

农银汇理中证 500 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§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	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
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.....	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 500 指数证券投资基金
基金简称	农银中证 500 指数
基金主代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 29 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,143,285.44 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，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% × 中证 500 指数 + 5% × 同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为较高风险、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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	5,409,289.65
本期利润	4,448,831.77
加权平均基金份额本期利润	0.1034
本期加权平均净值利润率	6.39%
本期基金份额净值增长率	6.53%
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	28,924,127.56
期末可供分配基金份额利润	0.7030
期末基金资产净值	70,067,413.00
期末基金份额净值	1.7030
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	70.30%

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06月30日。

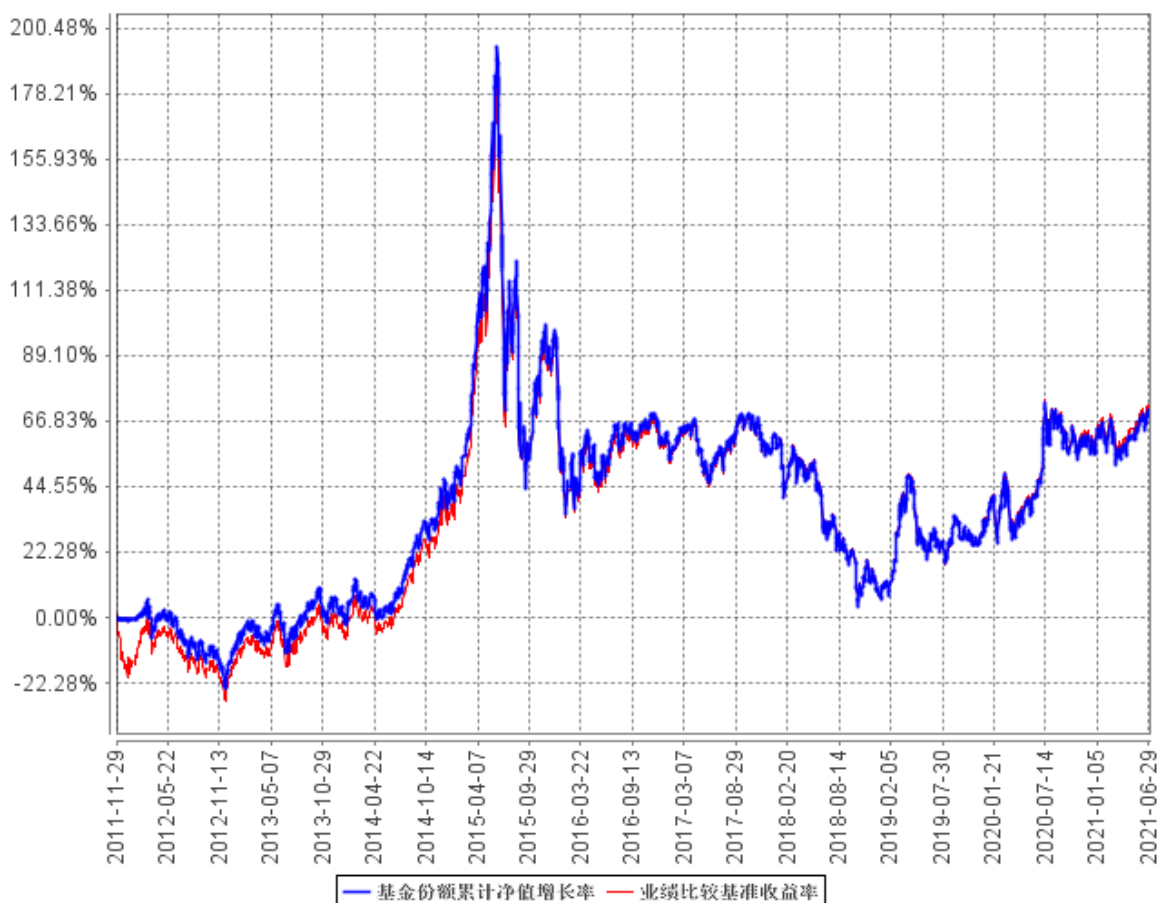
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.34%	0.74%	1.12%	0.69%	0.22%	0.05%
过去三个月	8.80%	0.66%	8.41%	0.65%	0.39%	0.01%
过去六个月	6.53%	0.95%	6.61%	0.94%	-0.08%	0.01%
过去一年	14.89%	1.19%	15.35%	1.19%	-0.46%	0.00%
过去三年	28.45%	1.40%	29.30%	1.40%	-0.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	70.30%	1.55%	72.00%	1.57%	-1.70%	-0.02%

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

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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	2014 年 2 月 10 日	-	14	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《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，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0385%，日均偏离度为 0.0164%，报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7030 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.53%，业绩比较基准收益率为 6.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《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，基金托管人在农银汇理中证 500 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,187,081.95	4,192,393.38
结算备付金		6,480.03	58,418.10
存出保证金		8,850.84	8,800.28
交易性金融资产	6.4.7.2	66,578,988.19	72,779,341.62
其中：股票投资		66,578,988.19	72,779,341.62
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		-	313,383.53
应收利息	6.4.7.5	724.28	916.72
应收股利		-	-
应收申购款		35,015.43	8,685.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,817,140.72	77,361,938.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		51.70	-
应付赎回款		558,784.15	189,933.51
应付管理人报酬		43,188.11	49,342.72
应付托管费		8,637.65	9,868.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,055.88	38,711.55
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	116,010.23	220,327.66
负债合计		749,727.72	508,183.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,143,285.44	48,076,687.77
未分配利润	6.4.7.10	28,924,127.56	28,777,067.13
所有者权益合计		70,067,413.00	76,853,754.90
负债和所有者权益总计		70,817,140.72	77,361,938.87

报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3258 元，基金份额总额 41,143,285.44 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：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
一、收入		5,010,752.83	10,142,626.35
1.利息收入		15,580.88	24,675.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,580.88	18,582.38
债券利息收入		-	6,092.87
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）		5,928,716.57	3,043,857.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,349,604.53	2,412,619.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	2,000.00
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	579,112.04	629,238.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-960,457.88	7,026,209.69
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	26,913.26	47,884.12
减：二、费用		561,921.06	719,022.76

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	258,911.10	344,938.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,782.24	68,987.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	77,665.95	106,402.69
5. 利息支出		-	80.81
其中：卖出回购金融资产支出		-	80.81
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	173,561.77	198,612.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,448,831.77	9,423,603.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,448,831.77	9,423,603.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：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）	48,076,687.77	28,777,067.13	76,853,754.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,448,831.77	4,448,831.77
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）	-6,933,402.33	-4,301,771.34	-11,235,173.67
其中：1. 基金申购款	12,118,034.31	7,649,427.25	19,767,461.56
2. 基金赎回款	-19,051,436.64	-11,951,198.59	-31,002,635.23
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）	41,143,285.44	28,924,127.56	70,067,413.00

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）	76,684,715.96	25,896,767.60	102,581,483.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,423,603.59	9,423,603.59
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）	-16,477,819.54	-6,281,413.72	-22,759,233.26
其中：1.基金申购款	17,961,771.57	6,626,667.16	24,588,438.73
2.基金赎回款	-34,439,591.11	-12,908,080.88	-47,347,671.99
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）	60,206,896.42	29,038,957.47	89,245,853.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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	4,187,081.95
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：	4,187,081.95

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	59,491,938.49	66,578,988.19	7,087,049.70
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	59,491,938.49	66,578,988.19	7,087,049.70

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

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	717.98
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	2.70
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	3.60
合计	724.28

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	23,055.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,055.88

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	1,543.46
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,466.77
合计	116,010.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,076,687.77	48,076,687.77
本期申购	12,118,034.31	12,118,034.31
本期赎回(以“-”号填列)	-19,051,436.64	-19,051,436.64
- 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	41,143,285.44	41,143,285.44

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,541,684.72	-11,764,617.59	28,777,067.13
本期利润	5,409,289.65	-960,457.88	4,448,831.77
本期基金份额交易产生的变动数	-6,080,353.56	1,778,582.22	-4,301,771.34
其中：基金申购款	10,641,059.20	-2,991,631.95	7,649,427.25
基金赎回款	-16,721,412.76	4,770,214.17	-11,951,198.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,870,620.81	-10,946,493.25	28,924,127.56

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	15,292.05
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	216.26
其他	72.57
合计	15,580.88

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	29,184,888.80
减：卖出股票成本总额	23,835,284.27
买卖股票差价收入	5,349,604.53

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买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内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债券申购差价收入。

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买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

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申购差价收入。

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**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

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	579,112.04
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	579,112.04

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	-960,457.88
——股票投资	-960,457.88
——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	-960,457.88

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	22,848.46
转换费	4,064.80
合计	26,913.26

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	77,665.95
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	77,665.95

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	24,795.19
信息披露费	39,671.58
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	95.00
合计	173,561.77

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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、权证交易、债券交易和债券回购交易。本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	258,911.10	344,938.94
其中：支付销售机构的客户维护费	-	154,751.44

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.75% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	51,782.24	68,987.72

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		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
交通银行	4,187,081.95	15,292.05	5,422,684.33	18,205.59

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未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
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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	公告重大事项	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	8,517	117,177.66	479,932.95	-
600811	东方集团	2021 年 6 月 30 日	公告重大事项	3.05	2021 年 7 月 14 日	3.36	32,630	147,688.29	99,521.50	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按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、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,187,081.95	-	-	-	4,187,081.95

结算备付金	6,480.03	-	-	-	6,480.03
存出保证金	8,850.84	-	-	-	8,850.84
交易性金融资产	-	-	-	-66,578,988.19	66,578,988.19
应收利息	-	-	-	724.28	724.28
应收申购款	-	-	-	35,015.43	35,015.43
资产总计	4,202,412.82	-	-	-66,614,727.90	70,817,140.72
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	51.70	51.70
应付赎回款	-	-	-	558,784.15	558,784.15
应付管理人报酬	-	-	-	43,188.11	43,188.11
应付托管费	-	-	-	8,637.65	8,637.65
应付交易费用	-	-	-	23,055.88	23,055.88
其他负债	-	-	-	116,010.23	116,010.23
负债总计	-	-	-	749,727.72	749,727.72
利率敏感度缺口	4,202,412.82	-	-	-65,865,000.18	70,067,413.00
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	4,192,393.38	-	-	-	4,192,393.38
结算备付金	58,418.10	-	-	-	58,418.10
存出保证金	8,800.28	-	-	-	8,800.28
交易性金融资产	-	-	-	-72,779,341.62	72,779,341.62
应收证券清算款	-	-	-	313,383.53	313,383.53
应收利息	-	-	-	916.72	916.72
应收申购款	-	-	-	8,685.24	8,685.24
资产总计	4,259,611.76	-	-	-73,102,327.11	77,361,938.87
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	189,933.51	189,933.51
应付管理人报酬	-	-	-	49,342.72	49,342.72
应付托管费	-	-	-	9,868.53	9,868.53
应付交易费用	-	-	-	38,711.55	38,711.55
其他负债	-	-	-	220,327.66	220,327.66
负债总计	-	-	-	508,183.97	508,183.97
利率敏感度缺口	4,259,611.76	-	-	-72,594,143.14	76,853,754.90

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	-	-	

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	66,578,988.19	95.02	72,779,341.62	94.70
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	66,578,988.19	95.02	72,779,341.62	94.70

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%	3,504,571.29	3,836,614.25
	业绩比较基准下降 5%	-3,504,571.29	-3,836,614.25

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	66,578,988.19	94.02
	其中：股票	66,578,988.19	94.02
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	4,193,561.98	5.92
8	其他各项资产	44,590.55	0.06
9	合计	70,817,140.72	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	654,574.00	0.93
B	采矿业	2,324,305.29	3.32
C	制造业	42,069,064.50	60.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,613,849.16	2.30
E	建筑业	1,234,036.08	1.76
F	批发和零售业	2,288,248.71	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,296,672.28	1.85
H	住宿和餐饮业	356,644.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,525,150.50	7.89
J	金融业	3,912,708.82	5.58
K	房地产业	2,159,431.44	3.08
L	租赁和商务服务业	817,889.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	175,258.75	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	567,445.82	0.81

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,717.24	0.06
Q	卫生和社会工作	180,776.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	675,358.00	0.96
S	综合	586,091.22	0.84
	合计	66,480,220.81	94.88

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	36,139.44	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.02
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	12,230.40	0.02
J	金融业	34,721.10	0.05
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	98,767.38	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	002709	天赐材料	6,258	666,977.64	0.95
2	000799	酒鬼酒	2,500	639,000.00	0.91
3	603486	科沃斯	2,480	565,638.40	0.81
4	600089	特变电工	40,400	519,140.00	0.74
5	000009	中国宝安	28,020	511,925.40	0.73
6	002340	格林美	52,172	487,808.20	0.70
7	002074	国轩高科	11,100	483,516.00	0.69
8	600460	士兰微	8,517	479,932.95	0.68
9	300285	国瓷材料	8,700	424,125.00	0.61
10	601233	桐昆股份	17,400	419,166.00	0.60
11	300207	欣旺达	12,000	390,720.00	0.56
12	002185	华天科技	23,900	367,821.00	0.52
13	600885	宏发股份	5,680	356,136.00	0.51
14	300316	晶盛机电	7,000	353,500.00	0.50
15	601636	旗滨集团	17,500	324,800.00	0.46
16	600733	北汽蓝谷	23,300	314,084.00	0.45
17	300037	新宙邦	3,100	310,310.00	0.44
18	300146	汤臣倍健	9,200	302,680.00	0.43
19	300253	卫宁健康	18,600	302,622.00	0.43
20	603737	三棵树	1,680	295,680.00	0.42
21	002648	卫星石化	7,500	293,925.00	0.42
22	002625	光启技术	14,100	293,421.00	0.42
23	002223	鱼跃医疗	7,589	289,368.57	0.41
24	600884	杉杉股份	12,355	288,118.60	0.41
25	002353	杰瑞股份	6,300	281,610.00	0.40
26	600219	南山铝业	78,200	281,520.00	0.40
27	601127	小康股份	4,200	280,014.00	0.40
28	002138	顺络电子	7,000	271,390.00	0.39
29	600779	水井坊	2,100	265,335.00	0.38
30	603444	吉比特	500	265,000.00	0.38
31	000547	航天发展	14,000	264,180.00	0.38
32	603589	口子窖	3,900	263,991.00	0.38
33	002797	第一创业	36,700	262,038.00	0.37

34	600704	物产中大	33,000	259,710.00	0.37
35	300699	光威复材	3,400	258,230.00	0.37
36	000988	华工科技	10,900	256,368.00	0.37
37	002444	巨星科技	7,500	255,600.00	0.36
38	002212	天融信	12,900	255,033.00	0.36
39	601099	太平洋	74,300	251,877.00	0.36
40	603893	瑞芯微	1,800	251,028.00	0.36
41	002422	科伦药业	12,400	247,380.00	0.35
42	002385	大北农	36,100	245,480.00	0.35
43	601168	西部矿业	20,500	244,565.00	0.35
44	600739	辽宁成大	11,700	243,477.00	0.35
45	000807	云铝股份	20,400	242,760.00	0.35
46	300308	中际旭创	6,200	238,824.00	0.34
47	600563	法拉电子	1,500	237,540.00	0.34
48	000636	风华高科	7,800	235,716.00	0.34
49	601117	中国化学	26,900	235,644.00	0.34
50	688099	晶晨股份	2,100	235,620.00	0.34
51	002439	启明星辰	8,100	234,981.00	0.34
52	600862	中航高科	7,600	233,928.00	0.33
53	600392	盛和资源	13,410	232,797.60	0.33
54	000830	鲁西化工	12,400	232,252.00	0.33
55	688002	睿创微纳	2,300	229,609.00	0.33
56	002078	太阳纸业	17,100	228,285.00	0.33
57	600754	锦江酒店	4,000	227,800.00	0.33
58	600699	均胜电子	8,900	227,128.00	0.32
59	002030	达安基因	10,688	227,013.12	0.32
60	600068	葛洲坝	30,100	225,449.00	0.32
61	002180	纳思达	7,000	225,400.00	0.32
62	002250	联化科技	8,044	224,427.60	0.32
63	600486	扬农化工	2,000	223,540.00	0.32
64	600315	上海家化	3,700	222,518.00	0.32
65	300088	长信科技	26,800	221,368.00	0.32
66	000630	铜陵有色	80,400	218,688.00	0.31
67	002507	涪陵榨菜	5,800	218,428.00	0.31
68	603605	珀莱雅	1,100	216,381.00	0.31
69	600201	生物股份	12,290	214,460.50	0.31
70	002013	中航机电	21,200	213,484.00	0.30
71	000039	中集集团	11,660	211,978.80	0.30
72	002075	沙钢股份	19,200	209,472.00	0.30

73	002127	南极电商	21,400	209,078.00	0.30
74	000513	丽珠集团	4,098	204,981.96	0.29
75	300001	特锐德	6,800	204,748.00	0.29
76	002028	思源电气	6,608	203,460.32	0.29
77	300223	北京君正	2,000	201,840.00	0.29
78	601997	贵阳银行	27,900	199,764.00	0.29
79	600177	雅戈尔	30,300	199,677.00	0.28
80	002511	中顺洁柔	7,100	195,605.00	0.28
81	000021	深科技	10,209	195,400.26	0.28
82	601005	重庆钢铁	73,100	195,177.00	0.28
83	002273	水晶光电	13,215	194,128.35	0.28
84	600549	厦门钨业	9,300	193,719.00	0.28
85	002299	圣农发展	8,100	193,428.00	0.28
86	002092	中泰化学	18,700	192,049.00	0.27
87	002080	中材科技	7,300	191,041.00	0.27
88	600988	赤峰黄金	12,700	190,373.00	0.27
89	002465	海格通信	20,100	190,146.00	0.27
90	000050	深天马 A	13,400	190,012.00	0.27
91	002603	以岭药业	6,500	189,540.00	0.27
92	300618	寒锐钴业	2,400	189,216.00	0.27
93	600171	上海贝岭	6,200	188,666.00	0.27
94	300168	万达信息	12,900	188,340.00	0.27
95	000739	普洛药业	6,400	188,160.00	0.27
96	300482	万孚生物	2,890	186,954.10	0.27
97	300009	安科生物	12,524	186,607.60	0.27
98	000825	太钢不锈	24,800	185,752.00	0.27
99	000983	山西焦煤	22,350	185,728.50	0.27
100	601128	常熟银行	29,900	185,380.00	0.26
101	600516	方大炭素	24,900	185,256.00	0.26
102	600867	通化东宝	15,500	185,070.00	0.26
103	600066	宇通客车	14,800	184,852.00	0.26
104	000998	隆平高科	11,500	184,460.00	0.26
105	600637	东方明珠	22,300	182,637.00	0.26
106	600536	中国软件	3,200	182,176.00	0.26
107	600316	洪都航空	4,700	180,856.00	0.26
108	300244	迪安诊断	4,720	180,776.00	0.26
109	300357	我武生物	2,800	179,536.00	0.26
110	600418	江淮汽车	14,400	178,992.00	0.26
111	601689	拓普集团	4,775	178,728.25	0.26

112	600879	航天电子	23,660	177,923.20	0.25
113	300463	迈克生物	4,200	176,778.00	0.25
114	600529	山东药玻	5,200	176,540.00	0.25
115	000932	华菱钢铁	26,720	176,352.00	0.25
116	600369	西南证券	36,200	176,294.00	0.25
117	300070	碧水源	24,100	176,171.00	0.25
118	000723	美锦能源	23,300	176,148.00	0.25
119	000750	国海证券	41,530	176,087.20	0.25
120	002152	广电运通	13,500	175,905.00	0.25
121	600487	亨通光电	15,400	175,560.00	0.25
122	600380	健康元	12,772	175,359.56	0.25
123	600827	百联股份	8,700	175,305.00	0.25
124	000960	锡业股份	10,900	174,727.00	0.25
125	688208	道通科技	2,000	173,980.00	0.25
126	300296	利亚德	22,200	173,604.00	0.25
127	300271	华宇软件	9,000	173,250.00	0.25
128	600166	福田汽车	50,200	173,190.00	0.25
129	002156	通富微电	7,200	173,088.00	0.25
130	000975	银泰黄金	18,129	172,406.79	0.25
131	002131	利欧股份	73,659	172,362.06	0.25
132	002373	千方科技	10,300	172,010.00	0.25
133	600909	华安证券	30,820	171,667.40	0.25
134	601615	明阳智能	10,600	171,614.00	0.24
135	300383	光环新网	11,800	169,802.00	0.24
136	600038	中直股份	3,200	168,768.00	0.24
137	002572	索菲亚	6,900	166,980.00	0.24
138	002926	华西证券	17,200	165,636.00	0.24
139	600642	申能股份	26,800	164,552.00	0.23
140	601198	东兴证券	15,000	163,950.00	0.23
141	601866	中远海发	43,300	162,375.00	0.23
142	300115	长盈精密	7,864	161,998.40	0.23
143	002065	东华软件	20,400	161,772.00	0.23
144	002690	美亚光电	2,900	161,704.00	0.23
145	603290	斯达半导	500	160,000.00	0.23
146	603638	艾迪精密	3,700	158,619.00	0.23
147	600271	航天信息	12,100	157,663.00	0.23
148	002500	山西证券	23,460	157,416.60	0.22
149	603156	养元饮品	5,500	157,190.00	0.22
150	000623	吉林敖东	10,142	157,099.58	0.22

151	600998	九州通	10,200	156,774.00	0.22
152	300474	景嘉微	1,600	156,672.00	0.22
153	600415	小商品城	29,900	153,985.00	0.22
154	000012	南玻 A	14,995	153,548.80	0.22
155	600895	张江高科	8,400	153,468.00	0.22
156	600153	建发股份	18,700	151,470.00	0.22
157	002294	信立泰	4,600	151,340.00	0.22
158	601699	潞安环能	12,800	151,168.00	0.22
159	300630	普利制药	2,877	150,754.80	0.22
160	600188	兖州煤业	9,700	148,992.00	0.21
161	600256	广汇能源	44,100	146,853.00	0.21
162	600707	彩虹股份	15,600	146,796.00	0.21
163	600535	天士力	9,900	146,619.00	0.21
164	600667	太极实业	16,100	146,510.00	0.21
165	600390	五矿资本	24,500	146,510.00	0.21
166	300418	昆仑万维	8,900	145,782.00	0.21
167	300024	机器人	13,600	145,112.00	0.21
168	002670	国盛金控	12,704	144,698.56	0.21
169	600008	首创环保	48,070	144,690.70	0.21
170	002372	伟星新材	6,960	143,863.20	0.21
171	600060	海信视像	8,500	143,650.00	0.21
172	600497	驰宏锌锗	33,300	143,523.00	0.20
173	000878	云南铜业	11,100	142,413.00	0.20
174	600208	新湖中宝	46,800	142,272.00	0.20
175	002557	洽洽食品	3,291	141,842.10	0.20
176	002382	蓝帆医疗	6,800	141,780.00	0.20
177	600155	华创阳安	13,200	141,240.00	0.20
178	000027	深圳能源	15,320	140,484.40	0.20
179	002019	亿帆医药	8,100	139,725.00	0.20
180	300251	光线传媒	12,900	139,449.00	0.20
181	603858	步长制药	6,200	139,438.00	0.20
182	600372	中航电子	8,400	139,020.00	0.20
183	600765	中航重机	6,100	138,165.00	0.20
184	002221	东华能源	12,606	138,035.70	0.20
185	600498	烽火通信	7,400	137,862.00	0.20
186	000718	苏宁环球	16,600	137,614.00	0.20
187	600409	三友化工	13,600	137,496.00	0.20
188	002174	游族网络	8,000	137,360.00	0.20
189	600141	兴发集团	7,268	136,856.44	0.20

190	002683	宏大爆破	4,900	136,073.00	0.19
191	600511	国药股份	4,100	135,546.00	0.19
192	600170	上海建工	48,600	134,136.00	0.19
193	002966	苏州银行	18,200	133,770.00	0.19
194	002146	荣盛发展	23,700	133,668.00	0.19
195	000401	冀东水泥	10,800	133,380.00	0.19
196	002506	协鑫集成	38,300	133,284.00	0.19
197	600875	东方电气	12,100	132,737.00	0.19
198	000997	新大陆	8,000	132,720.00	0.19
199	002390	信邦制药	12,650	132,572.00	0.19
200	601717	郑煤机	11,300	131,419.00	0.19
201	300058	蓝色光标	21,700	131,285.00	0.19
202	600801	华新水泥	7,436	130,650.52	0.19
203	002408	齐翔腾达	10,480	130,161.60	0.19
204	600160	巨化股份	14,700	129,948.00	0.19
205	002958	青农商行	30,300	129,684.00	0.19
206	603866	桃李面包	4,156	129,667.20	0.19
207	000686	东北证券	15,300	129,285.00	0.18
208	000738	航发控制	6,200	129,146.00	0.18
209	600258	首旅酒店	5,400	128,844.00	0.18
210	600663	陆家嘴	9,600	127,872.00	0.18
211	002195	二三四五	62,830	127,544.90	0.18
212	300315	掌趣科技	30,000	127,500.00	0.18
213	002268	卫士通	6,440	125,451.20	0.18
214	603707	健友股份	3,000	125,250.00	0.18
215	600325	华发股份	18,558	125,080.92	0.18
216	000540	中天金融	45,800	125,034.00	0.18
217	688321	微芯生物	2,700	124,713.00	0.18
218	688029	南微医学	400	124,676.00	0.18
219	300017	网宿科技	21,300	124,605.00	0.18
220	600732	爱旭股份	8,900	123,888.00	0.18
221	603260	合盛硅业	1,600	123,056.00	0.18
222	603225	新凤鸣	6,056	122,936.80	0.18
223	603712	七一二	3,400	122,740.00	0.18
224	000060	中金岭南	27,100	122,492.00	0.17
225	600859	王府井	4,240	122,451.20	0.17
226	601992	金隅集团	45,500	122,395.00	0.17
227	601016	节能风电	32,700	122,298.00	0.17
228	600027	华电国际	35,500	122,120.00	0.17

229	000961	中南建设	20,600	121,952.00	0.17
230	600567	山鹰国际	35,200	121,440.00	0.17
231	603077	和邦生物	58,140	120,931.20	0.17
232	002831	裕同科技	4,060	120,541.40	0.17
233	600282	南钢股份	33,800	120,328.00	0.17
234	603927	中科软	2,800	120,260.00	0.17
235	002191	劲嘉股份	11,300	120,232.00	0.17
236	000158	常山北明	10,414	119,656.86	0.17
237	002429	兆驰股份	19,700	119,579.00	0.17
238	600216	浙江医药	7,400	118,474.00	0.17
239	600500	中化国际	15,013	118,002.18	0.17
240	300212	易华录	4,380	117,865.80	0.17
241	000671	阳光城	22,600	117,520.00	0.17
242	002595	豪迈科技	4,400	117,480.00	0.17
243	600528	中铁工业	14,500	117,450.00	0.17
244	600839	四川长虹	40,300	117,273.00	0.17
245	601577	长沙银行	13,100	117,114.00	0.17
246	688088	虹软科技	2,100	117,075.00	0.17
247	603883	老百姓	2,220	116,949.60	0.17
248	000898	鞍钢股份	26,200	116,590.00	0.17
249	600755	厦门国贸	14,168	116,319.28	0.17
250	600737	中粮糖业	11,600	116,116.00	0.17
251	002056	横店东磁	8,900	115,700.00	0.17
252	002081	金螳螂	14,600	115,632.00	0.17
253	600598	北大荒	7,700	115,192.00	0.16
254	603198	迎驾贡酒	2,600	115,180.00	0.16
255	000999	华润三九	4,300	115,025.00	0.16
256	000709	河钢股份	46,600	114,636.00	0.16
257	000581	威孚高科	5,500	114,565.00	0.16
258	600728	佳都科技	15,400	114,114.00	0.16
259	600580	卧龙电驱	8,500	113,050.00	0.16
260	002124	天邦股份	16,120	113,001.20	0.16
261	002203	海亮股份	10,600	112,784.00	0.16
262	300182	捷成股份	22,600	112,774.00	0.16
263	600808	马钢股份	26,200	112,398.00	0.16
264	002281	光迅科技	4,549	111,905.40	0.16
265	002010	传化智联	14,500	111,795.00	0.16
266	000729	燕京啤酒	15,400	111,496.00	0.16
267	000930	中粮科技	12,200	109,922.00	0.16

268	600820	隧道股份	20,700	109,503.00	0.16
269	002396	星网锐捷	5,100	108,885.00	0.16
270	002745	木林森	8,100	108,540.00	0.15
271	300166	东方国信	8,779	108,508.44	0.15
272	002387	维信诺	10,400	108,472.00	0.15
273	000488	晨鸣纸业	13,300	108,262.00	0.15
274	000629	攀钢钒钛	47,100	107,859.00	0.15
275	002004	华邦健康	17,365	107,836.65	0.15
276	002048	宁波华翔	5,500	107,250.00	0.15
277	002242	九阳股份	3,300	107,217.00	0.15
278	002563	森马服饰	8,800	105,160.00	0.15
279	300002	神州泰岳	21,500	104,275.00	0.15
280	600970	中材国际	11,350	104,079.50	0.15
281	600022	山东钢铁	60,050	103,286.00	0.15
282	603000	人民网	6,000	103,140.00	0.15
283	600398	海澜之家	14,200	102,808.00	0.15
284	000598	兴蓉环境	19,700	102,637.00	0.15
285	600803	新奥股份	6,200	102,362.00	0.15
286	601106	中国一重	30,100	102,039.00	0.15
287	600037	歌华有线	10,600	101,866.00	0.15
288	600881	亚泰集团	35,400	100,890.00	0.14
289	600811	东方集团	32,630	99,521.50	0.14
290	600039	四川路桥	15,700	98,439.00	0.14
291	601880	辽港股份	57,490	98,307.90	0.14
292	000883	湖北能源	21,400	98,226.00	0.14
293	002925	盈趣科技	2,520	98,053.20	0.14
294	600348	华阳股份	13,200	97,944.00	0.14
295	000778	新兴铸管	26,300	97,836.00	0.14
296	603885	吉祥航空	6,400	97,664.00	0.14
297	000690	宝新能源	19,100	97,601.00	0.14
298	601456	国联证券	6,300	97,020.00	0.14
299	000887	中鼎股份	8,000	96,640.00	0.14
300	600597	光明乳业	6,700	96,547.00	0.14
301	600782	新钢股份	17,300	96,534.00	0.14
302	600260	凯乐科技	10,800	95,904.00	0.14
303	601118	海南橡胶	18,800	95,692.00	0.14
304	002249	大洋电机	18,200	95,550.00	0.14
305	002701	奥瑞金	18,532	95,254.48	0.14
306	600967	内蒙一机	9,400	95,128.00	0.14

307	600126	杭钢股份	18,490	94,853.70	0.14
308	600908	无锡银行	16,300	94,540.00	0.13
309	002705	新宝股份	3,600	94,500.00	0.13
310	603568	伟明环保	4,124	94,150.92	0.13
311	002085	万丰奥威	16,800	94,080.00	0.13
312	600718	东软集团	9,600	93,888.00	0.13
313	600645	中源协和	4,085	93,750.75	0.13
314	600026	中远海能	15,200	93,632.00	0.13
315	002183	怡亚通	16,300	93,399.00	0.13
316	002867	周大生	4,700	92,919.00	0.13
317	601179	中国西电	22,500	92,700.00	0.13
318	600410	华胜天成	11,929	92,569.04	0.13
319	600985	淮北矿业	7,500	91,575.00	0.13
320	603650	彤程新材	1,900	91,390.00	0.13
321	600572	康恩贝	20,465	90,864.60	0.13
322	000528	柳工	11,020	90,364.00	0.13
323	000970	中科三环	9,400	89,770.00	0.13
324	000877	天山股份	6,840	89,125.20	0.13
325	600167	联美控股	9,930	88,674.90	0.13
326	000402	金融街	13,100	88,425.00	0.13
327	601200	上海环境	7,360	88,099.20	0.13
328	600446	金证股份	6,100	88,084.00	0.13
329	002266	浙富控股	17,630	87,973.70	0.13
330	300072	三聚环保	15,300	87,822.00	0.13
331	000089	深圳机场	11,300	87,801.00	0.13
332	002368	太极股份	4,370	87,662.20	0.13
333	002128	露天煤业	8,400	87,444.00	0.12
334	601598	中国外运	17,300	87,365.00	0.12
335	600064	南京高科	9,400	87,326.00	0.12
336	600329	中新药业	3,100	87,079.00	0.12
337	000990	诚志股份	6,800	86,564.00	0.12
338	002110	三钢闽光	12,650	85,261.00	0.12
339	600517	国网英大	12,500	85,125.00	0.12
340	000400	许继电气	6,600	83,556.00	0.12
341	300026	红日药业	19,600	83,300.00	0.12
342	600158	中体产业	7,300	83,293.00	0.12
343	002985	北摩高科	850	82,875.00	0.12
344	300376	易事特	10,200	82,008.00	0.12
345	003035	南网能源	8,200	81,508.00	0.12

346	601718	际华集团	28,900	81,498.00	0.12
347	002233	塔牌集团	7,900	81,212.00	0.12
348	600120	浙江东方	18,923	80,990.44	0.12
349	000519	中兵红箭	7,529	80,710.88	0.12
350	601975	招商南油	37,700	80,678.00	0.12
351	000959	首钢股份	14,300	80,366.00	0.11
352	600507	方大特钢	11,805	80,037.90	0.11
353	600307	酒钢宏兴	34,400	79,808.00	0.11
354	000685	中山公用	9,776	79,772.16	0.11
355	001914	招商积余	4,600	79,028.00	0.11
356	600376	首开股份	14,100	78,960.00	0.11
357	601333	广深铁路	37,200	78,864.00	0.11
358	600195	中牧股份	6,587	78,780.52	0.11
359	000090	天健集团	14,186	78,448.58	0.11
360	601000	唐山港	32,526	78,387.66	0.11
361	002440	闰土股份	8,853	78,349.05	0.11
362	002505	鹏都农牧	34,930	78,243.20	0.11
363	600435	北方导航	9,700	77,018.00	0.11
364	000559	万向钱潮	14,500	76,995.00	0.11
365	600804	鹏博士	15,700	75,988.00	0.11
366	002839	张家港行	13,900	75,616.00	0.11
367	600643	爱建集团	10,670	74,476.60	0.11
368	600673	东阳光	16,518	74,165.82	0.11
369	300133	华策影视	12,500	74,000.00	0.11
370	600373	中文传媒	7,500	73,950.00	0.11
371	601860	紫金银行	20,200	73,326.00	0.10
372	603228	景旺电子	2,794	73,202.80	0.10
373	002155	湖南黄金	9,300	72,075.00	0.10
374	601991	大唐发电	27,200	71,808.00	0.10
375	000758	中色股份	15,100	71,725.00	0.10
376	600582	天地科技	18,200	70,980.00	0.10
377	000967	盈峰环境	10,300	70,761.00	0.10
378	601608	中信重工	18,900	70,686.00	0.10
379	002936	郑州银行	19,250	70,647.50	0.10
380	002038	双鹭药业	6,700	70,551.00	0.10
381	600056	中国医药	5,800	70,470.00	0.10
382	600266	城建发展	14,840	70,341.60	0.10
383	000563	陕国投 A	21,766	70,086.52	0.10
384	600388	龙净环保	8,100	69,012.00	0.10

385	600131	国网信通	5,200	68,848.00	0.10
386	601098	中南传媒	7,800	68,796.00	0.10
387	601958	金铂股份	10,600	68,688.00	0.10
388	300113	顺网科技	5,300	68,582.00	0.10
389	000681	视觉中国	5,300	68,529.00	0.10
390	600901	江苏租赁	13,100	68,120.00	0.10
391	600928	西安银行	14,600	68,036.00	0.10
392	600095	湘财股份	5,800	67,918.00	0.10
393	600259	广晟有色	2,000	67,620.00	0.10
394	003022	联泓新科	2,200	67,540.00	0.10
395	002416	爱施德	6,720	67,401.60	0.10
396	600062	华润双鹤	5,652	67,315.32	0.10
397	300180	华峰超纤	13,500	66,825.00	0.10
398	600959	江苏有线	21,900	66,795.00	0.10
399	600649	城投控股	13,900	66,164.00	0.09
400	600094	大名城	17,500	65,975.00	0.09
401	300741	华宝股份	1,300	65,936.00	0.09
402	002458	益生股份	6,600	65,802.00	0.09
403	002399	海普瑞	4,100	65,313.00	0.09
404	600764	中国海防	2,300	65,090.00	0.09
405	600776	东方通信	5,200	64,480.00	0.09
406	600006	东风汽车	8,800	64,240.00	0.09
407	600556	天下秀	6,000	63,360.00	0.09
408	601611	中国核建	8,700	62,814.00	0.09
409	600717	天津港	15,816	61,998.72	0.09
410	002317	众生药业	7,200	61,992.00	0.09
411	300257	开山股份	4,300	61,791.00	0.09
412	000028	国药一致	1,632	61,754.88	0.09
413	600546	山煤国际	8,600	61,748.00	0.09
414	600633	浙数文化	8,500	61,030.00	0.09
415	600648	外高桥	4,100	60,598.00	0.09
416	000717	韶钢松山	13,200	60,588.00	0.09
417	600729	重庆百货	2,197	60,307.65	0.09
418	002434	万里扬	7,400	60,014.00	0.09
419	601928	凤凰传媒	8,400	59,976.00	0.09
420	600021	上海电力	8,600	59,426.00	0.08
421	600863	内蒙华电	25,500	59,415.00	0.08
422	000078	海王生物	18,100	59,006.00	0.08
423	000501	鄂武商 A	5,005	58,558.50	0.08

424	002375	亚厦股份	7,300	57,816.00	0.08
425	605358	立昂微	500	57,790.00	0.08
426	600968	海油发展	22,300	57,757.00	0.08
427	000062	深圳华强	3,410	57,663.10	0.08
428	601828	美凯龙	4,800	57,600.00	0.08
429	002244	滨江集团	13,700	57,403.00	0.08
430	600835	上海机电	3,500	56,875.00	0.08
431	002424	贵州百灵	7,700	56,672.00	0.08
432	603355	莱克电气	900	56,007.00	0.08
433	000869	张裕 A	1,500	55,710.00	0.08
434	600623	华谊集团	6,200	54,622.00	0.08
435	600377	宁沪高速	5,500	53,680.00	0.08
436	600339	中油工程	18,400	52,256.00	0.07
437	600312	平高电气	8,900	51,976.00	0.07
438	600566	济川药业	2,900	51,910.00	0.07
439	002468	申通快递	6,800	51,816.00	0.07
440	601969	海南矿业	4,400	51,172.00	0.07
441	600787	中储股份	9,600	51,168.00	0.07
442	002583	海能达	10,100	50,904.00	0.07
443	000031	大悦城	14,100	50,760.00	0.07
444	600639	浦东金桥	3,700	50,505.00	0.07
445	000826	启迪环境	9,400	50,290.00	0.07
446	600823	世茂股份	12,300	49,692.00	0.07
447	601778	晶科科技	9,100	49,686.00	0.07
448	603317	天味食品	1,686	49,618.98	0.07
449	600466	蓝光发展	16,600	48,970.00	0.07
450	603888	新华网	2,300	48,691.00	0.07
451	601298	青岛港	7,700	47,586.00	0.07
452	002815	崇达技术	3,800	47,424.00	0.07
453	002532	天山铝业	5,600	46,984.00	0.07
454	000156	华数传媒	6,000	46,260.00	0.07
455	002948	青岛银行	9,200	45,724.00	0.07
456	000937	冀中能源	11,600	45,588.00	0.07
457	603708	家家悦	2,600	45,162.00	0.06
458	002635	安洁科技	3,084	45,118.92	0.06
459	000813	德展健康	9,900	44,946.00	0.06
460	000553	安道麦 A	4,800	44,496.00	0.06
461	002302	西部建设	5,600	44,240.00	0.06
462	300010	豆神教育	7,700	43,659.00	0.06

463	601228	广州港	13,600	43,248.00	0.06
464	603515	欧普照明	1,680	43,125.60	0.06
465	603377	东方时尚	3,996	42,717.24	0.06
466	600640	号百控股	3,500	42,665.00	0.06
467	600350	山东高速	6,900	42,435.00	0.06
468	001872	招商港口	2,500	42,300.00	0.06
469	000061	农产品	7,400	40,848.00	0.06
470	600871	石化油服	20,700	40,779.00	0.06
471	601139	深圳燃气	6,100	40,016.00	0.06
472	000046	泛海控股	17,100	39,330.00	0.06
473	002653	海思科	1,800	38,736.00	0.06
474	603786	科博达	500	37,750.00	0.05
475	601568	北元集团	4,400	37,664.00	0.05
476	603056	德邦股份	3,400	37,366.00	0.05
477	603379	三美股份	1,980	37,045.80	0.05
478	002901	大博医疗	500	36,445.00	0.05
479	002419	天虹股份	5,300	34,768.00	0.05
480	601003	柳钢股份	5,600	33,040.00	0.05
481	000537	广宇发展	6,300	32,949.00	0.05
482	601512	中新集团	3,300	32,868.00	0.05
483	600657	信达地产	9,279	32,290.92	0.05
484	601869	长飞光纤	1,300	31,668.00	0.05
485	601801	皖新传媒	6,700	31,624.00	0.05
486	603983	丸美股份	600	31,266.00	0.04
487	601187	厦门银行	3,200	30,336.00	0.04
488	002946	新乳业	1,900	28,785.00	0.04
489	600917	重庆燃气	3,500	28,595.00	0.04
490	603719	良品铺子	600	27,000.00	0.04
491	600903	贵州燃气	2,600	23,920.00	0.03
492	603868	飞科电器	500	21,030.00	0.03
493	002818	富森美	1,650	19,899.00	0.03
494	002423	中粮资本	2,100	19,005.00	0.03
495	603256	宏和科技	2,000	18,280.00	0.03
496	600956	新天绿能	1,500	17,565.00	0.03
497	601068	中铝国际	3,500	12,075.00	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	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05
2	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
3	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
4	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
5	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
6	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	000799	酒鬼酒	625,626.00	0.81
2	600998	九州通	345,614.00	0.45
3	601636	旗滨集团	306,271.00	0.40
4	300253	卫宁健康	284,435.00	0.37
5	300037	新宙邦	281,903.00	0.37
6	300308	中际旭创	253,572.00	0.33
7	002439	启明星辰	247,251.00	0.32
8	002422	科伦药业	243,239.00	0.32
9	600177	雅戈尔	222,738.00	0.29
10	600068	葛洲坝	211,660.00	0.28
11	600988	赤峰黄金	207,952.00	0.27
12	601117	中国化学	207,857.00	0.27
13	600536	中国软件	202,290.00	0.26
14	002127	南极电商	197,176.00	0.26
15	600066	宇通客车	189,418.00	0.25
16	600637	东方明珠	189,258.00	0.25
17	002180	纳思达	183,472.00	0.24
18	603893	瑞芯微	181,044.00	0.24
19	300383	光环新网	179,605.00	0.23
20	600487	亨通光电	179,226.00	0.23

注：买入金额均按买入成交金额（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	300274	阳光电源	1,452,895.09	1.89
2	300012	华测检测	788,142.00	1.03
3	600426	华鲁恒升	775,074.60	1.01
4	300496	中科创达	650,806.00	0.85
5	300595	欧普康视	649,873.40	0.85
6	603882	金域医学	628,530.00	0.82
7	600132	重庆啤酒	618,898.00	0.81
8	603806	福斯特	535,308.78	0.70
9	600143	金发科技	516,134.64	0.67
10	601799	星宇股份	502,774.00	0.65
11	600079	人福医药	470,571.00	0.61
12	002568	百润股份	418,419.00	0.54
13	601966	玲珑轮胎	417,347.00	0.54
14	002791	坚朗五金	373,532.00	0.49
15	603345	安井食品	365,285.00	0.48
16	603816	顾家家居	350,123.00	0.46
17	603338	浙江鼎力	282,688.60	0.37
18	002064	华峰化学	240,326.00	0.31
19	002920	德赛西威	235,181.00	0.31
20	002709	天赐材料	222,684.00	0.29

注：卖出金额按卖出的成交金额（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	18,595,388.72
卖出股票收入（成交）总额	29,184,888.80

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**

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	8,850.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	724.28
5	应收申购款	35,015.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,590.55

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

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	600460	士兰微	479,932.95	0.68	公告重大事项

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	605287	德才股份	11,014.44	0.02	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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,200	7,912.17	494,996.43	1.20%	40,648,289.01	98.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	487.92	0.0012%

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	48,076,687.77
本报告期基金总申购份额	12,118,034.31
减:本报告期基金总赎回份额	19,051,436.64
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	41,143,285.44

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

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了备案。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
国信证券	2	24,334,786.23	51.20%	22,662.83	51.20%	-
高华证券	2	23,190,933.90	48.80%	21,598.77	48.80%	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。
- (3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

(4)、内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理中证 500 指数基金 2020 年四季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	农银汇理中证 500 指数基金 2020 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 3 月 29 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
4	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2021 年 1 号	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 3 月 31 日
6	农银汇理中证 500 指数基金 2021 年一季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
7	农银汇理中证 500 指数基金招募说明书更新	上海证券报、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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

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