

农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 21 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 2026 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 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	53
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	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	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	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	农银中证 A500 指数增强	
基金主代码	023475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 25 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	71,136,153.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	023475	023476
报告期末下属分级 基金的份额总额	46,624,842.39 份	24,511,310.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，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	本基金作为股票指数增强型基金，在标的指数成份股权重的基础上，通过数量化方法对基本面开展深入研究，对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。1、股票投资策略。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 A500 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理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金为股票指数增强型基金，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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	王小飞
	联系电话	021-61095588	021-60637103
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	021-61095599	021-60637228
传真	021-61095556	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄涛	张金良

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	6,592,533.36	3,317,335.27
本期利润	8,486,132.30	4,641,073.66
加权平均基金份 额本期利润	0.1693	0.1786
本期加权平均净 值利润率	12.95%	13.72%
本期基金份额净 值增长率	13.74%	13.51%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	15,740,952.36	8,104,550.14
期末可供分配基 金份额利润	0.3376	0.3306

期末基金资产净值	65,697,313.66	34,361,041.68
期末基金份额净值	1.4091	1.4018
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	40.91%	40.18%

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

农银中证 A500 指数增强 A

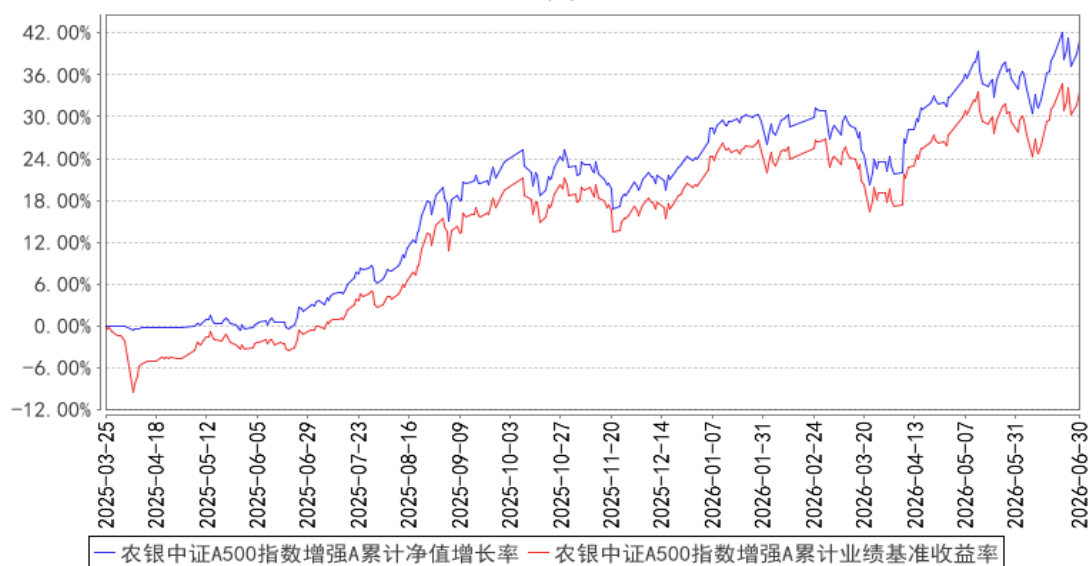
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.31%	1.34%	13.54%	1.34%	1.77%	0.00%
过去六个月	13.74%	1.23%	11.34%	1.22%	2.40%	0.01%
过去一年	37.05%	1.08%	34.40%	1.09%	2.65%	-0.01%
自基金合同生效起至今	40.91%	0.98%	33.58%	1.09%	7.33%	-0.11%

农银中证 A500 指数增强 C

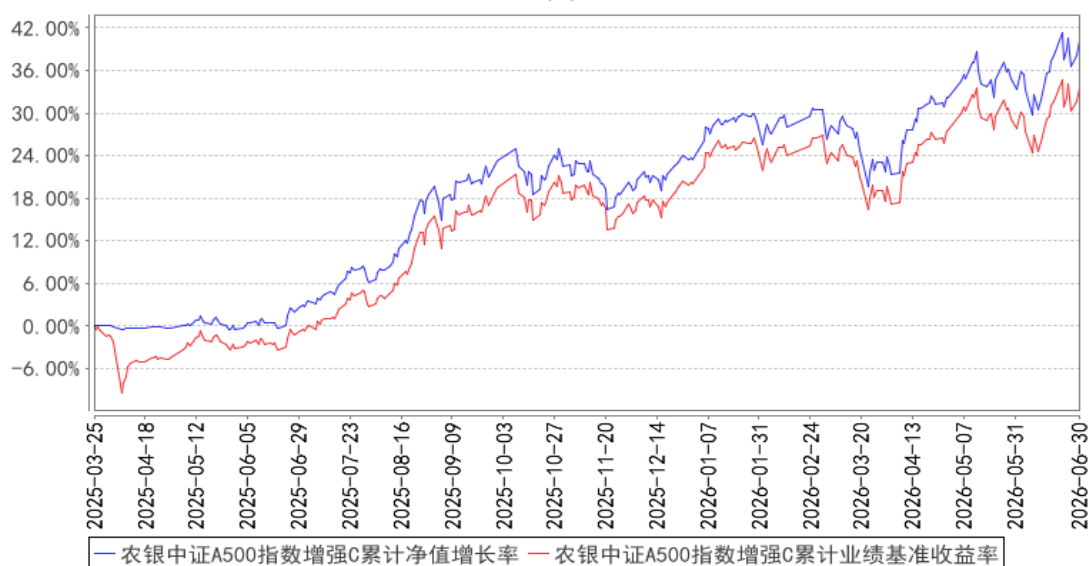
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.19%	1.34%	13.54%	1.34%	1.65%	0.00%
过去六个月	13.51%	1.23%	11.34%	1.22%	2.17%	0.01%
过去一年	36.49%	1.08%	34.40%	1.09%	2.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	40.18%	0.98%	33.58%	1.09%	6.60%	-0.11%

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A500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A500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：基金的投资组合比例为：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%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金建仓期为基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）起 6 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。公司法定代表人为黄涛先生。

截止 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 96 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、农银汇理瑞丰 6 个月持有期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）、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债债券型证券投资基金、农银汇理红利甄选混合型证券投资基金、农银汇理中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、农银汇理创新驱动混合型证券投资基金、农银汇理上证 180 指数型证券投资基金、农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金、农银汇理上证科创板 50 成份指数型证券投资基金、农银汇理中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、农银汇理平衡价值混合型证券投资基金、农银汇理中证红利低波动 100 指数型证券投资基金、农银汇理创业板指数型证券投资基金、农银汇理致远价值混合型证券投资基金、农银汇理瑞恒债券型证券投资基金、农银汇理消费启航混合型证券投资基金、农银汇理安泽多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金。

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		
钱大千	本基金的基金经理	2025 年 3 月 25 日	-	15 年	上海交通大学数学系博士。历任农银汇理基金管理有限公司风险控制部风控专员、研究部研究员、农银汇理资产管理有限公司资产及财富管理部投资经理、农银汇理

					基金管理有限公司投资理财部投资经理，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

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《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。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

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

2026 年上半年国内经济维持弱复苏、强分化格局，一季度经济修复动能平稳，二季度内需修复节奏有所放缓。制造业延续新旧动能切换态势，高端科技制造景气度领跑，传统行业企业整体景气偏弱、修复节奏偏缓。

A 股上半年呈现极致 K 型结构性行情，市场风格阶段性极致分化。一季度市场避险情绪升温，

价值股凭借地缘避险属性、高股息防御优势相对抗跌，走势显著占优；二季度市场风险偏好快速回暖，市场资金集中涌入 AI、半导体等科技成长赛道，形成极强的资金虹吸效应，大量资金从传统板块流出，导致价值板块持续承压、成交活跃度降至年内低位，市场风格彻底偏向科技成长，价值与成长的估值分化一度拉大至历史极值。

进入 7 月后，市场风格迎来根本性反转，行情呈现典型的“高低切换、成长退潮、红利回归”特征。上半年超额收益显著的 AI、半导体、光模块等高位科技成长赛道筹码极度拥挤、估值泡沫凸显，叠加获利盘集中兑现，迎来大幅深度调整，科创、创业板成长指数月度回撤幅度显著，科技板块整体波动剧烈、赚钱效应快速消退。前期极致的估值分化格局得到显著收敛。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银中证 A500 指数增强 A 基金份额净值为 1.4091 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.74%；截至本报告期末农银中证 A500 指数增强 C 基金份额净值为 1.4018 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.51%；同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从估值维度来看，经历 7 月科技股大幅回调后，成长赛道估值泡沫得到一定消化。随着市场风格彻底切换、资金开启高低估值再平衡，预计市场将从“极致成长抱团”转向“业绩为王、均衡修复”的结构化行情。

二季度成长类因子表现优异，但小市值因子表现较弱。我们在风格上完全中性，同时维持了较低的行业、基准偏离度，超额收益较为稳定。在 5、6 月极端市场风格下超额回撤较小。后续计划持续加强量化模型和因子的研究和挖掘，同时还是会坚持继续严格控制组合相对基准指数的各项风险暴露，包括行业、市值、样本股偏离度等。力争获得稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定等文件，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。

估值委员会成员由各业务相关的投资岗、研究岗、运营岗、风控岗和合规岗人员组成，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、以及适用性的情况、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。参与估值流程各方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。

本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	1,368,249.61	1,012,051.59
结算备付金		229,694.50	313,129.71
存出保证金		17,834.56	42,603.82
交易性金融资产	6.4.7.2	100,087,771.74	92,175,554.91
其中：股票投资		94,938,740.70	87,324,551.30
基金投资		-	-
债券投资		5,149,031.04	4,851,003.61
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		321,096.34	825,921.07
应收股利		-	-
应收申购款		60,597.28	91,090.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		102,085,244.03	94,460,351.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		1,000,000.00	800,000.00
应付清算款		435,193.88	-
应付赎回款		431,925.80	1,113,102.07
应付管理人报酬		49,194.45	46,753.15
应付托管费		12,298.59	11,688.30
应付销售服务费		11,288.89	9,937.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		81.65	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,905.43	164,471.13
负债合计		2,026,888.69	2,145,952.23
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	71,136,153.25	74,590,578.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	28,922,202.09	17,723,820.00
净资产合计		100,058,355.34	92,314,398.87
负债和净资产总计		102,085,244.03	94,460,351.10

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 71,136,153.25 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.4091 元，基金份额总额 46,624,842.39 份；下属 C 类基金份额净值 1.4018 元，基金份额总额 24,511,310.86 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,619,827.29	9,816,085.08
1. 利息收入		5,139.83	1,708,566.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,774.31	53,385.59
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		1,365.52	1,655,181.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		10,394,486.66	3,561,916.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,553,334.24	969,765.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	36,814.22	116,541.98
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	804,338.20	2,475,608.85
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	3,217,337.33	4,544,840.31
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	2,863.47	761.41
减：二、营业总支出		492,621.33	1,328,699.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	295,605.34	875,207.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,901.28	218,801.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	66,962.36	183,486.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,031.57	3,920.07
其中：卖出回购金融资产支出		5,031.57	3,920.07
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		22.21	59.58
8. 其他费用	6.4.7.23	51,098.57	47,223.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,127,205.96	8,487,385.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,127,205.96	8,487,385.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,127,205.96	8,487,385.89

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	74,590,578.87	-	17,723,820.00	92,314,398.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	74,590,578.87	-	17,723,820.00	92,314,398.87

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,454,425.62	-	11,198,382.09	7,743,956.47
(一)、综合收益总额	-	-	13,127,205.96	13,127,205.96
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,454,425.62	-	-1,928,823.87	-5,383,249.49
其中：1. 基金申购款	62,412,085.07	-	18,232,886.01	80,644,971.08
2. 基金赎回款	-65,866,510.69	-	-20,161,709.88	-86,028,220.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	71,136,153.25	-	28,922,202.09	100,058,355.34
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2025 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	911,553,749.31	-	-	911,553,749.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 722,079,265.52	-	5,295,156.47	-716,784,109.05
(一)、综合收益总额	-	-	8,487,385.89	8,487,385.89

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	- 722,079,265.52	-	-3,192,229.42	-725,271,494.94
其中：1. 基金申购款	6,922,814.38	-	31,796.74	6,954,611.12
2. 基金赎回款	- 729,002,079.90	-	-3,224,026.16	-732,226,106.06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	189,474,483.79	-	5,295,156.47	194,769,640.26

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：

孙建坤
基金管理人负责人

毕宏燕
主管会计工作负责人

丁煜琼
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 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，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[2025]259 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 911,553,749.31 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(25)第 00081 号验资报告。《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 3 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新适用的《农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》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，以中证 A500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股及其备选成份股(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、资产支持证券、同业存单、货币市场工具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相关规定。本基金的投资组合比例为：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%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为“中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%”。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

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

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3) 对证券投资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，股权的股息、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。

4) 对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

6) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,368,249.61
等于：本金	1,368,136.98
加：应计利息	112.63
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	1,368,249.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,647,317.23	-	94,938,740.70	10,291,423.47

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,104,377.00	46,261.04	5,149,031.04	-1,607.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,104,377.00	46,261.04	5,149,031.04	-1,607.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		89,751,694.23	46,261.04	100,087,771.74	10,289,816.47

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从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融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各项资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,316.86
其中：交易所市场	37,316.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
合计	86,905.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,724,982.09	49,724,982.09
本期申购	23,729,507.85	23,729,507.85
本期赎回（以“-”号填列）	-26,829,647.55	-26,829,647.55
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	46,624,842.39	46,624,842.39

农银中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,865,596.78	24,865,596.78
本期申购	38,682,577.22	38,682,577.22
本期赎回（以“-”号填列）	-39,036,863.14	-39,036,863.14
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	24,511,310.86	24,511,310.86

注：红利再投、转换入及级别调整入份额计入申购，转换出及级别调整出份额计入赎回。

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

农银中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,161,429.19	1,718,737.43	11,880,166.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,161,429.19	1,718,737.43	11,880,166.62
本期利润	6,592,533.36	1,893,598.94	8,486,132.30
本期基金份额交易产生的变动数	-1,013,010.19	-280,817.46	-1,293,827.65
其中：基金申购款	6,490,513.24	488,198.49	6,978,711.73
基金赎回款	-7,503,523.43	-769,015.95	-8,272,539.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,740,952.36	3,331,518.91	19,072,471.27

农银中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,985,283.78	858,369.60	5,843,653.38
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,985,283.78	858,369.60	5,843,653.38
本期利润	3,317,335.27	1,323,738.39	4,641,073.66
本期基金份额交易产生的变动数	-198,068.91	-436,927.31	-634,996.22
其中：基金申购款	10,069,900.83	1,184,273.45	11,254,174.28
基金赎回款	-10,267,969.74	-1,621,200.76	-11,889,170.50
本期已分配利润	-	-	-

本期末	8,104,550.14	1,745,180.68	9,849,730.82
-----	--------------	--------------	--------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,166.13
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	568.84
其他	39.34
合计	3,774.31

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	185,007,933.31
减：卖出股票成本总额	175,266,539.35
减：交易费用	188,059.72
买卖股票差价收入	9,553,334.24

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	31,950.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,864.00
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	36,814.22

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,860,720.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,795,136.00
减：应计利息总额	60,720.00

减：交易费用	—
买卖债券差价收入	4,864.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	804,338.20
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	804,338.20

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,217,337.33
股票投资	3,224,528.33
债券投资	-7,191.00
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	3,217,337.33

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,017.97
基金转换费收入	845.50
合计	2,863.47

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
银行费用	1,510.00

合计	51,098.57
----	-----------

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，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	295,605.34	875,207.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,183.18	431,858.53
应支付基金管理人的净管理费	173,422.16	443,348.94

注：支付基金管理人的管理人报酬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：

日基金管理人报酬=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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,901.28	218,801.85

注：支付基金托管人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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银中证 A500 指数 增强 A	农银中证 A500 指数 增强 C	合计
	农业银行	-	57,181.10
建设银行	-	6,573.49	6,573.49
合计	-	63,754.59	63,754.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银中证 A500 指数 增强 A	农银中证 A500 指数 增强 C	合计

农业银行	-	67,278.44	67,278.44
建设银行	-	115,585.92	115,585.92
合计	-	182,864.36	182,864.36

注：C 级基金份额支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值×0.40%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：

C 级基金日销售服务费=前一日 C 级基金基金资产净值×0.40% ÷ 当年天数。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,651,493.98	-
报告期间申购/买入总份额	7,935,084.52	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,586,578.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.2850%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3	-	-

月 25 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 3 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2025 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
建设银行	1,368,249.61	3,166.13	1,746,115.79	38,471.34

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管, 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 (2026 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/增发证券而流通受限的证券。

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
688072	拓荆科技	2026 年 6	重大事项停牌	879.53	2026 年 7	890.99	200	52,006.89	175,906.00	-

		月 29 日			月 13 日					
--	--	-----------	--	--	-----------	--	--	--	--	--

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,000,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。董事会及其下设的风控与合规管理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与内部控制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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,149,031.04	4,851,003.61
合计	5,149,031.04	4,851,003.61

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 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”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、流通受限的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短期内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,368,249.61	-	-	-	1,368,249.61
结算备付金	229,694.50	-	-	-	229,694.50
存出保证金	17,834.56	-	-	-	17,834.56
交易性金融资产	5,149,031.04	-	-	94,938,740.70	100,087,771.74
应收申购款	-	-	-	60,597.28	60,597.28
应收清算款	-	-	-	321,096.34	321,096.34
资产总计	6,764,809.71	-	-	95,320,434.32	102,085,244.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	431,925.80	431,925.80
应付管理人报酬	-	-	-	49,194.45	49,194.45
应付托管费	-	-	-	12,298.59	12,298.59
应付清算款	-	-	-	435,193.88	435,193.88
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	11,288.89	11,288.89
应交税费	-	-	-	81.65	81.65
其他负债	-	-	-	86,905.43	86,905.43
负债总计	1,000,000.00	-	-	1,026,888.69	2,026,888.69
利率敏感度缺口	5,764,809.71	-	-	94,293,545.63	100,058,355.34
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,012,051.59	-	-	-	1,012,051.59
结算备付金	313,129.71	-	-	-	313,129.71
存出保证金	42,603.82	-	-	-	42,603.82
交易性金融资产	4,851,003.61	-	-	87,324,551.30	92,175,554.91
应收申购款	-	-	-	91,090.00	91,090.00
应收清算款	-	-	-	825,921.07	825,921.07
资产总计	6,218,788.73	-	-	88,241,562.37	94,460,351.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,113,102.07	1,113,102.07
应付管理人报酬	-	-	-	46,753.15	46,753.15
应付托管费	-	-	-	11,688.30	11,688.30
卖出回购金融资产款	800,000.00	-	-	-	800,000.00
应付销售服务费	-	-	-	9,937.58	9,937.58
其他负债	-	-	-	164,471.13	164,471.13

负债总计	800,000.00	-	-	1,345,952.23	2,145,952.23
利率敏感度缺口	5,418,788.73	-	-	86,895,610.14	92,314,398.87

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）	
	市场利率平行上升 25 个基点	-3,896.50	-1,986.31	
	市场利率平行下降 25 个基点	3,896.50	1,986.31	

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	94,938,740.70	94.88	87,324,551.30	94.59
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	94,938,740.70	94.88	87,324,551.30	94.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,934,638.59	－
	业绩比较基准下降 5%	－4,934,638.59	－

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。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至上年度末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露上年度末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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	94,762,834.70	86,964,517.30
第二层次	5,324,937.04	5,211,037.61
第三层次	—	—
合计	100,087,771.74	92,175,554.91

6.4.14.2 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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	94,938,740.70	93.00
	其中：股票	94,938,740.70	93.00
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,149,031.04	5.04
	其中：债券	5,149,031.04	5.04
	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	1,597,944.11	1.57
8	其他各项资产	399,528.18	0.39
9	合计	102,085,244.03	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	140,985.00	0.14
B	采矿业	3,770,934.00	3.77
C	制造业	56,399,769.97	56.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,843,450.00	1.84
E	建筑业	874,105.00	0.87
F	批发和零售业	210,457.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	2,113,399.00	2.11
H	住宿和餐饮业	14,133.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,403,324.75	4.40
J	金融业	8,561,180.00	8.56
K	房地产业	189,016.00	0.19
L	租赁和商务服务业	249,705.60	0.25
M	科学研究和技术服务业	996,143.00	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	424,208.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,860.00	-
Q	卫生和社会工作	50,384.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	23,870.00	0.02
S	综合	117,530.00	0.12
	合计	80,387,454.32	80.34

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	24,700.00	0.02
C	制造业	10,845,566.38	10.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	136,010.00	0.14
F	批发和零售业	59,130.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	237,485.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,023,198.00	1.02
J	金融业	1,485,291.00	1.48
K	房地产业	7,326.00	0.01
L	租赁和商务服务业	62,826.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	404,160.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	141,010.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	63,684.00	0.06
Q	卫生和社会工作	60,900.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,551,286.38	14.54

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	300308	中际旭创	3,200	4,064,000.00	4.06
2	300750	宁德时代	7,600	2,986,876.00	2.99

3	300502	新易盛	3,860	2,343,020.00	2.34
4	688256	寒武纪	1,345	2,146,014.75	2.14
5	600519	贵州茅台	1,700	2,015,333.00	2.01
6	603986	兆易创新	2,200	1,793,000.00	1.79
7	000333	美的集团	20,900	1,578,577.00	1.58
8	601318	中国平安	31,500	1,503,810.00	1.50
9	002384	东山精密	5,000	1,311,750.00	1.31
10	600900	长江电力	46,800	1,238,796.00	1.24
11	601899	紫金矿业	47,900	1,204,206.00	1.20
12	688008	澜起科技	3,500	1,084,650.00	1.08
13	600036	招商银行	30,200	1,072,100.00	1.07
14	002371	北方华创	1,195	1,057,049.20	1.06
15	002475	立讯精密	14,600	1,027,840.00	1.03
16	600030	中信证券	34,700	996,931.00	1.00
17	603259	药明康德	7,400	921,374.00	0.92
18	688981	中芯国际	5,700	905,274.00	0.90
19	688041	海光信息	2,300	851,690.00	0.85
20	600150	中国船舶	24,900	841,371.00	0.84
21	000988	华工科技	4,500	830,745.00	0.83
22	688012	中微公司	1,637	766,934.50	0.77
23	300274	阳光电源	4,800	763,296.00	0.76
24	000338	潍柴动力	27,500	749,375.00	0.75
25	601816	京沪高铁	164,600	745,638.00	0.75
26	601328	交通银行	112,900	725,947.00	0.73
27	002415	海康威视	21,100	721,620.00	0.72
28	601166	兴业银行	40,700	673,992.00	0.67
29	300059	东方财富	33,000	672,540.00	0.67
30	000651	格力电器	17,900	671,250.00	0.67
31	600276	恒瑞医药	12,800	666,112.00	0.67
32	601398	工商银行	92,600	654,682.00	0.65
33	002463	沪电股份	4,200	641,760.00	0.64
34	000725	京东方 A	72,300	627,564.00	0.63
35	600183	生益科技	3,500	606,900.00	0.61
36	600487	亨通光电	5,400	590,436.00	0.59
37	601211	国泰海通	31,600	575,120.00	0.57
38	002594	比亚迪	6,700	533,990.00	0.53
39	688120	华海清科	1,540	496,157.20	0.50
40	600482	中国动力	14,900	488,720.00	0.49
41	000938	紫光股份	16,900	487,734.00	0.49
42	300476	胜宏科技	1,400	485,002.00	0.48
43	600887	伊利股份	19,600	469,616.00	0.47
44	300408	三环集团	2,800	467,320.00	0.47
45	603019	中科曙光	4,200	450,366.00	0.45

46	300604	长川科技	1,300	443,846.00	0.44
47	603993	洛阳钼业	25,000	438,750.00	0.44
48	000807	云铝股份	18,900	418,446.00	0.42
49	688235	百济神州	1,600	407,376.00	0.41
50	601088	中国神华	10,200	398,208.00	0.40
51	002493	荣盛石化	36,000	387,000.00	0.39
52	000063	中兴通讯	10,500	379,995.00	0.38
53	000301	东方盛虹	32,900	376,705.00	0.38
54	688180	君实生物	11,100	375,402.00	0.38
55	600309	万华化学	5,400	369,414.00	0.37
56	002008	大族激光	2,400	360,264.00	0.36
57	002266	浙富控股	71,000	359,260.00	0.36
58	300124	汇川技术	5,400	358,182.00	0.36
59	688002	睿创微纳	2,300	355,787.00	0.36
60	601117	中国化学	47,300	347,655.00	0.35
61	002916	深南电路	730	334,267.00	0.33
62	600000	浦发银行	38,100	328,041.00	0.33
63	601988	中国银行	56,800	324,896.00	0.32
64	000100	TCL 科技	54,800	318,936.00	0.32
65	601600	中国铝业	38,100	313,182.00	0.31
66	002028	思源电气	1,800	311,400.00	0.31
67	002281	光迅科技	1,200	308,328.00	0.31
68	300394	天孚通信	980	296,626.40	0.30
69	600941	中国移动	3,400	292,842.00	0.29
70	002352	顺丰控股	9,300	290,718.00	0.29
71	601601	中国太保	9,800	279,496.00	0.28
72	000792	盐湖股份	9,100	274,729.00	0.27
73	002353	杰瑞股份	1,800	274,500.00	0.27
74	300136	信维通信	2,300	274,275.00	0.27
75	601168	西部矿业	10,100	274,114.00	0.27
76	600497	驰宏锌锗	21,400	259,154.00	0.26
77	600176	中国巨石	3,500	255,080.00	0.25
78	601668	中国建筑	58,500	253,890.00	0.25
79	601857	中国石油	28,800	249,984.00	0.25
80	600111	北方稀土	5,000	240,250.00	0.24
81	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.24
82	601225	陕西煤业	11,600	236,060.00	0.24
83	600660	福耀玻璃	4,600	232,024.00	0.23
84	605117	德业股份	2,156	228,924.08	0.23
85	002050	三花智控	5,200	227,916.00	0.23
86	600089	特变电工	9,900	222,750.00	0.22
87	600584	长电科技	2,100	217,455.00	0.22
88	601766	中国中车	40,600	211,120.00	0.21

89	002460	赣锋锂业	3,200	209,280.00	0.21
90	300014	亿纬锂能	3,200	208,096.00	0.21
91	002422	科伦药业	5,400	208,008.00	0.21
92	603799	华友钴业	4,300	207,518.00	0.21
93	300033	同花顺	860	207,260.00	0.21
94	000858	五粮液	2,800	207,200.00	0.21
95	688521	芯原股份	550	204,127.00	0.20
96	600938	中国海油	7,500	203,625.00	0.20
97	002851	麦格米特	1,200	200,616.00	0.20
98	601728	中国电信	36,900	191,511.00	0.19
99	300567	精测电子	600	190,560.00	0.19
100	688777	中控技术	1,600	188,000.00	0.19
101	002466	天齐锂业	3,000	183,960.00	0.18
102	002230	科大讯飞	4,500	183,780.00	0.18
103	002709	天赐材料	3,500	180,005.00	0.18
104	300760	迈瑞医疗	1,300	176,579.00	0.18
105	600522	中天科技	2,900	175,972.00	0.18
106	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.18
107	601985	中国核电	19,200	173,376.00	0.17
108	000977	浪潮信息	2,400	168,000.00	0.17
109	002179	中航光电	3,600	166,320.00	0.17
110	600535	天士力	12,300	162,729.00	0.16
111	603288	海天味业	4,900	162,484.00	0.16
112	601872	招商轮船	9,200	161,644.00	0.16
113	601100	恒立液压	1,500	161,340.00	0.16
114	601919	中远海控	11,900	157,794.00	0.16
115	601658	邮储银行	31,700	156,281.00	0.16
116	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.15
117	000408	藏格矿业	2,200	152,504.00	0.15
118	600489	中金黄金	8,400	151,620.00	0.15
119	000630	铜陵有色	23,400	148,824.00	0.15
120	600031	三一重工	8,600	148,608.00	0.15
121	300346	南大光电	1,600	148,240.00	0.15
122	000001	平安银行	14,400	144,720.00	0.14
123	002202	金风科技	6,000	143,400.00	0.14
124	601689	拓普集团	2,500	141,050.00	0.14
125	300316	晶盛机电	2,300	138,920.00	0.14
126	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.14
127	002714	牧原股份	3,900	136,461.00	0.14
128	600893	航发动力	3,500	134,190.00	0.13
129	601006	大秦铁路	28,700	132,307.00	0.13
130	600879	航天电子	6,200	131,998.00	0.13
131	600362	江西铜业	3,000	129,900.00	0.13

132	600418	江淮汽车	5,000	129,150.00	0.13
133	002156	通富微电	1,700	128,979.00	0.13
134	600989	宝丰能源	6,300	128,079.00	0.13
135	002001	新 和 成	4,400	125,048.00	0.12
136	002738	中矿资源	2,100	123,879.00	0.12
137	600028	中国石化	27,200	121,312.00	0.12
138	000960	锡业股份	2,800	119,532.00	0.12
139	600690	海尔智家	5,800	118,378.00	0.12
140	600010	包钢股份	53,000	118,190.00	0.12
141	600673	东阳光	3,500	117,530.00	0.12
142	300054	鼎龙股份	1,100	116,567.00	0.12
143	002407	多氟多	2,300	115,529.00	0.12
144	000426	兴业银锡	3,500	115,360.00	0.12
145	002648	卫星化学	4,900	115,101.00	0.12
146	600118	中国卫星	1,400	114,870.00	0.11
147	601727	上海电气	15,800	110,600.00	0.11
148	600885	宏发股份	3,100	106,919.00	0.11
149	000425	徐工机械	13,200	106,788.00	0.11
150	601628	中国人寿	3,000	106,050.00	0.11
151	600160	巨化股份	2,000	106,020.00	0.11
152	600392	盛和资源	3,500	104,195.00	0.10
153	600426	华鲁恒升	4,300	102,856.00	0.10
154	300442	润泽科技	1,200	99,684.00	0.10
155	300223	北京君正	400	99,560.00	0.10
156	600141	兴发集团	2,100	98,637.00	0.10
157	600905	三峡能源	26,500	98,315.00	0.10
158	002558	巨人网络	3,500	96,460.00	0.10
159	600406	国电南瑞	4,200	95,970.00	0.10
160	000933	神火股份	4,500	95,400.00	0.10
161	300395	菲利华	700	93,611.00	0.09
162	600460	士兰微	1,700	92,922.00	0.09
163	600352	浙江龙盛	7,500	90,825.00	0.09
164	300450	先导智能	2,200	89,584.00	0.09
165	003816	中国广核	22,700	88,757.00	0.09
166	002049	紫光国微	1,000	88,750.00	0.09
167	002625	光启技术	2,900	87,928.00	0.09
168	601868	中国能建	32,900	87,843.00	0.09
169	601360	三六零	10,100	87,769.00	0.09
170	688578	艾力斯	800	87,360.00	0.09
171	002532	天山铝业	8,100	86,913.00	0.09
172	600026	中远海能	4,800	86,112.00	0.09
173	300661	圣邦股份	600	86,088.00	0.09
174	688111	金山办公	400	85,220.00	0.09

175	300418	昆仑万维	2,100	84,756.00	0.08
176	002340	格林美	12,700	83,947.00	0.08
177	002120	韵达股份	13,100	83,316.00	0.08
178	000831	中国稀土	1,500	83,235.00	0.08
179	600066	宇通客车	3,100	83,111.00	0.08
180	000975	山金国际	4,800	81,600.00	0.08
181	002821	凯莱英	500	81,000.00	0.08
182	600143	金发科技	5,200	80,340.00	0.08
183	002812	恩捷股份	1,200	80,292.00	0.08
184	600233	圆通速递	5,000	78,750.00	0.08
185	601233	桐昆股份	3,600	77,940.00	0.08
186	601877	正泰电器	3,100	77,717.00	0.08
187	603129	春风动力	300	76,740.00	0.08
188	600115	中国东航	20,000	76,200.00	0.08
189	601179	中国西电	5,100	76,092.00	0.08
190	600096	云天化	2,500	76,000.00	0.08
191	002837	英维克	940	74,786.40	0.07
192	002555	三七互娱	3,900	73,593.00	0.07
193	601012	隆基绿能	5,600	73,472.00	0.07
194	002465	海格通信	5,700	72,789.00	0.07
195	600019	宝钢股份	13,200	71,676.00	0.07
196	002273	水晶光电	2,000	70,960.00	0.07
197	002027	分众传媒	14,600	70,664.00	0.07
198	300207	欣旺达	3,700	70,263.00	0.07
199	000878	云南铜业	4,300	68,284.00	0.07
200	300458	全志科技	1,700	67,082.00	0.07
201	002155	湖南黄金	2,800	66,836.00	0.07
202	002414	高德红外	4,900	64,974.00	0.06
203	002128	电投能源	2,800	64,736.00	0.06
204	601021	春秋航空	1,400	63,812.00	0.06
205	600988	赤峰黄金	2,400	63,168.00	0.06
206	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.06
207	300339	润和软件	1,600	61,616.00	0.06
208	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.06
209	603659	璞泰来	2,100	60,753.00	0.06
210	301358	湖南裕能	800	60,696.00	0.06
211	600699	均胜电子	2,800	60,508.00	0.06
212	600795	国电电力	12,900	60,243.00	0.06
213	600547	山东黄金	2,600	60,034.00	0.06
214	601677	明泰铝业	3,600	59,760.00	0.06
215	002074	国轩高科	2,100	57,771.00	0.06
216	300454	深信服	600	57,720.00	0.06
217	600346	恒力石化	3,200	56,672.00	0.06

218	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.06
219	002444	巨星科技	1,800	55,980.00	0.06
220	001979	招商蛇口	8,600	55,298.00	0.06
221	002129	TCL 中环	4,600	55,292.00	0.06
222	688266	泽璟制药	473	55,180.18	0.06
223	002064	华峰化学	5,800	55,042.00	0.06
224	002472	双环传动	1,300	53,963.00	0.05
225	300433	蓝思科技	1,000	53,660.00	0.05
226	002195	岩山科技	8,200	53,628.00	0.05
227	002185	华天科技	2,400	53,544.00	0.05
228	600177	雅戈尔	7,100	53,463.00	0.05
229	000066	中国长城	2,800	53,340.00	0.05
230	300001	特锐德	1,400	52,962.00	0.05
231	600580	卧龙电驱	1,600	52,960.00	0.05
232	300073	当升科技	1,100	52,844.00	0.05
233	600588	用友网络	5,700	52,326.00	0.05
234	603806	福斯特	3,100	52,049.00	0.05
235	002138	顺络电子	700	51,170.00	0.05
236	600219	南山铝业	12,800	51,072.00	0.05
237	002756	永兴材料	900	50,976.00	0.05
238	688122	西部超导	800	50,248.00	0.05
239	000157	中联重科	7,100	49,487.00	0.05
240	688599	天合光能	3,500	49,420.00	0.05
241	601127	赛力斯	800	49,000.00	0.05
242	603650	彤程新材	500	48,990.00	0.05
243	688396	华润微	500	48,775.00	0.05
244	600674	川投能源	3,400	48,178.00	0.05
245	605499	东鹏饮料	390	48,137.70	0.05
246	600438	通威股份	3,900	47,229.00	0.05
247	300017	网宿科技	3,600	46,836.00	0.05
248	300390	天华新能	500	46,755.00	0.05
249	600886	国投电力	3,500	46,585.00	0.05
250	300037	新宙邦	500	46,425.00	0.05
251	000547	航天发展	2,400	45,960.00	0.05
252	002436	兴森科技	900	45,855.00	0.05
253	300803	指南针	500	45,835.00	0.05
254	002025	航天电器	600	45,732.00	0.05
255	002456	欧菲光	4,800	45,408.00	0.05
256	300058	蓝色光标	3,260	44,857.60	0.04
257	688188	柏楚电子	420	44,814.00	0.04
258	001965	招商公路	4,800	43,968.00	0.04
259	601058	赛轮轮胎	3,800	43,814.00	0.04
260	300496	中科创达	700	43,253.00	0.04

261	000683	博源化工	7,500	43,200.00	0.04
262	002497	雅化集团	2,100	42,777.00	0.04
263	002131	利欧股份	9,000	42,750.00	0.04
264	000519	中兵红箭	2,000	42,140.00	0.04
265	002065	东华软件	5,800	41,412.00	0.04
266	603979	金诚信	700	41,321.00	0.04
267	600895	张江高科	1,100	40,975.00	0.04
268	600667	太极实业	1,400	40,852.00	0.04
269	002595	豪迈科技	870	40,542.00	0.04
270	300748	金力永磁	1,300	40,105.00	0.04
271	600029	南方航空	7,700	39,886.00	0.04
272	688005	容百科技	1,300	39,780.00	0.04
273	603087	甘李药业	700	39,732.00	0.04
274	601319	中国人保	5,800	39,208.00	0.04
275	688472	阿特斯	3,600	38,952.00	0.04
276	688223	晶科能源	8,100	38,475.00	0.04
277	600323	瀚蓝环境	1,400	38,444.00	0.04
278	600372	中航机载	3,500	37,975.00	0.04
279	600018	上港集团	8,000	37,760.00	0.04
280	600839	四川长虹	5,400	37,692.00	0.04
281	600008	首创环保	13,500	36,720.00	0.04
282	000039	中集集团	4,500	36,495.00	0.04
283	002236	大华股份	2,200	36,278.00	0.04
284	300763	锦浪科技	400	36,140.00	0.04
285	601000	唐山港	8,600	35,690.00	0.04
286	300568	星源材质	1,900	35,568.00	0.04
287	688036	传音控股	600	35,370.00	0.04
288	302132	中航成飞	600	34,992.00	0.03
289	300024	机器人	1,800	34,794.00	0.03
290	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.03
291	002130	沃尔核材	1,800	34,128.00	0.03
292	600153	建发股份	4,300	34,099.00	0.03
293	600570	恒生电子	1,600	33,904.00	0.03
294	000967	盈峰环境	3,200	33,696.00	0.03
295	002459	晶澳科技	4,100	33,210.00	0.03
296	000617	中油资本	5,000	32,950.00	0.03
297	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.03
298	600050	中国联通	8,100	32,400.00	0.03
299	000034	神州数码	1,160	32,190.00	0.03
300	002085	万丰奥威	2,900	32,161.00	0.03
301	601111	中国国航	5,300	32,065.00	0.03
302	002271	东方雨虹	2,700	32,049.00	0.03
303	300759	康龙化成	1,100	31,823.00	0.03

304	600039	四川路桥	4,000	31,280.00	0.03
305	002405	四维图新	4,800	31,056.00	0.03
306	002517	恺英网络	1,900	30,875.00	0.03
307	600415	小商品城	3,000	30,480.00	0.03
308	000400	许继电气	1,400	30,380.00	0.03
309	688271	联影医疗	300	30,369.00	0.03
310	600011	华能国际	4,000	30,360.00	0.03
311	300474	景嘉微	500	30,240.00	0.03
312	600312	平高电气	1,700	30,022.00	0.03
313	688506	百利天恒	100	29,403.00	0.03
314	002241	歌尔股份	1,300	29,289.00	0.03
315	600196	复星医药	1,300	29,211.00	0.03
316	600760	中航沈飞	700	28,770.00	0.03
317	601633	长城汽车	1,900	28,671.00	0.03
318	300122	智飞生物	2,300	26,887.00	0.03
319	601888	中国中免	500	26,855.00	0.03
320	600741	华域汽车	1,700	26,384.00	0.03
321	300012	华测检测	1,900	26,334.00	0.03
322	601607	上海医药	1,700	26,180.00	0.03
323	688063	派能科技	489	26,049.03	0.03
324	002176	江特电机	2,600	26,026.00	0.03
325	600529	山东药玻	1,400	25,830.00	0.03
326	605589	圣泉集团	400	25,428.00	0.03
327	000963	华东医药	900	25,308.00	0.03
328	300438	鹏辉能源	300	24,855.00	0.02
329	000538	云南白药	500	23,685.00	0.02
330	300118	东方日升	1,900	23,655.00	0.02
331	600104	上汽集团	2,400	23,424.00	0.02
332	300142	沃森生物	1,800	23,382.00	0.02
333	300251	光线传媒	2,100	23,289.00	0.02
334	000423	东阿阿胶	500	22,680.00	0.02
335	002078	太阳纸业	1,800	22,482.00	0.02
336	600316	洪都航空	800	22,352.00	0.02
337	002044	美年健康	4,400	22,132.00	0.02
338	600803	新奥股份	1,400	22,120.00	0.02
339	601669	中国电建	4,700	22,090.00	0.02
340	600585	海螺水泥	1,300	22,035.00	0.02
341	600655	豫园股份	5,300	21,783.00	0.02
342	688390	固德威	200	21,702.00	0.02
343	300015	爱尔眼科	2,600	21,476.00	0.02
344	000035	中国天楹	4,400	21,252.00	0.02
345	002432	九安医疗	300	21,204.00	0.02
346	300724	捷佳伟创	300	21,180.00	0.02

347	300866	安克创新	200	20,900.00	0.02
348	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.02
349	688114	华大智造	400	20,432.00	0.02
350	600816	建元信托	8,100	19,764.00	0.02
351	000623	吉林敖东	1,100	19,503.00	0.02
352	601618	中国中冶	7,900	19,276.00	0.02
353	002294	信立泰	600	19,134.00	0.02
354	688169	石头科技	200	18,994.00	0.02
355	601018	宁波港	6,000	18,900.00	0.02
356	600398	海澜之家	3,600	18,828.00	0.02
357	600048	保利发展	4,000	18,520.00	0.02
358	600208	衢州发展	6,500	18,395.00	0.02
359	601390	中国中铁	4,300	17,931.00	0.02
360	002389	航天彩虹	1,000	17,770.00	0.02
361	300457	赢合科技	800	16,864.00	0.02
362	300832	新产业	400	16,800.00	0.02
363	601238	广汽集团	3,300	16,764.00	0.02
364	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.02
365	600009	上海机场	700	16,170.00	0.02
366	600704	物产中大	3,400	16,048.00	0.02
367	688116	天奈科技	400	15,280.00	0.02
368	600515	海南机场	5,500	15,070.00	0.02
369	000032	深桑达 A	600	14,970.00	0.01
370	002410	广联达	1,800	14,688.00	0.01
371	000738	航发控制	800	14,632.00	0.01
372	600166	福田汽车	5,000	14,550.00	0.01
373	002091	江苏国泰	2,000	14,460.00	0.01
374	002244	滨江集团	1,900	14,440.00	0.01
375	601155	新城控股	1,400	14,364.00	0.01
376	688065	凯赛生物	300	14,355.00	0.01
377	601186	中国铁建	2,400	14,280.00	0.01
378	000830	鲁西化工	1,100	13,200.00	0.01
379	600998	九州通	2,800	13,132.00	0.01
380	603939	益丰药房	700	12,586.00	0.01
381	601800	中国交建	2,200	12,562.00	0.01
382	002292	奥飞娱乐	1,900	12,464.00	0.01
383	002601	龙佰集团	700	11,536.00	0.01
384	000733	振华科技	200	11,328.00	0.01
385	603816	顾家家居	500	11,180.00	0.01
386	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.01
387	000786	北新建材	600	10,854.00	0.01
388	600170	上海建工	4,700	10,434.00	0.01
389	600511	国药股份	400	10,416.00	0.01

390	603486	科沃斯	200	10,150.00	0.01
391	603260	合盛硅业	200	9,652.00	0.01
392	300347	泰格医药	200	9,600.00	0.01
393	600085	同仁堂	400	9,244.00	0.01
394	603606	东方电缆	220	9,132.20	0.01
395	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.01
396	600862	中航高科	500	9,015.00	0.01
397	600258	首旅酒店	800	8,736.00	0.01
398	600521	华海药业	600	8,640.00	0.01
399	300699	光威复材	300	8,595.00	0.01
400	603596	伯特利	344	8,544.96	0.01
401	301236	软通动力	200	8,490.00	0.01
402	601216	君正集团	1,900	8,474.00	0.01
403	600332	白云山	400	8,016.00	0.01
404	600325	华发股份	3,400	7,854.00	0.01
405	600765	中航重机	600	7,752.00	0.01
406	002603	以岭药业	500	7,500.00	0.01
407	000887	中鼎股份	400	7,156.00	0.01
408	300573	兴齐眼药	174	7,092.24	0.01
409	300676	华大基因	200	7,012.00	0.01
410	600763	通策医疗	200	6,776.00	0.01
411	000999	华润三九	300	6,747.00	0.01
412	601880	辽港股份	4,400	6,072.00	0.01
413	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.01
414	603392	万泰生物	200	5,394.00	0.01
415	688009	中国通号	1,100	5,236.00	0.01
416	603885	吉祥航空	500	5,145.00	0.01
417	002223	鱼跃医疗	200	5,132.00	0.01
418	600486	扬农化工	100	5,070.00	0.01
419	002607	中公教育	2,700	4,860.00	0.00
420	000932	华菱钢铁	1,400	4,858.00	0.00
421	603568	伟明环保	300	4,614.00	0.00
422	300601	康泰生物	400	4,536.00	0.00
423	000998	隆平高科	600	4,524.00	0.00
424	603899	晨光股份	200	4,126.00	0.00
425	000069	华侨城 A	2,500	4,100.00	0.00
426	600859	王府井	400	3,672.00	0.00
427	688017	绿的谐波	8	3,342.88	0.00
428	600864	哈投股份	300	1,557.00	0.00
429	600004	白云机场	200	1,452.00	0.00
430	600499	科达制造	100	1,380.00	0.00
431	600820	隧道股份	200	1,042.00	0.00
432	300070	碧水源	200	638.00	0.00

433	300144	宋城演艺	100	581.00	0.00
-----	--------	------	-----	--------	------

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	301536	星辰科技	7,800	1,003,938.00	1.00
2	688609	九联科技	41,500	456,915.00	0.46
3	601665	齐鲁银行	78,000	450,060.00	0.45
4	600458	时代新材	25,500	422,025.00	0.42
5	000962	东方钽业	4,100	371,460.00	0.37
6	601066	中信建投	12,700	369,189.00	0.37
7	600320	振华重工	83,400	344,442.00	0.34
8	300842	帝科股份	3,800	338,846.00	0.34
9	600973	宝胜股份	46,400	328,976.00	0.33
10	688680	海优新材	7,816	328,272.00	0.33
11	600919	江苏银行	30,100	324,478.00	0.32
12	603296	华勤技术	4,340	322,331.80	0.32
13	300943	春晖智控	6,400	287,680.00	0.29
14	603283	赛腾股份	3,300	267,234.00	0.27
15	688710	益诺思	3,800	255,360.00	0.26
16	600353	旭光电子	5,500	250,800.00	0.25
17	688110	东芯股份	1,200	244,440.00	0.24
18	688225	亚信安全	19,600	243,432.00	0.24
19	688268	华特气体	900	240,750.00	0.24
20	301283	聚胶股份	9,510	232,804.80	0.23
21	600869	远东股份	6,700	224,249.00	0.22
22	300969	恒帅股份	2,300	215,648.00	0.22
23	002653	海思科	3,100	205,654.00	0.21
24	688045	必易微	2,500	201,950.00	0.20
25	688385	复旦微电	2,800	199,612.00	0.20
26	688720	艾森股份	1,960	197,960.00	0.20
27	002885	京泉华	4,800	196,128.00	0.20
28	600909	华安证券	16,900	187,759.00	0.19
29	603444	吉比特	500	179,210.00	0.18
30	688551	科威尔	2,470	173,566.90	0.17
31	300776	帝尔激光	800	171,968.00	0.17
32	601208	东材科技	2,400	169,896.00	0.17
33	600428	中远海特	20,900	163,229.00	0.16
34	000708	中信特钢	12,900	162,798.00	0.16
35	002245	蔚蓝锂芯	8,332	155,891.72	0.16
36	600498	烽火通信	2,100	154,560.00	0.15
37	601059	信达证券	9,500	153,805.00	0.15
38	301589	诺瓦星云	1,000	148,980.00	0.15

39	688372	伟测科技	800	148,800.00	0.15
40	000951	中国重汽	7,600	148,276.00	0.15
41	603115	海星股份	1,200	146,964.00	0.15
42	002897	意华股份	1,600	140,768.00	0.14
43	301566	达利凯普	3,700	137,196.00	0.14
44	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.14
45	301529	福赛科技	1,400	134,904.00	0.13
46	603990	麦迪科技	6,000	127,740.00	0.13
47	688337	普源精电	1,700	127,381.00	0.13
48	300285	国瓷材料	1,200	123,816.00	0.12
49	688456	有研粉材	800	111,680.00	0.11
50	600203	福日电子	8,800	106,920.00	0.11
51	301502	华阳智能	1,500	104,280.00	0.10
52	688301	奕瑞科技	840	104,160.00	0.10
53	301071	力量钻石	1,100	101,750.00	0.10
54	688388	嘉元科技	2,265	99,660.00	0.10
55	688443	智翔金泰	4,100	95,325.00	0.10
56	603013	亚普股份	5,600	88,424.00	0.09
57	605016	百龙创园	3,200	82,720.00	0.08
58	002345	潮宏基	8,500	77,945.00	0.08
59	603558	健盛集团	6,700	74,303.00	0.07
60	002468	申通快递	5,100	74,256.00	0.07
61	301219	腾远钴业	1,330	72,884.00	0.07
62	002956	西麦食品	3,500	72,660.00	0.07
63	300867	圣元环保	4,000	72,480.00	0.07
64	688095	福昕软件	1,200	71,316.00	0.07
65	603317	天味食品	5,300	68,953.00	0.07
66	300681	英搏尔	2,400	68,688.00	0.07
67	301109	军信股份	5,500	68,530.00	0.07
68	002154	报喜鸟	19,100	67,996.00	0.07
69	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.07
70	300957	贝泰妮	2,100	66,171.00	0.07
71	301371	敷尔佳	2,500	65,000.00	0.06
72	605189	富春染织	5,300	63,865.00	0.06
73	600455	博通股份	2,900	63,684.00	0.06
74	300662	科锐国际	3,700	62,826.00	0.06
75	301239	普瑞眼科	2,000	60,900.00	0.06
76	002204	大连重工	11,000	58,080.00	0.06
77	603889	新澳股份	10,920	55,801.20	0.06
78	688682	霍莱沃	1,400	54,460.00	0.05
79	002624	完美世界	4,100	50,922.00	0.05
80	300464	星徽股份	7,000	49,910.00	0.05
81	688035	德邦科技	500	45,900.00	0.05

82	300088	长信科技	3,600	41,760.00	0.04
83	000629	钨钛股份	10,800	36,072.00	0.04
84	603225	新凤鸣	1,400	27,510.00	0.03
85	603077	和邦生物	11,800	27,376.00	0.03
86	600637	东方明珠	3,100	25,761.00	0.03
87	300383	光环新网	2,000	24,880.00	0.02
88	600256	广汇能源	5,000	24,700.00	0.02
89	688290	景业智能	300	19,908.00	0.02
90	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.02
91	300628	亿联网络	550	18,601.00	0.02
92	300459	汤姆猫	5,400	18,306.00	0.02
93	600845	宝信软件	1,000	16,630.00	0.02
94	002180	奔图科技	1,000	16,360.00	0.02
95	688096	京源环保	1,200	16,032.00	0.02
96	301381	赛维时代	500	9,220.00	0.01
97	300002	神州泰岳	1,100	8,591.00	0.01
98	300627	华测导航	280	7,952.00	0.01
99	300529	健帆生物	500	7,700.00	0.01
100	300322	硕贝德	300	7,560.00	0.01
101	600007	中国国贸	300	5,694.00	0.01
102	001914	招商积余	200	1,632.00	0.00
103	688595	芯海科技	36	1,578.96	0.00
104	000761	本钢板材	200	430.00	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	000338	潍柴动力	1,735,221.00	1.88
2	300750	宁德时代	1,682,577.00	1.82
3	300308	中际旭创	1,486,130.00	1.61
4	000100	TCL 科技	1,466,618.00	1.59
5	600150	中国船舶	1,450,184.78	1.57
6	000333	美的集团	1,412,913.00	1.53
7	000708	中信特钢	1,307,872.00	1.42
8	000725	京东方 A	1,284,308.00	1.39
9	600320	振华重工	1,199,966.00	1.30
10	002415	海康威视	1,114,148.00	1.21
11	603444	吉比特	1,108,945.00	1.20
12	603799	华友钴业	1,072,869.00	1.16
13	000807	云铝股份	1,063,803.00	1.15
14	002384	东山精密	1,055,243.00	1.14
15	000792	盐湖股份	1,019,821.00	1.10

16	002028	思源电气	1,019,367.00	1.10
17	002460	赣锋锂业	1,013,328.00	1.10
18	600519	贵州茅台	995,527.00	1.08
19	601211	国泰海通	991,914.00	1.07
20	600900	长江电力	967,734.00	1.05

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	300750	宁德时代	2,491,724.00	2.70
2	000338	潍柴动力	1,661,051.00	1.80
3	300308	中际旭创	1,593,045.00	1.73
4	600019	宝钢股份	1,447,167.00	1.57
5	000333	美的集团	1,410,633.00	1.53
6	603444	吉比特	1,297,680.00	1.41
7	002415	海康威视	1,271,599.00	1.38
8	600519	贵州茅台	1,256,508.00	1.36
9	000100	TCL 科技	1,248,858.00	1.35
10	600031	三一重工	1,225,262.00	1.33
11	002008	大族激光	1,213,805.00	1.31
12	601318	中国平安	1,149,692.00	1.25
13	002475	立讯精密	1,130,537.00	1.22
14	000725	京东方 A	1,123,483.00	1.22
15	000792	盐湖股份	1,105,180.00	1.20
16	000708	中信特钢	1,051,568.00	1.14
17	600057	厦门象屿	1,042,089.00	1.13
18	002460	赣锋锂业	1,040,083.00	1.13
19	688331	荣昌生物	1,036,520.62	1.12
20	600066	宇通客车	1,017,230.00	1.10

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	179,656,200.42
卖出股票收入（成交）总额	185,007,933.31

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	5,149,031.04	5.15
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	5,149,031.04	5.15

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	102310	国债 2513	26,000	2,632,826.25	2.63
2	019827	26 国债 01	25,000	2,516,204.79	2.51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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投资。

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。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

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约定的备选股票库

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	17,834.56
2	应收清算款	321,096.34
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	60,597.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	399,528.18

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

本基金本报告期末不存在前十名股票中有流通受限的情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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（%）
农银中证 A500 指数增强 A	1,260	37,003.84	14,726,317.99	31.58	31,898,524.40	68.42
农银中证 A500 指数增强 C	980	25,011.54	0.00	0.00	24,511,310.86	100.00

合计	2,240	31,757.21	14,726,317.99	20.70	56,409,835.26	79.30
----	-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

注：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	农银中证 A500 指数增强 A	49,627.14	0.1064
	农银中证 A500 指数增强 C	17,000.04	0.0694
	合计	66,627.18	0.0937

注：注： 1、本基金于 2008 年 12 月 23 日成立，自 2010 年 10 月 25 日分为 A、C 两类。

2、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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	农银中证 A500 指数增强 A	0~10
	农银中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	农银中证 A500 指数增强 A	0
	农银中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银中证 A500 指数增强 A	农银中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 25 日）基金份额总额	590,675,589.66	320,878,159.65
本报告期期初基金份额总额	49,724,982.09	24,865,596.78
本报告期基金总申购份额	23,729,507.85	38,682,577.22
减：本报告期基金	26,829,647.55	39,036,863.14

总赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	46,624,842.39	24,511,310.86

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

本报告期内，根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第六届董事会第六次会议决议，孙建坤先生自 2026 年 6 月 5 日起担任本公司总经理职务。程昆先生自 2026 年 6 月 5 日起不再担任公司总经理，黄涛先生自 2026 年 6 月 5 日起不再代为履行总经理职务。

本公司已于 2026 年 6 月 6 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内，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

本报告期内，未发生影响基金管理人公司经营或基金财产的诉讼。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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无因托管业务受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
华创证券	2	122,940,744.49	33.71	24,331.91	33.71	-
东方证券	2	104,407,298.47	28.63	20,661.56	28.63	-
长江证券	2	39,926,068.06	10.95	7,902.05	10.95	-
中信证券	2	38,213,483.01	10.48	7,563.10	10.48	-
国泰海通证券	2	25,913,783.24	7.11	5,128.30	7.11	-
国金证券	2	23,052,075.37	6.32	4,562.02	6.32	-
天风证券	2	3,426,481.03	0.94	678.12	0.94	-
申万宏源证券	2	3,025,317.96	0.83	598.75	0.83	-
兴业证券	2	2,681,406.60	0.74	530.52	0.74	-
华泰证券	2	1,077,475.50	0.30	213.26	0.30	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

（1）财务状况良好，注册资本不少于 20 亿元人民币，最近一个完整年度在证券业协会披露的审计报告被出具无保留意见。

（2）交易、研究等服务能力较强，最近一个完整年度年报披露的佣金席位占比在全市场前 1/2。

（3）经营行为规范，合规风控能力较强，最近一年未因研究、交易业务违规而在中国证券监督管理委员会及其派出机构网站披露受到行政处罚。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
华创证券	-	-	17,200,000.00	20.85	-	-
东方证券	-	-	21,800,000.00	26.42	-	-
长江证券	-	-	2,800,000.00	3.39	-	-
中信证券	-	-	5,000,000.00	6.06	-	-
国泰海通证券	2,602,067.00	50.98	8,100,000.00	9.82	-	-
国金证券	-	-	10,000,000.00	12.12	-	-
天风证券	2,502,310.00	49.02	7,900,000.00	9.58	-	-
申万宏源证券	-	-	3,700,000.00	4.48	-	-
兴业证券	-	-	2,500,000.00	3.03	-	-
华泰证券	-	-	3,500,000.00	4.24	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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 A500 指数增强型证券	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 21 日

	投资基金 2025 年第 4 季度报告		
2	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 30 日
3	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 21 日
4	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金-招募说明书更新-2026 年第 1 次	中国证监会规定的媒介	2026 年 6 月 29 日
5	农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026 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

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	2026-06-22 至 2026-06-30	6,651,493.98	7,935,084.52	0.00	14,586,578.50	20.51

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。

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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 A500 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、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

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。

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

2026 年 8 月 28 日