

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 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	58
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	59
§ 12 备查文件目录	59
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	36,940,063.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% × 中证 500 指数 + 5% × 同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为较高风险、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	xuxin@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	http://www.abc-ca.com

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,343.23
本期利润	-6,835,463.74
加权平均基金份额本期利润	-0.1940
本期加权平均净值利润率	-12.19%
本期基金份额净值增长率	-11.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	23,068,126.48
期末可供分配基金份额利润	0.6245
期末基金资产净值	60,008,190.13
期末基金份额净值	1.6245
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	62.45%

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

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

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

3.2 基金净值表现

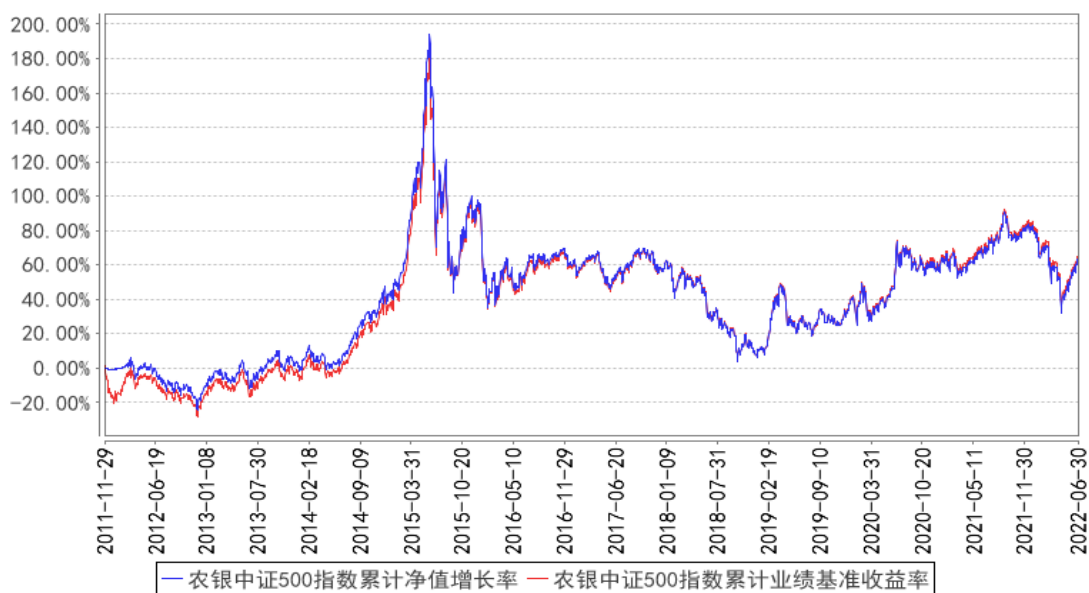
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.40%	1.04%	6.74%	1.05%	0.66%	-0.01%

过去三个月	2.84%	1.65%	1.99%	1.66%	0.85%	-0.01%
过去六个月	-11.14%	1.54%	-11.65%	1.55%	0.51%	-0.01%
过去一年	-4.61%	1.25%	-4.84%	1.26%	0.23%	-0.01%
过去三年	28.28%	1.28%	29.11%	1.28%	-0.83%	0.00%
自基金合同生效起至今	62.45%	1.52%	63.67%	1.55%	-1.22%	-0.03%

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

农银中证500指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 67 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月定期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、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金及农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金的基金经理	2014 年 2 月 10 日	-	14 年	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

注：注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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 0.0232%，日均偏离度为 0.0150%，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 1.6245 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.14%，业绩比较基准收益率为-11.65%。

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其适用性的情况、

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,822,953.56	2,378,998.19
结算备付金		6,821.78	2,093.30
存出保证金		1,909.12	4,295.51
交易性金融资产	6.4.7.2	57,378,231.75	60,979,432.60
其中：股票投资		56,771,497.78	59,979,232.60
基金投资		-	-
债券投资		606,733.97	1,000,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	96,228.58
应收股利		-	-
应收申购款		91,770.60	17,234.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	23,473.75
资产总计		60,301,686.81	63,501,756.87
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		116,763.44	101,658.35
应付管理人报酬		35,289.40	40,016.20
应付托管费		7,057.86	8,003.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	134,385.98	205,251.53
负债合计		293,496.68	354,929.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	36,940,063.65	34,540,284.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,068,126.48	28,606,543.25
净资产合计		60,008,190.13	63,146,827.53
负债和净资产总计		60,301,686.81	63,501,756.87

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6245 元，基金份额总额 36,940,063.65 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-6,411,660.15	5,010,752.83
1. 利息收入		10,385.77	15,580.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,385.77	15,580.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		418,932.41	5,928,716.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-200,661.54	5,349,604.53
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	3,617.49	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	615,976.46	579,112.04
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-6,849,806.97	-960,457.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,828.64	26,913.26
减：二、营业总支出		423,803.59	561,921.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	208,539.07	258,911.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	41,707.75	51,782.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	173,556.77	251,227.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,835,463.74	4,448,831.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,835,463.74	4,448,831.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,835,463.74	4,448,831.77

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53

期末净资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,399,779.37	-	-5,538,416.77	-3,138,637.40
（一）、综合收益总额	-	-	-6,835,463.74	-6,835,463.74
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,399,779.37	-	1,297,046.97	3,696,826.34
其中：1. 基金申购款	5,881,747.39	-	3,458,683.32	9,340,430.71
2. 基金赎回款	-3,481,968.02	-	-2,161,636.35	-5,643,604.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-	-

列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	36,940,063.65	-	23,068,126.48	60,008,190.13
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	48,076,687.77	-	28,777,067.13	76,853,754.90
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	48,076,687.77	-	28,777,067.13	76,853,754.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,933,402.33	-	147,060.43	-6,786,341.90
(一)、综合收益总额	-	-	4,448,831.77	4,448,831.77
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,933,402.33	-	-4,301,771.34	-11,235,173.67
其中: 1. 基金申购	12,118,034.31	-	7,649,427.25	19,767,461.56

款				
2. 基金赎回款	-19,051,436.64	-	-11,951,198.59	-31,002,635.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	41,143,285.44	-	28,924,127.56	70,067,413.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,243.88 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《JiJinMingCheng 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 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日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

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所列内容外,本基金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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会

会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则

1、金融资产和金融负债的分类：

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

3、收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

1、金融资产和金融负债的分类：

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，结合现时情况确定应计提的坏账准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

3、收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

金融工具分类和计量结果

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款, 金额分别为 2,378,998.19 元、2,093.30 元、4,295.51 元、23,473.75 元、96,228.58 元和 17,234.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款, 金额分别为 2,379,500.45 元、2,094.30 元、4,297.51 元、0.00 元、96,228.58 元和 17,234.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 60,979,432.60 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 61,002,401.09 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 101,658.35 元、40,016.20 元、8,003.26 元、

24,878.89 元和 372.64 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 101,658.35 元、40,016.20 元、8,003.26 元、24,878.89 元和 372.64 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,822,953.56
等于：本金	2,822,422.38
加：应计利息	531.18
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,822,953.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	57,037,321.42	-	56,771,497.78	-265,823.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	599,760.00	5,833.97	606,733.97	1,140.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	599,760.00	5,833.97	606,733.97	1,140.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	57,637,081.42	5,833.97	57,378,231.75	-264,683.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金额资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	265.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,654.12
其中：交易所市场	19,654.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	114,466.77
合计	134,385.98

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,540,284.28	34,540,284.28
本期申购	5,881,747.39	5,881,747.39
本期赎回（以“-”号填列）	-3,481,968.02	-3,481,968.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	36,940,063.65	36,940,063.65

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	38,662,389.61	-10,055,846.36	28,606,543.25

本期利润	14,343.23	-6,849,806.97	-6,835,463.74
本期基金份额交易产生的变动数	2,682,802.66	-1,385,755.69	1,297,046.97
其中：基金申购款	6,575,947.83	-3,117,264.51	3,458,683.32
基金赎回款	-3,893,145.17	1,731,508.82	-2,161,636.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,359,535.50	-18,291,409.02	23,068,126.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		10,172.68
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		187.99
其他		25.10
合计		10,385.77

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		10,453,240.19
减：卖出股票成本总额		10,618,526.08
减：交易费用		35,375.65
买卖股票差价收入		-200,661.54

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		4,818.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-1,200.60
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		3,617.49

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,024,300.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,001,200.00
减：应计利息总额	24,300.00
减：交易费用	0.60
买卖债券差价收入	-1,200.60

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	615,976.46
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	615,976.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,849,806.97
股票投资	-6,851,946.97
债券投资	2,140.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-6,849,806.97

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,908.84
基金转换费收入	919.80
合计	8,828.64

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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-
银行费用	90.00
账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	173,556.77

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	208,539.07	258,911.10
其中：支付销售机构的客户维护 费	93,825.86	116,415.52

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	41,707.75	51,782.24

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,822,953.56	10,172.68	4,187,081.95	15,292.05

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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年6月30日	重大事项停牌	9.60	-	-	10,404	118,087.04	99,878.40	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，

对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	606,733.97	1,000,200.00
合计	606,733.97	1,000,200.00

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注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 2022 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	2,822,953.56	-	-	-	2,822,953.56
结算备付金	6,821.78	-	-	-	6,821.78
存出保证金	1,909.12	-	-	-	1,909.12
交易性金融资产	606,733.97	-	-	56,771,497.78	57,378,231.75
应收申购款	-	-	-	91,770.60	91,770.60
资产总计	3,438,418.43	-	-	56,863,268.38	60,301,686.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	116,763.44	116,763.44
应付管理人报酬	-	-	-	35,289.40	35,289.40
应付托管费	-	-	-	7,057.86	7,057.86
其他负债	-	-	-	134,385.98	134,385.98
负债总计	-	-	-	293,496.68	293,496.68
利率敏感度缺口	3,438,418.43	-	-	56,569,771.70	60,008,190.13
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,378,998.19	-	-	-	2,378,998.19
结算备付金	2,093.30	-	-	-	2,093.30
存出保证金	4,295.51	-	-	-	4,295.51
交易性金融资产	1,000,200.00	-	-	59,979,232.60	60,979,432.60
应收证券清算款	-	-	-	96,228.58	96,228.58
应收利息	-	-	-	23,473.75	23,473.75
应收申购款	-	-	-	17,234.94	17,234.94
资产总计	3,385,587.00	-	-	60,116,169.87	63,501,756.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	101,658.35	101,658.35
应付管理人报酬	-	-	-	40,016.20	40,016.20

应付托管费	-	-	-	8,003.26	8,003.26
应付交易费用	-	-	-	24,878.89	24,878.89
其他负债	-	-	-	180,372.64	180,372.64
负债总计	-	-	-	354,929.34	354,929.34
利率敏感度缺口	3,385,587.00	-	-	59,761,240.53	63,146,827.53

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。		
	其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	市场利率平行上升 25个基点	-810.90	-147.08
市场利率平行下降 25个基点	810.90	147.08	

注：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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,771,497.78	94.61	59,979,232.60	94.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	56,771,497.78	94.61	59,979,232.60	94.98

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。		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	2,986,972.14	3,158,265.48
	业绩比较基准下降5%	-2,986,972.14	-3,158,265.48

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	56,671,619.38	59,864,776.60
第二层次	706,612.37	1,114,656.00
第三层次	-	-
合计	57,378,231.75	60,979,432.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	56,771,497.78	94.15
	其中：股票	56,771,497.78	94.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	606,733.97	1.01
	其中：债券	606,733.97	1.01

	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	2,829,775.34	4.69
8	其他各项资产	93,679.72	0.16
9	合计	60,301,686.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	519,182.40	0.87
B	采矿业	2,522,063.96	4.20
C	制造业	33,725,052.73	56.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,753,816.58	2.92
E	建筑业	734,669.50	1.22
F	批发和零售业	2,196,171.92	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,514,187.24	2.52
H	住宿和餐饮业	119,040.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,213,660.04	7.02
J	金融业	5,020,596.55	8.37
K	房地产业	1,341,126.06	2.23
L	租赁和商务服务业	685,495.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	708,665.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	410,810.18	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	134,352.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	755,829.00	1.26
S	综合	416,779.62	0.69
	合计	56,771,497.78	94.61

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	23,600	545,160.00	0.91
2	601615	明阳智能	14,500	490,100.00	0.82
3	600256	广汇能源	39,700	418,438.00	0.70
4	300769	德方纳米	900	367,812.00	0.61
5	600096	云天化	11,100	349,428.00	0.58
6	300012	华测检测	14,500	336,545.00	0.56
7	002497	雅化集团	9,900	323,235.00	0.54
8	002407	多氟多	6,600	322,806.00	0.54
9	300390	天华超净	3,600	314,640.00	0.52
10	002240	盛新锂能	5,200	313,872.00	0.52
11	002180	纳思达	6,100	308,782.00	0.51
12	600157	永泰能源	191,700	304,803.00	0.51
13	600885	宏发股份	7,252	303,496.20	0.51
14	000009	中国宝安	22,220	299,747.80	0.50
15	600141	兴发集团	6,668	293,325.32	0.49
16	300073	当升科技	3,100	280,054.00	0.47
17	002756	永兴材料	1,800	273,978.00	0.46
18	600392	盛和资源	12,110	273,686.00	0.46
19	002384	东山精密	11,800	270,574.00	0.45
20	603613	国联股份	3,045	269,787.00	0.45
21	600418	江淮汽车	15,100	259,116.00	0.43
22	300285	国瓷材料	6,900	247,848.00	0.41
23	600563	法拉电子	1,200	246,192.00	0.41
24	600765	中航重机	7,580	243,924.40	0.41
25	600399	抚顺特钢	13,600	243,440.00	0.41
26	600233	圆通速递	11,900	242,641.00	0.40
27	601555	东吴证券	34,580	239,639.40	0.40
28	601058	赛轮轮胎	21,100	237,797.00	0.40
29	600487	亨通光电	16,300	237,002.00	0.39
30	300037	新宙邦	4,500	236,520.00	0.39
31	000983	山西焦煤	17,650	236,333.50	0.39

32	600499	科达制造	11,400	235,296.00	0.39
33	600732	爱旭股份	7,000	231,140.00	0.39
34	603077	和邦生物	53,140	226,376.40	0.38
35	688180	君实生物	3,000	226,020.00	0.38
36	002385	大北农	28,500	222,585.00	0.37
37	603456	九洲药业	4,300	222,310.00	0.37
38	688122	西部超导	2,400	221,280.00	0.37
39	002268	卫士通	5,140	220,557.40	0.37
40	601108	财通证券	27,900	219,573.00	0.37
41	300363	博腾股份	2,800	218,372.00	0.36
42	603345	安井食品	1,300	218,231.00	0.36
43	600486	扬农化工	1,600	213,248.00	0.36
44	688099	晶晨股份	2,100	212,100.00	0.35
45	000519	中兵红箭	7,229	210,725.35	0.35
46	600298	安琪酵母	4,300	209,625.00	0.35
47	603605	珀莱雅	1,260	208,126.80	0.35
48	000630	铜陵有色	63,600	207,336.00	0.35
49	300144	宋城演艺	13,500	207,225.00	0.35
50	600862	中航高科	7,200	202,320.00	0.34
51	000988	华工科技	8,700	201,579.00	0.34
52	002353	杰瑞股份	5,000	201,500.00	0.34
53	000783	长江证券	33,300	197,469.00	0.33
54	601077	渝农商行	53,200	196,840.00	0.33
55	601168	西部矿业	16,400	194,012.00	0.32
56	002625	光启技术	11,200	193,424.00	0.32
57	601696	中银证券	14,400	191,520.00	0.32
58	300146	汤臣倍健	8,800	190,520.00	0.32
59	601162	天风证券	59,600	189,528.00	0.32
60	002028	思源电气	5,308	189,283.28	0.32
61	300724	捷佳伟创	2,100	187,635.00	0.31
62	002507	涪陵榨菜	5,400	186,408.00	0.31
63	002056	横店东磁	7,000	186,340.00	0.31
64	002797	第一创业	28,900	185,249.00	0.31
65	603517	绝味食品	3,200	185,024.00	0.31
66	600988	赤峰黄金	11,500	183,425.00	0.31
67	688777	中控技术	2,500	181,900.00	0.30
68	603589	口子窖	3,100	181,691.00	0.30
69	000932	华菱钢铁	35,620	181,305.80	0.30
70	002185	华天科技	19,300	181,034.00	0.30
71	601128	常熟银行	23,500	179,540.00	0.30
72	601636	旗滨集团	13,900	177,225.00	0.30
73	688390	固德威	560	175,285.60	0.29

74	002603	以岭药业	7,200	174,960.00	0.29
75	600039	四川路桥	16,600	174,798.00	0.29
76	600521	华海药业	7,700	174,790.00	0.29
77	002326	永太科技	5,300	174,529.00	0.29
78	603026	石大胜华	1,200	174,420.00	0.29
79	601607	上海医药	9,600	173,568.00	0.29
80	600109	国金证券	19,200	172,800.00	0.29
81	000830	鲁西化工	9,900	171,171.00	0.29
82	002078	太阳纸业	13,900	171,109.00	0.29
83	002624	完美世界	11,700	168,129.00	0.28
84	605117	德业股份	600	167,934.00	0.28
85	600546	山煤国际	8,600	167,356.00	0.28
86	600153	建发股份	12,800	167,296.00	0.28
87	603939	益丰药房	3,100	163,773.00	0.27
88	603267	鸿远电子	1,200	161,196.00	0.27
89	002422	科伦药业	8,600	160,820.00	0.27
90	600348	华阳股份	10,400	160,784.00	0.27
91	601872	招商轮船	27,900	160,704.00	0.27
92	000738	航发控制	5,700	160,170.00	0.27
93	000831	五矿稀土	5,100	159,375.00	0.27
94	603127	昭衍新药	1,400	159,320.00	0.27
95	600705	中航产融	46,000	159,160.00	0.27
96	300699	光威复材	2,700	158,949.00	0.26
97	600497	驰宏锌锗	30,600	158,814.00	0.26
98	601990	南京证券	19,000	158,460.00	0.26
99	600177	雅戈尔	23,900	158,457.00	0.26
100	600875	东方电气	9,600	157,920.00	0.26
101	600549	厦门钨业	7,300	157,826.00	0.26
102	000970	中科三环	8,395	157,658.10	0.26
103	300088	长信科技	21,100	156,562.00	0.26
104	603444	吉比特	400	155,200.00	0.26
105	000999	华润三九	3,400	153,000.00	0.25
106	002138	顺络电子	5,600	152,600.00	0.25
107	600160	巨化股份	11,600	152,540.00	0.25
108	600859	王府井	5,840	151,723.20	0.25
109	000998	隆平高科	9,100	151,606.00	0.25
110	002572	索菲亚	5,500	151,250.00	0.25
111	601699	潞安环能	10,300	150,586.00	0.25
112	300676	华大基因	2,100	150,570.00	0.25
113	600516	方大炭素	19,600	148,960.00	0.25
114	002673	西部证券	22,700	148,458.00	0.25
115	000807	云铝股份	15,000	148,200.00	0.25

116	002508	老板电器	4,100	147,723.00	0.25
117	600143	金发科技	15,500	147,560.00	0.25
118	002557	洽洽食品	2,591	147,505.63	0.25
119	000039	中集集团	10,560	146,256.00	0.24
120	600482	中国动力	9,300	146,103.00	0.24
121	002030	达安基因	8,488	145,908.72	0.24
122	601997	贵阳银行	25,100	145,831.00	0.24
123	002273	水晶光电	12,015	145,501.65	0.24
124	000960	锡业股份	8,600	144,222.00	0.24
125	002465	海格通信	15,800	143,622.00	0.24
126	000629	攀钢钒钛	37,000	140,600.00	0.23
127	300357	我武生物	2,700	140,481.00	0.23
128	000728	国元证券	22,500	139,950.00	0.23
129	300136	信维通信	8,300	139,855.00	0.23
130	300058	蓝色光标	21,400	139,742.00	0.23
131	000975	银泰黄金	14,329	139,564.46	0.23
132	600170	上海建工	45,900	139,077.00	0.23
133	002409	雅克科技	2,500	138,775.00	0.23
134	600704	物产中大	26,800	137,484.00	0.23
135	002092	中泰化学	17,700	137,352.00	0.23
136	600536	中国软件	3,380	137,194.20	0.23
137	601577	长沙银行	17,300	137,189.00	0.23
138	603198	迎驾贡酒	2,100	136,794.00	0.23
139	600079	人福医药	8,500	136,000.00	0.23
140	002294	信立泰	4,800	134,880.00	0.22
141	300244	迪安诊断	4,320	134,352.00	0.22
142	600739	辽宁成大	9,200	134,136.00	0.22
143	300558	贝达药业	2,200	133,760.00	0.22
144	300474	景嘉微	1,950	133,360.50	0.22
145	002223	鱼跃医疗	5,189	133,149.74	0.22
146	300418	昆仑万维	8,300	132,800.00	0.22
147	000547	航天发展	11,100	132,534.00	0.22
148	600415	小商品城	23,700	132,009.00	0.22
149	000636	风华高科	7,000	131,530.00	0.22
150	002372	伟星新材	5,460	131,258.40	0.22
151	002739	万达电影	9,600	131,040.00	0.22
152	002506	协鑫集成	35,200	130,944.00	0.22
153	600699	均胜电子	8,300	130,393.00	0.22
154	300253	卫宁健康	14,800	129,944.00	0.22
155	600372	中航电子	6,700	129,913.00	0.22
156	300296	利亚德	17,500	127,750.00	0.21
157	300308	中际旭创	4,100	127,305.00	0.21

158	600637	东方明珠	17,600	125,840.00	0.21
159	002683	广东宏大	4,500	125,235.00	0.21
160	600985	淮北矿业	8,600	125,216.00	0.21
161	600867	通化东宝	12,100	125,114.00	0.21
162	601016	节能风电	26,000	124,800.00	0.21
163	600236	桂冠电力	20,400	124,236.00	0.21
164	000887	中鼎股份	6,800	124,032.00	0.21
165	600315	上海家化	2,900	123,975.00	0.21
166	600026	中远海能	12,000	123,960.00	0.21
167	601198	东兴证券	13,900	123,710.00	0.21
168	002156	通富微电	8,000	123,200.00	0.21
169	002299	圣农发展	6,400	122,752.00	0.20
170	600171	上海贝岭	4,900	122,647.00	0.20
171	002065	东华软件	19,300	121,976.00	0.20
172	600380	健康元	9,872	121,919.20	0.20
173	300832	新产业	2,700	121,797.00	0.20
174	600879	航天电子	18,760	121,752.40	0.20
175	300026	红日药业	15,600	120,120.00	0.20
176	600642	申能股份	21,100	119,848.00	0.20
177	688185	康希诺	600	119,448.00	0.20
178	002408	齐翔腾达	14,712	119,314.32	0.20
179	600258	首旅酒店	4,800	119,040.00	0.20
180	000750	国海证券	32,730	118,809.90	0.20
181	002936	郑州银行	44,155	118,776.95	0.20
182	000623	吉林敖东	8,042	118,699.92	0.20
183	000729	燕京啤酒	12,200	117,852.00	0.20
184	002203	海亮股份	10,200	117,810.00	0.20
185	000878	云南铜业	10,300	117,317.00	0.20
186	000400	许继电气	6,100	117,120.00	0.20
187	600673	东阳光	13,018	117,031.82	0.20
188	600820	隧道股份	19,000	116,280.00	0.19
189	000513	丽珠集团	3,198	115,799.58	0.19
190	601717	郑煤机	8,000	115,280.00	0.19
191	600529	山东药玻	4,100	114,595.00	0.19
192	600369	西南证券	28,700	113,939.00	0.19
193	600580	卧龙电驱	7,900	113,918.00	0.19
194	600801	华新水泥	5,836	113,860.36	0.19
195	002439	启明星辰	5,700	113,601.00	0.19
196	300383	光环新网	10,900	113,578.00	0.19
197	300017	网宿科技	21,100	113,096.00	0.19
198	600038	中直股份	2,500	113,000.00	0.19
199	002131	利欧股份	58,059	112,634.46	0.19

200	600848	上海临港	8,300	112,548.00	0.19
201	002183	怡亚通	15,600	112,476.00	0.19
202	600316	洪都航空	3,700	111,888.00	0.19
203	600166	福田汽车	39,500	111,785.00	0.19
204	002444	巨星科技	5,900	111,156.00	0.19
205	603568	伟明环保	3,324	110,921.88	0.18
206	002958	青农商行	33,400	110,888.00	0.18
207	002195	二三四五	49,130	110,542.50	0.18
208	600027	华电国际	28,100	110,433.00	0.18
209	600325	华发股份	14,558	110,204.06	0.18
210	600909	华安证券	24,220	110,201.00	0.18
211	300618	寒锐钴业	1,900	110,048.00	0.18
212	601005	重庆钢铁	57,600	110,016.00	0.18
213	688256	寒武纪	1,700	109,990.00	0.18
214	600008	首创环保	37,870	109,823.00	0.18
215	300001	特锐德	6,300	109,053.00	0.18
216	300024	机器人	10,700	107,856.00	0.18
217	000825	太钢不锈	19,600	106,820.00	0.18
218	603218	日月股份	4,200	106,680.00	0.18
219	002926	华西证券	13,600	106,624.00	0.18
220	002500	山西证券	18,560	106,534.40	0.18
221	002430	杭氧股份	3,400	106,284.00	0.18
222	000050	深天马 A	10,600	105,682.00	0.18
223	000739	普洛药业	5,100	105,264.00	0.18
224	600271	航天信息	9,600	105,024.00	0.18
225	000027	深圳能源	16,320	104,611.20	0.17
226	002373	千方科技	9,400	104,528.00	0.17
227	002250	联化科技	6,344	103,851.28	0.17
228	688521	芯原股份	2,100	103,740.00	0.17
229	002212	天融信	10,200	103,530.00	0.17
230	600863	内蒙华电	28,200	102,930.00	0.17
231	002985	北摩高科	1,755	102,807.90	0.17
232	600118	中国卫星	5,100	102,408.00	0.17
233	600208	新湖中宝	37,100	102,396.00	0.17
234	601866	中远海发	34,100	102,300.00	0.17
235	603233	大参林	3,260	102,038.00	0.17
236	300677	英科医疗	3,980	100,932.80	0.17
237	688009	中国通号	22,200	100,566.00	0.17
238	300009	安科生物	9,924	100,331.64	0.17
239	002249	大洋电机	16,300	100,082.00	0.17
240	603156	养元饮品	4,400	99,968.00	0.17
241	000060	中金岭南	22,400	99,904.00	0.17

242	002670	国盛金控	10,404	99,878.40	0.17
243	601992	金隅集团	36,000	99,720.00	0.17
244	600066	宇通客车	11,500	99,475.00	0.17
245	000778	新兴铸管	20,600	99,292.00	0.17
246	002152	广电运通	10,700	99,189.00	0.17
247	300182	捷成股份	17,800	97,900.00	0.16
248	603658	安图生物	2,000	97,780.00	0.16
249	300070	碧水源	18,700	97,427.00	0.16
250	000401	冀东水泥	9,200	96,784.00	0.16
251	603858	步长制药	4,900	96,579.00	0.16
252	600998	九州通	8,100	96,471.00	0.16
253	002831	裕同科技	3,260	96,333.00	0.16
254	600056	中国医药	6,500	96,330.00	0.16
255	002966	苏州银行	15,780	96,258.00	0.16
256	002191	劲嘉股份	8,900	95,408.00	0.16
257	300168	万达信息	10,100	95,344.00	0.16
258	600390	五矿资本	19,400	94,866.00	0.16
259	300251	光线传媒	10,000	94,700.00	0.16
260	002128	电投能源	6,600	94,512.00	0.16
261	600970	中材国际	9,750	94,477.50	0.16
262	000021	深科技	8,109	94,388.76	0.16
263	000997	新大陆	7,100	93,791.00	0.16
264	600667	太极实业	12,700	93,726.00	0.16
265	002505	鹏都农牧	27,530	93,326.70	0.16
266	300482	万孚生物	2,290	93,225.90	0.16
267	002221	东华能源	10,006	93,155.86	0.16
268	600528	中铁工业	11,500	92,575.00	0.15
269	688188	柏楚电子	420	92,416.80	0.15
270	600021	上海电力	9,000	92,250.00	0.15
271	000656	金科股份	32,200	92,092.00	0.15
272	600839	四川长虹	31,900	91,872.00	0.15
273	603885	吉祥航空	5,100	91,749.00	0.15
274	002244	滨江集团	10,600	91,690.00	0.15
275	000987	越秀金控	13,025	91,565.75	0.15
276	688002	睿创微纳	2,300	91,356.00	0.15
277	600297	广汇汽车	35,000	91,350.00	0.15
278	600827	百联股份	6,900	91,149.00	0.15
279	600062	华润双鹤	3,552	91,144.32	0.15
280	002396	星网锐捷	4,000	90,560.00	0.15
281	002127	南极电商	16,900	90,246.00	0.15
282	603707	健友股份	3,200	90,240.00	0.15
283	600598	北大荒	6,100	90,036.00	0.15

284	002019	亿帆医药	6,400	89,472.00	0.15
285	600155	华创阳安	10,500	89,040.00	0.15
286	002155	湖南黄金	7,300	88,622.00	0.15
287	600511	国药股份	3,300	88,374.00	0.15
288	600498	烽火通信	6,100	88,328.00	0.15
289	002266	浙富控股	18,430	88,279.70	0.15
290	000012	南玻 A	11,895	88,260.90	0.15
291	600201	生物股份	9,590	87,844.40	0.15
292	000930	中粮科技	9,700	87,688.00	0.15
293	600409	三友化工	10,700	87,633.00	0.15
294	000883	湖北能源	17,000	86,870.00	0.14
295	002153	石基信息	5,460	86,650.20	0.14
296	600718	东软集团	7,500	86,325.00	0.14
297	600259	广晟有色	1,700	86,105.00	0.14
298	002124	天邦食品	12,720	85,478.40	0.14
299	600755	厦门国贸	11,368	85,260.00	0.14
300	002511	中顺洁柔	6,800	85,136.00	0.14
301	603712	七一二	2,700	85,050.00	0.14
302	600060	海信视像	6,800	85,000.00	0.14
303	000686	东北证券	12,100	84,579.00	0.14
304	600566	济川药业	3,100	84,196.00	0.14
305	600959	江苏有线	25,800	84,108.00	0.14
306	600282	南钢股份	26,500	83,475.00	0.14
307	600895	张江高科	6,700	83,415.00	0.14
308	600782	新钢股份	16,500	83,160.00	0.14
309	601179	中国西电	17,700	82,836.00	0.14
310	000581	威孚高科	4,300	82,775.00	0.14
311	601880	辽港股份	48,690	82,773.00	0.14
312	000709	河钢股份	36,600	82,716.00	0.14
313	600064	南京高科	7,500	82,500.00	0.14
314	000690	宝新能源	18,800	82,344.00	0.14
315	600022	山东钢铁	47,250	82,215.00	0.14
316	600535	天士力	7,800	81,978.00	0.14
317	002939	长城证券	8,000	81,280.00	0.14
318	300376	易事特	10,000	81,200.00	0.14
319	601778	晶科科技	15,000	81,000.00	0.13
320	002701	奥瑞金	15,532	80,766.40	0.13
321	300630	普利制药	2,277	80,036.55	0.13
322	002002	鸿达兴业	21,500	79,765.00	0.13
323	600500	中化国际	11,913	79,221.45	0.13
324	600808	马钢股份	20,900	79,211.00	0.13
325	000598	兴蓉环境	15,500	79,205.00	0.13

326	600216	浙江医药	5,800	79,170.00	0.13
327	600037	歌华有线	8,400	78,876.00	0.13
328	600663	陆家嘴	7,600	78,736.00	0.13
329	002468	申通快递	6,600	78,672.00	0.13
330	002532	天山铝业	12,000	78,360.00	0.13
331	002595	豪迈科技	3,500	78,190.00	0.13
332	600728	佳都科技	12,100	78,166.00	0.13
333	600567	山鹰国际	27,900	77,283.00	0.13
334	688006	杭可科技	1,100	77,066.00	0.13
335	600517	国网英大	14,800	76,812.00	0.13
336	002004	华邦健康	13,665	76,250.70	0.13
337	601456	国联证券	6,200	76,074.00	0.13
338	300463	迈克生物	3,700	75,813.00	0.13
339	688208	道通科技	2,300	75,716.00	0.13
340	603225	新风鸣	6,556	75,656.24	0.13
341	603866	桃李面包	4,558	75,434.90	0.13
342	002745	木林森	7,700	75,229.00	0.13
343	000785	居然之家	16,900	75,205.00	0.13
344	300115	长盈精密	7,264	74,891.84	0.12
345	002429	兆驰股份	19,500	74,880.00	0.12
346	600597	光明乳业	5,900	74,517.00	0.12
347	601958	金钼股份	8,400	74,256.00	0.12
348	300166	东方国信	7,979	73,566.38	0.12
349	688289	圣湘生物	2,480	73,432.80	0.12
350	300888	稳健医疗	1,100	73,150.00	0.12
351	601106	中国一重	23,700	72,759.00	0.12
352	603927	中科软	3,120	72,758.40	0.12
353	601860	紫金银行	25,200	72,324.00	0.12
354	300072	海新能科	14,200	71,852.00	0.12
355	002390	信邦制药	10,350	71,518.50	0.12
356	600398	海澜之家	14,900	70,775.00	0.12
357	600507	方大特钢	10,105	70,633.95	0.12
358	601718	际华集团	22,700	70,370.00	0.12
359	600572	康恩贝	15,865	70,281.95	0.12
360	000540	中天金融	36,300	70,059.00	0.12
361	601118	海南橡胶	14,500	69,310.00	0.12
362	600737	中粮糖业	9,100	68,432.00	0.11
363	000559	万向钱潮	11,400	67,716.00	0.11
364	600967	内蒙一机	7,400	67,488.00	0.11
365	002048	宁波华翔	4,200	67,284.00	0.11
366	000089	深圳机场	8,700	67,164.00	0.11
367	000937	冀中能源	9,000	67,140.00	0.11

368	002690	美亚光电	3,090	66,991.20	0.11
369	603883	老百姓	1,976	66,946.88	0.11
370	600582	天地科技	14,000	66,920.00	0.11
371	002368	太极股份	3,470	66,658.70	0.11
372	000898	鞍钢股份	20,700	66,654.00	0.11
373	001914	招商积余	3,700	66,489.00	0.11
374	600871	石化油服	35,100	66,339.00	0.11
375	601000	唐山港	25,526	65,857.08	0.11
376	600435	北方导航	7,600	65,512.00	0.11
377	600195	中牧股份	5,287	64,818.62	0.11
378	601568	北元集团	10,140	64,287.60	0.11
379	000959	首钢股份	13,500	64,260.00	0.11
380	002110	三钢闽光	10,550	64,249.50	0.11
381	002281	光迅科技	3,649	64,149.42	0.11
382	601333	广深铁路	29,300	63,874.00	0.11
383	002705	新宝股份	2,900	63,771.00	0.11
384	600556	天下秀	7,700	63,371.00	0.11
385	600764	中国海防	2,500	63,100.00	0.11
386	000156	华数传媒	7,900	62,963.00	0.10
387	002233	塔牌集团	7,100	62,835.00	0.10
388	600811	东方集团	22,130	62,627.90	0.10
389	002010	传化智联	9,700	62,371.00	0.10
390	000537	广宇发展	4,800	62,352.00	0.10
391	003035	南网能源	9,800	62,230.00	0.10
392	002174	游族网络	6,300	61,551.00	0.10
393	600329	达仁堂	2,500	61,450.00	0.10
394	000402	金融街	10,300	61,285.00	0.10
395	688029	南微医学	700	61,040.00	0.10
396	300212	易华录	3,480	60,552.00	0.10
397	688321	微芯生物	2,400	60,456.00	0.10
398	600120	浙江东方	15,023	60,242.23	0.10
399	600126	杭钢股份	11,690	59,852.80	0.10
400	000488	晨鸣纸业	10,600	59,784.00	0.10
401	603638	艾迪精密	2,900	59,450.00	0.10
402	600167	联美控股	7,930	59,395.70	0.10
403	600446	金证股份	5,700	59,166.00	0.10
404	000990	诚志股份	5,400	59,130.00	0.10
405	002867	周大生	3,800	59,014.00	0.10
406	000685	中山公用	7,676	58,951.68	0.10
407	002416	爱施德	6,320	58,776.00	0.10
408	002925	盈趣科技	2,720	58,534.40	0.10
409	601200	上海环境	5,760	58,521.60	0.10

410	002081	金螳螂	11,500	58,420.00	0.10
411	600373	中文传媒	5,800	57,942.00	0.10
412	601611	中国核建	6,900	57,891.00	0.10
413	601098	中南传媒	6,100	57,584.00	0.10
414	002382	蓝帆医疗	6,000	57,300.00	0.10
415	001965	招商公路	7,500	57,225.00	0.10
416	600707	彩虹股份	12,200	57,096.00	0.10
417	000158	常山北明	9,514	57,084.00	0.10
418	002146	荣盛发展	18,800	56,964.00	0.09
419	601608	中信重工	15,000	56,850.00	0.09
420	603317	天味食品	1,986	56,541.42	0.09
421	002387	维信诺	8,400	56,448.00	0.09
422	002399	海普瑞	3,200	56,256.00	0.09
423	600095	湘财股份	7,300	56,137.00	0.09
424	000967	盈峰环境	11,000	55,660.00	0.09
425	600131	国网信通	4,100	55,145.00	0.09
426	002948	青岛银行	15,230	55,132.60	0.09
427	600376	首开股份	11,100	54,501.00	0.09
428	000528	柳工	8,320	54,163.20	0.09
429	603000	人民网	4,800	53,760.00	0.09
430	688088	虹软科技	1,700	53,703.00	0.09
431	002423	中粮资本	8,000	53,680.00	0.09
432	601187	厦门银行	9,000	53,640.00	0.09
433	600623	华谊集团	6,400	53,120.00	0.09
434	600901	江苏租赁	10,300	52,839.00	0.09
435	000563	陕国投 A	16,766	52,309.92	0.09
436	601991	大唐发电	21,400	52,002.00	0.09
437	601598	中国外运	13,400	51,992.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	26,600	51,604.00	0.09
439	600006	东风汽车	6,800	51,340.00	0.09
440	603228	景旺电子	2,194	51,186.02	0.09
441	300257	开山股份	3,400	50,864.00	0.08
442	600906	财达证券	5,500	49,445.00	0.08
443	000961	中南建设	16,200	49,410.00	0.08
444	600717	天津港	12,316	49,387.16	0.08
445	603650	彤程新材	1,500	48,870.00	0.08
446	002434	万里扬	5,600	47,880.00	0.08
447	002242	九阳股份	2,600	47,736.00	0.08
448	000718	苏宁环球	12,900	47,472.00	0.08
449	601928	凤凰传媒	6,500	46,475.00	0.08
450	000671	阳光城	21,100	46,209.00	0.08
451	000553	安道麦 A	3,800	46,018.00	0.08

452	000415	渤海租赁	21,000	45,570.00	0.08
453	601969	海南矿业	5,200	44,668.00	0.07
454	600968	海油发展	17,200	44,376.00	0.07
455	000031	大悦城	10,900	43,600.00	0.07
456	600648	外高桥	3,200	43,520.00	0.07
457	600787	中储股份	7,600	43,244.00	0.07
458	600928	西安银行	11,300	41,471.00	0.07
459	600339	中油工程	14,200	41,038.00	0.07
460	002563	森马服饰	6,900	40,848.00	0.07
461	000028	国药一致	1,332	39,680.28	0.07
462	300869	康泰医学	1,400	39,564.00	0.07
463	601228	广州港	10,500	38,535.00	0.06
464	600835	上海机电	2,800	38,444.00	0.06
465	002815	崇达技术	3,000	38,430.00	0.06
466	688819	天能股份	1,100	38,038.00	0.06
467	600377	宁沪高速	4,300	36,851.00	0.06
468	603056	德邦股份	2,700	36,261.00	0.06
469	000717	韶钢松山	10,300	36,050.00	0.06
470	000869	张裕 A	1,200	35,688.00	0.06
471	603379	三美股份	1,580	35,155.00	0.06
472	002945	华林证券	2,300	35,075.00	0.06
473	601139	深圳燃气	5,000	34,700.00	0.06
474	000062	深圳华强	2,710	34,417.00	0.06
475	601869	长飞光纤	1,100	34,012.00	0.06
476	600299	安迪苏	3,500	33,530.00	0.06
477	601298	青岛港	5,900	32,273.00	0.05
478	001872	招商港口	2,000	31,200.00	0.05
479	002653	海思科	1,900	30,609.00	0.05
480	300741	华宝股份	1,100	30,602.00	0.05
481	603868	飞科电器	400	30,300.00	0.05
482	601156	东航物流	1,500	29,700.00	0.05
483	600823	世茂股份	9,800	29,204.00	0.05
484	600927	永安期货	1,400	28,238.00	0.05
485	601828	美凯龙	4,600	27,876.00	0.05
486	600350	山东高速	5,300	27,825.00	0.05
487	001227	兰州银行	5,500	27,060.00	0.05
488	603786	科博达	400	24,628.00	0.04
489	603355	莱克电气	960	24,220.80	0.04
490	001203	大中矿业	2,000	22,600.00	0.04
491	603515	欧普照明	1,280	22,336.00	0.04
492	601665	齐鲁银行	4,500	21,960.00	0.04
493	603719	良品铺子	700	20,041.00	0.03

494	002946	新乳业	1,500	19,485.00	0.03
495	601003	柳钢股份	4,300	17,415.00	0.03
496	002901	大博医疗	400	15,656.00	0.03
497	600956	新天绿能	1,200	14,784.00	0.02
498	603983	丸美股份	500	13,400.00	0.02
499	600917	重庆燃气	1,500	10,830.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

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	300769	德方纳米	351,249.00	0.56
2	600096	云天化	335,563.00	0.53
3	300012	华测检测	332,804.00	0.53
4	002497	雅化集团	327,289.00	0.52
5	002240	盛新锂能	319,305.00	0.51
6	300390	天华超净	273,078.00	0.43
7	002407	多氟多	265,265.00	0.42
8	688180	君实生物	258,312.00	0.41
9	002756	永兴材料	257,662.00	0.41
10	300073	当升科技	249,057.00	0.39
11	601058	赛轮轮胎	233,455.00	0.37
12	601108	财通证券	218,959.00	0.35
13	688122	西部超导	217,844.77	0.34
14	000783	长江证券	200,756.00	0.32
15	600499	科达制造	200,073.00	0.32
16	688777	中控技术	199,937.13	0.32
17	601162	天风证券	189,709.00	0.30
18	601696	中银证券	187,507.00	0.30
19	603345	安井食品	183,048.00	0.29
20	002625	光启技术	180,117.00	0.29

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	000733	振华科技	383,322.00	0.61
2	002340	格林美	359,415.72	0.57
3	600188	兖矿能源	343,401.00	0.54

4	601117	中国化学	293,788.00	0.47
5	000723	美锦能源	288,206.00	0.46
6	600884	杉杉股份	255,545.90	0.40
7	300751	迈为股份	245,325.00	0.39
8	300763	锦浪科技	243,269.00	0.39
9	605358	立昂微	241,896.24	0.38
10	688005	容百科技	240,446.60	0.38
11	002013	中航机电	223,273.00	0.35
12	601689	拓普集团	219,297.50	0.35
13	600754	锦江酒店	211,686.00	0.34
14	300223	北京君正	176,236.00	0.28
15	688536	思瑞浦	166,032.00	0.26
16	600733	北汽蓝谷	158,180.00	0.25
17	002080	中材科技	148,852.00	0.24
18	600803	新奥股份	145,144.00	0.23
19	603290	斯达半导	136,099.00	0.22
20	601975	招商南油	124,839.00	0.20

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	14,262,738.23
卖出股票收入（成交）总额	10,453,240.19

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	606,733.97	1.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	606,733.97	1.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	6,000	606,733.97	1.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,909.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	91,770.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	93,679.72

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,945	7,470.18	297,367.97	0.81	36,642,695.68	99.19

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	87.68	0.0002

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：1、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	34,540,284.28
本报告期基金总申购份额	5,881,747.39
减：本报告期基金总赎回份额	3,481,968.02

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,940,063.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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 (%)	
高华证券	2	12,611,108.12	51.20	11,745.37	51.20	-
国信证券	2	12,017,978.00	48.80	11,192.79	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 (%)
高华证券	599,760.00	100.00	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 01 月 21 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2021 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 03 月 29 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 04 月 21 日
4	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	2022 年 06 月 29 日
5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2022 年 1 号	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 06 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

2022 年 8 月 30 日