证金	1,066.72	-	-	-	1,066.72
交易性金融资产	-	-	-	56,250,724.89	56,250,724.89
应收申购款	-	-	-	28,010.86	28,010.86
资产总计	3,334,135.86	-	-	56,278,735.75	59,612,871.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,390.34	15,390.34
应付管理人报酬	-	-	-	36,564.11	36,564.11
应付托管费	-	-	-	7,312.79	7,312.79
其他负债	-	-	-	179,399.92	179,399.92
负债总计	-	-	-	238,667.16	238,667.16
利率敏感度缺口	3,334,135.86	-	-	56,040,068.59	59,374,204.45
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,541,512.25	-	-	-	2,541,512.25
结算备付金	23,114.51	-	-	-	23,114.51
存出保证金	2,191.24	-	-	-	2,191.24
交易性金融资产	612,125.75	-	-	53,424,577.42	54,036,703.17
应收申购款	-	-	-	11,802.12	11,802.12
资产总计	3,178,943.75	-	-	53,436,379.54	56,615,323.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,651.62	10,651.62
应付管理人报酬	-	-	-	36,983.24	36,983.24
应付托管费	-	-	-	7,396.62	7,396.62
其他负债	-	-	-	205,346.89	205,346.89
负债总计	-	-	-	260,378.37	260,378.37
利率敏感度缺口	3,178,943.75	-	-	53,176,001.17	56,354,944.92

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月）

			31 日 )
	市场利率平行上升 25 个基点	-	-58.61
	市场利率平行下降 25 个基点	-	58.61

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	56,250,724.89	94.74	53,424,577.42	94.80
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	56,250,724.89	94.74	53,424,577.42	94.80

#### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		2,961,685.19
业绩比较基准下降 5%		-2,961,685.19	-2,808,727.16

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	56,210,298.89	53,217,976.42
第二层次	40,426.00	818,726.75
第三层次	-	-
合计	56,250,724.89	54,036,703.17

###### 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 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：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	56,250,724.89	94.36
	其中：股票	56,250,724.89	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,333,069.14	5.59
8	其他各项资产	29,077.58	0.05
9	合计	59,612,871.61	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	394,090.00	0.66
B	采矿业	2,073,173.80	3.49
C	制造业	35,181,687.33	59.25
D	电力、热力、燃	1,944,448.90	3.27

	气及水生产和供应业		
E	建筑业	626,025.50	1.05
F	批发和零售业	1,785,598.60	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	849,738.18	1.43
H	住宿和餐饮业	106,120.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,683,270.42	7.89
J	金融业	4,823,642.17	8.12
K	房地产业	764,641.30	1.29
L	租赁和商务服务业	692,409.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	638,488.00	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	314,817.91	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	279,245.60	0.47
R	文化、体育和娱乐业	796,435.00	1.34
S	综合	296,893.18	0.50
	合计	56,250,724.89	94.74

### 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	0.00	0.00

### 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	300308	中际旭创	5,300	781,485.00	1.32
2	688256	寒武纪	1,700	319,600.00	0.54
3	000988	华工科技	8,300	315,483.00	0.53
4	002384	东山精密	11,400	295,260.00	0.50
5	002340	格林美	42,600	294,366.00	0.50
6	002422	科伦药业	9,800	290,864.00	0.49
7	600372	中航电子	18,600	282,348.00	0.48
8	300418	昆仑万维	6,900	277,932.00	0.47
9	300012	华测检测	14,000	273,000.00	0.46
10	600157	永泰能源	184,300	261,706.00	0.44
11	300724	捷佳伟创	2,300	258,405.00	0.44
12	600079	人福医药	9,500	255,930.00	0.43
13	688777	中控技术	4,060	254,886.80	0.43
14	600489	中金黄金	24,100	248,953.00	0.42
15	300003	乐普医疗	10,900	246,449.00	0.42
16	600487	亨通光电	16,400	240,424.00	0.40
17	002738	中矿资源	4,700	239,418.00	0.40
18	002028	思源电气	5,108	238,645.76	0.40

19	600536	中国软件	4,994	234,118.72	0.39
20	002463	沪电股份	11,100	232,434.00	0.39
21	601058	赛轮轮胎	20,300	231,217.00	0.39
22	601555	东吴证券	33,280	230,963.20	0.39
23	600765	中航重机	8,580	227,455.80	0.38
24	300037	新宙邦	4,300	223,127.00	0.38
25	000066	中国长城	16,100	222,663.00	0.38
26	600885	宏发股份	6,952	221,421.20	0.37
27	000807	云铝股份	17,300	220,229.00	0.37
28	600482	中国动力	9,000	210,960.00	0.36
29	688099	晶晨股份	2,500	210,800.00	0.36
30	000009	中国宝安	17,120	206,638.40	0.35
31	300146	汤臣倍健	8,500	203,830.00	0.34
32	000423	东阿阿胶	3,800	203,110.00	0.34
33	600352	浙江龙盛	21,600	201,960.00	0.34
34	300058	蓝色光标	20,700	200,169.00	0.34
35	002966	苏州银行	30,380	198,989.00	0.34
36	002156	通富微电	8,800	198,880.00	0.33
37	603444	吉比特	400	196,444.00	0.33
38	002185	华天科技	21,300	195,960.00	0.33
39	601108	财通证券	27,000	195,480.00	0.33
40	600415	小商品城	22,800	194,484.00	0.33
41	002624	完美世界	11,300	190,857.00	0.32
42	002625	光启技术	12,500	190,750.00	0.32
43	600027	华电国际	28,200	188,658.00	0.32
44	300144	宋城演艺	15,200	188,480.00	0.32
45	600109	国金证券	21,600	187,272.00	0.32
46	000783	长江证券	32,100	186,180.00	0.31
47	600988	赤峰黄金	13,800	185,748.00	0.31
48	601233	桐昆股份	14,000	185,500.00	0.31
49	600298	安琪酵母	5,100	184,671.00	0.31
50	600161	天坛生物	6,800	184,620.00	0.31
51	601077	渝农商行	51,400	184,526.00	0.31
52	300285	国瓷材料	6,700	183,580.00	0.31
53	002008	大族激光	7,000	183,400.00	0.31
54	600096	云天化	10,700	182,649.00	0.31
55	600418	江淮汽车	14,500	182,555.00	0.31
56	300568	星源材质	10,600	182,214.00	0.31
57	002385	大北农	27,500	181,500.00	0.31
58	002223	鱼跃医疗	4,989	179,554.11	0.30
59	000630	铜陵有色	61,000	176,290.00	0.30
60	002407	多氟多	8,860	175,959.60	0.30
61	002409	雅克科技	2,400	174,912.00	0.29

62	600862	中航高科	6,900	174,639.00	0.29
63	300390	天华新能	4,860	173,988.00	0.29
64	603882	金域医学	2,300	173,650.00	0.29
65	300024	机器人	10,300	171,701.00	0.29
66	601162	天风证券	57,400	171,052.00	0.29
67	603688	石英股份	1,500	170,760.00	0.29
68	000933	神火股份	13,100	170,300.00	0.29
69	002240	盛新锂能	5,300	168,911.00	0.28
70	600705	中航产融	44,000	168,520.00	0.28
71	300395	菲利华	3,400	167,280.00	0.28
72	300474	景嘉微	1,850	166,481.50	0.28
73	603596	伯特利	2,100	166,446.00	0.28
74	300604	长川科技	3,500	166,215.00	0.28
75	300073	当升科技	3,300	166,089.00	0.28
76	601168	西部矿业	15,800	166,058.00	0.28
77	002497	雅化集团	9,300	165,354.00	0.28
78	605358	立昂微	4,500	165,285.00	0.28
79	000932	华菱钢铁	34,320	163,706.40	0.28
80	002439	启明星辰	5,500	163,680.00	0.28
81	600066	宇通客车	11,000	162,140.00	0.27
82	000975	银泰黄金	13,829	161,799.30	0.27
83	002600	领益智造	23,400	161,694.00	0.27
84	600060	海信视像	6,500	160,875.00	0.27
85	300136	信维通信	8,000	160,640.00	0.27
86	688169	石头科技	500	160,340.00	0.27
87	002138	顺络电子	6,700	160,197.00	0.27
88	002568	百润股份	4,400	159,940.00	0.27
89	002797	第一创业	27,900	159,588.00	0.27
90	002850	科达利	1,200	158,700.00	0.27
91	002465	海格通信	15,300	158,202.00	0.27
92	603939	益丰药房	4,240	156,880.00	0.26
93	603816	顾家家居	4,100	156,415.00	0.26
94	000021	深科技	7,809	156,101.91	0.26
95	601128	常熟银行	22,700	154,814.00	0.26
96	300253	卫宁健康	14,300	154,726.00	0.26
97	600839	四川长虹	30,600	154,530.00	0.26
98	600160	巨化股份	11,200	154,336.00	0.26
99	000591	太阳能	22,700	153,906.00	0.26
100	300832	新产业	2,600	153,400.00	0.26
101	600879	航天电子	18,060	153,329.40	0.26
102	600873	梅花生物	17,100	152,703.00	0.26
103	688567	孚能科技	7,000	151,130.00	0.25
104	002368	太极股份	3,670	151,093.90	0.25

105	688521	芯原股份	2,100	151,032.00	0.25
106	600563	法拉电子	1,100	151,030.00	0.25
107	000683	远兴能源	21,000	150,990.00	0.25
108	300699	光威复材	4,860	149,931.00	0.25
109	601990	南京证券	18,300	149,694.00	0.25
110	600392	盛和资源	11,610	149,420.70	0.25
111	300866	安克创新	1,700	148,750.00	0.25
112	600497	驰宏锌锗	29,600	148,592.00	0.25
113	002078	太阳纸业	13,900	148,591.00	0.25
114	603589	口子窖	3,000	148,050.00	0.25
115	601696	中银证券	13,800	147,108.00	0.25
116	002025	航天电器	2,300	146,740.00	0.25
117	300118	东方日升	5,700	146,091.00	0.25
118	000729	燕京啤酒	11,700	145,899.00	0.25
119	600177	雅戈尔	23,100	145,761.00	0.25
120	600516	方大炭素	23,400	145,080.00	0.24
121	000831	中国稀土	4,900	145,040.00	0.24
122	600141	兴发集团	6,468	143,718.96	0.24
123	300017	网宿科技	20,200	143,622.00	0.24
124	002294	信立泰	4,600	143,474.00	0.24
125	600642	申能股份	20,400	142,596.00	0.24
126	002673	西部证券	22,300	141,605.00	0.24
127	000728	国元证券	21,700	141,484.00	0.24
128	600699	均胜电子	8,000	141,120.00	0.24
129	002430	杭氧股份	4,100	140,876.00	0.24
130	000629	钒钛股份	35,700	139,587.00	0.24
131	002532	天山铝业	23,200	138,968.00	0.23
132	600170	上海建工	51,600	138,804.00	0.23
133	600325	华发股份	14,058	138,471.30	0.23
134	600118	中国卫星	4,900	138,229.00	0.23
135	688536	思瑞浦	634	138,212.00	0.23
136	002268	电科网安	4,940	137,677.80	0.23
137	688390	固德威	824	137,492.64	0.23
138	002273	水晶光电	11,515	137,489.10	0.23
139	002372	伟星新材	6,660	136,796.40	0.23
140	002739	万达电影	10,900	136,686.00	0.23
141	002195	二三四五	47,230	136,494.70	0.23
142	600153	建发股份	12,500	136,375.00	0.23
143	600521	华海药业	7,400	136,234.00	0.23
144	000400	许继电气	5,900	135,995.00	0.23
145	300595	欧普康视	4,500	135,855.00	0.23
146	601966	玲珑轮胎	6,100	135,542.00	0.23
147	600166	福田汽车	39,800	135,320.00	0.23

148	600549	厦门钨业	7,100	135,113.00	0.23
149	600143	金发科技	15,400	134,442.00	0.23
150	688002	睿创微纳	3,000	134,400.00	0.23
151	603000	人民网	4,600	134,320.00	0.23
152	000738	航发控制	5,500	134,200.00	0.23
153	600399	抚顺特钢	13,100	133,620.00	0.23
154	000998	隆平高科	8,700	133,545.00	0.22
155	600637	东方明珠	17,000	132,940.00	0.22
156	600859	王府井	6,640	131,405.60	0.22
157	002065	东华软件	18,600	131,316.00	0.22
158	002444	巨星科技	6,000	131,280.00	0.22
159	600486	扬农化工	1,500	131,130.00	0.22
160	300487	蓝晓科技	2,100	131,082.00	0.22
161	000997	新大陆	6,900	130,410.00	0.22
162	600481	双良节能	9,300	130,014.00	0.22
163	300438	鹏辉能源	2,700	129,708.00	0.22
164	601577	长沙银行	16,700	129,592.00	0.22
165	601198	东兴证券	16,100	129,122.00	0.22
166	002131	利欧股份	56,059	128,935.70	0.22
167	600499	科达制造	11,300	128,368.00	0.22
168	002353	杰瑞股份	5,100	128,163.00	0.22
169	688220	翱捷科技	1,700	128,163.00	0.22
170	300682	朗新科技	5,500	128,040.00	0.22
171	600704	物产中大	25,900	127,946.00	0.22
172	300383	光环新网	11,900	127,925.00	0.22
173	688072	拓荆科技	300	127,791.00	0.22
174	000960	锡业股份	8,200	127,510.00	0.21
175	600021	上海电力	11,700	126,009.00	0.21
176	300676	华大基因	2,100	125,979.00	0.21
177	600271	航天信息	9,200	125,948.00	0.21
178	002373	千方科技	9,200	125,488.00	0.21
179	601997	贵阳银行	24,300	125,388.00	0.21
180	000519	中兵红箭	6,929	125,345.61	0.21
181	688009	中国通号	21,500	124,700.00	0.21
182	300001	特锐德	6,000	124,680.00	0.21
183	603077	和邦生物	51,240	124,513.20	0.21
184	000623	吉林敖东	7,742	124,181.68	0.21
185	002056	横店东磁	6,800	123,828.00	0.21
186	000703	恒逸石化	18,200	123,396.00	0.21
187	002507	涪陵榨菜	6,730	123,226.30	0.21
188	300088	长信科技	20,400	123,012.00	0.21
189	600380	健康元	9,572	121,660.12	0.20
190	600867	通化东宝	11,600	121,104.00	0.20

191	002152	广电运通	10,300	120,716.00	0.20
192	600998	九州通	11,622	120,636.36	0.20
193	000513	丽珠集团	3,098	120,543.18	0.20
194	002281	光迅科技	3,249	120,505.41	0.20
195	600511	国药股份	3,100	120,435.00	0.20
196	600498	烽火通信	5,900	120,183.00	0.20
197	600529	山东药玻	4,400	119,768.00	0.20
198	002203	海亮股份	9,900	118,899.00	0.20
199	002299	圣农发展	6,200	118,730.00	0.20
200	600546	山煤国际	8,200	118,654.00	0.20
201	600348	华阳股份	14,950	118,254.50	0.20
202	601016	节能风电	32,220	118,247.40	0.20
203	000636	风华高科	7,700	118,118.00	0.20
204	603338	浙江鼎力	2,100	117,621.00	0.20
205	600739	辽宁成大	8,900	117,035.00	0.20
206	603737	三棵树	1,780	116,447.60	0.20
207	002595	豪迈科技	3,300	115,929.00	0.20
208	601636	旗滨集团	13,400	115,508.00	0.19
209	603517	绝味食品	3,100	115,165.00	0.19
210	002080	中材科技	5,600	114,912.00	0.19
211	603712	七一二	3,800	114,798.00	0.19
212	002531	天顺风能	7,500	114,225.00	0.19
213	603885	吉祥航空	7,400	114,182.00	0.19
214	002192	融捷股份	1,700	113,611.00	0.19
215	002506	协鑫集成	38,600	113,098.00	0.19
216	688516	奥特维	600	113,040.00	0.19
217	002432	九安医疗	3,200	112,672.00	0.19
218	603927	中科软	2,920	112,595.20	0.19
219	600863	内蒙华电	27,100	112,465.00	0.19
220	600970	中材国际	8,750	111,562.50	0.19
221	600655	豫园股份	16,200	111,132.00	0.19
222	600580	卧龙电驱	7,600	111,036.00	0.19
223	688772	珠海冠宇	5,500	110,825.00	0.19
224	000878	云南铜业	10,000	110,500.00	0.19
225	688385	复旦微电	2,203	110,370.30	0.19
226	002092	中泰化学	17,100	110,295.00	0.19
227	600820	隧道股份	18,300	109,983.00	0.19
228	300182	捷成股份	17,400	109,794.00	0.18
229	300296	利亚德	16,800	109,704.00	0.18
230	600528	中铁工业	11,100	109,668.00	0.18
231	600909	华安证券	23,420	109,371.40	0.18
232	300212	易华录	3,280	108,994.40	0.18
233	002939	长城证券	13,400	108,942.00	0.18

234	002683	广东宏大	3,700	108,928.00	0.18
235	002926	华西证券	13,100	108,861.00	0.18
236	600535	天士力	7,500	108,825.00	0.18
237	688301	奕瑞科技	383	108,170.69	0.18
238	600329	达仁堂	2,400	107,736.00	0.18
239	300748	金力永磁	3,600	107,712.00	0.18
240	688200	华峰测控	700	107,100.00	0.18
241	603233	大参林	3,812	106,774.12	0.18
242	603160	汇顶科技	2,300	106,375.00	0.18
243	600258	首旅酒店	5,600	106,120.00	0.18
244	000547	航天发展	10,600	106,000.00	0.18
245	000750	国海证券	31,630	105,960.50	0.18
246	300244	迪安诊断	4,120	105,595.60	0.18
247	000893	亚钾国际	4,600	105,524.00	0.18
248	600008	首创环保	36,570	105,321.60	0.18
249	000039	中集集团	15,240	105,003.60	0.18
250	600416	湘电股份	5,500	104,995.00	0.18
251	000970	中科三环	8,095	103,777.90	0.17
252	603156	养元饮品	4,200	103,740.00	0.17
253	002557	洽洽食品	2,491	103,501.05	0.17
254	000060	中金岭南	21,700	103,075.00	0.17
255	002429	兆驰股份	18,700	102,850.00	0.17
256	601991	大唐发电	30,900	102,279.00	0.17
257	603893	瑞芯微	1,400	101,990.00	0.17
258	000830	鲁西化工	9,600	101,376.00	0.17
259	603456	九洲药业	3,700	101,306.00	0.17
260	300558	贝达药业	2,100	100,863.00	0.17
261	600369	西南证券	27,600	100,740.00	0.17
262	600390	五矿资本	18,700	100,606.00	0.17
263	600435	北方导航	8,700	99,963.00	0.17
264	002500	山西证券	17,760	99,100.80	0.17
265	002508	老板电器	3,900	98,631.00	0.17
266	600398	海澜之家	14,300	98,384.00	0.17
267	603658	安图生物	1,900	98,287.00	0.17
268	002936	郑州银行	42,655	98,106.50	0.17
269	688188	柏楚电子	520	98,051.20	0.17
270	002128	电投能源	7,400	97,828.00	0.16
271	300009	安科生物	9,724	97,240.00	0.16
272	300070	碧水源	18,100	97,016.00	0.16
273	601880	辽港股份	62,090	96,860.40	0.16
274	601717	郑煤机	7,700	95,865.00	0.16
275	600848	上海临港	8,000	95,600.00	0.16
276	600038	中直股份	2,400	95,568.00	0.16

277	002153	石基信息	6,808	95,312.00	0.16
278	300026	红日药业	17,500	94,850.00	0.16
279	603858	步长制药	4,600	94,714.00	0.16
280	600985	淮北矿业	8,200	94,464.00	0.16
281	000050	深天马 A	10,200	93,636.00	0.16
282	300529	健帆生物	4,000	92,720.00	0.16
283	603127	昭衍新药	2,260	92,434.00	0.16
284	002572	索菲亚	5,300	92,326.00	0.16
285	601179	中国西电	16,900	91,429.00	0.15
286	603267	鸿远电子	1,400	91,420.00	0.15
287	002244	滨江集团	10,300	90,846.00	0.15
288	002408	齐翔腾达	14,212	90,530.44	0.15
289	600673	东阳光	12,518	90,254.78	0.15
290	688779	长远锂科	8,000	90,160.00	0.15
291	601456	国联证券	9,900	90,090.00	0.15
292	600566	济川药业	3,100	90,024.00	0.15
293	003035	南网能源	12,600	89,712.00	0.15
294	600827	百联股份	6,700	89,579.00	0.15
295	002266	浙富控股	21,630	89,331.90	0.15
296	300373	扬杰科技	2,200	89,254.00	0.15
297	601958	金钼股份	8,000	89,200.00	0.15
298	600895	张江高科	6,400	89,088.00	0.15
299	002019	亿帆医药	6,100	89,060.00	0.15
300	600667	太极实业	12,200	88,572.00	0.15
301	688538	和辉光电	34,600	87,884.00	0.15
302	000155	川能动力	6,100	87,840.00	0.15
303	300357	我武生物	2,600	87,438.00	0.15
304	002958	青农商行	32,100	87,312.00	0.15
305	600208	新湖中宝	35,100	87,048.00	0.15
306	601000	唐山港	24,626	86,929.78	0.15
307	000739	普洛药业	4,900	86,926.00	0.15
308	688116	天奈科技	1,900	86,925.00	0.15
309	601666	平煤股份	11,500	86,710.00	0.15
310	600378	昊华科技	2,300	86,572.00	0.15
311	000887	中鼎股份	6,600	86,394.00	0.15
312	600282	南钢股份	25,600	86,272.00	0.15
313	600171	上海贝岭	4,700	85,775.00	0.14
314	600755	厦门国贸	11,068	85,666.32	0.14
315	002155	湖南黄金	7,000	85,400.00	0.14
316	300677	英科医疗	3,880	85,360.00	0.14
317	600316	洪都航空	3,600	84,420.00	0.14
318	002670	国盛金控	9,604	84,323.12	0.14

319	600959	江苏有线	24,900	84,162.00	0.14
320	300115	长盈精密	6,964	82,941.24	0.14
321	601231	环旭电子	5,500	82,280.00	0.14
322	603218	日月股份	4,300	81,657.00	0.14
323	002030	达安基因	8,188	81,634.36	0.14
324	600315	上海家化	2,800	81,228.00	0.14
325	000778	新兴铸管	19,900	81,192.00	0.14
326	300888	稳健医疗	1,940	80,839.80	0.14
327	600131	国网信通	4,000	80,760.00	0.14
328	601866	中远海发	32,600	80,522.00	0.14
329	600056	中国医药	6,200	80,476.00	0.14
330	600517	国网英大	14,100	80,370.00	0.14
331	000598	兴蓉环境	14,800	80,364.00	0.14
332	002487	大金重工	2,600	80,184.00	0.14
333	300363	博腾股份	2,700	79,893.00	0.13
334	600582	天地科技	13,700	79,871.00	0.13
335	002221	东华能源	9,206	79,631.90	0.13
336	002249	大洋电机	13,900	79,230.00	0.13
337	000987	越秀资本	12,425	78,898.75	0.13
338	600598	北大荒	5,900	78,647.00	0.13
339	300251	光线传媒	9,700	78,473.00	0.13
340	002326	永太科技	5,100	77,979.00	0.13
341	000027	深圳能源	11,820	77,893.80	0.13
342	600906	财达证券	10,800	77,760.00	0.13
343	601005	重庆钢铁	55,300	77,420.00	0.13
344	688082	盛美上海	700	77,280.00	0.13
345	000709	河钢股份	34,100	77,066.00	0.13
346	603026	胜华新材	1,300	77,025.00	0.13
347	601106	中国一重	22,800	76,608.00	0.13
348	002183	怡亚通	15,000	76,500.00	0.13
349	002518	科士达	1,900	76,019.00	0.13
350	600718	东软集团	7,100	75,686.00	0.13
351	601992	金隅集团	34,400	74,992.00	0.13
352	000883	湖北能源	16,400	74,784.00	0.13
353	002831	裕同科技	3,060	74,633.40	0.13
354	600373	中文传媒	5,600	74,592.00	0.13
355	603568	伟明环保	4,251	74,435.01	0.13
356	002690	美亚光电	2,890	74,417.50	0.13
357	601665	齐鲁银行	18,900	74,088.00	0.12
358	603883	老百姓	2,476	73,908.60	0.12
359	002511	中顺洁柔	6,600	73,590.00	0.12
360	000825	太钢不锈	18,900	73,143.00	0.12
361	002985	北摩高科	1,655	73,018.60	0.12

362	300776	帝尔激光	1,120	72,688.00	0.12
363	601778	晶科科技	14,700	72,618.00	0.12
364	600663	陆家嘴	7,300	72,051.00	0.12
365	601928	凤凰传媒	6,300	71,820.00	0.12
366	600967	内蒙一机	7,100	71,710.00	0.12
367	603228	景旺电子	2,794	71,666.10	0.12
368	600737	中粮糖业	8,900	71,645.00	0.12
369	002791	坚朗五金	1,100	71,181.00	0.12
370	603225	新凤鸣	6,356	70,233.80	0.12
371	688208	道通科技	2,300	69,713.00	0.12
372	600155	华创云信	11,200	69,664.00	0.12
373	600801	华新水泥	5,636	69,604.60	0.12
374	601098	中南传媒	6,000	69,600.00	0.12
375	600297	广汇汽车	33,400	69,472.00	0.12
376	300861	美畅股份	1,600	69,392.00	0.12
377	688778	厦钨新能	1,400	69,300.00	0.12
378	002468	申通快递	6,400	69,248.00	0.12
379	300482	万孚生物	2,590	68,971.70	0.12
380	688276	百克生物	1,100	68,860.00	0.12
381	002745	木林森	7,400	68,080.00	0.11
382	603529	爱玛科技	2,100	67,662.00	0.11
383	000012	南 玻 A	11,295	67,318.20	0.11
384	603866	桃李面包	6,650	67,298.00	0.11
385	001227	兰州银行	23,500	67,210.00	0.11
386	000156	华数传媒	7,700	66,990.00	0.11
387	600871	石化油服	33,600	66,528.00	0.11
388	000581	威孚高科	4,200	66,150.00	0.11
389	688690	纳微科技	1,700	66,045.00	0.11
390	600500	中化国际	11,813	65,680.28	0.11
391	688029	南微医学	800	65,248.00	0.11
392	301029	怡合达	1,460	65,232.80	0.11
393	002032	苏 泊 尔	1,300	65,000.00	0.11
394	000401	冀东水泥	8,800	64,856.00	0.11
395	002250	联化科技	6,144	64,266.24	0.11
396	002867	周大生	3,600	64,008.00	0.11
397	600556	天下秀	9,000	63,810.00	0.11
398	601611	中国核建	7,500	63,375.00	0.11
399	688052	纳芯微	400	63,348.00	0.11
400	601118	海南橡胶	14,100	63,168.00	0.11
401	002010	传化智联	11,800	62,776.00	0.11
402	600022	山东钢铁	44,050	62,551.00	0.11
403	688520	神州细胞	1,100	62,414.00	0.11
404	000930	中粮科技	7,700	62,370.00	0.11

405	688006	杭可科技	2,040	62,158.80	0.10
406	600259	广晟有色	1,700	61,438.00	0.10
407	000785	居然之家	16,100	61,341.00	0.10
408	002423	中粮资本	7,600	60,800.00	0.10
409	688281	华秦科技	300	60,750.00	0.10
410	601598	中国外运	13,000	60,580.00	0.10
411	601608	中信重工	14,300	60,203.00	0.10
412	600062	华润双鹤	3,452	60,133.84	0.10
413	603826	坤彩科技	1,200	60,000.00	0.10
414	300850	新强联	1,600	59,808.00	0.10
415	002505	鹏都农牧	31,530	59,591.70	0.10
416	000559	万向钱潮	10,900	59,405.00	0.10
417	600597	光明乳业	5,700	59,280.00	0.10
418	002081	金螳螂	13,100	59,081.00	0.10
419	000089	深圳机场	8,500	59,075.00	0.10
420	600782	新钢股份	15,900	58,989.00	0.10
421	300618	寒锐钴业	1,800	58,338.00	0.10
422	000958	电投产融	13,300	57,589.00	0.10
423	603638	艾迪精密	2,800	57,456.00	0.10
424	600409	三友化工	10,400	56,680.00	0.10
425	600901	江苏金租	13,720	56,663.60	0.10
426	600707	彩虹股份	11,800	56,168.00	0.09
427	600339	中油工程	13,800	56,166.00	0.09
428	000937	冀中能源	8,800	56,144.00	0.09
429	601187	厦门银行	11,100	55,722.00	0.09
430	688107	安路科技	1,000	55,390.00	0.09
431	600095	湘财股份	7,100	55,380.00	0.09
432	000898	鞍钢股份	19,800	55,044.00	0.09
433	603707	健友股份	4,060	54,810.00	0.09
434	002761	浙江建投	3,600	54,648.00	0.09
435	000967	盈峰环境	10,700	54,035.00	0.09
436	601718	际华集团	18,100	53,757.00	0.09
437	000537	广宇发展	4,600	53,682.00	0.09
438	000415	渤海租赁	25,500	53,550.00	0.09
439	600507	方大特钢	11,505	53,268.15	0.09
440	600167	联美控股	7,630	53,181.10	0.09
441	001914	招商积余	3,500	52,675.00	0.09
442	601156	东航物流	4,000	52,000.00	0.09
443	601568	北元集团	9,840	51,856.80	0.09
444	688234	天岳先进	700	51,758.00	0.09
445	600968	海油发展	16,800	51,576.00	0.09
446	000563	陕国投 A	16,866	51,441.30	0.09
447	600808	马钢股份	19,900	51,143.00	0.09

448	002925	盈趣科技	2,600	50,440.00	0.08
449	600195	中牧股份	4,287	50,072.16	0.08
450	300257	开山股份	3,300	50,061.00	0.08
451	300442	润泽科技	1,600	49,216.00	0.08
452	603650	彤程新材	1,500	49,200.00	0.08
453	600764	中国海防	1,800	48,996.00	0.08
454	688185	康希诺	600	48,900.00	0.08
455	002705	新宝股份	2,700	48,681.00	0.08
456	600126	杭钢股份	11,090	48,130.60	0.08
457	002608	江苏国信	6,300	47,691.00	0.08
458	603379	三美股份	1,980	46,549.80	0.08
459	000959	首钢股份	13,200	46,200.00	0.08
460	603786	科博达	700	45,990.00	0.08
461	000402	金融街	10,100	45,652.00	0.08
462	002653	海思科	1,900	44,840.00	0.08
463	688819	天能股份	1,200	44,208.00	0.07
464	002110	三钢闽光	10,350	43,677.00	0.07
465	601828	美凯龙	9,100	43,589.00	0.07
466	001203	大中矿业	3,800	42,218.00	0.07
467	688289	圣湘生物	2,500	42,100.00	0.07
468	002563	森马服饰	6,700	41,674.00	0.07
469	600377	宁沪高速	4,200	41,286.00	0.07
470	601298	青岛港	5,800	40,426.00	0.07
471	603056	德邦股份	2,600	40,092.00	0.07
472	601228	广州港	12,400	40,052.00	0.07
473	000031	大悦城	10,800	39,528.00	0.07
474	600927	永安期货	2,400	39,024.00	0.07
475	600928	西安银行	11,000	38,720.00	0.07
476	600623	华谊集团	6,200	38,626.00	0.07
477	603317	天味食品	2,640	38,570.40	0.06
478	601869	长飞光纤	1,000	37,010.00	0.06
479	600350	山东高速	5,600	35,672.00	0.06
480	002399	海普瑞	3,100	35,557.00	0.06
481	601136	首创证券	2,500	35,425.00	0.06
482	601139	深圳燃气	4,800	34,992.00	0.06
483	000869	张裕 A	1,100	33,726.00	0.06
484	601969	海南矿业	5,100	33,558.00	0.06
485	001872	招商港口	1,900	32,813.00	0.06
486	600995	南网储能	2,900	31,929.00	0.05
487	000553	安道麦 A	3,700	31,228.00	0.05
488	688105	诺唯赞	1,000	30,490.00	0.05
489	002945	华林证券	2,200	30,096.00	0.05
490	688248	南网科技	700	26,873.00	0.05

491	601158	重庆水务	4,800	26,688.00	0.04
492	600299	安迪苏	3,300	26,301.00	0.04
493	603868	飞科电器	400	25,236.00	0.04
494	603355	莱克电气	960	24,393.60	0.04
495	600956	新天绿能	2,600	22,672.00	0.04
496	600032	浙江新能	1,800	22,608.00	0.04
497	688295	中复神鹰	600	22,008.00	0.04
498	300741	华宝股份	1,000	21,420.00	0.04
499	002901	大博医疗	500	15,540.00	0.03

### 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	000540	*ST 中天	41,300	0.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	241,380.00	0.43
2	000066	中国长城	229,852.00	0.41
3	688188	柏楚电子	214,061.00	0.38
4	000423	东阿阿胶	199,739.00	0.35
5	600372	中航电子	195,974.00	0.35
6	000933	神火股份	187,534.00	0.33
7	002240	盛新锂能	184,885.00	0.33
8	002008	大族激光	174,863.00	0.31
9	603882	金域医学	171,926.00	0.31
10	688301	奕瑞科技	164,890.00	0.29
11	688169	石头科技	162,984.00	0.29
12	688536	思瑞浦	154,820.89	0.27
13	002600	领益智造	152,109.00	0.27
14	300395	菲利华	148,371.00	0.26
15	688516	奥特维	144,196.00	0.26
16	688200	华峰测控	142,020.00	0.25
17	688220	翱捷科技	141,177.96	0.25
18	300118	东方日升	137,779.00	0.24
19	002432	九安医疗	132,729.00	0.24
20	300487	蓝晓科技	132,641.00	0.24

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	688122	西部超导	243,436.70	0.43
2	603345	安井食品	229,354.00	0.41
3	601607	上海医药	226,702.00	0.40
4	000999	华润三九	218,565.00	0.39
5	002603	以岭药业	194,765.00	0.35
6	603605	珀莱雅	191,495.32	0.34
7	603606	东方电缆	185,522.00	0.33
8	601699	潞安环能	175,175.00	0.31
9	601872	招商轮船	170,344.00	0.30
10	300168	万达信息	169,552.00	0.30
11	603613	国联股份	160,988.75	0.29
12	688301	奕瑞科技	158,231.00	0.28
13	688188	柏楚电子	150,386.00	0.27
14	600026	中远海能	146,749.00	0.26
15	688063	派能科技	135,103.00	0.24
16	601333	广深铁路	114,300.00	0.20
17	688390	固德威	110,720.00	0.20
18	002212	天融信	110,704.00	0.20
19	600201	生物股份	96,528.40	0.17
20	600728	佳都科技	94,307.00	0.17

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	9,349,256.21
卖出股票收入（成交）总额	7,967,320.02

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**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

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	1,066.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,010.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,077.58

**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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	*ST 中天	0.00	0.00	公告重大事项

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
4,651	8,326.03	297,367.97	0.77	38,427,006.83	99.23

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	8,311.51	0.0215

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年11月29日) 基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	37,838,959.81
本报告期基金总申购份额	3,868,503.56
减：本报告期基金总赎回份额	2,983,088.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	38,724,374.80

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	9,127,087.03	53.28	6,674.71	47.25	-
高华证券	1	8,002,101.43	46.72	7,452.95	52.75	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。
- (3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请,集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后,研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价,做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

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

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站	2023 年 03 月 29 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2023 年 04 月 20 日
4	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2023 年第 1 次	上海证券报、基金管理人网站	2023 年 06 月 29 日

5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站	2023 年 06 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、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日