

农银汇理沪深 300 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
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.....	54
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.....	54
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.....	54

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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
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	57
§ 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	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 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	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	农银沪深 300 指数	
基金主代码	660008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 4 月 12 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	296,005,805.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	660008	005152
报告期末下属分级基金的份额总额	292,342,334.94 份	3,663,470.55 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105799
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银	北京市西城区复兴门内大街 55

	城路 9 号 50 层	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	许金超	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
本期已实现收益	75,450.29	-11,679.55
本期利润	-39,500,608.17	229,354.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1358	0.0928
本期加权平均净值利润率	-8.69%	6.25%
本期基金份额净值增长率	-7.99%	-8.17%
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	2,207,014.24
	期末可供分配基金份额利润	0.6024
	期末基金资产净值	5,870,484.79

期末基金份额净值	1.6271	1.6024
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	62.71%	44.06%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.81%	1.01%	9.12%	1.02%	0.69%	-0.01%
过去三个月	6.70%	1.36%	5.93%	1.36%	0.77%	0.00%
过去六个月	-7.99%	1.38%	-8.72%	1.38%	0.73%	0.00%
过去一年	-11.76%	1.18%	-13.40%	1.18%	1.64%	0.00%
过去三年	24.08%	1.20%	16.68%	1.20%	7.40%	0.00%
自基金合同生效起至今	62.71%	1.36%	34.52%	1.35%	28.19%	0.01%

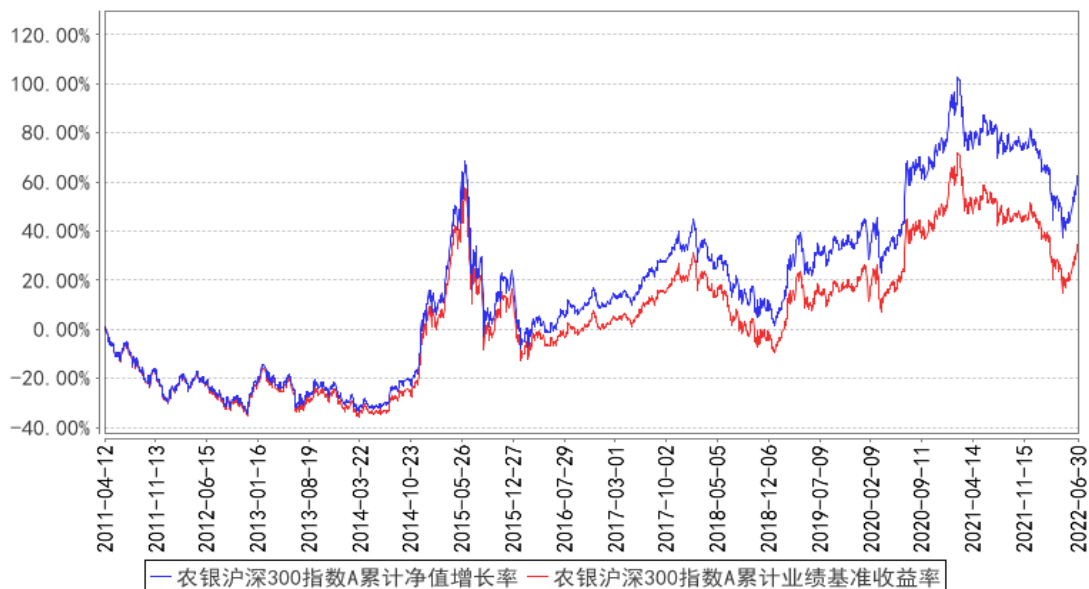
农银沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

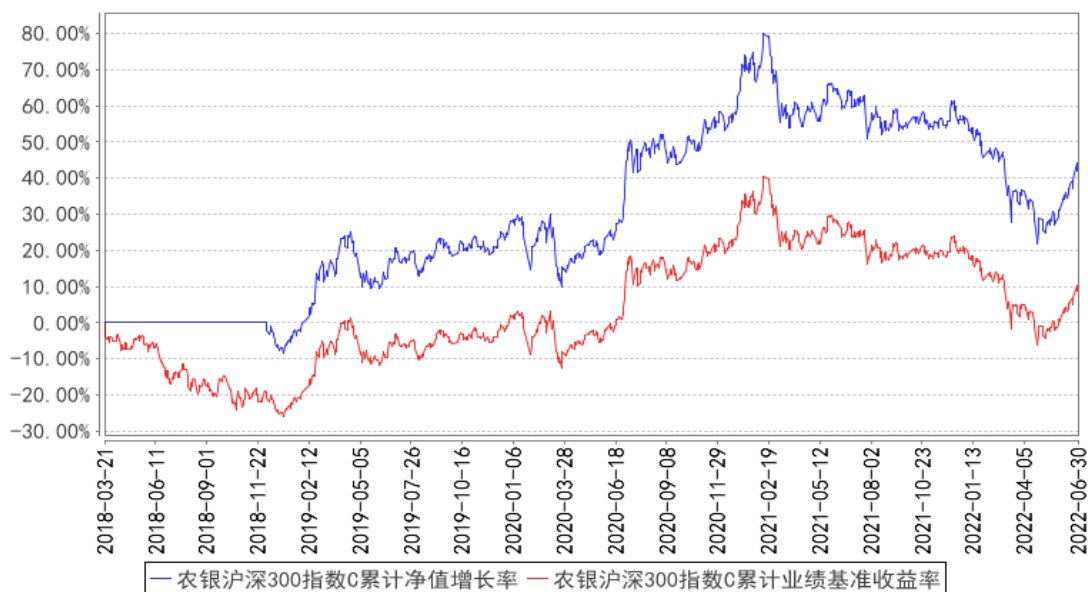
	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	9.77%	1.01%	9.12%	1.02%	0.65%	-0.01%
过去三个月	6.60%	1.36%	5.93%	1.36%	0.67%	0.00%
过去六个月	-8.17%	1.38%	-8.72%	1.38%	0.55%	0.00%
过去一年	-12.12%	1.18%	-13.40%	1.18%	1.28%	0.00%
过去三年	22.56%	1.20%	16.68%	1.20%	5.88%	0.00%
自基金合同生效 起至今	44.06%	1.13%	10.00%	1.26%	34.06%	-0.13%

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

农银沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 4 月 12 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 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	2012 年 8 月 3 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：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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0226%，日均偏离度为 0.0140%，符合基金合同约定规定的日均偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制不超过 4%。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；

4) 指数中成份股票的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.6271 元,本报告期基金份额净值增长率为-7.99%;截至本报告期末农银沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.6024 元,本报告期基金份额净值增长率为-8.17%;同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动化指数产品,我们将坚持指数被动化投资理念,运用定量分析技术,减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击,把基金的跟踪误差控制在较低的水平,从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》(证监会计字[2007]15 号)、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13 号)等文件,本公司制订了证券投资基金估值政策和程序,并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期本基金不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：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	19,676,985.43	27,737,002.30
结算备付金		26,329.11	5,973.98
存出保证金		16,210.40	12,409.84
交易性金融资产	6.4.7.2	464,946,969.49	481,282,927.93
其中：股票投资		456,815,271.96	481,282,927.93

基金投资		-	-
债券投资		8,131,697.53	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		48,323.10	44,313.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,658.36
资产总计		484,714,817.53	509,085,286.22
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2022年6月30日	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		42.70	523,618.43
应付赎回款		2,674,933.02	724,293.21
应付管理人报酬		226,736.60	259,280.26
应付托管费		56,684.15	64,820.07
应付销售服务费		1,830.80	205.20
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	204,620.33	352,848.02
负债合计		3,164,847.60	1,925,065.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	296,005,805.49	286,801,541.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	185,544,164.44	220,358,679.12
净资产合计		481,549,969.93	507,160,221.03
负债和净资产总计		484,714,817.53	509,085,286.22

注：本基金为分级基金，报告截止日 2022 年 6 月 30 日，农银沪深 300 指数 A 基金份额净值 1.6271 元，基金份额总额 292,342,334.94 份；农银沪深 300 指数 C 基金份额净值 1.6024 元，基金份额总额 3,663,470.55 份。农银沪深 300 指数份额总额合计为 296,005,805.49 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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		-37,358,457.32	12,599,459.23
1. 利息收入		36,810.28	58,708.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	36,810.28	58,708.52
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）		1,905,907.00	58,054,284.16
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,515,147.95	53,977,802.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	52,542.06	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,368,512.89	4,076,481.88
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	-39,335,024.45	-45,655,019.09
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	33,849.85	141,485.64
减：二、营业总支出		1,912,796.39	2,796,980.49

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,364,611.58	1,734,574.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	341,152.88	433,643.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,185.15	1,990.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		398.63	-
其中：卖出回购金融资产支出		398.63	-
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	199,448.15	626,771.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-39,271,253.71	9,802,478.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-39,271,253.71	9,802,478.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-39,271,253.71	9,802,478.74

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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、上期期末净资产（基金净值）	286,801,541.91	-	220,358,679.12	507,160,221.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	286,801,541.91	-	220,358,679.12	507,160,221.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号	9,204,263.58	-	-34,814,514.68	-25,610,251.10

填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-39,271,253.71	-39,271,253.71
(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)	9,204,263.58	-	4,456,739.03	13,661,002.61
其中：1. 基金申购款	39,147,008.65	-	21,538,105.89	60,685,114.54
2. 基金赎回款	-29,942,745.07	-	-17,081,366.86	-47,024,111.93
(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)	296,005,805.49	-	185,544,164.44	481,549,969.93
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)	360,689,323.44	-	297,997,043.75	658,686,367.19

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）	360,689,323.44	-	297,997,043.75	658,686,367.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-55,704,402.21	-	-40,602,958.99	-96,307,361.20
（一）、综合收益总额	-	-	9,802,478.74	9,802,478.74
（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）	-55,704,402.21	-	-50,405,437.73	-106,109,839.94
其中：1. 基金申购款	57,350,444.29	-	49,004,757.29	106,355,201.58
2. 基金赎回款	-113,054,846.50	-	-99,410,195.02	-212,465,041.52
（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）	304,984,921.23	-	257,394,084.76	562,379,005.99

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

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 125 号《关于核准农银汇理沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,296,561,559.84 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 123 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,297,550,055.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 988,495.60 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。其中:股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,其中投资于标的指数成份股的比例

不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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

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商业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商业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、应收利息和应收申购款，金额分别为 27,737,002.30 元、5,973.98 元、12,409.84 元、2,658.36 元和 44,313.81 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-应收利息和应收申购款，金额分别为 27,739,652.36 元、5,976.68 元、12,415.44 元、0.00 元和 44,313.81 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 481,282,927.93 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 481,282,927.93 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 523,618.43 元、724,293.21 元、259,280.26 元、64,820.07 元、205.20 元、121,742.35 元和 51,105.67 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、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 523,618.43 元、724,293.21 元、259,280.26 元、64,820.07 元、205.20 元、121,742.35 元和 51,105.67 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在

“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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	19,676,985.43
等于：本金	19,675,421.47
加：应计利息	1,563.96
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	19,676,985.43

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	379,215,923.63	-	456,815,271.96	77,599,348.33

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,009,600.00	119,697.53	8,131,697.53	2,400.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,009,600.00	119,697.53	8,131,697.53	2,400.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	387,225,523.63	119,697.53	464,946,969.49	77,601,748.33	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

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	6,579.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	58,780.75
其中：交易所市场	58,780.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	50,000.00
合计	204,620.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A

项目	本期 -	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	286,472,818.02	286,472,818.02
本期申购	35,103,730.67	35,103,730.67
本期赎回（以“-”号填列）	-29,234,213.75	-29,234,213.75
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	292,342,334.94	292,342,334.94

农银沪深 300 指数 C

项目	本期
----	----

	-	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	328,723.89	328,723.89
本期申购	4,043,277.98	4,043,277.98
本期赎回 (以“-”号填列)	-708,531.32	-708,531.32
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	3,663,470.55	3,663,470.55

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

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	272,671,487.93	-52,557,681.95	220,113,805.98
本期利润	75,450.29	-39,576,058.46	-39,500,608.17
本期基金份额交易产生的变动数	5,611,064.94	-2,887,112.55	2,723,952.39
其中：基金申购款	33,445,678.58	-13,995,905.71	19,449,772.87
基金赎回款	-27,834,613.64	11,108,793.16	-16,725,820.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	278,358,003.16	-95,020,852.96	183,337,150.20

农银沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	304,663.64	-59,790.50	244,873.14
本期利润	-11,679.55	241,034.01	229,354.46
本期基金份额交易产生的变动数	3,092,553.11	-1,359,766.47	1,732,786.64
其中：基金申购款	3,748,928.62	-1,660,595.60	2,088,333.02
基金赎回款	-656,375.51	300,829.13	-355,546.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,385,537.20	-1,178,522.96	2,207,014.24

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

6.4.7.13 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	35,569.13
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	1,110.37
其他	130.78
合计	36,810.28

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	40,093,079.06
减：卖出股票成本总额	42,463,160.35
减：交易费用	145,066.66
买卖股票差价收入	-2,515,147.95

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	52,550.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-8.08
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	52,542.06

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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	8.08
买卖债券差价收入	-8.08

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期末无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内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贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	4,368,512.89
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	4,368,512.89

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	-39,335,024.45
股票投资	-39,337,424.45
债券投资	2,400.00
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	-39,335,024.45

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	32,958.65
基金转换费收入	891.20
合计	33,849.85

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,188.00
账户维护费	9,000.00

指数使用费	100,000.00
合计	199,448.15

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

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	1,364,611.58	1,734,574.72
其中：支付销售机构的客户维护 费	547,207.96	694,952.98

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	341,152.88	433,643.71

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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
工商银行	19,676,985.43	35,569.13	31,687,636.64	57,740.26

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(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**

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	受限期	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
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	创业板锁定	42.50	32.02	442	14,450.00	14,152.84	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	创业板锁定	50.31	70.37	259	13,030.29	18,225.83	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	创业板锁定	37.23	25.39	372	13,849.56	9,445.08	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	创业板锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	创业板锁定	76.56	51.92	235	17,991.60	12,201.20	-

		日								
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	创业板 锁定	72.69	71.54	247	17,954.43	17,670.38	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	创业板 锁定	109.30	45.69	287	20,876.30	13,113.03	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	创业板 锁定	17.27	14.83	1,251	21,604.77	18,552.33	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	创业板 锁定	173.98	87.82	151	14,614.32	13,260.82	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	创业板 锁定	39.30	37.93	311	12,222.30	11,796.23	-

注：受限期是指证券的总限售期。数量包含受限期内送股数量，送股部分成本为零。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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	8,131,697.53	-
合计	8,131,697.53	-

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	19,676,985.43	-	-	-	19,676,985.43
结算备付金	26,329.11	-	-	-	26,329.11
存出保证金	16,210.40	-	-	-	16,210.40
交易性金融资产	8,131,697.53	-	-	-456,815,271.96	464,946,969.49
应收申购款	-	-	-	48,323.10	48,323.10
资产总计	27,851,222.47	-	-	-456,863,595.06	484,714,817.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,674,933.02	2,674,933.02
应付管理人报酬	-	-	-	226,736.60	226,736.60
应付托管费	-	-	-	56,684.15	56,684.15
应付清算款	-	-	-	42.70	42.70
应付销售服务费	-	-	-	1,830.80	1,830.80
其他负债	-	-	-	204,620.33	204,620.33

负债总计	-	-	-	3,164,847.60	3,164,847.60
利率敏感度缺口	27,851,222.47	-	-	-453,698,747.46	481,549,969.93
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	27,737,002.30	-	-	-	27,737,002.30
结算备付金	5,973.98	-	-	-	5,973.98
存出保证金	12,409.84	-	-	-	12,409.84
交易性金融资产	-	-	-	-481,282,927.93	481,282,927.93
应收利息	-	-	-	2,658.36	2,658.36
应收申购款	-	-	-	44,313.81	44,313.81
资产总计	27,755,386.12	-	-	-481,329,900.10	509,085,286.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	523,618.43	523,618.43
应付赎回款	-	-	-	724,293.21	724,293.21
应付管理人报酬	-	-	-	259,280.26	259,280.26
应付托管费	-	-	-	64,820.07	64,820.07
应付销售服务费	-	-	-	205.20	205.20
应付交易费用	-	-	-	121,742.35	121,742.35
其他负债	-	-	-	231,105.67	231,105.67
负债总计	-	-	-	1,925,065.19	1,925,065.19
利率敏感度缺口	27,755,386.12	-	-	-479,404,834.91	507,160,221.03

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	-6,645.63	-
市场利率平行下降 25 个基点	6,645.63	-	

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	456,815,271.96	94.86	481,282,927.93	94.90
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	456,815,271.96	94.86	481,282,927.93	94.90

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%	24,001,274.86	25,279,507.11
	业绩比较基准下降 5%	-24,001,274.86	-25,279,507.11

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	456,677,919.32	479,090,340.46
第二层次	8,131,697.53	5,504.49
第三层次	137,352.64	2,187,082.98
合计	464,946,969.49	481,282,927.93

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	456,815,271.96	94.24
	其中：股票	456,815,271.96	94.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,131,697.53	1.68
	其中：债券	8,131,697.53	1.68
	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	19,703,314.54	4.06
8	其他各项资产	64,533.50	0.01
9	合计	484,714,817.53	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	5,547,658.60	1.15
B	采矿业	13,192,313.12	2.74
C	制造业	271,236,326.76	56.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,500,428.38	2.39
E	建筑业	8,925,206.16	1.85
F	批发和零售业	1,170,377.24	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	12,133,633.89	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,999,823.66	2.91
J	金融业	92,212,925.64	19.15
K	房地产业	8,560,366.31	1.78

L	租赁和商务服务业	6,433,271.35	1.34
M	科学研究和技术服务业	6,975,635.56	1.45
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	234,495.00	0.05
Q	卫生和社会工作	4,000,681.17	0.83
R	文化、体育和娱乐业	545,436.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	456,668,578.84	94.83

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	120,744.05	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	11,796.23	0.00
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	14,152.84	0.00

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	146,693.12	0.03

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	13,646	27,906,070.00	5.80
2	300750	宁德时代	30,500	16,287,000.00	3.38
3	600036	招商银行	268,873	11,346,440.60	2.36
4	601318	中国平安	235,438	10,992,600.22	2.28
5	601012	隆基绿能	131,717	8,776,303.71	1.82
6	000858	五粮液	42,242	8,529,927.06	1.77
7	002594	比亚迪	19,658	6,555,746.42	1.36
8	000333	美的集团	106,482	6,430,447.98	1.34
9	601166	兴业银行	315,959	6,287,584.10	1.31
10	300059	东方财富	229,764	5,836,005.60	1.21
11	600900	长江电力	247,275	5,716,998.00	1.19
12	601888	中国中免	21,252	4,950,228.36	1.03
13	601328	交通银行	988,410	4,922,281.80	1.02
14	603259	药明康德	44,644	4,642,529.56	0.96
15	600030	中信证券	212,165	4,595,493.90	0.95
16	600887	伊利股份	111,244	4,332,953.80	0.90
17	000568	泸州老窖	16,020	3,949,570.80	0.82
18	002415	海康威视	102,550	3,712,310.00	0.77
19	002475	立讯精密	107,840	3,643,913.60	0.76
20	600276	恒瑞医药	97,026	3,598,694.34	0.75
21	600438	通威股份	58,700	3,513,782.00	0.73
22	000651	格力电器	102,806	3,466,618.32	0.72
23	601988	中国银行	1,054,005	3,436,056.30	0.71
24	600809	山西汾酒	10,440	3,390,912.00	0.70
25	300760	迈瑞医疗	10,600	3,319,920.00	0.69
26	600309	万华化学	34,125	3,309,783.75	0.69
27	000725	京东方 A	815,196	3,211,872.24	0.67
28	002714	牧原股份	57,840	3,196,816.80	0.66
29	000001	平安银行	210,915	3,159,506.70	0.66
30	002142	宁波银行	86,040	3,081,092.40	0.64

31	601899	紫金矿业	326,562	3,046,823.46	0.63
32	000002	万科 A	148,031	3,034,635.50	0.63
33	002812	恩捷股份	11,700	2,930,265.00	0.61
34	002129	TCL 中环	49,200	2,897,388.00	0.60
35	601939	建设银行	469,107	2,842,788.42	0.59
36	000792	盐湖股份	94,500	2,831,220.00	0.59
37	002466	天齐锂业	22,400	2,795,520.00	0.58
38	603799	华友钴业	29,018	2,774,701.16	0.58
39	603288	海天味业	30,208	2,729,594.88	0.57
40	600048	保利发展	156,077	2,725,104.42	0.57
41	300015	爱尔眼科	59,021	2,642,370.17	0.55
42	300124	汇川技术	40,106	2,641,782.22	0.55
43	002460	赣锋锂业	17,500	2,602,250.00	0.54
44	600031	三一重工	129,169	2,461,961.14	0.51
45	601668	中国建筑	455,769	2,424,691.08	0.50
46	300014	亿纬锂能	24,700	2,408,250.00	0.50
47	601088	中国神华	71,691	2,387,310.30	0.50
48	002304	洋河股份	13,023	2,385,162.45	0.50
49	002352	顺丰控股	42,300	2,360,763.00	0.49
50	600436	片仔癀	6,600	2,354,418.00	0.49
51	300498	温氏股份	110,420	2,350,841.80	0.49
52	600690	海尔智家	82,500	2,265,450.00	0.47
53	002271	东方雨虹	43,800	2,254,386.00	0.47
54	600089	特变电工	82,300	2,254,197.00	0.47
55	300274	阳光电源	22,500	2,210,625.00	0.46
56	601816	京沪高铁	427,800	2,147,556.00	0.45
57	603986	兆易创新	14,524	2,065,458.04	0.43
58	600837	海通证券	210,366	2,063,690.46	0.43
59	600000	浦发银行	255,845	2,049,318.45	0.43
60	600016	民生银行	540,564	2,010,898.08	0.42
61	603501	韦尔股份	11,500	1,989,845.00	0.41
62	600406	国电南瑞	72,875	1,967,625.00	0.41
63	300122	智飞生物	17,400	1,931,574.00	0.40
64	601919	中远海控	137,900	1,916,810.00	0.40
65	688981	中芯国际	42,125	1,902,786.25	0.40
66	000625	长安汽车	108,189	1,873,833.48	0.39
67	600585	海螺水泥	52,191	1,841,298.48	0.38
68	600919	江苏银行	257,350	1,832,332.00	0.38
69	601688	华泰证券	128,207	1,820,539.40	0.38
70	002709	天赐材料	29,300	1,818,358.00	0.38
71	600104	上汽集团	101,547	1,808,552.07	0.38
72	601225	陕西煤业	84,400	1,787,592.00	0.37

73	000063	中兴通讯	69,317	1,769,663.01	0.37
74	002049	紫光国微	9,300	1,764,396.00	0.37
75	601601	中国太保	74,441	1,751,596.73	0.36
76	002241	歌尔股份	52,020	1,747,872.00	0.36
77	300142	沃森生物	34,800	1,683,972.00	0.35
78	600111	北方稀土	47,755	1,679,065.80	0.35
79	002230	科大讯飞	40,665	1,676,211.30	0.35
80	000661	长春高新	7,100	1,657,282.00	0.34
81	002459	晶澳科技	20,380	1,607,982.00	0.33
82	002371	北方华创	5,700	1,579,584.00	0.33
83	688599	天合光能	23,600	1,539,900.00	0.32
84	300450	先导智能	23,800	1,503,684.00	0.31
85	601211	国泰君安	98,300	1,494,160.00	0.31
86	002027	分众传媒	220,363	1,483,042.99	0.31
87	000338	潍柴动力	118,276	1,474,901.72	0.31
88	000100	TCL 科技	305,877	1,465,150.83	0.30
89	601169	北京银行	322,633	1,464,753.82	0.30
90	600660	福耀玻璃	34,935	1,460,632.35	0.30
91	601229	上海银行	216,796	1,420,013.80	0.29
92	601985	中国核电	205,400	1,409,044.00	0.29
93	600050	中国联通	405,250	1,402,165.00	0.29
94	601766	中国中车	265,184	1,378,956.80	0.29
95	600745	闻泰科技	16,200	1,378,782.00	0.29
96	601390	中国中铁	223,823	1,374,273.22	0.29
97	600893	航发动力	29,022	1,320,791.22	0.27
98	601669	中国电建	166,762	1,312,416.94	0.27
99	300347	泰格医药	11,400	1,304,730.00	0.27
100	603659	璞泰来	15,200	1,282,880.00	0.27
101	601658	邮储银行	237,200	1,278,508.00	0.27
102	000776	广发证券	64,524	1,206,598.80	0.25
103	600009	上海机场	21,022	1,191,947.40	0.25
104	600028	中国石化	291,611	1,189,772.88	0.25
105	600905	三峡能源	187,200	1,177,488.00	0.24
106	601009	南京银行	112,334	1,170,520.28	0.24
107	600019	宝钢股份	194,209	1,169,138.18	0.24
108	600010	包钢股份	496,843	1,167,581.05	0.24
109	600999	招商证券	80,894	1,165,682.54	0.24
110	600958	东方证券	113,952	1,163,449.92	0.24
111	600196	复星医药	26,042	1,148,191.78	0.24
112	300896	爱美客	1,900	1,140,019.00	0.24
113	601628	中国人寿	36,319	1,128,794.52	0.23
114	601857	中国石油	212,908	1,128,412.40	0.23

115	002410	广联达	20,600	1,121,464.00	0.23
116	600570	恒生电子	25,627	1,115,799.58	0.23
117	000895	双汇发展	37,781	1,106,983.30	0.23
118	601818	光大银行	360,567	1,085,306.67	0.23
119	002179	中航光电	17,080	1,081,505.60	0.22
120	002311	海大集团	18,000	1,080,180.00	0.22
121	002050	三花智控	39,122	1,075,072.56	0.22
122	603993	洛阳钼业	187,000	1,071,510.00	0.22
123	600346	恒力石化	46,261	1,028,844.64	0.21
124	300759	康龙化成	10,800	1,028,376.00	0.21
125	600760	中航沈飞	17,000	1,027,650.00	0.21
126	002493	荣盛石化	66,200	1,018,818.00	0.21
127	002074	国轩高科	21,900	998,640.00	0.21
128	601633	长城汽车	26,804	992,820.16	0.21
129	300661	圣邦股份	5,400	982,908.00	0.20
130	600926	杭州银行	64,600	967,708.00	0.20
131	600460	士兰微	18,600	967,200.00	0.20
132	300782	卓胜微	7,040	950,400.00	0.20
133	300316	晶盛机电	14,000	946,260.00	0.20
134	600426	华鲁恒升	32,400	946,080.00	0.20
135	688012	中微公司	8,100	945,675.00	0.20
136	300496	中科创达	7,200	939,456.00	0.20
137	000538	云南白药	15,487	935,259.93	0.19
138	002001	新和成	40,664	927,545.84	0.19
139	001979	招商蛇口	69,055	927,408.65	0.19
140	601989	中国重工	249,856	926,965.76	0.19
141	002821	凯莱英	3,200	924,800.00	0.19
142	600176	中国巨石	52,594	915,661.54	0.19
143	000768	中航西飞	30,139	912,910.31	0.19
144	002920	德赛西威	6,100	902,800.00	0.19
145	000596	古井贡酒	3,600	898,776.00	0.19
146	002202	金风科技	60,524	895,755.20	0.19
147	000963	华东医药	19,039	859,801.24	0.18
148	601006	大秦铁路	130,354	859,032.86	0.18
149	601138	工业富联	87,100	857,064.00	0.18
150	600763	通策医疗	4,900	854,756.00	0.18
151	000166	申万宏源	197,539	847,442.31	0.18
152	601877	正泰电器	23,400	837,252.00	0.17
153	600584	长电科技	31,000	837,000.00	0.17
154	300207	欣旺达	26,200	827,920.00	0.17
155	601377	兴业证券	117,415	827,775.75	0.17
156	601066	中信建投	28,300	818,153.00	0.17

157	600588	用友网络	37,609	816,491.39	0.17
158	600029	南方航空	111,064	811,877.84	0.17
159	600383	金地集团	59,346	797,610.24	0.17
160	601186	中国铁建	100,854	796,746.60	0.17
161	600741	华域汽车	34,512	793,776.00	0.16
162	600085	同仁堂	14,985	792,406.80	0.16
163	600600	青岛啤酒	7,600	789,792.00	0.16
164	688111	金山办公	4,000	788,480.00	0.16
165	601838	成都银行	47,200	782,576.00	0.16
166	600188	兖矿能源	19,800	781,704.00	0.16
167	688005	容百科技	6,000	776,640.00	0.16
168	000786	北新建材	22,200	768,564.00	0.16
169	600795	国电电力	195,418	764,084.38	0.16
170	600132	重庆啤酒	5,200	762,320.00	0.16
171	601111	中国国航	65,481	760,234.41	0.16
172	300408	三环集团	25,200	758,520.00	0.16
173	000876	新希望	49,380	755,514.00	0.16
174	603806	福斯特	11,500	753,480.00	0.16
175	601117	中国化学	79,300	746,213.00	0.15
176	600150	中国船舶	39,200	744,016.00	0.15
177	603019	中科曙光	25,620	743,492.40	0.15
178	603260	合盛硅业	6,300	743,148.00	0.15
179	601238	广汽集团	48,400	737,616.00	0.15
180	300751	迈为股份	1,500	736,350.00	0.15
181	600547	山东黄金	39,351	730,354.56	0.15
182	003816	中国广核	258,600	724,080.00	0.15
183	601800	中国交建	77,244	716,824.32	0.15
184	600989	宝丰能源	48,200	706,130.00	0.15
185	601100	恒立液压	11,412	704,348.64	0.15
186	600015	华夏银行	134,842	702,526.82	0.15
187	300999	金龙鱼	13,000	702,260.00	0.15
188	603369	今世缘	13,700	698,700.00	0.15
189	600886	国投电力	65,360	686,280.00	0.14
190	688396	华润微	11,600	685,212.00	0.14
191	600011	华能国际	96,400	678,656.00	0.14
192	002648	卫星化学	26,200	677,270.00	0.14
193	601788	光大证券	42,800	674,528.00	0.14
194	601868	中国能建	284,300	673,791.00	0.14
195	000157	中联重科	108,754	669,924.64	0.14
196	300601	康泰生物	14,680	663,242.40	0.14
197	000301	东方盛虹	39,100	661,181.00	0.14
198	300763	锦浪科技	3,100	660,300.00	0.14

199	600115	中国东航	120,078	659,228.22	0.14
200	603185	上机数控	4,200	655,158.00	0.14
201	000425	徐工机械	120,124	647,468.36	0.13
202	002236	大华股份	39,400	646,948.00	0.13
203	002601	龙佰集团	31,300	627,565.00	0.13
204	002555	三七互娱	29,200	619,916.00	0.13
205	002008	大族激光	18,449	611,215.37	0.13
206	603486	科沃斯	5,000	609,450.00	0.13
207	000938	紫光股份	31,361	608,403.40	0.13
208	601916	浙商银行	183,100	607,892.00	0.13
209	603833	欧派家居	4,031	607,391.08	0.13
210	601901	方正证券	90,239	605,503.69	0.13
211	002736	国信证券	63,200	604,824.00	0.13
212	300628	亿联网络	7,900	601,585.00	0.12
213	688008	澜起科技	9,912	600,468.96	0.12
214	603392	万泰生物	3,844	596,973.20	0.12
215	600941	中国移动	9,800	592,900.00	0.12
216	000977	浪潮信息	22,300	590,504.00	0.12
217	601336	新华保险	18,288	588,690.72	0.12
218	600352	浙江龙盛	56,988	580,137.84	0.12
219	600219	南山铝业	157,100	579,699.00	0.12
220	603290	斯达半导	1,500	578,850.00	0.12
221	000069	华侨城 A	88,150	572,093.50	0.12
222	601995	中金公司	12,800	569,472.00	0.12
223	300595	欧普康视	9,800	560,462.00	0.12
224	300454	深信服	5,300	550,034.00	0.11
225	002841	视源股份	7,300	549,836.00	0.11
226	601618	中国中冶	156,460	547,610.00	0.11
227	300413	芒果超媒	16,350	545,436.00	0.11
228	688126	沪硅产业	23,701	544,648.98	0.11
229	002120	韵达股份	31,836	543,122.16	0.11
230	002007	华兰生物	23,706	540,496.80	0.11
231	300529	健帆生物	10,500	534,345.00	0.11
232	600845	宝信软件	9,770	533,442.00	0.11
233	601799	星宇股份	3,100	530,100.00	0.11
234	002252	上海莱士	88,638	525,623.34	0.11
235	601360	三六零	60,800	518,016.00	0.11
236	300003	乐普医疗	27,701	514,407.57	0.11
237	000703	恒逸石化	48,160	506,161.60	0.11
238	603882	金域医学	6,100	503,555.00	0.10
239	601155	新城控股	19,800	503,514.00	0.10
240	300919	中伟股份	4,000	495,600.00	0.10

241	600332	白云山	15,400	486,486.00	0.10
242	601878	浙商证券	42,500	483,650.00	0.10
243	300433	蓝思科技	43,548	482,076.36	0.10
244	688036	传音控股	5,300	472,919.00	0.10
245	002602	世纪华通	97,998	472,350.36	0.10
246	600489	中金黄金	63,768	471,245.52	0.10
247	600918	中泰证券	61,100	467,415.00	0.10
248	601021	春秋航空	8,000	466,800.00	0.10
249	002938	鹏鼎控股	15,300	462,213.00	0.10
250	000066	中国长城	42,400	458,768.00	0.10
251	603899	晨光股份	8,100	454,248.00	0.09
252	300033	同花顺	4,700	451,905.00	0.09
253	300223	北京君正	4,200	446,250.00	0.09
254	000708	中信特钢	22,100	445,315.00	0.09
255	601728	中国电信	119,111	444,284.03	0.09
256	600183	生益科技	25,400	431,546.00	0.09
257	601865	福莱特	11,200	426,720.00	0.09
258	600018	上港集团	71,400	416,262.00	0.09
259	601898	中煤能源	40,100	416,238.00	0.09
260	002916	深南电路	4,380	410,449.80	0.09
261	600362	江西铜业	22,775	406,078.25	0.08
262	300957	贝泰妮	1,800	391,554.00	0.08
263	688169	石头科技	600	370,020.00	0.08
264	600161	天坛生物	15,000	364,200.00	0.08
265	002791	坚朗五金	2,800	363,216.00	0.08
266	601216	君正集团	73,996	361,100.48	0.07
267	600061	国投资本	56,344	358,347.84	0.07
268	002414	高德红外	27,716	356,704.92	0.07
269	601319	中国人保	70,000	354,200.00	0.07
270	002568	百润股份	11,320	340,052.80	0.07
271	000408	藏格矿业	10,300	339,282.00	0.07
272	600606	绿地控股	84,000	332,640.00	0.07
273	688561	奇安信	5,900	329,220.00	0.07
274	601966	玲珑轮胎	12,900	327,273.00	0.07
275	688065	凯赛生物	2,800	313,040.00	0.07
276	601998	中信银行	65,724	312,189.00	0.06
277	600655	豫园股份	32,900	310,576.00	0.06
278	603160	汇顶科技	5,000	309,650.00	0.06
279	002600	领益智造	60,700	304,714.00	0.06
280	688363	华熙生物	2,100	298,578.00	0.06
281	002064	华峰化学	32,600	275,144.00	0.06
282	601881	中国银河	28,200	272,694.00	0.06

283	600025	华能水电	38,600	269,814.00	0.06
284	603195	公牛集团	1,700	259,947.00	0.05
285	603087	甘李药业	4,900	235,053.00	0.05
286	002607	中公教育	40,500	234,495.00	0.05
287	300866	安克创新	3,500	232,120.00	0.05
288	002032	苏泊尔	3,500	197,190.00	0.04
289	000800	一汽解放	20,400	190,536.00	0.04
290	601808	中海油服	13,000	181,350.00	0.04
291	601236	红塔证券	19,400	177,122.00	0.04
292	605499	东鹏饮料	1,000	170,860.00	0.04
293	000877	天山股份	13,000	159,900.00	0.03
294	601825	沪农商行	21,100	132,297.00	0.03
295	300979	华利集团	1,800	131,544.00	0.03
296	601698	中国卫通	9,900	111,969.00	0.02
297	001289	龙源电力	3,400	73,984.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301219	腾远钴业	252	22,601.30	0.00
2	301217	铜冠铜箔	1,251	18,552.33	0.00
3	301122	采纳股份	259	18,225.83	0.00
4	301201	诚达药业	247	17,670.38	0.00
5	301103	何氏眼科	442	14,152.84	0.00
6	301206	三元生物	287	13,113.03	0.00
7	301200	大族数控	235	12,201.20	0.00
8	301235	华康医疗	311	11,796.23	0.00
9	301123	奕东电子	372	9,445.08	0.00
10	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000792	盐湖股份	3,093,663.00	0.61
2	600089	特变电工	2,085,752.00	0.41
3	600519	贵州茅台	1,608,297.00	0.32
4	300661	圣邦股份	1,021,469.00	0.20
5	002074	国轩高科	958,175.00	0.19
6	300750	宁德时代	898,302.00	0.18
7	300496	中科创达	876,590.00	0.17
8	600460	士兰微	874,200.00	0.17

9	002920	德赛西威	861,542.00	0.17
10	600188	兖矿能源	837,069.00	0.17
11	601117	中国化学	800,942.00	0.16
12	300207	欣旺达	799,496.00	0.16
13	300015	爱尔眼科	797,286.41	0.16
14	600036	招商银行	775,668.00	0.15
15	002648	卫星化学	753,731.04	0.15
16	000725	京东方 A	747,621.00	0.15
17	601318	中国平安	736,417.00	0.15
18	300751	迈为股份	703,520.00	0.14
19	600030	中信证券	680,852.65	0.13
20	600941	中国移动	659,498.00	0.13

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,505,729.00	0.30
2	601728	中国电信	1,219,862.00	0.24
3	300015	爱尔眼科	803,778.04	0.16
4	300750	宁德时代	736,250.00	0.15
5	600036	招商银行	681,489.00	0.13
6	601318	中国平安	653,565.00	0.13
7	601328	交通银行	576,140.00	0.11
8	688223	晶科能源	569,999.36	0.11
9	601108	财通证券	561,393.80	0.11
10	000783	长江证券	521,547.60	0.10
11	601939	建设银行	516,757.00	0.10
12	601012	隆基绿能	489,293.00	0.10
13	600109	国金证券	482,680.80	0.10
14	601607	上海医药	473,172.64	0.09
15	300144	宋城演艺	457,043.10	0.09
16	000858	五粮液	447,158.00	0.09
17	601988	中国银行	440,969.00	0.09
18	688197	首药控股	434,546.56	0.09
19	601696	中银证券	417,853.00	0.08
20	601990	南京证券	410,028.00	0.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	57,332,928.83
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	40,093,079.06
--------------	---------------

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	8,131,697.53	1.69
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	8,131,697.53	1.69

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	019664	21 国债 16	80,000	8,131,697.53	1.69

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

2021 年 8 月 13 日，兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行公开处罚，罚款 5 万元。

2022 年 3 月 21 日，兴业银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违规行为，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 350 万元。

2022 年 3 月 21 日，招商银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违规行为，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 300 万元。

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

其余证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票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	16,210.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,323.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,533.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301217	铜冠铜箔	18,552.33	0.00	创业板锁定
2	301122	采纳股份	18,225.83	0.00	创业板锁定
3	301201	诚达药业	17,670.38	0.00	创业板锁定
4	301103	何氏眼科	14,152.84	0.00	创业板锁定
5	301219	腾远钴业	13,260.82	0.00	创业板锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
农银沪深 300 指数 A	36,179	8,080.44	4,125,205.76	1.41	288,217,129.18	98.59
农银沪深 300 指数 C	43	85,196.99	0.00	0.00	3,663,470.55	100.00
合计	36,222	8,171.99	4,125,205.760	1.39	291,880,599.73	98.61

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

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	农银沪深 300 指数 A	5,972.97	0.0020
	农银沪深 300 指数 C	0.00	0.0000
	合计	5,972.97	0.0020

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2011 年 4 月 12 日) 基金份额总额	3,297,550,055.44	-
本报告期期初基金份额总额	286,472,818.02	328,723.89
本报告期基金总申购份额	35,103,730.67	4,043,277.98
减：本报告期基金总赎回份额	29,234,213.75	708,531.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	292,342,334.94	3,663,470.55

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

2、总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期，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。本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源证券	2	63,562,141.20	68.44	59,195.69	68.44	-
中金公司	2	29,310,177.03	31.56	27,296.60	31.56	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证

		成交总额的 比例 (%)		购成交总额的 比例 (%)		成交总额的 比例 (%)
申万宏源 证券		-		-		-
中金公司	8,009,600.00	100.00	6,000,000.00	100.00		-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	农银汇理沪深 300 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 3 月 29 日
3	农银汇理沪深 300 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 4 月 21 日
4	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 6 月 29 日
5	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金-招募说明书更新-2022 年第 1 次	上海证券报、基金管理人网站	2022 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

12.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日