

# 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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的情况.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	农银沪深 300 指数	
基金主代码	660008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 4 月 12 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	304,984,921.23 份	
下属分级基金的基金简称:	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码:	660008	005152
报告期末下属分级基金的份额总额	304,356,873.90 份	628,047.33 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在 4% 以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，以实现对沪深 300 指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将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。基金管理人将根据中证指数公司提供的成分股及权重数据进行相应的买入或卖出操作，使跟踪组合的构成基本与标的指数一致。	
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数+5%×同期银行活期存款利率。	
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品，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。	
	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	农银汇理基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东
	联系电话	021-61095588
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com
客户服务电话	021-61095599	95588
传真	021-61095556	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	许金超	陈四清

## 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	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
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

基金级别	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	55,365,910.68	91,587.15
本期利润	9,822,228.04	-19,749.30
加权平均基金份额本期利润	0.0312	-0.0358
本期加权平均净值利润率	1.69%	-1.97%
本期基金份额净值增长率	0.97%	0.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	256,877,000.38	517,084.38
期末可供分配基金份额利润	0.8440	0.8233
期末基金资产净值	561,233,874.28	1,145,131.71
期末基金份额净值	1.8440	1.8233
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	84.40%	63.92%

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

农银沪深 300 指数 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	-1.28%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.63%	0.00%
过去三个月	4.09%	0.93%	3.32%	0.93%	0.77%	0.00%
过去六个月	0.97%	1.25%	0.29%	1.25%	0.68%	0.00%
过去一年	27.16%	1.26%	24.19%	1.27%	2.97%	-0.01%
过去三年	55.70%	1.29%	46.39%	1.30%	9.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	84.40%	1.37%	55.34%	1.36%	29.06%	0.01%

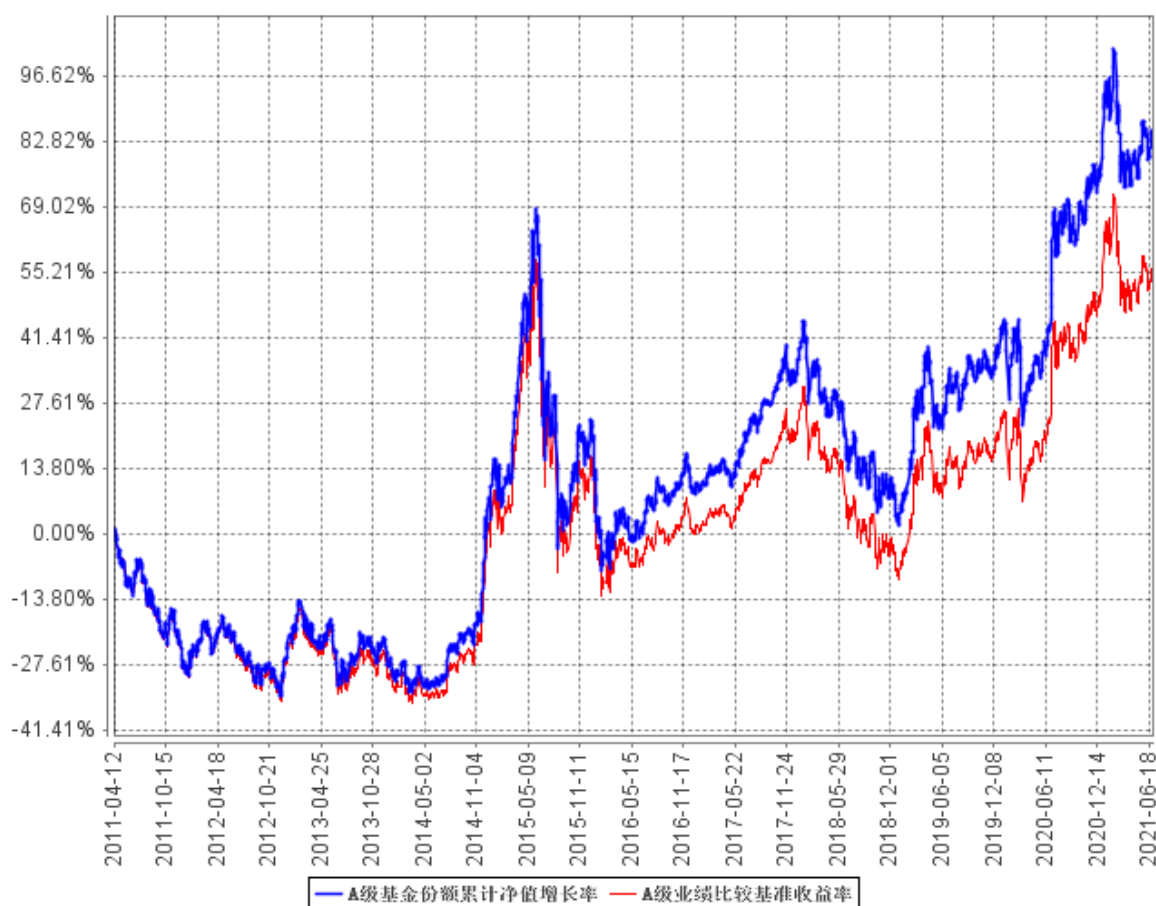


农银沪深 300 指数 C

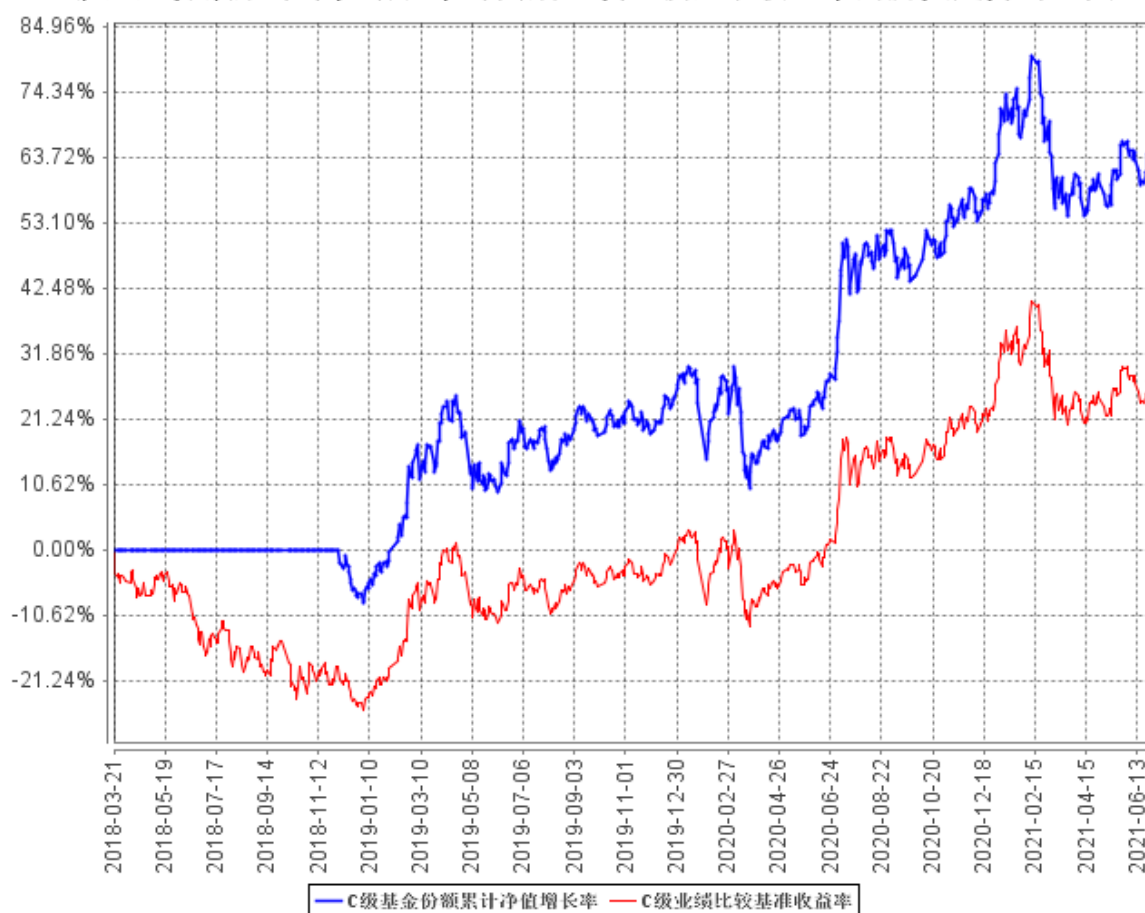
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.32%	0.76%	-1.91%	0.76%	0.59%	0.00%
过去三个月	3.99%	0.93%	3.32%	0.93%	0.67%	0.00%
过去六个月	0.77%	1.25%	0.29%	1.25%	0.48%	0.00%
过去一年	26.65%	1.26%	24.19%	1.27%	2.46%	-0.01%
过去三年	63.92%	1.16%	46.39%	1.30%	17.53%	-0.14%
自基金合同生效起至今	63.92%	1.11%	27.03%	1.28%	36.89%	-0.17%

### 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

A级基金份额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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—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 4 月 12 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。公司法定代表人为许金超先生。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 62 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、农银汇理金利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、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、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、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、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、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金及农银汇理金盛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	本基金基金经理	2012 年 8 月 3 日	-	13	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《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 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，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0241%，日均偏离度为 0.0168%，符合基金合同约定规定的日均偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制不超过 4%。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) 指数中成份股票的调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.8440 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.97%；截至本报告期末农银沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.8233 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.77%；同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

### 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沪深 300 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 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同的要求，报告期本基金不需分配利润。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	31,687,636.64	35,313,905.00
结算备付金		18,086.05	9,815.96
存出保证金		31,408.09	43,468.03
交易性金融资产	6.4.7.2	533,857,168.71	624,822,309.17
其中：股票投资		533,857,168.71	624,822,309.17
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		737,970.44	9,345,598.07
应收利息	6.4.7.5	2,645.59	3,484.84
应收股利		-	-
应收申购款		129,280.07	112,753.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		566,464,195.59	669,651,334.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,467,648.94	10,138,125.97
应付管理人报酬		277,059.28	331,262.89
应付托管费		69,264.82	82,815.73
应付销售服务费		335.13	448.74
应付交易费用	6.4.7.7	120,036.55	140,732.36
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,844.88	271,581.83
负债合计		4,085,189.60	10,964,967.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	304,984,921.23	360,689,323.44
未分配利润	6.4.7.10	257,394,084.76	297,997,043.75
所有者权益合计		562,379,005.99	658,686,367.19
负债和所有者权益总计		566,464,195.59	669,651,334.71

注：本基金为分级基金，报告截止日 2021 年 6 月 30 日，农银沪深 300 指数 A 基金份额净值 1.8440 元，基金份额总额 304,356,873.90 份；农银沪深 300 指数 C 基金份额净值 1.8233 元，基金份额总额 628,047.33 份。农银沪深 300 指数份额总额合计为 304,984,921.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		12,599,459.23	19,333,892.88
1.利息收入		58,708.52	163,040.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,708.52	118,638.44
债券利息收入		-	44,401.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,054,284.16	38,412,338.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	53,977,802.28	31,714,825.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,076,481.88	6,697,513.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-45,655,019.09	-19,509,461.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	141,485.64	267,974.96
<b>减：二、费用</b>		2,796,980.49	3,547,690.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,734,574.72	2,166,577.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	433,643.71	541,644.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,990.59	1,915.24
4. 交易费用	6.4.7.19	420,084.36	621,728.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	206,687.11	215,825.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		9,802,478.74	15,786,202.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		9,802,478.74	15,786,202.01

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	360,689,323.44	297,997,043.75	658,686,367.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,802,478.74	9,802,478.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-55,704,402.21	-50,405,437.73	-106,109,839.94
其中：1.基金申购款	57,350,444.29	49,004,757.29	106,355,201.58
2.基金赎回款	-113,054,846.50	-99,410,195.02	-212,465,041.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减	-	-	-

少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	304,984,921.23	257,394,084.76	562,379,005.99
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	598,468,798.04	249,194,217.81	847,663,015.85
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	15,786,202.01	15,786,202.01
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数 (净值减少以“-”号 填列)	-116,041,807.66	-47,844,475.56	-163,886,283.22
其中：1.基金申购款	124,837,249.27	43,971,421.02	168,808,670.29
2.基金赎回款	-240,879,056.93	-91,815,896.58	-332,694,953.51
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	482,426,990.38	217,135,944.26	699,562,934.64

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：

                  许金超  毕宏燕  丁煜琼                    
 基金管理人负责人                  主管会计工作负责人                  会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

农银汇理沪深 300 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[2011]第 125 号《关于核准农银汇理沪深 300 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《农银汇理沪深 300 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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,296,561,559.84 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 123 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,297,550,055.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 988,495.60 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据 2018 年 3 月 20 日发布的《关于农银沪深 300 基金增设 C 类份额并修改基金合同、托管协议的公告》,从 2018 年 3 月 21 日起,本基金增设 C 级基金份额(以下简称“农银沪深 300 指数 C”),农银沪深 300 指数 C 是指缴纳销售服务费而不缴纳申购费与赎回费的本基金基金份额,缴纳申购费与赎回费的基金份额归为本基金 A 级基金份额(以下简称“农银沪深 300 指数 A”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 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,包括标的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:股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,其中投资于标的指数成份股的比例不低于股票投资的 80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深 300 指数+5%×同期银行活期存款利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值

变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	31,687,636.64
定期存款	-
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	-
合计：	31,687,636.64

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	365,556,525.80	533,857,168.71	168,300,642.91
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		365,556,525.80	533,857,168.71	168,300,642.91

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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因买断式逆回购交易而取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,625.61
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7.29
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.69
合计	2,645.59

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	120,036.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	120,036.55

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,625.33
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
应付指数使用费	50,000.00
合计	150,844.88

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	359,918,783.43	359,918,783.43
本期申购	56,965,841.87	56,965,841.87
本期赎回(以“-”号填列)	-112,527,751.40	-112,527,751.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	304,356,873.90	304,356,873.90

金额单位：人民币元

农银沪深 300 指数 C	
项目	本期



	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	770,540.01	770,540.01
本期申购	384,602.42	384,602.42
本期赎回(以“-”号填列)	-527,095.10	-527,095.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	628,047.33	628,047.33

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	245,012,201.90	52,361,230.62	297,373,432.52
本期利润	55,365,910.68	-45,543,682.64	9,822,228.04
本期基金份额交易产生的变动数	-40,879,407.16	-9,439,253.02	-50,318,660.18
其中：基金申购款	44,448,503.73	4,215,345.98	48,663,849.71
基金赎回款	-85,327,910.89	-13,654,599.00	-98,982,509.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	259,498,705.42	-2,621,705.04	256,877,000.38

单位：人民币元

农银沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	513,071.77	110,539.46	623,611.23
本期利润	91,587.15	-111,336.45	-19,749.30
本期基金份额交易产生的变动数	-81,867.41	-4,910.14	-86,777.55
其中：基金申购款	299,221.33	41,686.25	340,907.58
基金赎回款	-381,088.74	-46,596.39	-427,685.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	522,791.51	-5,707.13	517,084.38

注：本基金于 2011 年 4 月 12 日成立，自 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	57,740.26
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	678.27
其他	289.99
合计	58,708.52

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	171,103,293.33
减：卖出股票成本总额	117,125,491.05
买卖股票差价收入	53,977,802.28

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期末无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,076,481.88
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	4,076,481.88

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-45,655,019.09
——股票投资	-45,655,019.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——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	-45,655,019.09

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	135,194.76
转换费收入 660008	6,290.88
合计	141,485.64

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

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	420,084.36
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	420,084.36

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	3,467.56
合计	206,687.11

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 0.03% 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

本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,734,574.72	2,166,577.15
其中：支付销售机构的客户维护费	694,952.98	868,413.19

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	433,643.71	541,644.35

注：支付基金托管人工商银行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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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应支付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

本基金本报告期间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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
工商银行	31,687,636.64	57,740.26	36,316,850.34	117,247.33

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	科创板锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	科创板锁定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-



			日							
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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	停牌	停	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
------	----	----	---	----	----	----	-------	----	-------	----

码	名称	日期	牌原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	额	
002024	苏宁易购	2021年6月16日	公告重大事件	5.59	2021年7月6日	6.15	100,554	1,159,191.51	562,096.86	-

### 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

本报告期末及上年度末本基金未持有短期信用评级债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 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。

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 2021年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,687,636.64	-	-	-	31,687,636.64
结算备付金	18,086.05	-	-	-	18,086.05
存出保证金	31,408.09	-	-	-	31,408.09
交易性金融资产	-	-	-	533,857,168.71	533,857,168.71
应收证券清算款	-	-	-	737,970.44	737,970.44
应收利息	-	-	-	2,645.59	2,645.59
应收申购款	-	-	-	129,280.07	129,280.07
资产总计	31,737,130.78	-	-	534,727,064.81	566,464,195.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,467,648.94	3,467,648.94
应付管理人报酬	-	-	-	277,059.28	277,059.28
应付托管费	-	-	-	69,264.82	69,264.82
应付销售服务费	-	-	-	335.13	335.13
应付交易费用	-	-	-	120,036.55	120,036.55
其他负债	-	-	-	150,844.88	150,844.88
负债总计	-	-	-	4,085,189.60	4,085,189.60
利率敏感度缺口	31,737,130.78	-	-	530,641,875.21	562,379,005.99

上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,313,905.00	-	-	-	35,313,905.00
结算备付金	9,815.96	-	-	-	9,815.96
存出保证金	43,468.03	-	-	-	43,468.03
交易性金融 资产	-	-	-	624,822,309.17	624,822,309.17
应收证券清 算款	-	-	-	9,345,598.07	9,345,598.07
应收利息	-	-	-	3,484.84	3,484.84
应收申购款	-	-	-	112,753.64	112,753.64
资产总计	35,367,188.99	-	-	634,284,145.72	669,651,334.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,138,125.97	10,138,125.97
应付管理人 报酬	-	-	-	331,262.89	331,262.89
应付托管费	-	-	-	82,815.73	82,815.73
应付销售服 务费	-	-	-	448.74	448.74
应付交易费 用	-	-	-	140,732.36	140,732.36
其他负债	-	-	-	271,581.83	271,581.83
负债总计	-	-	-	10,964,967.52	10,964,967.52
利率敏感度 缺口	35,367,188.99	-	-	-623,319,178.20	658,686,367.19

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-	-
	市场利率平行下降 25 个基点	-	-

#### 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 2021年6月30日		上年度末 2020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	533,857,168.71	94.93	624,822,309.17	94.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	533,857,168.71	94.93	624,822,309.17	94.86

##### 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	27,929,482.45	32,797,072.00
业绩比较基准下降 5%	-27,929,482.45	-32,797,072.00	

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。

## § 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	533,857,168.71	94.24
	其中：股票	533,857,168.71	94.24
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	31,705,722.69	5.60
8	其他各项资产	901,304.19	0.16
9	合计	566,464,195.59	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,596,204.20	1.00
B	采矿业	11,505,287.76	2.05
C	制造业	294,551,285.31	52.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,406,903.34	1.67
E	建筑业	6,458,524.45	1.15
F	批发和零售业	3,875,498.51	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	15,317,595.16	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,509,240.67	3.11
J	金融业	126,270,385.61	22.45
K	房地产业	10,731,434.48	1.91
L	租赁和商务服务业	9,719,470.03	1.73

M	科学研究和技术服务业	7,623,182.96	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	963,029.00	0.17
Q	卫生和社会工作	11,343,852.82	2.02
R	文化、体育和娱乐业	2,225,874.20	0.40
S	综合	-	-
	合计	533,097,768.50	94.79

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	631,171.07	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	49,173.00	0.01
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	20,300.21	0.00
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	759,400.21	0.14

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	15,646	32,179,128.20	5.72
2	601318	中国平安	270,138	17,364,470.64	3.09
3	600036	招商银行	308,673	16,726,989.87	2.97
4	000858	五粮液	48,442	14,430,387.38	2.57
5	601012	隆基股份	107,969	9,591,965.96	1.71
6	000333	美的集团	122,982	8,777,225.34	1.56
7	600276	恒瑞医药	111,726	7,594,016.22	1.35
8	002415	海康威视	116,550	7,517,475.00	1.34
9	601166	兴业银行	364,059	7,481,412.45	1.33
10	601888	中国中免	24,352	7,308,035.20	1.30
11	603259	药明康德	44,744	7,006,462.96	1.25
12	300059	东方财富	206,187	6,760,871.73	1.20
13	000651	格力电器	120,006	6,252,312.60	1.11
14	600900	长江电力	283,675	5,855,052.00	1.04
15	002594	比亚迪	22,658	5,687,158.00	1.01
16	601328	交通银行	1,151,910	5,644,359.00	1.00
17	002475	立讯精密	121,940	5,609,240.00	1.00
18	600887	伊利股份	151,644	5,585,048.52	0.99
19	000001	平安银行	241,915	5,472,117.30	0.97
20	600030	中信证券	212,465	5,298,877.10	0.94
21	000725	京东方 A	844,496	5,269,655.04	0.94
22	300015	爱尔眼科	67,421	4,785,542.58	0.85
23	000568	泸州老窖	18,320	4,322,420.80	0.77
24	600031	三一重工	148,069	4,304,365.83	0.77
25	600309	万华化学	39,125	4,257,582.50	0.76
26	603501	韦尔股份	13,000	4,186,000.00	0.74
27	603288	海天味业	31,444	4,054,703.80	0.72
28	000002	万科 A	169,831	4,043,676.11	0.72
29	002714	牧原股份	65,640	3,992,224.80	0.71
30	601988	中国银行	1,266,505	3,900,835.40	0.69
31	600809	山西汾酒	8,700	3,897,600.00	0.69
32	300122	智飞生物	20,000	3,734,600.00	0.66
33	601919	中远海控	120,700	3,686,178.00	0.66

34	002142	宁波银行	89,900	3,503,403.00	0.62
35	601899	紫金矿业	352,062	3,411,480.78	0.61
36	601939	建设银行	511,407	3,400,856.55	0.60
37	600436	片仔癀	7,500	3,362,250.00	0.60
38	002812	恩捷股份	13,300	3,113,530.00	0.55
39	002304	洋河股份	15,023	3,112,765.60	0.55
40	002352	顺丰控股	45,400	3,073,580.00	0.55
41	002230	科大讯飞	44,365	2,998,186.70	0.53
42	300274	阳光电源	25,500	2,934,030.00	0.52
43	300014	亿纬锂能	28,200	2,930,826.00	0.52
44	600000	浦发银行	292,745	2,927,450.00	0.52
45	600438	通威股份	67,400	2,916,398.00	0.52
46	300124	汇川技术	38,606	2,866,881.56	0.51
47	600837	海通证券	240,766	2,768,809.00	0.49
48	000661	长春高新	7,100	2,747,700.00	0.49
49	000100	TCL 科技	349,877	2,676,559.05	0.48
50	601816	京沪高铁	489,900	2,591,571.00	0.46
51	600016	民生银行	581,964	2,566,461.24	0.46
52	000063	中兴通讯	77,017	2,559,274.91	0.46
53	002241	歌尔股份	59,620	2,548,158.80	0.45
54	300347	泰格医药	13,100	2,532,230.00	0.45
55	002460	赣锋锂业	20,700	2,506,563.00	0.45
56	603986	兆易创新	13,324	2,503,579.60	0.45
57	603799	华友钴业	21,906	2,501,665.20	0.44
58	601601	中国太保	85,341	2,472,328.77	0.44
59	600585	海螺水泥	59,891	2,458,525.55	0.44
60	600690	海尔智家	94,400	2,445,904.00	0.43
61	002271	东方雨虹	44,000	2,434,080.00	0.43
62	601668	中国建筑	523,069	2,432,270.85	0.43
63	002027	分众传媒	256,263	2,411,434.83	0.43
64	300142	沃森生物	39,000	2,406,300.00	0.43
65	600763	通策医疗	5,600	2,301,600.00	0.41
66	600196	复星医药	30,042	2,166,929.46	0.39
67	600048	保利地产	179,177	2,157,291.08	0.38
68	600703	三安光电	67,014	2,147,798.70	0.38
69	000338	潍柴动力	118,476	2,117,166.12	0.38
70	600919	江苏银行	294,650	2,092,015.00	0.37
71	002129	中环股份	52,900	2,041,940.00	0.36
72	601688	华泰证券	128,807	2,035,150.60	0.36

73	601229	上海银行	247,996	2,033,567.20	0.36
74	600050	中国联通	464,050	2,004,696.00	0.36
75	600660	福耀玻璃	34,935	1,951,119.75	0.35
76	600570	恒生电子	20,919	1,950,696.75	0.35
77	601211	国泰君安	112,500	1,928,250.00	0.34
78	600104	上汽集团	87,347	1,919,013.59	0.34
79	601766	中国中车	303,384	1,844,574.72	0.33
80	688111	金山办公	4,600	1,816,080.00	0.32
81	601169	北京银行	370,133	1,802,547.71	0.32
82	600999	招商证券	92,494	1,759,235.88	0.31
83	002371	北方华创	6,200	1,719,756.00	0.31
84	600019	宝钢股份	222,809	1,702,260.76	0.30
85	002311	海大集团	20,800	1,697,280.00	0.30
86	002049	紫光国微	10,600	1,634,414.00	0.29
87	002410	广联达	23,700	1,616,340.00	0.29
88	601088	中国神华	82,391	1,608,272.32	0.29
89	600406	国电南瑞	69,196	1,608,115.04	0.29
90	300498	温氏股份	111,620	1,603,979.40	0.29
91	601818	光大银行	413,667	1,563,661.26	0.28
92	300601	康泰生物	10,300	1,534,700.00	0.27
93	600745	闻泰科技	15,600	1,511,640.00	0.27
94	000625	长安汽车	56,609	1,487,684.52	0.26
95	000538	云南白药	12,791	1,480,174.52	0.26
96	600028	中国石化	333,711	1,454,979.96	0.26
97	600893	航发动力	26,522	1,410,705.18	0.25
98	601628	中国人寿	41,619	1,410,467.91	0.25
99	300450	先导智能	23,400	1,407,276.00	0.25
100	600346	恒力石化	52,761	1,384,448.64	0.25
101	601658	邮储银行	272,100	1,365,942.00	0.24
102	600588	用友网络	40,909	1,360,633.34	0.24
103	002821	凯莱英	3,600	1,341,360.00	0.24
104	601390	中国中铁	254,623	1,334,224.52	0.24
105	601633	长城汽车	30,504	1,329,669.36	0.24
106	300595	欧普康视	12,800	1,325,440.00	0.24
107	601009	南京银行	125,134	1,316,409.68	0.23
108	002493	荣盛石化	76,000	1,312,520.00	0.23
109	601377	兴业证券	133,915	1,293,618.90	0.23
110	601857	中国石油	242,908	1,284,983.32	0.23
111	688036	传音控股	6,000	1,257,000.00	0.22

112	300413	芒果超媒	17,750	1,217,650.00	0.22
113	600111	北方稀土	58,355	1,207,948.50	0.21
114	600132	重庆啤酒	6,000	1,187,700.00	0.21
115	601225	陕西煤业	100,100	1,186,185.00	0.21
116	600584	长电科技	31,000	1,168,080.00	0.21
117	002601	龙麟佰利	33,600	1,161,888.00	0.21
118	600009	上海机场	24,122	1,160,991.86	0.21
119	300408	三环集团	27,200	1,153,824.00	0.21
120	600426	华鲁恒升	37,000	1,145,150.00	0.20
121	000776	广发证券	74,124	1,122,237.36	0.20
122	601100	恒立液压	13,012	1,117,991.04	0.20
123	688012	中微公司	6,700	1,111,664.00	0.20
124	002001	新和成	38,520	1,104,753.60	0.20
125	603882	金域医学	6,900	1,102,413.00	0.20
126	000895	双汇发展	34,481	1,096,495.80	0.19
127	600926	杭州银行	74,300	1,095,925.00	0.19
128	300433	蓝思科技	37,148	1,092,522.68	0.19
129	002179	中航光电	13,700	1,082,574.00	0.19
130	002050	三花智控	44,722	1,072,433.56	0.19
131	000166	申万宏源	225,739	1,056,458.52	0.19
132	600958	东方证券	104,600	1,044,954.00	0.19
133	600741	华域汽车	39,412	1,035,353.24	0.18
134	002841	视源股份	8,300	1,031,607.00	0.18
135	600600	青岛啤酒	8,900	1,029,285.00	0.18
136	300003	乐普医疗	31,401	1,008,600.12	0.18
137	000963	华东医药	21,839	1,004,812.39	0.18
138	002007	华兰生物	27,206	997,916.08	0.18
139	000786	北新建材	25,400	996,950.00	0.18
140	603993	洛阳钼业	191,600	988,656.00	0.18
141	000157	中联重科	106,254	981,786.96	0.17
142	601006	大秦铁路	148,854	979,459.32	0.17
143	603806	福斯特	9,200	967,196.00	0.17
144	601901	方正证券	103,039	964,445.04	0.17
145	002607	中公教育	46,100	963,029.00	0.17
146	601336	新华保险	20,888	958,968.08	0.17
147	600015	华夏银行	154,042	953,519.98	0.17
148	002236	大华股份	45,000	949,500.00	0.17
149	601989	中国重工	228,656	942,062.72	0.17
150	600143	金发科技	45,100	940,786.00	0.17

151	601155	新城控股	22,600	940,160.00	0.17
152	600176	中国巨石	60,194	933,608.94	0.17
153	601138	工业富联	74,700	927,027.00	0.16
154	000768	中航西飞	34,639	910,312.92	0.16
155	601877	正泰电器	26,900	897,922.00	0.16
156	600352	浙江龙盛	65,188	895,683.12	0.16
157	600760	中航沈飞	14,700	886,410.00	0.16
158	600010	宝钢股份	571,343	885,581.65	0.16
159	688169	石头科技	700	882,700.00	0.16
160	601788	光大证券	48,900	874,821.00	0.16
161	300529	健帆生物	10,100	872,236.00	0.16
162	001979	招商蛇口	79,455	870,032.25	0.15
163	600547	山东黄金	45,251	869,724.22	0.15
164	002008	大族激光	21,449	866,325.11	0.15
165	601186	中国铁建	115,254	856,337.22	0.15
166	603369	今世缘	15,700	850,312.00	0.15
167	002202	金风科技	68,824	836,899.84	0.15
168	601916	浙商银行	209,500	831,715.00	0.15
169	000876	新希望	56,480	828,561.60	0.15
170	002555	三七互娱	33,300	799,866.00	0.14
171	003816	中国广核	295,800	789,786.00	0.14
172	603899	晨光文具	9,300	786,408.00	0.14
173	000938	紫光股份	35,861	784,638.68	0.14
174	002736	国信证券	72,200	776,150.00	0.14
175	601799	星宇股份	3,400	767,448.00	0.14
176	600109	国金证券	60,310	765,333.90	0.14
177	601066	中信建投	24,300	763,749.00	0.14
178	000069	华侨城 A	102,150	759,996.00	0.14
179	600989	宝丰能源	55,200	755,136.00	0.13
180	300136	信维通信	24,306	750,569.28	0.13
181	000425	徐工机械	117,824	750,538.88	0.13
182	600150	中国船舶	44,800	739,648.00	0.13
183	603160	汇顶科技	5,700	738,891.00	0.13
184	601669	中国电建	190,462	737,087.94	0.13
185	002384	东山精密	34,300	714,812.00	0.13
186	000977	浪潮信息	25,400	714,502.00	0.13
187	600795	国电电力	293,518	713,248.74	0.13
188	000783	长江证券	97,060	710,479.20	0.13
189	603659	璞泰来	5,200	710,320.00	0.13

190	688008	澜起科技	11,312	705,642.56	0.13
191	603019	中科曙光	25,520	704,607.20	0.13
192	601238	广汽集团	54,200	701,890.00	0.12
193	600085	同仁堂	17,085	697,922.25	0.12
194	600079	人福医药	24,600	695,442.00	0.12
195	000596	古井贡酒	2,900	694,550.00	0.12
196	002624	完美世界	28,950	692,194.50	0.12
197	601838	成都银行	54,000	682,560.00	0.12
198	300677	英科医疗	5,400	673,920.00	0.12
199	300558	贝达药业	6,200	671,088.00	0.12
200	600886	国投电力	69,460	667,510.60	0.12
201	600183	生益科技	28,500	667,185.00	0.12
202	600029	南方航空	110,764	666,799.28	0.12
203	601985	中国核电	130,400	659,824.00	0.12
204	000703	恒逸石化	55,060	657,967.00	0.12
205	600362	江西铜业	29,375	657,412.50	0.12
206	601108	财通证券	62,600	656,674.00	0.12
207	300144	宋城演艺	39,054	656,107.20	0.12
208	601360	三六零	53,400	652,014.00	0.12
209	603517	绝味食品	7,700	649,033.00	0.12
210	002414	高德红外	23,440	646,475.20	0.11
211	002600	领益智造	70,300	646,057.00	0.11
212	601555	东吴证券	77,390	645,432.60	0.11
213	603833	欧派家居	4,531	643,220.76	0.11
214	000066	中国长城	43,700	638,020.00	0.11
215	002252	上海莱士	83,838	627,946.62	0.11
216	002044	美年健康	68,284	622,067.24	0.11
217	002938	鹏鼎控股	17,300	620,724.00	0.11
218	300676	华大基因	5,200	616,720.00	0.11
219	600522	中天科技	61,100	611,000.00	0.11
220	300033	同花顺	5,400	609,012.00	0.11
221	000728	国元证券	76,154	606,947.38	0.11
222	601607	上海医药	28,724	606,938.12	0.11
223	688396	华润微	6,600	600,732.00	0.11
224	002602	世纪华通	92,798	595,763.16	0.11
225	600332	白云山	17,500	592,375.00	0.11
226	600161	天坛生物	17,100	585,675.00	0.10
227	600872	中炬高新	13,900	584,078.00	0.10
228	601077	渝农商行	146,000	582,540.00	0.10

229	601111	中国国航	74,481	579,462.18	0.10
230	600383	金地集团	56,246	575,959.04	0.10
231	300628	亿联网络	6,800	569,840.00	0.10
232	601800	中国交建	87,744	568,581.12	0.10
233	600845	宝信软件	11,170	568,553.00	0.10
234	600115	中国东航	111,578	566,816.24	0.10
235	002024	苏宁易购	100,554	562,096.86	0.10
236	002508	老板电器	11,800	548,700.00	0.10
237	000860	顺鑫农业	13,000	548,340.00	0.10
238	600061	国投资本	64,044	543,733.56	0.10
239	002916	深南电路	4,880	542,314.40	0.10
240	601727	上海电气	127,400	540,176.00	0.10
241	601618	中国中冶	177,860	530,022.80	0.09
242	000708	中信特钢	25,200	525,168.00	0.09
243	601162	天风证券	107,940	524,588.40	0.09
244	601021	春秋航空	9,200	523,480.00	0.09
245	600705	中航资本	133,200	515,484.00	0.09
246	601878	浙商证券	38,600	504,888.00	0.09
247	603939	益丰药房	8,970	503,127.30	0.09
248	688363	华熙生物	1,800	500,148.00	0.09
249	600606	绿地控股	90,900	495,405.00	0.09
250	600489	中金黄金	56,668	488,478.16	0.09
251	601990	南京证券	45,900	482,868.00	0.09
252	002456	欧菲光	53,665	476,545.20	0.08
253	002157	正邦科技	39,200	468,440.00	0.08
254	002463	沪电股份	30,000	464,100.00	0.08
255	600011	华能国际	109,500	462,090.00	0.08
256	000656	金科股份	79,700	461,463.00	0.08
257	600521	华海药业	21,800	455,184.00	0.08
258	600655	豫园股份	38,700	448,533.00	0.08
259	601933	永辉超市	94,808	448,441.84	0.08
260	600118	中国卫星	14,723	430,794.98	0.08
261	601696	中银证券	20,800	428,272.00	0.08
262	601216	君正集团	83,996	427,539.64	0.08
263	600848	上海临港	23,880	427,452.00	0.08
264	603392	万泰生物	1,620	419,871.60	0.07
265	600018	上港集团	86,500	412,605.00	0.07
266	601995	中金公司	6,600	405,900.00	0.07
267	603195	公牛集团	2,000	404,000.00	0.07

268	002558	巨人网络	30,220	401,926.00	0.07
269	002120	韵达股份	28,836	390,151.08	0.07
270	601998	中信银行	76,324	389,252.40	0.07
271	601872	招商轮船	80,560	372,187.20	0.07
272	002673	西部证券	44,528	367,356.00	0.07
273	601319	中国人保	61,900	367,067.00	0.07
274	688009	中国通号	64,500	367,005.00	0.07
275	688126	沪硅产业	12,400	361,832.00	0.06
276	603338	浙江鼎力	6,100	358,009.00	0.06
277	002739	万达电影	22,300	352,117.00	0.06
278	601881	中国银河	32,100	346,038.00	0.06
279	603658	安图生物	4,410	334,145.70	0.06
280	600233	圆通速递	31,400	314,314.00	0.06
281	603233	大参林	5,900	301,549.00	0.05
282	600482	中国动力	16,200	282,204.00	0.05
283	601231	环旭电子	16,500	277,365.00	0.05
284	002153	石基信息	11,318	266,086.18	0.05
285	002032	苏泊尔	4,100	261,539.00	0.05
286	600025	华能水电	44,800	259,392.00	0.05
287	002939	长城证券	23,200	258,216.00	0.05
288	000800	一汽解放	23,200	251,024.00	0.04
289	601236	红塔证券	18,100	245,436.00	0.04
290	002773	康弘药业	9,220	213,258.60	0.04
291	601808	中海油服	14,800	212,528.00	0.04
292	600918	中泰证券	19,100	206,662.00	0.04
293	601698	中国卫通	11,000	178,090.00	0.03
294	603087	甘李药业	1,500	159,870.00	0.03
295	600299	安迪苏	10,000	119,600.00	0.02
296	002945	华林证券	6,700	92,594.00	0.02

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.05
2	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
3	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
4	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01



5	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
6	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
7	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
8	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
9	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
10	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
11	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
12	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
13	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
14	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
15	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
16	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
17	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
18	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
19	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002714	牧原股份	5,947,216.38	0.90
2	600519	贵州茅台	5,396,450.00	0.82
3	300274	阳光电源	2,371,926.00	0.36
4	601816	京沪高铁	2,272,834.00	0.35
5	688111	金山办公	1,844,300.95	0.28
6	002157	正邦科技	1,761,644.00	0.27
7	000876	新希望	1,696,779.00	0.26
8	002311	海大集团	1,585,283.00	0.24
9	300450	先导智能	1,565,926.00	0.24
10	300498	温氏股份	1,486,792.00	0.23
11	300595	欧普康视	1,307,754.80	0.20
12	600426	华鲁恒升	1,234,283.70	0.19
13	002415	海康威视	1,145,188.04	0.17
14	600132	重庆啤酒	1,037,215.00	0.16
15	688169	石头科技	1,017,934.00	0.15

16	600050	中国联通	980,010.00	0.15
17	601658	邮储银行	978,704.00	0.15
18	603882	金域医学	978,080.00	0.15
19	600900	长江电力	909,100.00	0.14
20	600143	金发科技	903,189.00	0.14

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	002714	牧原股份	6,870,794.60	1.04
2	601318	中国平安	6,485,403.29	0.98
3	600519	贵州茅台	5,978,920.00	0.91
4	600036	招商银行	4,894,732.00	0.74
5	000858	五粮液	4,666,929.14	0.71
6	000333	美的集团	3,402,812.18	0.52
7	600276	恒瑞医药	2,874,046.60	0.44
8	601166	兴业银行	2,374,621.00	0.36
9	601888	中国中免	2,305,213.00	0.35
10	000651	格力电器	2,199,515.00	0.33
11	002311	海大集团	2,121,604.00	0.32
12	600887	伊利股份	2,053,817.00	0.31
13	601328	交通银行	2,047,389.00	0.31
14	300059	东方财富	1,867,970.00	0.28
15	300498	温氏股份	1,784,894.00	0.27
16	600030	中信证券	1,775,985.00	0.27
17	000876	新希望	1,700,095.00	0.26
18	000001	平安银行	1,691,936.00	0.26
19	002157	正邦科技	1,639,271.00	0.25
20	600031	三一重工	1,598,560.00	0.24

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	71,815,369.68
卖出股票收入（成交）总额	171,103,293.33

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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

2020 年 9 月 4 日，兴业银行股份有限公司因 1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易

信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

其余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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	31,408.09
2	应收证券清算款	737,970.44
3	应收股利	-
4	应收利息	2,645.59
5	应收申购款	129,280.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	901,304.19

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688690	纳微科技	277,777.53	0.05	科创板锁定
2	688117	圣诺生物	60,141.84	0.01	科创板锁定
3	688239	航宇科技	56,550.48	0.01	新股流通受限
4	301017	漱玉平民	49,173.00	0.01	新股流通受限

## § 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
农银沪深 300 指数 A	42,681	7,130.97	4,127,619.42	1.36%	300,229,254.48	98.64%
农银沪深 300 指数 C	38	16,527.56	0.00	0.00%	628,047.33	100.00%
合计	42,719	7,139.33	4,127,619.42	1.35%	300,857,301.81	98.65%

注：1、本基金于 2011 年 4 月 12 日成立，自 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	农银沪深 300 指数 A	5,983.54	0.0020%
	农银沪深 300 指数 C	0.00	0.0000%
	合计	5,983.54	0.0020%

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的情况

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	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2011 年 4 月 12 日）基金份额总额	3,297,550,055.44	-
本报告期期初基金份额总额	359,918,783.43	770,540.01
本报告期基金总申购份额	56,965,841.87	384,602.42
减：本报告期基金总赎回份额	112,527,751.40	527,095.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	304,356,873.90	628,047.33

注：1、本基金于 2011 年 4 月 12 日成立，自 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。

2、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”）董事会有关决议，原本公司副总经理 Céline Zhang（张晴）女士自 2021 年 4 月 29 日离任本公司副总经理职务；毕宏燕女士自 2021 年 6 月 17 日任职本公司副总经理职位。本公司已分别于 2021 年 4 月 30 日、2021 年 6 月 18 日在指定媒体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备案。

本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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

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。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	
申万宏源	2	180,979,001.79	75.07%	168,546.62	75.07%	-
中金公司	2	60,088,464.29	24.93%	55,961.11	24.93%	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：



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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 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	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2020 年四季度报告	上证报、基金管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2020 年年度报告	上证报、基金管理人网站	2021 年 3 月 29 日
3	农银汇理沪深 300 指数基金一招募说明书更新—2021 年第 1 号	上证报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
4	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同	上证报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
5	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	上证报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
6	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金招募说明书更新	上证报、基金管理人网站	2021 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内不存在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、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理沪深 300 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

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

2021 年 8 月 30 日