

# 农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2024 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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	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	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	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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
<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>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	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>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
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	39,197,789.10 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量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% × 中证 500 指数 + 5% × 同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>

址	
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,455,357.47
本期利润	-4,274,608.58
加权平均基金份额本期利润	-0.1101
本期加权平均净值利润率	-8.19%
本期基金份额净值增长率	-8.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,941,200.10
期末可供分配基金份额利润	0.2791
期末基金资产净值	50,138,989.20
期末基金份额净值	1.2791
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	27.91%

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	-5.91%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.64%	0.01%
过去三个月	-5.31%	1.08%	-6.16%	1.09%	0.85%	-0.01%

过去六个月	-8.00%	1.51%	-8.46%	1.53%	0.46%	-0.02%
过去一年	-16.58%	1.20%	-16.71%	1.21%	0.13%	-0.01%
过去三年	-24.89%	1.13%	-26.02%	1.14%	1.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	27.91%	1.46%	27.25%	1.48%	0.66%	-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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 83 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券

投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银



汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理国企优选混合型证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金的基金经理	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 0.0312%，日均偏离度为 0.0211%，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 1.2791 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.00%，业绩比较基准收益率为-8.46%。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,092,986.93	3,044,088.91
结算备付金		2,472.61	-
存出保证金		940.57	1,709.58
交易性金融资产	6.4.7.2	47,199,294.12	50,302,547.60
其中：股票投资		47,199,294.12	50,302,547.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		13,403.51	41,166.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		50,309,097.74	53,389,512.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		6,011.14	60,760.51
应付管理人报酬		31,921.12	33,933.32
应付托管费		6,384.20	6,786.66
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	125,792.08	241,588.20
负债合计		170,108.54	343,068.69
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	39,197,789.10	38,152,996.78
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,941,200.10	14,893,447.45
净资产合计		50,138,989.20	53,046,444.23
负债和净资产总计		50,309,097.74	53,389,512.92

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2791 元，基金份额总额 39,197,789.10 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-3,867,290.08	2,095,363.68
1. 利息收入		11,177.56	12,526.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,177.56	12,526.37
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）		-1,065,114.53	-62,674.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,726,605.12	-719,106.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	654.25
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	661,490.59	655,778.24
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	-2,819,251.11	2,139,695.51
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	5,898.00	5,816.08
<b>减：二、营业总支出</b>		407,318.50	443,748.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	194,686.60	223,086.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,937.32	44,617.23
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	173,694.58	176,044.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,274,608.58	1,651,615.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,274,608.58	1,651,615.31
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-4,274,608.58	1,651,615.31
----------	--	---------------	--------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	38,152,996.78	-	14,893,447.45	53,046,444.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	38,152,996.78	-	14,893,447.45	53,046,444.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,044,792.32	-	-3,952,247.35	-2,907,455.03
（一）、综合收益总额	-	-	-4,274,608.58	-4,274,608.58
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,044,792.32	-	322,361.23	1,367,153.55
其中：1. 基金申购款	4,428,547.37	-	1,507,716.17	5,936,263.54
2. 基金赎回款	-3,383,755.05	-	-1,185,354.94	-4,569,109.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	39,197,789.10	-	10,941,200.10	50,138,989.20

项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数(净资产减少以“-”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	38,724,374.80	-	20,649,829.65	59,374,204.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

程昆

基金管理人负责人

毕宏燕

主管会计工作负责人

丁煜琼

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

注：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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计

算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款	3,092,986.93
等于：本金	3,092,445.47	
加：应计利息	541.46	
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	3,092,986.93	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	57,152,688.62	-	47,199,294.12	-9,953,394.50
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	57,152,688.62	-	47,199,294.12	-9,953,394.50

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期无其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,136.01
其中：交易所市场	11,136.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	114,644.58
合计	125,792.08

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,152,996.78	38,152,996.78
本期申购	4,428,547.37	4,428,547.37
本期赎回（以“-”号填列）	-3,383,755.05	-3,383,755.05
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	39,197,789.10	39,197,789.10

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	40,776,303.22	-25,882,855.77	14,893,447.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	40,776,303.22	-25,882,855.77	14,893,447.45
本期利润	-1,455,357.47	-2,819,251.11	-4,274,608.58
本期基金份额交易产生的变动数	1,106,677.23	-784,316.00	322,361.23
其中：基金申购款	4,705,427.63	-3,197,711.46	1,507,716.17
基金赎回款	-3,598,750.40	2,413,395.46	-1,185,354.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,427,622.98	-29,486,422.88	10,941,200.10

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	11,085.98	
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	82.27	
其他	9.31	
合计	11,177.56	

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	6,915,694.27	
减：卖出股票成本总额	8,624,807.43	
减：交易费用	17,491.96	
买卖股票差价收入	-1,726,605.12	

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	661,490.59
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	661,490.59

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,819,251.11
股票投资	-2,819,251.11
债券投资	-
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	-2,819,251.11

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,761.20
基金转换费收入	1,136.80
合计	5,898.00

## 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02



信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	50.00
账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	173,694.58

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	194,686.60	223,086.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	87,294.78	100,316.98
应支付基金管理人的净管理费	107,391.82	122,769.50

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	38,937.32	44,617.23

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	3,092,986.93	11,085.98	3,327,632.34	12,399.21

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	公告重大事项	0.00	-	-	41,300	124,465.48	0.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注 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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,092,986.93	-	-	-	3,092,986.93
结算备付金	2,472.61	-	-	-	2,472.61
存出保证金	940.57	-	-	-	940.57
交易性金融资产	-	-	-	47,199,294.12	47,199,294.12
应收申购款	-	-	-	13,403.51	13,403.51
资产总计	3,096,400.11	-	-	47,212,697.63	50,309,097.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,011.14	6,011.14
应付管理人报酬	-	-	-	31,921.12	31,921.12
应付托管费	-	-	-	6,384.20	6,384.20
其他负债	-	-	-	125,792.08	125,792.08
负债总计	-	-	-	170,108.54	170,108.54
利率敏感度缺口	3,096,400.11	-	-	47,042,589.09	50,138,989.20
上年度末 2023 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	3,044,088.91	-	-	-	3,044,088.91
存出保证金	1,709.58	-	-	-	1,709.58
交易性金融资产	-	-	-	50,302,547.60	50,302,547.60
应收申购款	-	-	-	41,166.83	41,166.83
资产总计	3,045,798.49	-	-	50,343,714.43	53,389,512.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	60,760.51	60,760.51
应付管理人报酬	-	-	-	33,933.32	33,933.32

应付托管费	-	-	6,786.66	6,786.66
其他负债	-	-	241,588.20	241,588.20
负债总计	-	-	343,068.69	343,068.69
利率敏感度缺口	3,045,798.49	-	50,000,645.74	53,046,444.23

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

本基金本报告期末和上年度末未持有利率敏感性资产，因此，市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,199,294.12	94.14	50,302,547.60	94.83
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	47,199,294.12	94.14	50,302,547.60	94.83

## 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,485,695.48	2,639,922.67
业绩比较基准下降 5%	-2,485,695.48	-2,639,922.67	

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	47,199,294.12	50,302,547.60
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	47,199,294.12	50,302,547.60

## 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	47,199,294.12	93.82
	其中：股票	47,199,294.12	93.82
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	3,095,459.54	6.15
8	其他各项资产	14,344.08	0.03
9	合计	50,309,097.74	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	297,104.00	0.59
B	采矿业	2,210,710.00	4.41
C	制造业	29,797,235.32	59.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,902,752.40	3.79
E	建筑业	478,904.00	0.96
F	批发和零售业	1,002,895.20	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	958,540.90	1.91
H	住宿和餐饮业	148,183.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,366,985.98	6.72
J	金融业	4,400,585.48	8.78
K	房地产业	535,661.00	1.07
L	租赁和商务服务业	362,887.56	0.72
M	科学研究和技术服务业	381,053.28	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	212,856.28	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,091.00	0.11
Q	卫生和社会工作	292,670.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	712,572.00	1.42
S	综合	84,606.72	0.17
	合计	47,199,294.12	94.14

### 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

### 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	300502	新易盛	5,700	601,635.00	1.20
2	002028	思源电气	4,908	328,345.20	0.65
3	688169	石头科技	800	314,080.00	0.63
4	601058	赛轮轮胎	21,000	294,000.00	0.59

5	600066	宇通客车	10,600	273,480.00	0.55
6	002340	格林美	40,900	260,533.00	0.52
7	000933	神火股份	12,600	254,898.00	0.51
8	601077	渝农商行	49,300	247,486.00	0.49
9	000988	华工科技	8,000	239,440.00	0.48
10	601168	西部矿业	13,300	238,735.00	0.48
11	300394	天孚通信	2,680	236,965.60	0.47
12	002384	东山精密	10,900	225,630.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	3,600	225,360.00	0.45
14	000630	铜陵有色	61,100	220,571.00	0.44
15	600418	江淮汽车	13,900	220,176.00	0.44
16	600988	赤峰黄金	13,300	217,322.00	0.43
17	601233	桐昆股份	13,400	213,864.00	0.43
18	600157	永泰能源	177,000	208,860.00	0.42
19	002625	光启技术	12,000	208,200.00	0.42
20	600096	云天化	10,300	200,026.00	0.40
21	000400	许继电气	5,700	196,137.00	0.39
22	601567	三星医疗	5,600	196,000.00	0.39
23	002156	通富微电	8,500	190,315.00	0.38
24	002273	水晶光电	11,115	188,732.70	0.38
25	688777	中控技术	5,000	188,500.00	0.38
26	002128	电投能源	8,900	187,790.00	0.37
27	002078	太阳纸业	13,400	186,930.00	0.37
28	601555	东吴证券	31,680	186,912.00	0.37
29	600885	宏发股份	6,652	184,127.36	0.37
30	688617	惠泰医疗	400	182,440.00	0.36
31	601128	常熟银行	24,000	181,680.00	0.36
32	300207	欣旺达	11,900	180,523.00	0.36
33	002223	鱼跃医疗	4,789	180,066.40	0.36
34	002532	天山铝业	22,200	180,042.00	0.36
35	600352	浙江龙盛	20,700	177,813.00	0.35
36	600398	海澜之家	19,100	176,484.00	0.35
37	002138	顺络电子	6,400	175,744.00	0.35
38	002966	苏州银行	23,380	175,350.00	0.35
39	002353	杰瑞股份	4,900	171,892.00	0.34
40	601108	财通证券	26,000	171,860.00	0.34
41	600765	中航重机	8,280	168,912.00	0.34
42	002185	华天科技	20,400	166,260.00	0.33
43	600879	航天电子	21,060	163,636.20	0.33
44	002517	恺英网络	17,100	163,305.00	0.33
45	301236	软通动力	4,600	161,966.00	0.32
46	603606	东方电缆	3,300	161,073.00	0.32
47	688099	晶晨股份	2,700	160,164.00	0.32

48	600873	梅花生物	15,900	159,318.00	0.32
49	600177	雅戈尔	22,100	157,352.00	0.31
50	601577	长沙银行	19,200	157,056.00	0.31
51	600109	国金证券	20,700	156,285.00	0.31
52	600079	人福医药	9,100	156,247.00	0.31
53	600060	海信视像	6,300	155,862.00	0.31
54	300003	乐普医疗	10,500	155,820.00	0.31
55	002738	中矿资源	5,800	155,440.00	0.31
56	300017	网宿科技	19,400	153,260.00	0.31
57	688120	华海清科	800	151,664.00	0.30
58	603979	金诚信	3,000	151,590.00	0.30
59	603160	汇顶科技	2,200	151,250.00	0.30
60	300136	信维通信	7,700	150,766.00	0.30
61	600497	驰宏锌锗	27,700	147,918.00	0.30
62	002202	金风科技	22,000	147,840.00	0.29
63	002739	万达电影	12,200	147,498.00	0.29
64	000932	华菱钢铁	33,020	146,278.60	0.29
65	002409	雅克科技	2,300	144,693.00	0.29
66	600985	淮北矿业	8,600	143,964.00	0.29
67	600348	华阳股份	14,450	143,922.00	0.29
68	002281	光迅科技	3,849	143,837.13	0.29
69	000683	远兴能源	20,800	143,728.00	0.29
70	600536	中国软件	4,794	143,436.48	0.29
71	002444	巨星科技	5,800	143,260.00	0.29
72	002465	海格通信	13,800	142,968.00	0.29
73	000009	中国宝安	16,420	141,212.00	0.28
74	000878	云南铜业	11,200	139,552.00	0.28
75	002008	大族激光	6,700	139,360.00	0.28
76	002436	兴森科技	13,500	139,320.00	0.28
77	688122	西部超导	3,600	137,952.00	0.28
78	600642	申能股份	15,600	137,748.00	0.27
79	601615	明阳智能	14,500	136,880.00	0.27
80	600298	安琪酵母	4,900	136,857.00	0.27
81	002797	第一创业	26,800	136,412.00	0.27
82	300054	鼎龙股份	6,000	136,080.00	0.27
83	300474	景嘉微	2,150	135,944.50	0.27
84	000039	中集集团	14,640	135,566.40	0.27
85	601990	南京证券	17,600	135,168.00	0.27
86	300012	华测检测	13,400	134,804.00	0.27
87	000066	中国长城	15,400	134,750.00	0.27
88	688525	佰维存储	2,100	134,715.00	0.27
89	600529	山东药玻	5,300	134,302.00	0.27
90	002673	西部证券	21,500	133,085.00	0.27

91	601666	平煤股份	11,800	132,160.00	0.26
92	600839	四川长虹	29,400	132,006.00	0.26
93	601179	中国西电	16,300	131,052.00	0.26
94	603596	伯特利	3,360	130,704.00	0.26
95	000831	中国稀土	5,100	129,285.00	0.26
96	300395	菲利华	4,200	129,150.00	0.26
97	000783	长江证券	26,400	127,512.00	0.25
98	601717	郑煤机	8,600	127,280.00	0.25
99	000728	国元证券	21,000	127,260.00	0.25
100	688188	柏楚电子	688	126,970.40	0.25
101	300002	神州泰岳	15,600	126,672.00	0.25
102	000738	航发控制	6,300	126,441.00	0.25
103	603816	顾家家居	3,900	125,931.00	0.25
104	600862	中航高科	6,700	125,826.00	0.25
105	002432	九安医疗	3,100	125,674.00	0.25
106	688180	君实生物	4,300	124,915.00	0.25
107	000703	恒逸石化	17,500	124,075.00	0.25
108	601198	东兴证券	15,500	123,380.00	0.25
109	601997	贵阳银行	23,300	122,791.00	0.24
110	000960	锡业股份	7,900	122,371.00	0.24
111	002595	豪迈科技	3,200	122,144.00	0.24
112	002155	湖南黄金	6,700	121,270.00	0.24
113	603338	浙江鼎力	2,000	120,840.00	0.24
114	601696	中银证券	13,300	120,764.00	0.24
115	600863	内蒙华电	26,000	120,640.00	0.24
116	601162	天风证券	55,200	120,336.00	0.24
117	300037	新宙邦	4,200	119,952.00	0.24
118	002294	信立泰	4,500	119,835.00	0.24
119	300866	安克创新	1,680	119,632.80	0.24
120	600521	华海药业	7,000	119,350.00	0.24
121	000921	海信家电	3,700	119,288.00	0.24
122	600038	中直股份	2,900	119,219.00	0.24
123	603939	益丰药房	4,848	119,018.40	0.24
124	002472	双环传动	5,400	118,908.00	0.24
125	603345	安井食品	1,600	118,896.00	0.24
126	300724	捷佳伟创	2,200	118,822.00	0.24
127	300001	特锐德	5,900	118,708.00	0.24
128	002984	森麒麟	4,900	118,041.00	0.24
129	600141	兴发集团	6,168	117,685.44	0.23
130	600549	厦门钨业	6,800	117,300.00	0.23
131	600699	均胜电子	7,900	117,078.00	0.23
132	300699	光威复材	4,660	115,707.80	0.23
133	002407	多氟多	9,460	115,695.80	0.23

134	600546	山煤国际	7,900	115,498.00	0.23
135	600895	张江高科	6,200	114,576.00	0.23
136	002850	科达利	1,500	114,570.00	0.23
137	600820	隧道股份	17,500	114,275.00	0.23
138	300285	国瓷材料	6,400	114,240.00	0.23
139	002262	恩华药业	4,800	113,952.00	0.23
140	600369	西南证券	31,800	113,844.00	0.23
141	603589	口子窖	2,900	113,651.00	0.23
142	000021	深科技	7,509	113,536.08	0.23
143	002195	岩山科技	45,230	113,527.30	0.23
144	600872	中炬高新	5,000	113,450.00	0.23
145	002064	华峰化学	15,800	113,286.00	0.23
146	301358	湖南裕能	3,600	113,256.00	0.23
147	603087	甘李药业	2,400	111,168.00	0.22
148	601000	唐山港	23,626	111,042.20	0.22
149	600486	扬农化工	1,950	110,077.50	0.22
150	300073	当升科技	3,200	109,792.00	0.22
151	300146	汤臣倍健	8,100	109,755.00	0.22
152	600021	上海电力	11,000	108,790.00	0.22
153	300114	中航电测	2,400	108,600.00	0.22
154	601966	玲珑轮胎	5,900	108,383.00	0.22
155	000513	丽珠集团	2,898	107,834.58	0.22
156	300058	蓝色光标	19,800	107,712.00	0.21
157	600704	物产中大	24,800	107,632.00	0.21
158	002756	永兴材料	3,000	107,340.00	0.21
159	600153	建发股份	12,000	107,160.00	0.21
160	000830	鲁西化工	9,200	106,628.00	0.21
161	600155	华创云信	18,000	106,380.00	0.21
162	300529	健帆生物	3,900	106,119.00	0.21
163	603179	新泉股份	2,700	105,948.00	0.21
164	600118	中国卫星	4,700	104,481.00	0.21
165	688065	凯赛生物	2,300	104,397.00	0.21
166	600583	海油工程	17,600	104,016.00	0.21
167	002558	巨人网络	11,000	103,840.00	0.21
168	601156	东航物流	5,100	103,785.00	0.21
169	002152	广电运通	9,900	103,554.00	0.21
170	000591	太阳能	21,800	102,678.00	0.20
171	000623	吉林敖东	7,642	102,402.80	0.20
172	002025	航天电器	2,200	102,036.00	0.20
173	600970	中材国际	8,450	101,907.00	0.20
174	300373	扬杰科技	2,600	101,140.00	0.20
175	002385	大北农	26,200	100,870.00	0.20
176	300144	宋城演艺	12,500	100,375.00	0.20

177	600380	健康元	8,972	100,217.24	0.20
178	002439	启明星辰	5,800	100,108.00	0.20
179	605358	立昂微	4,300	99,502.00	0.20
180	601216	君正集团	26,900	99,261.00	0.20
181	600143	金发科技	15,000	99,150.00	0.20
182	000729	燕京啤酒	11,200	98,896.00	0.20
183	000723	美锦能源	20,700	98,532.00	0.20
184	300251	光线传媒	11,700	98,397.00	0.20
185	600998	九州通	20,122	98,195.36	0.20
186	300383	光环新网	11,600	98,020.00	0.20
187	600637	东方明珠	16,100	97,888.00	0.20
188	600282	南钢股份	19,600	97,608.00	0.19
189	600392	盛和资源	11,310	97,492.20	0.19
190	300024	机器人	10,000	97,400.00	0.19
191	600763	通策医疗	1,800	97,290.00	0.19
192	000519	中兵红箭	6,629	97,247.43	0.19
193	000636	风华高科	7,400	96,644.00	0.19
194	600516	方大炭素	22,400	96,544.00	0.19
195	300677	英科医疗	3,580	95,979.80	0.19
196	000818	航锦科技	4,300	94,944.00	0.19
197	002958	青农商行	35,400	94,872.00	0.19
198	601665	齐鲁银行	19,300	94,763.00	0.19
199	600909	华安证券	22,420	94,388.20	0.19
200	002044	美年健康	24,900	94,122.00	0.19
201	600008	首创环保	35,070	93,987.60	0.19
202	000883	湖北能源	15,600	93,756.00	0.19
203	300088	长信科技	19,800	93,060.00	0.19
204	600867	通化东宝	11,100	92,907.00	0.19
205	000629	钒钛股份	37,000	92,500.00	0.18
206	601016	节能风电	30,920	92,450.80	0.18
207	600511	国药股份	3,000	92,370.00	0.18
208	688213	思特威	1,900	92,150.00	0.18
209	600566	济川药业	2,900	91,959.00	0.18
210	000997	新大陆	6,600	91,806.00	0.18
211	601456	国联证券	9,500	91,580.00	0.18
212	600582	天地科技	13,200	90,948.00	0.18
213	600498	烽火通信	5,700	90,630.00	0.18
214	300567	精测电子	1,600	90,416.00	0.18
215	600499	科达制造	10,700	90,201.00	0.18
216	600129	太极集团	3,100	89,652.00	0.18
217	601933	永辉超市	36,100	89,528.00	0.18
218	000598	兴蓉环境	11,900	89,488.00	0.18
219	600535	天士力	7,100	89,318.00	0.18

220	600004	白云机场	9,400	89,112.00	0.18
221	601991	大唐发电	29,600	89,096.00	0.18
222	002120	韵达股份	11,500	89,010.00	0.18
223	600170	上海建工	41,400	89,010.00	0.18
224	000750	国海证券	30,530	88,842.30	0.18
225	600580	卧龙电驱	7,300	88,695.00	0.18
226	002261	拓维信息	8,000	88,560.00	0.18
227	300118	东方日升	7,300	88,330.00	0.18
228	000060	中金岭南	20,800	88,192.00	0.18
229	603000	人民网	4,400	87,956.00	0.18
230	300568	星源材质	10,700	87,740.00	0.17
231	603658	安图生物	1,900	87,533.00	0.17
232	600166	福田汽车	38,700	87,075.00	0.17
233	002430	杭氧股份	3,900	86,775.00	0.17
234	002429	兆驰股份	18,000	86,580.00	0.17
235	002939	长城证券	12,900	86,430.00	0.17
236	603290	斯达半导	1,000	86,110.00	0.17
237	300765	新诺威	3,400	85,782.00	0.17
238	603228	景旺电子	2,694	85,669.20	0.17
239	600325	华发股份	13,158	85,527.00	0.17
240	600816	建元信托	31,400	85,094.00	0.17
241	603156	养元饮品	4,000	85,080.00	0.17
242	601231	环旭电子	5,300	85,065.00	0.17
243	603486	科沃斯	1,800	84,924.00	0.17
244	600673	东阳光	12,018	84,606.72	0.17
245	603927	中科软	4,648	84,082.32	0.17
246	000893	亚钾国际	5,200	84,032.00	0.17
247	002508	老板电器	3,800	83,980.00	0.17
248	600563	法拉电子	1,100	83,798.00	0.17
249	000998	隆平高科	8,500	83,555.00	0.17
250	300487	蓝晓科技	2,000	83,520.00	0.17
251	603568	伟明环保	4,051	83,369.58	0.17
252	000027	深圳能源	11,420	83,366.00	0.17
253	002497	雅化集团	9,300	82,956.00	0.17
254	002653	海思科	2,700	82,890.00	0.17
255	300601	康泰生物	5,300	82,733.00	0.17
256	600754	锦江酒店	3,600	82,728.00	0.16
257	601636	旗滨集团	12,800	82,560.00	0.16
258	603298	杭叉集团	4,200	82,488.00	0.16
259	002926	华西证券	12,500	82,375.00	0.16
260	601866	中远海发	31,900	82,302.00	0.16
261	688052	纳芯微	800	82,224.00	0.16
262	002624	完美世界	10,800	82,080.00	0.16



263	300253	卫宁健康	13,900	82,010.00	0.16
264	002065	东华软件	18,100	81,812.00	0.16
265	688385	复旦微电	2,603	81,682.14	0.16
266	600737	中粮糖业	8,500	81,515.00	0.16
267	300604	长川科技	3,000	81,510.00	0.16
268	603077	和邦生物	49,240	81,246.00	0.16
269	601958	金钼股份	7,800	81,198.00	0.16
270	688002	睿创微纳	2,900	81,113.00	0.16
271	002056	横店东磁	6,500	81,055.00	0.16
272	600131	国网信通	4,800	80,976.00	0.16
273	002500	山西证券	17,160	80,652.00	0.16
274	688114	华大智造	1,700	80,597.00	0.16
275	002299	圣农发展	5,900	80,476.00	0.16
276	688772	珠海冠宇	5,400	80,460.00	0.16
277	600373	中文传媒	5,400	80,136.00	0.16
278	002414	高德红外	13,600	80,104.00	0.16
279	300390	天华新能	4,660	80,058.80	0.16
280	300009	安科生物	9,324	79,626.96	0.16
281	300763	锦浪科技	1,900	79,116.00	0.16
282	002368	太极股份	3,470	78,248.50	0.16
283	603885	吉祥航空	7,100	78,029.00	0.16
284	002372	伟星新材	5,060	78,025.20	0.16
285	601611	中国核建	9,600	77,664.00	0.15
286	600707	彩虹股份	11,400	77,634.00	0.15
287	002507	涪陵榨菜	6,330	77,542.50	0.15
288	603379	三美股份	1,980	77,497.20	0.15
289	002203	海亮股份	9,700	77,406.00	0.15
290	600655	豫园股份	15,000	77,250.00	0.15
291	000887	中鼎股份	6,300	77,112.00	0.15
292	603893	瑞芯微	1,300	76,921.00	0.15
293	600755	厦门国贸	10,668	76,489.56	0.15
294	002831	裕同科技	2,960	75,746.40	0.15
295	603225	新凤鸣	4,856	75,705.04	0.15
296	688521	芯原股份	2,800	74,900.00	0.15
297	600416	湘电股份	7,500	74,550.00	0.15
298	601880	辽港股份	60,590	74,525.70	0.15
299	600329	达仁堂	2,300	74,497.00	0.15
300	600859	王府井	6,340	74,431.60	0.15
301	600884	杉杉股份	9,100	73,892.00	0.15
302	600995	南网储能	7,600	73,416.00	0.15
303	600801	华新水泥	5,336	73,370.00	0.15
304	600435	北方导航	8,500	73,270.00	0.15
305	688390	固德威	1,305	73,236.60	0.15

306	002506	协鑫集成	37,700	73,138.00	0.15
307	002019	亿帆医药	5,900	72,924.00	0.15
308	300803	指南针	2,000	72,820.00	0.15
309	600390	五矿资本	17,900	72,495.00	0.14
310	300070	碧水源	17,300	72,487.00	0.14
311	002683	广东宏大	3,600	72,468.00	0.14
312	300296	利亚德	16,100	72,450.00	0.14
313	002244	滨江集团	9,900	71,874.00	0.14
314	000050	深天马 A	9,800	71,344.00	0.14
315	600598	北大荒	5,700	71,193.00	0.14
316	600739	辽宁成大	8,500	71,145.00	0.14
317	600483	福能股份	6,100	71,126.00	0.14
318	600399	抚顺特钢	12,600	70,938.00	0.14
319	601598	中国外运	12,600	70,938.00	0.14
320	002487	大金重工	3,100	70,928.00	0.14
321	601098	中南传媒	5,700	70,794.00	0.14
322	300748	金力永磁	5,460	70,761.60	0.14
323	002568	百润股份	4,200	70,686.00	0.14
324	002572	索菲亚	4,600	70,518.00	0.14
325	600901	江苏金租	13,920	70,296.00	0.14
326	300676	华大基因	2,000	70,020.00	0.14
327	000155	川能动力	6,500	70,005.00	0.14
328	600848	上海临港	7,600	69,236.00	0.14
329	001286	陕西能源	6,000	69,180.00	0.14
330	002373	千方科技	7,600	68,932.00	0.14
331	002240	盛新锂能	5,100	68,442.00	0.14
332	002080	中材科技	5,300	68,370.00	0.14
333	002936	郑州银行	39,420	68,196.60	0.14
334	000563	陕国投 A	24,666	67,831.50	0.14
335	002268	电科网安	4,740	67,450.20	0.13
336	300595	欧普康视	4,300	67,424.00	0.13
337	002557	洽洽食品	2,391	67,402.29	0.13
338	603712	七一二	3,700	67,303.00	0.13
339	000778	新兴铸管	19,300	67,164.00	0.13
340	601928	凤凰传媒	6,100	66,856.00	0.13
341	603858	步长制药	4,400	66,660.00	0.13
342	603883	老百姓	3,609	66,261.24	0.13
343	688538	和辉光电	33,456	66,242.88	0.13
344	600271	航天信息	9,000	66,240.00	0.13
345	688234	天岳先进	1,400	65,688.00	0.13
346	688017	绿的谐波	800	65,680.00	0.13
347	600062	华润双鹤	3,352	65,632.16	0.13
348	601212	白银有色	23,600	65,608.00	0.13

349	600258	首旅酒店	5,300	65,455.00	0.13
350	002531	天顺风能	7,300	65,262.00	0.13
351	603688	石英股份	2,200	65,142.00	0.13
352	300558	贝达药业	2,000	65,100.00	0.13
353	600968	海油发展	15,800	65,096.00	0.13
354	600977	中国电影	6,000	64,560.00	0.13
355	600528	中铁工业	8,800	64,416.00	0.13
356	600959	江苏有线	24,200	63,888.00	0.13
357	601155	新城控股	7,200	63,864.00	0.13
358	000709	河钢股份	32,900	63,826.00	0.13
359	000739	普洛药业	4,700	63,779.00	0.13
360	688220	翱捷科技	1,700	63,682.00	0.13
361	600378	昊华科技	2,200	63,580.00	0.13
362	002408	齐翔腾达	11,312	63,347.20	0.13
363	688005	容百科技	2,700	62,856.00	0.13
364	000825	太钢不锈	18,500	62,530.00	0.12
365	688536	思瑞浦	634	62,011.54	0.12
366	601118	海南橡胶	13,600	61,880.00	0.12
367	688301	奕瑞科技	536	61,763.28	0.12
368	600056	中国医药	6,100	61,732.00	0.12
369	603737	三棵树	1,680	60,933.60	0.12
370	000987	越秀资本	12,225	60,636.00	0.12
371	688331	荣昌生物	1,400	60,480.00	0.12
372	603882	金城医学	2,200	59,818.00	0.12
373	600517	国网英大	13,800	59,754.00	0.12
374	601399	国机重装	23,000	59,340.00	0.12
375	601019	山东出版	5,000	59,100.00	0.12
376	600906	财达证券	10,300	59,019.00	0.12
377	603456	九洲药业	4,300	58,996.00	0.12
378	300212	易华录	3,480	58,568.40	0.12
379	600612	老凤祥	1,000	58,190.00	0.12
380	600871	石化油服	33,000	57,420.00	0.11
381	603529	爱玛科技	2,100	57,393.00	0.11
382	002266	浙富控股	20,430	56,999.70	0.11
383	600316	洪都航空	3,400	56,542.00	0.11
384	000937	冀中能源	8,400	56,280.00	0.11
385	603650	彤程新材	1,900	56,145.00	0.11
386	688567	孚能科技	5,800	55,680.00	0.11
387	600925	苏能股份	11,000	55,550.00	0.11
388	688200	华峰测控	600	55,050.00	0.11
389	688063	派能科技	1,380	54,799.80	0.11
390	002423	中粮资本	7,300	54,677.00	0.11
391	001227	兰州银行	22,900	54,502.00	0.11

392	601298	青岛港	5,700	54,492.00	0.11
393	601965	中国汽研	3,200	54,048.00	0.11
394	000032	深桑达 A	3,600	53,928.00	0.11
395	600098	广州发展	8,400	53,760.00	0.11
396	600208	新湖中宝	33,900	53,562.00	0.11
397	603444	吉比特	300	53,403.00	0.11
398	002607	中公教育	34,700	53,091.00	0.11
399	600663	陆家嘴	6,000	52,920.00	0.11
400	688297	中无人机	1,600	52,848.00	0.11
401	601608	中信重工	13,800	52,578.00	0.10
402	002670	国盛金控	6,204	52,547.88	0.10
403	603728	鸣志电器	1,300	52,299.00	0.10
404	688561	奇安信	2,200	51,964.00	0.10
405	600578	京能电力	16,000	51,840.00	0.10
406	603233	大参林	3,612	51,651.60	0.10
407	300776	帝尔激光	1,120	51,475.20	0.10
408	300438	鹏辉能源	2,800	51,352.00	0.10
409	688032	禾迈股份	447	51,306.66	0.10
410	688516	奥特维	1,218	50,924.58	0.10
411	003031	中瓷电子	1,100	50,864.00	0.10
412	601106	中国一重	22,000	50,820.00	0.10
413	300357	我武生物	2,500	50,550.00	0.10
414	600377	宁沪高速	4,000	50,400.00	0.10
415	600500	中化国际	14,413	50,301.37	0.10
416	002865	钧达股份	1,300	49,894.00	0.10
417	600967	内蒙一机	6,900	49,680.00	0.10
418	688029	南微医学	800	49,248.00	0.10
419	000785	居然之家	20,200	49,086.00	0.10
420	688349	三一重能	1,970	48,934.80	0.10
421	600350	山东高速	5,500	48,675.00	0.10
422	600315	上海家化	2,700	48,006.00	0.10
423	600827	百联股份	6,500	47,970.00	0.10
424	000958	电投产融	13,000	47,580.00	0.09
425	688425	铁建重工	12,900	47,472.00	0.09
426	002608	江苏国信	6,100	47,275.00	0.09
427	000156	华数传媒	7,500	47,100.00	0.09
428	601568	北元集团	12,640	46,894.40	0.09
429	000537	中绿电	4,900	46,697.00	0.09
430	300888	稳健医疗	1,840	46,552.00	0.09
431	601992	金隅集团	33,800	46,306.00	0.09
432	603517	绝味食品	3,000	46,200.00	0.09
433	002690	美亚光电	2,790	46,035.00	0.09
434	603707	健友股份	3,860	45,856.80	0.09

435	002867	周大生	3,500	45,710.00	0.09
436	000559	万向钱潮	10,200	45,492.00	0.09
437	300682	朗新集团	5,300	45,103.00	0.09
438	600126	杭钢股份	10,890	44,757.90	0.09
439	603826	坤彩科技	1,540	44,613.80	0.09
440	688475	萤石网络	1,300	44,343.00	0.09
441	003022	联泓新科	3,200	43,872.00	0.09
442	688520	神州细胞	1,100	43,285.00	0.09
443	000967	盈峰环境	10,200	43,146.00	0.09
444	600339	中油工程	13,500	42,120.00	0.08
445	603218	日月股份	4,100	42,107.00	0.08
446	600481	双良节能	9,000	42,030.00	0.08
447	600361	创新新材	10,400	41,912.00	0.08
448	600032	浙江新能	5,700	41,496.00	0.08
449	688248	南网科技	1,400	41,482.00	0.08
450	301267	华夏眼科	2,000	41,440.00	0.08
451	600095	湘财股份	6,900	41,124.00	0.08
452	000898	鞍钢股份	19,200	40,704.00	0.08
453	603127	昭衍新药	3,064	40,659.28	0.08
454	688778	厦钨新能	1,300	40,612.00	0.08
455	003035	南网能源	9,100	40,040.00	0.08
456	600808	马钢股份	19,300	38,986.00	0.08
457	603786	科博达	600	38,490.00	0.08
458	002153	石基信息	6,608	37,863.84	0.08
459	002563	森马服饰	6,500	37,765.00	0.08
460	603185	弘元绿能	2,200	37,598.00	0.07
461	601228	广州港	12,100	36,905.00	0.07
462	000539	粤电力 A	7,200	36,576.00	0.07
463	001872	招商港口	1,900	36,575.00	0.07
464	688779	长远锂科	7,800	36,114.00	0.07
465	001203	大中矿业	3,700	35,557.00	0.07
466	600928	西安银行	10,800	35,316.00	0.07
467	688281	华秦科技	420	34,994.40	0.07
468	000401	冀东水泥	8,600	34,916.00	0.07
469	000959	首钢股份	12,600	34,272.00	0.07
470	688006	杭可科技	1,940	33,853.00	0.07
471	002518	科士达	1,900	33,630.00	0.07
472	600764	中国海防	1,700	33,371.00	0.07
473	603056	德邦股份	2,500	32,750.00	0.07
474	600299	安迪苏	3,300	32,010.00	0.06
475	603305	旭升集团	3,000	31,680.00	0.06
476	601139	深圳燃气	4,700	31,396.00	0.06
477	688172	燕东微	1,900	30,742.00	0.06

478	300861	美畅股份	1,500	29,025.00	0.06
479	603317	天味食品	2,540	28,981.40	0.06
480	688276	百克生物	1,000	28,370.00	0.06
481	688375	国博电子	400	28,256.00	0.06
482	688387	信科移动	5,400	27,216.00	0.05
483	301029	怡合达	1,360	26,737.60	0.05
484	688819	天能股份	1,100	26,246.00	0.05
485	688153	唯捷创芯	700	25,900.00	0.05
486	002791	坚朗五金	1,000	25,870.00	0.05
487	600927	永安期货	2,300	25,645.00	0.05
488	688107	安路科技	1,000	25,420.00	0.05
489	601858	中国科传	1,300	24,856.00	0.05
490	000031	大悦城	10,300	24,102.00	0.05
491	688348	昱能科技	400	23,600.00	0.05
492	601828	美凯龙	8,800	22,440.00	0.04
493	002945	华林证券	2,200	21,956.00	0.04
494	601158	重庆水务	4,400	21,120.00	0.04
495	600956	新天绿能	2,500	20,425.00	0.04
496	688295	中复神鹰	800	16,240.00	0.03
497	603868	飞科电器	400	15,360.00	0.03
498	301165	锐捷网络	500	14,920.00	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	400174	中天3	41,300	0.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688777	中控技术	209,270.00	0.39
2	601567	三星医疗	186,911.00	0.35
3	688617	惠泰医疗	176,212.00	0.33
4	002202	金风科技	167,020.00	0.31
5	601615	明阳智能	157,387.00	0.30
6	603979	金诚信	154,278.00	0.29
7	002436	兴森科技	152,104.00	0.29
8	301358	湖南裕能	143,079.00	0.27
9	300002	神州泰岳	141,123.00	0.27
10	000921	海信家电	140,548.00	0.26
11	300054	鼎龙股份	137,203.00	0.26

12	688188	柏楚电子	133,444.00	0.25
13	600872	中炬高新	130,476.00	0.25
14	603345	安井食品	129,446.00	0.24
15	002984	森麒麟	123,323.00	0.23
16	688525	佰维存储	117,701.50	0.22
17	603179	新泉股份	113,884.00	0.21
18	603087	甘李药业	111,664.00	0.21
19	000818	航锦科技	105,614.00	0.20
20	600763	通策医疗	105,524.00	0.20

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	411,630.00	0.78
2	002422	科伦药业	346,113.00	0.65
3	000975	山金国际	273,129.71	0.51
4	600160	巨化股份	253,087.00	0.48
5	300418	昆仑万维	240,332.00	0.45
6	600161	天坛生物	211,337.00	0.40
7	600415	小商品城	184,970.00	0.35
8	600482	中国动力	169,373.00	0.32
9	688072	拓荆科技	153,474.99	0.29
10	688188	柏楚电子	140,628.00	0.27
11	002600	领益智造	117,184.00	0.22
12	688728	格科微	83,266.00	0.16
13	002131	利欧股份	78,743.42	0.15
14	002032	苏泊尔	75,612.00	0.14
15	000581	威孚高科	73,481.00	0.14
16	000547	航天发展	68,380.00	0.13
17	002092	ST 中泰	65,119.00	0.12
18	300026	红日药业	64,841.00	0.12
19	000970	中科三环	63,238.95	0.12
20	601778	晶科科技	60,914.00	0.11

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	8,340,805.06
卖出股票收入（成交）总额	6,915,694.27

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	940.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,403.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,344.08

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
4,467	8,774.97	297,367.97	0.76	38,900,421.13	99.24

### 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	29,016.95	0.0740

### 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	38,152,996.78
本报告期基金总申购份额	4,428,547.37
减：本报告期基金总赎回份额	3,383,755.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	39,197,789.10

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

本报告期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

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人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 (%)	
高华证券	1	8,372,519.93	54.88	7,920.00	60.67	-
东方证券	2	6,883,979.40	45.12	5,134.75	39.33	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

(1) 财务状况良好，注册资本不少于 20 亿元人民币，最近一个完整年度在证券业协会披露的审计报告被出具无保留意见。

(2) 交易、研究等服务能力较强，最近一个完整年度年报披露的佣金席位占比在全市场前 1/2。

(3) 经营行为规范，合规风控能力较强，最近一年未因研究、交易业务违规而在中国证券监督管理委员会及其派出机构网站披露受到行政处罚。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
高华证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
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 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站	2024 年 3 月 28 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2024 年 4 月 18 日
4	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2024 年第 1 次	上海证券报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 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	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

2024 年 8 月 29 日