

农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	农银中证 A500 指数增强	
基金主代码	023475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 25 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	189,474,483.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	023475	023476
报告期末下属分级 基金的份额总额	155,138,355.55 份	34,336,128.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化及基本面选股方法进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金作为股票指数增强型基金，在标的指数成份股权重的基础上，通过数量化方法对基本面开展深入研究，对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。1、股票投资策略。2、债券投资策略。3、资产支持证券投资策略。4、参与融资及转融通证券出借业务策略。5、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期的风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金为股票指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	王小飞
	联系电话	021-61095588	021-60637103
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	021-61095599	021-60637228
传真	021-61095556	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄涛	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	3,438,884.79	503,660.79
本期利润	6,562,461.76	1,924,924.13
加权平均基金份额 本期利润	0.0173	0.0111
本期加权平均净 值利润率	1.73%	1.11%
本期基金份额净 值增长率	2.82%	2.70%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	2,823,838.50	584,907.60
期末可供分配基	0.0182	0.0170

金份额利润		
期末基金资产净值	159,507,064.65	35,262,575.61
期末基金份额净值	1.0282	1.0270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.82%	2.70%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银中证 A500 指数增强 A

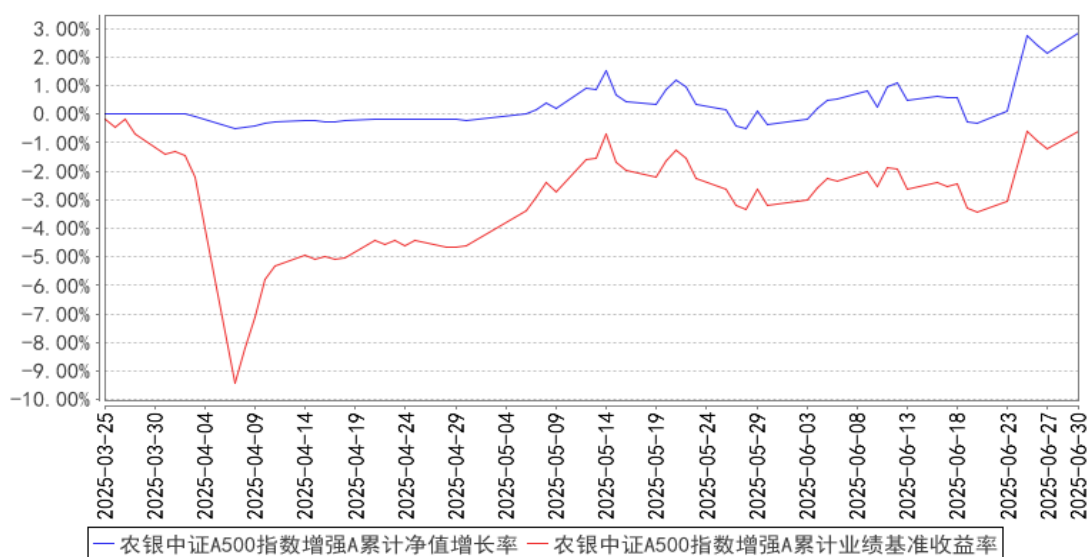
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.21%	0.56%	2.68%	0.57%	0.53%	-0.01%
过去三个月	2.83%	0.42%	0.83%	1.14%	2.00%	-0.72%
自基金合同生效起至今	2.82%	0.40%	-0.61%	1.10%	3.43%	-0.70%

农银中证 A500 指数增强 C

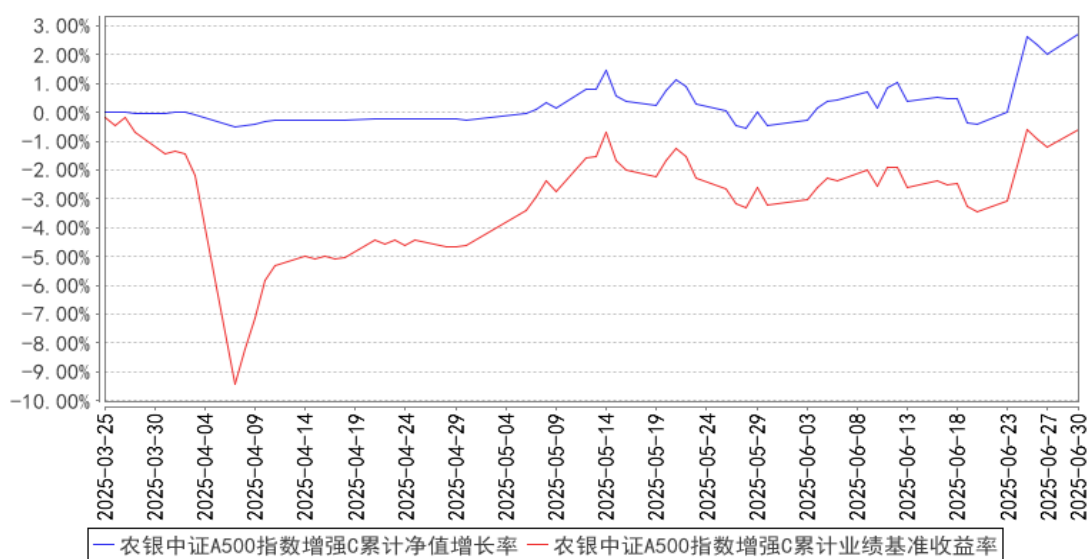
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.17%	0.56%	2.68%	0.57%	0.49%	-0.01%
过去三个月	2.72%	0.42%	0.83%	1.14%	1.89%	-0.72%
自基金合同生效起至今	2.70%	0.40%	-0.61%	1.10%	3.31%	-0.70%

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A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金建仓期为基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）起 6 个月，截至报告期末，建仓期未满。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 87 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银

汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 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、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债债券型证券投资基金、农银汇理红利甄选混合型证券投资基金、农银汇理中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、农银汇理创新驱动混合型证券投资基金、农银汇理上证 180 指数型证券投资基金、农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金、农银汇理上证科创板 50 成份指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱大千	本基金的基金经理	2025 年 3 月 25 日	-	14 年	上海交通大学数学系博士。2010 年加入农银汇理基金管理有限公司，历任风险控制部风控专员、研究部研究员、农银汇理资产管理有限公司资产及财富管理部投资经理、农银汇理基金管理有限公司投资理财部投资经理，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

上半年，从经济数据来看，一季度房地产市场在政策支持下延续修复，止跌回稳效果明显。但进入二季度后，市场边际减弱；消费方面，得益于以旧换新政策的推动前五月社会消费品零售总额累计同比增长 5%；出口方面，虽然在一季度两次被加征芬太尼关税，二季度又面临美国对全球实施的对等关税，但由于抢出口、抢转口等因素影响，前五月出口金额累计同比增长 6%。总的来说，出口超预期高增和两新政策推动了整体经济的温和复苏。但价格指数如 CPI、PPI 依然在低位徘徊，体现出整体需求依然较弱，且部分行业依然存在产能过剩的情况。

然而，经济复苏没有传导到权益市场风格。考虑到以旧换新的政策属于短期托底行为，对耐用消费品存在一定透支效果。出口方面，中美虽然达成一些妥协，但后续依然面临着较大的不确定

定性，加之价格指数依然低位徘徊，市场对于经济增长持续性缺乏信心。基本面强相关的顺周期板块未能走出 Beta 行情。另一方面，去年 924 以来，政策对于资本市场的支持力度空前。特别是创设了两项直接支持资本市场的工具。在今年四月初，当中美贸易战全面升级时，市场一度暴跌，维稳资金果断出手及时阻断了流动性风险的扩散，股市也迅速企稳回升。市场是有学习效应的，后续市场波动也被压缩到了一个历史极低的水平。市场风险偏好维持较高水平，各种主题行情轮番炒作，银行和小微盘均表现强势。

本产品 3 月成立后，在市场波动中逐步提升股票仓位。截止 6 月末，股票仓位在 9 成以上。后续我们计划继续保持较高的股票仓位。后续计划持续加强量化模型和因子的研究和挖掘，严格控制组合相对基准指数的各项风险暴露，包括行业、市值、样本股偏离度等。力争获得稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0282 元，自基金合同生效起至本报告期末基金份额净值增长率为 2.82%；截至本报告期末农银中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0270 元，自基金合同生效起至本报告期末基金份额净值增长率为 2.70%；同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在近期加速上行后，风险偏好进一步抬升。从估值来看，中证全指 PE 估值已经来到历史偏高水平，PB 估值仍在中位数附近。从股债比较角度来看，目前也已经来到中位数附近。从代表活跃资金的融资情况来看，融资余额时隔 10 年再度来到两万亿以上，但融资买入占比距离极值依然有较大空间。

鉴于当前监管对于权益市场的呵护态度，当前估值水平依然处于合理定价区间。而市场继续系统性上行则需要基本面改善来消化估值提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	1,746,115.79
结算备付金		9,254,753.40
存出保证金		69,434.30
交易性金融资产	6.4.7.2	194,550,027.89
其中：股票投资		181,054,614.30
基金投资		—
债券投资		13,495,413.59
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		19,266,722.81
应收股利		—
应收申购款		21,000.00
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		224,908,054.19
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负 债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		3,500,000.00
应付清算款		-
应付赎回款		26,301,834.75
应付管理人报酬		132,354.11
应付托管费		33,088.53
应付销售服务费		17,017.56
应付投资顾问费		-
应交税费		4.12
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	154,114.86
负债合计		30,138,413.93
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	189,474,483.79
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	5,295,156.47
净资产合计		194,769,640.26
负债和净资产总计		224,908,054.19

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 189,474,483.79 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0282 元，基金份额总额 155,138,355.55 份；下属 C 类基金份额净值 1.0270 元，基金份额总额 34,336,128.24 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,816,085.08
1. 利息收入		1,708,566.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	53,385.59
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		1,655,181.21
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,561,916.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	969,765.73
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	116,541.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	2,475,608.85
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	4,544,840.31
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	761.41
减：二、营业总支出		1,328,699.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	875,207.47
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	218,801.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	183,486.46
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		3,920.07
其中：卖出回购金融资产支出		3,920.07
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		59.58
8. 其他费用	6.4.7.23	47,223.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,487,385.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,487,385.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		8,487,385.89

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	911,553,749.31	-	-	911,553,749.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-722,079,265.52	-	5,295,156.47	-716,784,109.05
(一)、综合收益总额	-	-	8,487,385.89	8,487,385.89
(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)	-722,079,265.52	-	-3,192,229.42	-725,271,494.94
其中：1. 基金申购款	6,922,814.38	-	31,796.74	6,954,611.12
2. 基金赎回款	-729,002,079.90	-	-3,224,026.16	-732,226,106.06
(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	189,474,483.79	-	5,295,156.47	194,769,640.26

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 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，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[2025]259 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 911,553,749.31 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(25)第 00081 号验资报告。《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 3 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新适用的《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证 A500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股及其备选成份股(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为“中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二

层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润或累计亏损。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 由于本基金 C 类基金份额收取销售服务费，而 A 类基金份额不收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活

跃)等情况,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种使用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

2)对证券投资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,股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,746,115.79
等于：本金	1,745,991.35
加：应计利息	124.44
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	1,746,115.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		176,518,228.33	-	181,054,614.30	4,536,385.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,388,275.66	98,683.59	13,495,413.59	8,454.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,388,275.66	98,683.59	13,495,413.59	8,454.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		189,906,503.99	98,683.59	194,550,027.89	4,544,840.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	110,675.38
其中：交易所市场	110,675.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	43,439.48
合计	154,114.86

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	590,675,589.66	590,675,589.66
本期申购	580,029.27	580,029.27
本期赎回（以“-”号填列）	-436,117,263.38	-436,117,263.38
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	155,138,355.55	155,138,355.55
-----	----------------	----------------

农银中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	320,878,159.65	320,878,159.65
本期申购	6,342,785.11	6,342,785.11
本期赎回（以“-”号填列）	-292,884,816.52	-292,884,816.52
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	34,336,128.24	34,336,128.24

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

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

农银中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,438,884.79	3,123,576.97	6,562,461.76
本期基金份额交易产生的变动数	-615,046.29	-1,578,706.37	-2,193,752.66
其中：基金申购款	833.13	595.73	1,428.86
基金赎回款	-615,879.42	-1,579,302.10	-2,195,181.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,823,838.50	1,544,870.60	4,368,709.10

农银中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	503,660.79	1,421,263.34	1,924,924.13
本期基金份额交易产	81,246.81	-1,079,723.57	-998,476.76

生的变动数			
其中：基金申购款	11,419.19	18,948.69	30,367.88
基金赎回款	69,827.62	-1,098,672.26	-1,028,844.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	584,907.60	341,539.77	926,447.37

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,471.34
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	14,889.96
其他	24.29
合计	53,385.59

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	199,920,857.51
减：卖出股票成本总额	198,700,431.96
减：交易费用	250,659.82
买卖股票差价收入	969,765.73

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	109,207.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,334.76
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	116,541.98

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年3月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	58,381,092.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,576,307.24
减：应计利息总额	797,450.88
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	7,334.76

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,475,608.85
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	2,475,608.85

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,544,840.31
股票投资	4,536,385.97
债券投资	8,454.34
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	4,544,840.31

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	761.41
合计	761.41

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,162.78
信息披露费	31,276.70
证券出借违约金	-
银行费用	3,784.28
合计	47,223.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	875,207.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	431,858.53
应支付基金管理人的净管理费	443,348.94

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	218,801.85

注：支付基金托管人的基金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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C	合计
农业银行	-	67,278.44	67278.44

建设银行	-	115,585.92	115585.92
合计	-	182,864.36	182864.36

注：C 级基金份额支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{C 级基金日销售服务费} = \text{前一日 C 级基金基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行-活期存款	1,746,115.79	38,471.34

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2025 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用

评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	13,495,413.59
合计	13,495,413.59

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

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,746,115.79	-	-	-	1,746,115.79
结算备付金	9,254,753.40	-	-	-	9,254,753.40
存出保证金	69,434.30	-	-	-	69,434.30
交易性金融资产	13,495,413.59	-	-	181,054,614.30	194,550,027.89
应收申购款	-	-	-	21,000.00	21,000.00
应收清算款	-	-	-	19,266,722.81	19,266,722.81
资产总计	24,565,717.08	-	-	200,342,337.11	224,908,054.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,301,834.75	26,301,834.75
应付管理人报酬	-	-	-	132,354.11	132,354.11
应付托管费	-	-	-	33,088.53	33,088.53
卖出回购金融资产款	3,500,000.00	-	-	-	3,500,000.00
应付销售服务费	-	-	-	17,017.56	17,017.56
应交税费	-	-	-	4.12	4.12
其他负债	-	-	-	154,114.86	154,114.86
负债总计	3,500,000.00	-	-	26,638,413.93	30,138,413.93
利率敏感度缺口	21,065,717.08	-	-	-173,703,923.18	194,769,640.26

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。	
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。	
	其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025 年 6 月 30 日）
	市场利率上升 25 个基点	-14,645.06

	市场利率下降 25 个基点	14,645.06
--	---------------	-----------

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	181,054,614.30	92.96
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	181,054,614.30	92.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至本报告期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期末其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	181,054,614.30
第二层次	13,495,413.59
第三层次	—
合计	194,550,027.89

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、债券和基金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	181,054,614.30	80.50
	其中：股票	181,054,614.30	80.50
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,495,413.59	6.00
	其中：债券	13,495,413.59	6.00
	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	11,000,869.19	4.89
8	其他各项资产	19,357,157.11	8.61
9	合计	224,908,054.19	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	922,536.00	0.47
B	采矿业	9,467,807.00	4.86
C	制造业	91,875,565.90	47.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,575,666.00	2.35
E	建筑业	3,480,084.00	1.79
F	批发和零售业	2,005,739.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,097,009.00	2.62
H	住宿和餐饮业	316,512.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,674,991.60	5.48
J	金融业	25,640,140.00	13.16
K	房地产业	532,083.00	0.27
L	租赁和商务服务业	989,074.60	0.51
M	科学研究和技术服务业	1,695,866.00	0.87
N	水利、环境和公共	212,682.00	0.11

	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	219,648.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	295,386.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	158,000,790.10	81.12

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	802,035.00	0.41
C	制造业	18,814,555.20	9.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,202,764.00	0.62
E	建筑业	208,648.00	0.11
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	163,721.00	0.08
J	金融业	1,459,877.00	0.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	226,208.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	161,736.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,280.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,053,824.20	11.84

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	600519	贵州茅台	4,700	6,624,744.00	3.40
2	300750	宁德时代	22,900	5,775,838.00	2.97
3	601318	中国平安	80,100	4,443,948.00	2.28
4	000333	美的集团	59,100	4,267,020.00	2.19
5	600036	招商银行	92,100	4,231,995.00	2.17
6	000725	京东方 A	716,200	2,857,638.00	1.47
7	600900	长江电力	91,000	2,742,740.00	1.41
8	601166	兴业银行	113,200	2,642,088.00	1.36
9	601899	紫金矿业	129,900	2,533,050.00	1.30
10	601398	工商银行	322,700	2,449,293.00	1.26
11	000100	TCL 科技	523,500	2,266,755.00	1.16
12	600030	中信证券	72,600	2,005,212.00	1.03
13	002624	完美世界	122,600	1,859,842.00	0.95
14	000651	格力电器	39,600	1,778,832.00	0.91
15	600276	恒瑞医药	33,200	1,723,080.00	0.88
16	300059	东方财富	74,000	1,711,620.00	0.88
17	002594	比亚迪	5,100	1,692,741.00	0.87
18	000858	五 粮 液	14,100	1,676,490.00	0.86
19	000977	浪潮信息	32,500	1,653,600.00	0.85
20	601857	中国石油	182,800	1,562,940.00	0.80
21	601766	中国中车	204,700	1,441,088.00	0.74
22	603993	洛阳钼业	166,600	1,402,772.00	0.72
23	601328	交通银行	175,300	1,402,400.00	0.72
24	603019	中科曙光	19,800	1,393,920.00	0.72
25	600887	伊利股份	49,300	1,374,484.00	0.71
26	600919	江苏银行	114,400	1,365,936.00	0.70
27	603259	药明康德	19,500	1,356,225.00	0.70
28	600000	浦发银行	85,100	1,181,188.00	0.61
29	601988	中国银行	204,800	1,150,976.00	0.59
30	600031	三一重工	61,100	1,096,745.00	0.56
31	600482	中国动力	46,500	1,072,755.00	0.55
32	600352	浙江龙盛	103,200	1,048,512.00	0.54
33	300454	深信服	11,100	1,045,398.00	0.54
34	300124	汇川技术	16,100	1,039,577.00	0.53
35	300760	迈瑞医疗	4,500	1,011,375.00	0.52
36	600498	烽火通信	46,600	979,998.00	0.50
37	002371	北方华创	2,200	972,862.00	0.50
38	688256	寒武纪	1,600	962,400.00	0.49
39	600104	上汽集团	59,800	959,790.00	0.49

40	601816	京沪高铁	164,400	945,300.00	0.49
41	601728	中国电信	116,900	905,975.00	0.47
42	000001	平安银行	74,400	898,008.00	0.46
43	601668	中国建筑	154,700	892,619.00	0.46
44	002352	顺丰控股	17,900	872,804.00	0.45
45	002714	牧原股份	20,600	865,406.00	0.44
46	600418	江淮汽车	21,500	861,935.00	0.44
47	603799	华友钴业	22,700	840,354.00	0.43
48	601127	赛力斯	6,100	819,352.00	0.42
49	300207	欣旺达	40,800	818,448.00	0.42
50	601919	中远海控	53,600	806,144.00	0.41
51	603501	豪威集团	6,300	804,195.00	0.41
52	000063	中兴通讯	24,000	779,760.00	0.40
53	600941	中国移动	6,900	776,595.00	0.40
54	601601	中国太保	19,100	716,441.00	0.37
55	688008	澜起科技	8,500	697,000.00	0.36
56	600660	福耀玻璃	11,900	678,419.00	0.35
57	002230	科大讯飞	13,800	660,744.00	0.34
58	688235	百济神州	2,800	654,192.00	0.34
59	688981	中芯国际	7,400	652,458.00	0.33
60	688041	海光信息	4,600	649,934.00	0.33
61	600335	国机汽车	98,900	637,905.00	0.33
62	600050	中国联通	118,300	631,722.00	0.32
63	000338	潍柴动力	40,400	621,352.00	0.32
64	603986	兆易创新	4,900	619,997.00	0.32
65	600028	中国石化	105,600	595,584.00	0.31
66	002938	鹏鼎控股	18,500	592,555.00	0.30
67	601225	陕西煤业	30,600	588,744.00	0.30
68	601618	中国中冶	193,400	576,332.00	0.30
69	002027	分众传媒	75,200	548,960.00	0.28
70	600150	中国船舶	16,800	546,672.00	0.28
71	000878	云南铜业	40,800	518,976.00	0.27
72	601868	中国能建	232,400	518,252.00	0.27
73	601628	中国人寿	12,400	510,756.00	0.26
74	600760	中航沈飞	8,600	504,132.00	0.26
75	002415	海康威视	18,000	499,140.00	0.26
76	601088	中国神华	12,300	498,642.00	0.26
77	601006	大秦铁路	75,000	495,000.00	0.25
78	603288	海天味业	12,700	494,157.00	0.25
79	603087	甘李药业	9,000	493,020.00	0.25
80	002179	中航光电	12,100	488,356.00	0.25
81	000425	徐工机械	61,600	478,632.00	0.25
82	600704	物产中大	90,100	474,827.00	0.24

83	600426	华鲁恒升	21,500	465,905.00	0.24
84	300476	胜宏科技	3,400	456,892.00	0.23
85	601021	春秋航空	8,200	456,330.00	0.23
86	688012	中微公司	2,500	455,750.00	0.23
87	601658	邮储银行	82,600	451,822.00	0.23
88	600166	福田汽车	165,500	448,505.00	0.23
89	002625	光启技术	11,200	447,776.00	0.23
90	002241	歌尔股份	19,000	443,080.00	0.23
91	002050	三花智控	16,600	437,908.00	0.22
92	600019	宝钢股份	66,300	436,917.00	0.22
93	601600	中国铝业	62,000	436,480.00	0.22
94	600547	山东黄金	13,500	431,055.00	0.22
95	601985	中国核电	45,900	427,788.00	0.22
96	002463	沪电股份	10,000	425,800.00	0.22
97	600893	航发动力	11,000	423,940.00	0.22
98	300014	亿纬锂能	9,100	416,871.00	0.21
99	000938	紫光股份	17,100	410,229.00	0.21
100	000887	中鼎股份	22,800	401,052.00	0.21
101	601989	中国重工	85,100	394,864.00	0.20
102	002384	东山精密	10,200	385,254.00	0.20
103	600362	江西铜业	16,400	384,252.00	0.20
104	000768	中航西飞	14,000	382,760.00	0.20
105	600570	恒生电子	11,300	379,002.00	0.19
106	000538	云南白药	6,600	368,214.00	0.19
107	688111	金山办公	1,300	364,065.00	0.19
108	600584	长电科技	10,700	360,483.00	0.19
109	600111	北方稀土	14,200	353,580.00	0.18
110	000988	华工科技	7,500	352,575.00	0.18
111	600690	海尔智家	14,000	346,920.00	0.18
112	601012	隆基绿能	22,600	339,452.00	0.17
113	300408	三环集团	10,100	337,340.00	0.17
114	002028	思源电气	4,600	335,386.00	0.17
115	000400	许继电气	15,200	330,904.00	0.17
116	603833	欧派家居	5,800	327,410.00	0.17
117	002475	立讯精密	9,400	326,086.00	0.17
118	600938	中国海油	12,400	323,764.00	0.17
119	600988	赤峰黄金	13,000	323,440.00	0.17
120	600795	国电电力	66,500	321,860.00	0.17
121	600489	中金黄金	21,700	317,471.00	0.16
122	600258	首旅酒店	22,400	316,512.00	0.16
123	688271	联影医疗	2,400	306,576.00	0.16
124	000568	泸州老窖	2,700	306,180.00	0.16
125	600160	巨化股份	10,200	292,536.00	0.15

126	300308	中际旭创	2,000	291,720.00	0.15
127	601100	恒立液压	4,000	288,000.00	0.15
128	600170	上海建工	118,600	283,454.00	0.15
129	601727	上海电气	37,800	279,342.00	0.14
130	600183	生益科技	9,000	271,350.00	0.14
131	000157	中联重科	36,900	266,787.00	0.14
132	600989	宝丰能源	16,300	263,082.00	0.14
133	600886	国投电力	17,800	262,372.00	0.13
134	000408	藏格矿业	5,900	251,753.00	0.13
135	605499	东鹏饮料	800	251,240.00	0.13
136	000807	云铝股份	15,700	250,886.00	0.13
137	300274	阳光电源	3,700	250,749.00	0.13
138	002049	紫光国微	3,800	250,268.00	0.13
139	002517	恺英网络	12,900	249,099.00	0.13
140	600066	宇通客车	9,900	246,114.00	0.13
141	002001	新 和 成	11,500	244,605.00	0.13
142	000002	万 科 A	38,000	243,960.00	0.13
143	000792	盐湖股份	14,200	242,536.00	0.12
144	600029	南方航空	40,200	237,180.00	0.12
145	601800	中国交建	26,500	235,585.00	0.12
146	000975	山金国际	12,400	234,856.00	0.12
147	600011	华能国际	32,700	233,478.00	0.12
148	600346	恒力石化	16,200	231,012.00	0.12
149	600487	亨通光电	14,700	224,910.00	0.12
150	600089	特变电工	18,800	224,284.00	0.12
151	601111	中国国航	27,900	220,131.00	0.11
152	600436	片仔癀	1,100	220,011.00	0.11
153	300015	爱尔眼科	17,600	219,648.00	0.11
154	601168	西部矿业	13,200	219,516.00	0.11
155	002916	深南电路	2,030	218,854.30	0.11
156	300033	同花顺	800	218,408.00	0.11
157	600372	中航机载	18,100	218,286.00	0.11
158	600460	士兰微	8,700	215,934.00	0.11
159	601390	中国中铁	38,200	214,302.00	0.11
160	002202	金风科技	20,600	211,150.00	0.11
161	600096	云天化	9,600	210,912.00	0.11
162	000963	华东医药	5,200	209,872.00	0.11
163	601117	中国化学	27,200	208,624.00	0.11
164	000786	北新建材	7,800	206,544.00	0.11
165	600741	华域汽车	11,700	206,505.00	0.11
166	002273	水晶光电	10,300	205,691.00	0.11
167	600176	中国巨石	17,900	204,060.00	0.10
168	600588	用友网络	15,200	203,224.00	0.10

169	002156	通富微电	7,900	202,398.00	0.10
170	600406	国电南瑞	8,900	199,449.00	0.10
171	300395	菲利华	3,900	199,290.00	0.10
172	601360	三六零	19,500	198,900.00	0.10
173	600219	南山铝业	51,700	198,011.00	0.10
174	600885	宏发股份	8,800	196,328.00	0.10
175	688002	睿创微纳	2,800	195,216.00	0.10
176	300017	网宿科技	18,100	194,032.00	0.10
177	302132	中航成飞	2,200	193,468.00	0.10
178	600039	四川路桥	19,500	193,050.00	0.10
179	600585	海螺水泥	8,900	191,083.00	0.10
180	300394	天孚通信	2,380	190,019.20	0.10
181	600309	万华化学	3,500	189,910.00	0.10
182	300759	康龙化成	7,700	188,958.00	0.10
183	002493	荣盛石化	22,600	187,128.00	0.10
184	600085	同仁堂	5,100	183,906.00	0.09
185	002532	天山铝业	21,600	179,496.00	0.09
186	002558	巨人网络	7,600	178,980.00	0.09
187	600196	复星医药	7,100	178,139.00	0.09
188	000423	东阿阿胶	3,400	177,820.00	0.09
189	600674	川投能源	10,900	174,836.00	0.09
190	300223	北京君正	2,500	173,000.00	0.09
191	688617	惠泰医疗	580	172,260.00	0.09
192	600115	中国东航	42,600	171,678.00	0.09
193	300433	蓝思科技	7,600	169,480.00	0.09
194	002138	顺络电子	6,000	168,720.00	0.09
195	603596	伯特利	3,200	168,608.00	0.09
196	002078	太阳纸业	12,500	168,250.00	0.09
197	600438	通威股份	10,000	167,500.00	0.09
198	002472	双环传动	5,000	167,450.00	0.09
199	300251	光线传媒	8,200	166,214.00	0.09
200	000301	东方盛虹	19,700	164,101.00	0.08
201	600143	金发科技	15,800	162,898.00	0.08
202	000034	神州数码	4,300	161,852.00	0.08
203	600862	中航高科	6,200	161,696.00	0.08
204	300418	昆仑万维	4,800	161,424.00	0.08
205	002353	杰瑞股份	4,600	161,000.00	0.08
206	300054	鼎龙股份	5,600	160,608.00	0.08
207	603606	东方电缆	3,100	160,301.00	0.08
208	003816	中国广核	44,000	160,160.00	0.08
209	000999	华润三九	5,060	158,276.80	0.08
210	603659	璞泰来	8,400	157,752.00	0.08
211	688777	中控技术	3,500	157,185.00	0.08

212	601319	中国人保	17,900	155,909.00	0.08
213	300496	中科创达	2,700	154,494.00	0.08
214	600256	广汇能源	25,600	154,112.00	0.08
215	688169	石头科技	980	153,419.00	0.08
216	300450	先导智能	6,100	151,585.00	0.08
217	603129	春风动力	700	151,550.00	0.08
218	600010	包钢股份	84,500	151,255.00	0.08
219	002185	华天科技	14,900	150,490.00	0.08
220	002405	四维图新	17,600	150,304.00	0.08
221	601607	上海医药	8,300	148,404.00	0.08
222	300604	长川科技	3,300	148,203.00	0.08
223	000630	铜陵有色	44,100	147,294.00	0.08
224	688396	华润微	3,100	146,196.00	0.08
225	600009	上海机场	4,600	146,142.00	0.08
226	000733	振华科技	2,900	145,145.00	0.07
227	601216	君正集团	25,700	141,864.00	0.07
228	601186	中国铁建	17,100	136,971.00	0.07
229	001965	招商公路	11,400	136,800.00	0.07
230	000932	华菱钢铁	30,900	135,960.00	0.07
231	002709	天赐材料	7,500	135,900.00	0.07
232	600153	建发股份	13,100	135,847.00	0.07
233	000519	中兵红箭	6,200	135,718.00	0.07
234	002281	光迅科技	2,700	133,164.00	0.07
235	600839	四川长虹	13,700	133,164.00	0.07
236	002410	广联达	9,900	132,759.00	0.07
237	300001	特锐德	5,500	131,835.00	0.07
238	300073	当升科技	3,000	131,610.00	0.07
239	603979	金诚信	2,800	130,032.00	0.07
240	603392	万泰生物	2,100	128,100.00	0.07
241	002180	纳思达	5,500	126,170.00	0.06
242	601669	中国电建	25,100	122,237.00	0.06
243	300346	南大光电	3,840	121,497.60	0.06
244	601567	三星医疗	5,400	121,068.00	0.06
245	300136	信维通信	5,400	120,960.00	0.06
246	000623	吉林敖东	7,100	120,345.00	0.06
247	002065	东华软件	12,500	120,000.00	0.06
248	600018	上港集团	20,800	118,768.00	0.06
249	000625	长安汽车	9,200	117,392.00	0.06
250	002271	东方雨虹	10,900	116,957.00	0.06
251	601677	明泰铝业	9,400	116,748.00	0.06
252	002236	大华股份	7,300	115,924.00	0.06
253	600905	三峡能源	26,600	113,316.00	0.06
254	002648	卫星化学	6,500	112,645.00	0.06

255	603939	益丰药房	4,600	112,562.00	0.06
256	600637	东方明珠	15,000	112,050.00	0.06
257	300088	长信科技	18,600	110,856.00	0.06
258	601888	中国中免	1,800	109,746.00	0.06
259	600563	法拉电子	1,000	109,090.00	0.06
260	002294	信立泰	2,300	108,859.00	0.06
261	002407	多氟多	8,900	108,491.00	0.06
262	600188	兖矿能源	8,900	108,313.00	0.06
263	600415	小商品城	5,200	107,536.00	0.06
264	000039	中集集团	13,600	106,896.00	0.05
265	600332	白云山	4,000	105,440.00	0.05
266	600008	首创环保	34,800	105,096.00	0.05
267	002601	龙佰集团	6,400	103,744.00	0.05
268	600879	航天电子	9,900	103,653.00	0.05
269	002920	德赛西威	1,000	102,130.00	0.05
270	000831	中国稀土	2,800	101,136.00	0.05
271	688188	柏楚电子	760	100,061.60	0.05
272	601799	星宇股份	800	100,000.00	0.05
273	600998	九州通	19,400	99,716.00	0.05
274	603486	科沃斯	1,700	98,991.00	0.05
275	002414	高德红外	9,500	97,375.00	0.05
276	600177	雅戈尔	13,300	97,090.00	0.05
277	002432	九安医疗	2,600	94,718.00	0.05
278	601179	中国西电	15,300	93,942.00	0.05
279	600398	海澜之家	13,400	93,264.00	0.05
280	601877	正泰电器	4,100	92,947.00	0.05
281	002152	广电运通	6,900	92,736.00	0.05
282	688072	拓荆科技	600	92,226.00	0.05
283	002129	TCL 中环	12,000	92,160.00	0.05
284	300866	安克创新	800	90,880.00	0.05
285	002422	科伦药业	2,500	89,800.00	0.05
286	688122	西部超导	1,700	88,196.00	0.05
287	300459	汤姆猫	15,700	87,920.00	0.05
288	600323	瀚蓝环境	3,600	87,660.00	0.05
289	002603	以岭药业	6,200	87,420.00	0.04
290	300058	蓝色光标	13,260	86,985.60	0.04
291	300002	神州泰岳	7,300	86,140.00	0.04
292	688099	晶晨股份	1,200	85,212.00	0.04
293	300832	新产业	1,500	85,080.00	0.04
294	600233	圆通速递	6,600	85,074.00	0.04
295	688120	华海清科	500	84,350.00	0.04
296	002739	万达电影	7,300	83,439.00	0.04
297	002436	兴森科技	6,300	83,412.00	0.04

298	002245	蔚蓝锂芯	6,400	82,112.00	0.04
299	000547	航天发展	9,600	80,640.00	0.04
300	600004	白云机场	8,800	80,080.00	0.04
301	688036	传音控股	1,000	79,700.00	0.04
302	600131	国网信通	4,500	79,650.00	0.04
303	002223	鱼跃医疗	2,200	78,320.00	0.04
304	601615	明阳智能	6,800	78,132.00	0.04
305	601872	招商轮船	12,400	77,624.00	0.04
306	600549	厦门钨业	3,700	77,404.00	0.04
307	300383	光环新网	5,400	77,220.00	0.04
308	600895	张江高科	3,000	77,100.00	0.04
309	300339	润和软件	1,500	76,245.00	0.04
310	002008	大族激光	3,100	75,547.00	0.04
311	002085	万丰奥威	4,700	74,683.00	0.04
312	688009	中国通号	14,500	74,530.00	0.04
313	300573	兴齐眼药	1,420	73,541.80	0.04
314	600667	太极实业	11,100	73,038.00	0.04
315	300296	利亚德	11,900	72,590.00	0.04
316	300012	华测检测	6,200	72,478.00	0.04
317	002444	巨星科技	2,800	71,428.00	0.04
318	688180	君实生物	2,100	71,358.00	0.04
319	300003	乐普医疗	5,000	68,900.00	0.04
320	000617	中油资本	9,400	68,620.00	0.04
321	600392	盛和资源	5,200	68,484.00	0.04
322	601058	赛轮轮胎	5,200	68,224.00	0.04
323	300142	沃森生物	6,200	68,200.00	0.04
324	300628	亿联网络	1,950	67,782.00	0.03
325	601233	桐昆股份	6,300	66,780.00	0.03
326	300567	精测电子	1,100	66,671.00	0.03
327	600699	均胜电子	3,800	66,272.00	0.03
328	603885	吉祥航空	4,900	66,003.00	0.03
329	300568	星源材质	5,200	65,936.00	0.03
330	002074	国轩高科	2,000	64,920.00	0.03
331	688005	容百科技	2,900	64,728.00	0.03
332	600141	兴发集团	3,100	63,643.00	0.03
333	600521	华海药业	3,400	63,342.00	0.03
334	300627	华测导航	1,780	62,300.00	0.03
335	600655	豫园股份	11,200	62,160.00	0.03
336	600497	驰宏锌锗	11,700	61,893.00	0.03
337	601689	拓普集团	1,300	61,425.00	0.03
338	300315	掌趣科技	10,100	61,307.00	0.03
339	300661	圣邦股份	840	61,126.80	0.03
340	002340	格林美	9,600	60,960.00	0.03

341	002318	久立特材	2,600	60,814.00	0.03
342	300529	健帆生物	2,800	60,396.00	0.03
343	600316	洪都航空	1,600	60,320.00	0.03
344	002409	雅克科技	1,100	60,159.00	0.03
345	301236	软通动力	1,100	60,104.00	0.03
346	002266	浙富控股	19,500	60,060.00	0.03
347	002195	岩山科技	10,500	59,115.00	0.03
348	002091	江苏国泰	8,000	58,160.00	0.03
349	000960	锡业股份	3,800	58,140.00	0.03
350	603650	彤程新材	1,800	57,870.00	0.03
351	000998	隆平高科	5,800	57,130.00	0.03
352	300919	中伟股份	1,700	55,896.00	0.03
353	601018	宁波港	15,200	55,632.00	0.03
354	002841	视源股份	1,600	55,360.00	0.03
355	300285	国瓷材料	3,100	53,785.00	0.03
356	688047	龙芯中科	400	53,356.00	0.03
357	300347	泰格医药	1,000	53,320.00	0.03
358	000066	中国长城	3,600	53,280.00	0.03
359	300896	爱美客	300	52,443.00	0.03
360	300558	贝达药业	900	52,155.00	0.03
361	300763	锦浪科技	900	51,651.00	0.03
362	600535	天士力	3,300	51,645.00	0.03
363	601633	长城汽车	2,400	51,552.00	0.03
364	002497	雅化集团	4,500	51,300.00	0.03
365	300474	景嘉微	700	51,100.00	0.03
366	600516	方大炭素	11,000	51,040.00	0.03
367	300118	东方日升	5,300	50,774.00	0.03
368	000933	神火股份	2,900	48,256.00	0.02
369	601155	新城控股	3,500	47,880.00	0.02
370	000830	鲁西化工	4,600	47,380.00	0.02
371	601000	唐山港	11,500	46,690.00	0.02
372	600038	中直股份	1,200	46,572.00	0.02
373	603816	顾家家居	1,800	45,936.00	0.02
374	600867	通化东宝	5,600	45,920.00	0.02
375	000708	中信特钢	3,900	45,864.00	0.02
376	300182	捷成股份	8,300	45,733.00	0.02
377	002821	凯莱英	500	44,125.00	0.02
378	002128	电投能源	2,200	43,516.00	0.02
379	002439	启明星辰	2,700	43,173.00	0.02
380	603000	人民网	2,100	42,441.00	0.02
381	000069	华侨城 A	18,800	42,300.00	0.02
382	600325	华发股份	8,600	41,882.00	0.02
383	603605	珀莱雅	500	41,395.00	0.02

384	300024	机器人	2,400	41,232.00	0.02
385	600859	王府井	2,900	40,281.00	0.02
386	605117	德业股份	740	38,968.40	0.02
387	002459	晶澳科技	3,900	38,922.00	0.02
388	002120	韵达股份	5,800	38,860.00	0.02
389	300070	碧水源	8,500	38,250.00	0.02
390	000009	中国宝安	4,000	35,520.00	0.02
391	300037	新宙邦	1,000	35,200.00	0.02
392	300457	赢合科技	1,500	34,500.00	0.02
393	002007	华兰生物	2,200	34,474.00	0.02
394	000967	盈峰环境	4,900	34,055.00	0.02
395	002292	奥飞娱乐	3,500	34,020.00	0.02
396	600803	新奥股份	1,800	34,020.00	0.02
397	603260	合盛硅业	700	33,180.00	0.02
398	002831	裕同科技	1,400	32,788.00	0.02
399	002812	恩捷股份	1,100	32,219.00	0.02
400	600129	太极集团	1,500	31,965.00	0.02
401	001979	招商蛇口	3,600	31,572.00	0.02
402	688063	派能科技	700	31,556.00	0.02
403	601636	旗滨集团	6,200	31,062.00	0.02
404	001914	招商积余	2,500	30,925.00	0.02
405	688599	天合光能	2,100	30,513.00	0.02
406	688390	固德威	700	30,415.00	0.02
407	600486	扬农化工	500	29,000.00	0.01
408	600529	山东药玻	1,300	28,782.00	0.01
409	600315	上海家化	1,300	27,391.00	0.01
410	603806	福斯特	2,100	27,216.00	0.01
411	300724	捷佳伟创	500	27,150.00	0.01
412	300068	南都电源	1,700	27,064.00	0.01
413	603568	伟明环保	1,400	26,712.00	0.01
414	002025	航天电器	500	25,705.00	0.01
415	600820	隧道股份	4,200	25,620.00	0.01
416	002312	川发龙蟒	2,200	25,256.00	0.01
417	300676	华大基因	500	24,885.00	0.01
418	600499	科达制造	2,300	22,540.00	0.01
419	000818	航锦科技	1,000	22,500.00	0.01
420	601880	辽港股份	14,500	21,750.00	0.01
421	603077	和邦生物	12,000	21,000.00	0.01
422	002372	伟星新材	2,000	20,720.00	0.01
423	603899	晨光股份	700	20,293.00	0.01
424	300438	鹏辉能源	700	19,327.00	0.01
425	601866	中远海发	7,700	19,019.00	0.01
426	002544	普天科技	800	18,760.00	0.01

427	600007	中国国贸	800	16,464.00	0.01
-----	--------	------	-----	-----------	------

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	600268	国电南自	209,400	1,637,508.00	0.84
2	603236	移远通信	13,900	1,192,620.00	0.61
3	600623	华谊集团	137,600	1,041,632.00	0.53
4	603296	华勤技术	11,400	919,752.00	0.47
5	300596	利安隆	30,800	886,116.00	0.45
6	601311	骆驼股份	95,000	857,850.00	0.44
7	000050	深天马 A	99,900	851,148.00	0.44
8	603766	隆鑫通用	64,700	825,572.00	0.42
9	000898	鞍钢股份	349,500	810,840.00	0.42
10	600866	星湖科技	116,400	804,324.00	0.41
11	600871	石化油服	411,300	802,035.00	0.41
12	000959	首钢股份	225,900	768,060.00	0.39
13	001288	运机集团	33,540	698,638.20	0.36
14	600926	杭州银行	39,400	662,708.00	0.34
15	300803	指南针	8,100	653,346.00	0.34
16	300752	隆利科技	27,500	618,200.00	0.32
17	603393	新天然气	20,700	599,265.00	0.31
18	601126	四方股份	28,600	465,322.00	0.24
19	603113	金能科技	63,700	441,441.00	0.23
20	600267	海正药业	46,500	430,125.00	0.22
21	300206	理邦仪器	35,500	426,710.00	0.22
22	000553	安道麦 A	59,100	426,702.00	0.22
23	300702	天宇股份	18,200	423,332.00	0.22
24	600578	京能电力	94,200	422,958.00	0.22
25	600262	北方股份	18,400	419,520.00	0.22
26	600380	健康元	36,800	405,904.00	0.21
27	603712	七一二	18,800	394,988.00	0.20
28	688290	景业智能	7,000	364,840.00	0.19
29	001323	慕思股份	11,800	355,888.00	0.18
30	688387	信科移动	55,500	313,575.00	0.16
31	603722	阿科力	5,500	255,420.00	0.13
32	688788	科思科技	5,200	237,484.00	0.12
33	002160	常铝股份	53,400	230,688.00	0.12
34	688337	普源精电	5,600	199,752.00	0.10
35	600057	厦门象屿	27,100	190,513.00	0.10
36	002140	东华科技	19,100	175,720.00	0.09
37	600027	华电国际	25,300	138,391.00	0.07
38	688722	同益中	6,300	134,001.00	0.07
39	300304	云意电气	18,100	131,768.00	0.07

40	603811	诚意药业	14,100	130,143.00	0.07
41	601688	华泰证券	6,800	121,108.00	0.06
42	000761	本钢板材	32,000	115,200.00	0.06
43	002096	易普力	8,900	110,449.00	0.06
44	603199	九华旅游	3,000	108,720.00	0.06
45	688385	复旦微电	2,100	103,467.00	0.05
46	688128	中国电研	3,700	90,650.00	0.05
47	300999	金龙鱼	2,200	64,966.00	0.03
48	300212	易华录	2,900	63,104.00	0.03
49	002368	太极股份	2,500	58,550.00	0.03
50	603588	高能环境	9,400	53,016.00	0.03
51	688667	菱电电控	800	42,568.00	0.02
52	600167	联美控股	7,500	42,150.00	0.02
53	002268	电科网安	2,300	42,067.00	0.02
54	002541	鸿路钢构	2,400	40,176.00	0.02
55	600755	厦门国贸	5,900	35,695.00	0.02
56	603688	石英股份	1,000	35,220.00	0.02
57	002081	金螳螂	9,600	32,928.00	0.02
58	603456	九洲药业	2,100	31,941.00	0.02
59	600873	梅花生物	2,700	28,863.00	0.01
60	002151	北斗星通	800	22,952.00	0.01
61	600816	建元信托	7,700	22,715.00	0.01
62	002240	盛新锂能	1,400	18,032.00	0.01
63	603882	金域医学	500	14,280.00	0.01
64	601003	柳钢股份	2,900	10,208.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,675,949.51	5.99
2	300750	宁德时代	8,642,464.00	4.44
3	601318	中国平安	7,187,688.00	3.69
4	000333	美的集团	6,978,821.00	3.58
5	600036	招商银行	6,471,326.00	3.32
6	000651	格力电器	5,249,050.00	2.70
7	002594	比亚迪	5,204,409.00	2.67
8	000725	京东方 A	4,814,772.00	2.47
9	600900	长江电力	4,408,702.00	2.26
10	601166	兴业银行	4,027,649.00	2.07
11	000100	TCL 科技	3,867,689.00	1.99
12	601899	紫金矿业	3,833,819.00	1.97
13	601398	工商银行	3,679,042.00	1.89

14	600031	三一重工	3,539,972.00	1.82
15	300059	东方财富	3,469,031.00	1.78
16	600030	中信证券	3,096,302.00	1.59
17	688256	寒武纪	3,085,775.88	1.58
18	600276	恒瑞医药	3,046,642.00	1.56
19	000977	浪潮信息	2,988,435.05	1.53
20	000858	五粮液	2,902,550.85	1.49

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,189,753.00	2.15
2	000651	格力电器	3,416,610.00	1.75
3	002594	比亚迪	3,412,047.00	1.75
4	300750	宁德时代	3,391,307.40	1.74
5	601318	中国平安	3,360,551.00	1.73
6	600036	招商银行	2,888,614.00	1.48
7	000333	美的集团	2,600,837.00	1.34
8	688036	传音控股	2,549,091.17	1.31
9	600031	三一重工	2,205,932.00	1.13
10	000932	华菱钢铁	2,066,869.00	1.06
11	000725	京东方 A	2,009,808.00	1.03
12	300059	东方财富	1,952,320.00	1.00
13	600170	上海建工	1,879,377.00	0.96
14	600900	长江电力	1,846,866.00	0.95
15	601166	兴业银行	1,812,772.00	0.93
16	603818	曲美家居	1,678,240.00	0.86
17	000100	TCL 科技	1,669,493.00	0.86
18	600143	金发科技	1,667,232.00	0.86
19	688256	寒武纪	1,663,294.48	0.85
20	300487	蓝晓科技	1,663,218.00	0.85

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	375,218,660.29
卖出股票收入（成交）总额	199,920,857.51

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,495,413.59	6.93
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	13,495,413.59	6.93

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	50,000	5,063,528.77	2.60
2	019766	25 国债 01	45,000	4,519,833.29	2.32
3	019773	25 国债 08	39,000	3,912,051.53	2.01

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	69,434.30
2	应收清算款	19,266,722.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,357,157.11

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

本基金本报告期末不存在前十名股票中有流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)

农银中证 A500 指数增强 A	1,763	87,996.80	3,879,752.53	2.50	151,258,603.02	97.50
农银中证 A500 指数增强 C	706	48,634.74	300,075.00	0.87	34,036,053.24	99.13
合计	2,469	76,741.39	4,179,827.53	2.21	185,294,656.26	97.79

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	农银中证 A500 指数增强 A	-	-
	农银中证 A500 指数增强 C	17,000.04	0.0495
	合计	17,000.04	0.0090

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	农银中证 A500 指数增强 A	0
	农银中证 A500 指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	农银中证 A500 指数增强 A	0
	农银中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 3 月 25 日） 基金份额总额	590,675,589.66	320,878,159.65
基金合同生效日起至	580,029.27	6,342,785.11

报告期期末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	436,117,263.38	292,884,816.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	155,138,355.55	34,336,128.24

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，基金管理人未发生重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
浙商证券	2	308,032,894.04	53.56	60,960.01	53.56	—
中信证券	2	78,975,787.39	13.73	15,629.26	13.73	—
东方证券	2	60,135,050.52	10.46	11,902.05	10.46	—
国金证券	2	41,166,176.46	7.16	8,147.61	7.16	—
兴业证券	2	29,749,417.65	5.17	5,887.60	5.17	—
申万宏源证券	3	24,057,956.00	4.18	4,761.34	4.18	—
华创证券	2	17,002,322.28	2.96	3,364.89	2.96	—
长江证券	2	15,895,213.46	2.76	3,145.04	2.76	—
华泰证券	2	124,700.00	0.02	24.67	0.02	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通证券	2	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—

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、本基金本报告期新增以上交易单元，无剔除交易单元。

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(%)
浙商证券	21,090,781.00	21.20	5,074,900,000.00	45.11	-	-
中信证券	5,284,484.90	5.31	1,568,500,000.00	13.94	-	-
东方证券	999,940.00	1.01	1,510,000,000.00	13.42	-	-
国金证券	47,691,888.00	47.95	963,000,000.00	8.56	-	-
兴业证券	-	-	374,500,000.00	3.33	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	22,395,331.00	22.52	1,123,300,000.00	9.98	-	-
长江证券	2,000,800.00	2.01	636,200,000.00	5.65	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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 A500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 20 日

2	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金-基金合同	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 20 日
3	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金-招募说明书	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 20 日
4	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金份额发售公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 20 日
5	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金-托管协议	中国证监会规定的媒介	2025 年 2 月 20 日
6	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 3 月 26 日
7	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证监会规定的媒介	2025 年 4 月 25 日
8	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金-招募说明书更新-2025 年第 1 次	中国证监会规定的媒介	2025 年 6 月 27 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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日