

农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资
基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 18 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银中证 1000 指数增强
基金主代码	017323
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 7 月 18 日
报告期末基金份额总额	210,978,636.63 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化及基本面选股方法进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金作为指数增强型基金，以跟踪中证 1000 指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过数量化方法对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。 1、股票投资策略：（1）指数投资策略。（2）指数增强策略。2、债券投资策略。3、资产支持证券投资策略。4、参与融资及转融通证券出借业务策略。5、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017323	017324
报告期末下属分级基金的份额总额	197,351,952.00 份	13,626,684.63 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 18 日-2023 年 9 月 30 日）	
	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
1. 本期已实现收益	303,797.70	16,871.68
2. 本期利润	283,121.56	15,431.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0016	0.0006
4. 期末基金资产净值	197,653,189.65	13,636,219.16
5. 期末基金份额净值	1.0015	1.0007

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银中证 1000 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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
自基金合同 生效起至今	0.15%	0.01%	-6.38%	0.98%	6.53%	-0.97%

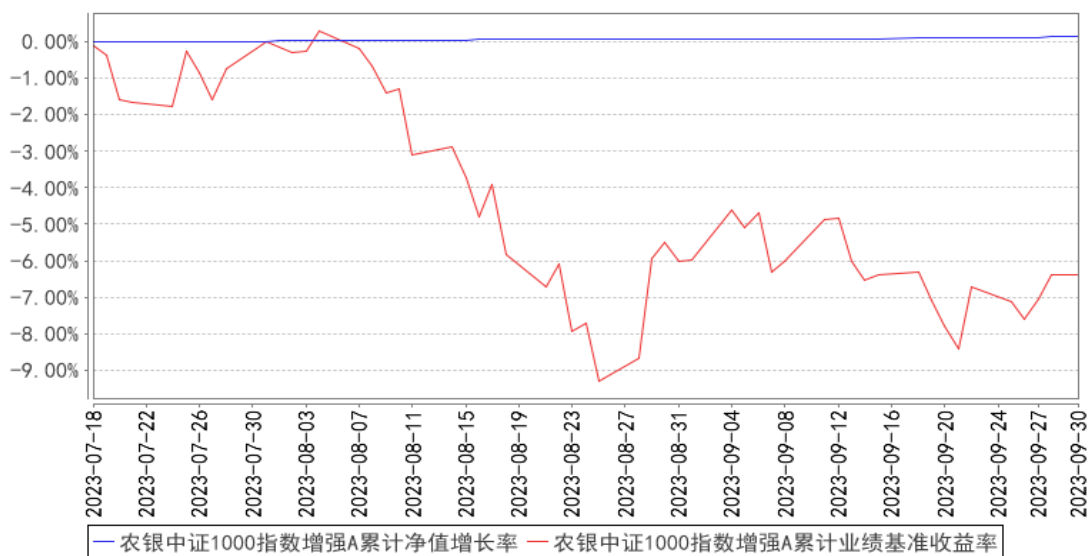
农银中证 1000 指数增强 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

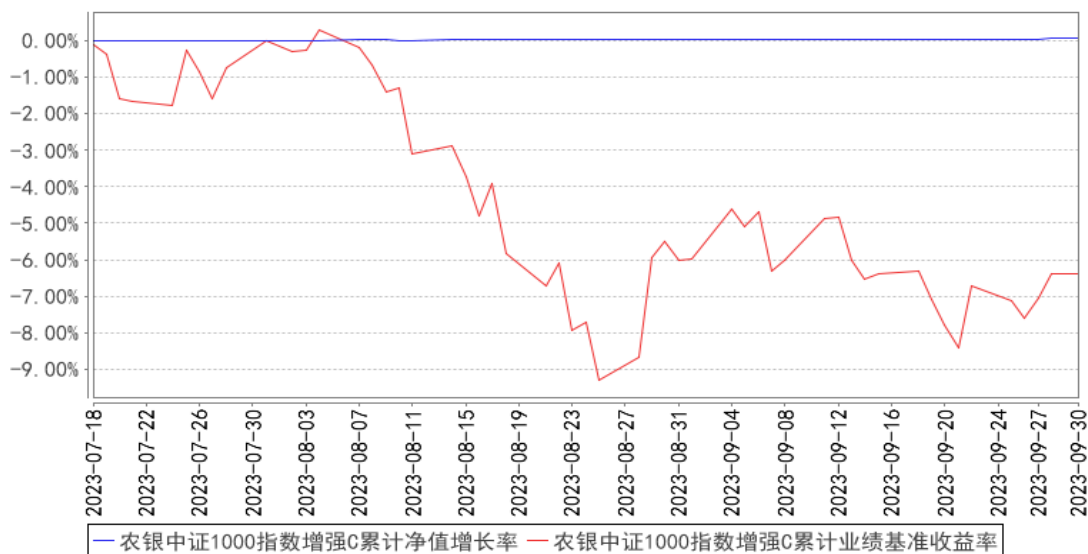
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
自基金合同生效起至今	0.07%	0.01%	-6.38%	0.98%	6.45%	-0.97%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金建仓期为基金合同生效日（2023 年 7 月 18 日）起 6

个月，截至报告期末，建仓期未滿。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2023 年 7 月 18 日	-	16 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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，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，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

报告期内，所有投资组合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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，基金成立处于建仓期内，进行基金建仓和日常操作，针对市场偏弱的状态，本基金采取了缓慢建仓低仓位的策略。整体看，对市场的走势判断基本正确，三季度市场基本上处于震荡下跌的过程，基金缓慢建仓也因此获取了部分超额收益。

本基金作为一只投资于中证 1000 指数的指数增强型产品，我们将坚持指数被动化投资理念，同时通过运用定量分析技术，结合基本面分析，在控制基金的跟踪误差的前提下，获得超过标的指数的收益率，从而为投资者提供一个增强花的指数投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 基金份额净值为 1.0015 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.15%，同期业绩比较基准收益率为-6.38%；截至本报告期末本基金 C 基金份额净值为 1.0007 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.07%，同期业绩比较基准收益率为-6.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,794,781.95	0.85
	其中：股票	1,794,781.95	0.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,196,986.30	10.93
	其中：债券	23,196,986.30	10.93
	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	162,442,183.41	76.51
	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	23,656,593.91	11.14
8	其他资产	1,212,002.91	0.57
9	合计	212,302,548.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,221,589.00	0.58

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业	82,280.00	0.04
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	408,424.95	0.19
J	金融业		
K	房地产业	82,488.00	0.04
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	1,794,781.95	0.85

5.2.2 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。

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	603297	永新光学	1,000	86,850.00	0.04
2	688023	安恒信息	600	86,262.00	0.04
3	688100	威胜信息	2,800	83,048.00	0.04
4	603595	东尼电子	2,500	83,025.00	0.04
5	300470	中密控股	2,000	82,540.00	0.04
6	600225	卓朗科技	16,800	82,488.00	0.04
7	000503	国新健康	7,700	82,390.00	0.04
8	603098	森特股份	4,400	82,280.00	0.04
9	688399	硕世生物	1,600	82,256.00	0.04

10	600775	南京熊猫	9,200	81,696.00	0.04
----	--------	------	-------	-----------	------

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	23,196,986.30	10.98
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	23,196,986.30	10.98

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	210,000	21,168,632.88	10.02
2	019698	23 国债 05	20,000	2,028,353.42	0.96

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,936.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,209,066.06
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,212,002.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银中证 1000 指数增强 A	农银中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日(2023 年 7 月 18 日)基金份额总额	184,108,237.70	39,166,055.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	60,577,731.50	7,720,233.11
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	47,334,017.20	33,259,604.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	197,351,952.00	13,626,684.63

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2023-09-22 至	0.00	59,950,042.36	0.00	59,950,042.36	28.42

	2023-09-30					
2	2023-07-18 至 2023-09-30	80,002,600.00	0.00	0.00	80,002,600.00	37.92

产品特有风险

本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：

（一）赎回申请延期办理的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理或延缓支付的风险。

（二）基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入（或舍去尾数）等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

（三）基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

（四）基金合同提前终止的风险

单一投资者大额赎回后可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将面临根据基金合同的约定终止基金合同、清算或转型等风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址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

2023 年 10 月 25 日