

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 500 指数证券投资基金	
基金简称	农银中证 500 指数	
基金主代码	660011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 11 月 29 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	73,353,471.88 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 500 指数 A	农银中证 500 指数 C
下属分级基金的交 易代码	660011	027247
报告期末下属分级 基金的份额总额	72,351,424.72 份	1,002,047.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%×中证 500 指数+5%×同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	方圆
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码	200120	200336
法定代表人	黄涛	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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)	2026 年 4 月 24 日（基金合同生效 日） - 2026 年 6 月 30 日
	农银中证 500 指数 A	农银中证 500 指数 C
本期已实现收益	19,754,817.28	110,282.67
本期利润	25,634,945.01	165,974.90
加权平均基金份 额本期利润	0.3562	0.3721
本期加权平均净 值利润率	16.81%	17.10%
本期基金份额净 值增长率	20.51%	4.25%
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	95,049,760.69	1,315,801.16
期末可供分配基 金份额利润	1.3137	1.3131
期末基金资产净 值	167,401,185.41	2,317,848.32
期末基金份额净 值	2.3137	2.3131

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	131.37%	4.25%

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 500 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
过去三个月	18.25%	1.56%	17.61%	1.56%	0.64%	0.00%
过去六个月	20.51%	1.57%	19.93%	1.58%	0.58%	-0.01%
过去一年	50.90%	1.35%	49.68%	1.35%	1.22%	0.00%
过去三年	50.90%	1.40%	48.12%	1.41%	2.78%	-0.01%
过去五年	35.86%	1.29%	31.58%	1.30%	4.28%	-0.01%
过去七年	82.70%	1.29%	78.52%	1.29%	4.18%	0.00%
过去十年	47.04%	1.27%	46.37%	1.28%	0.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	131.37%	1.46%	126.31%	1.48%	5.06%	-0.02%

农银中证 500 指数 C

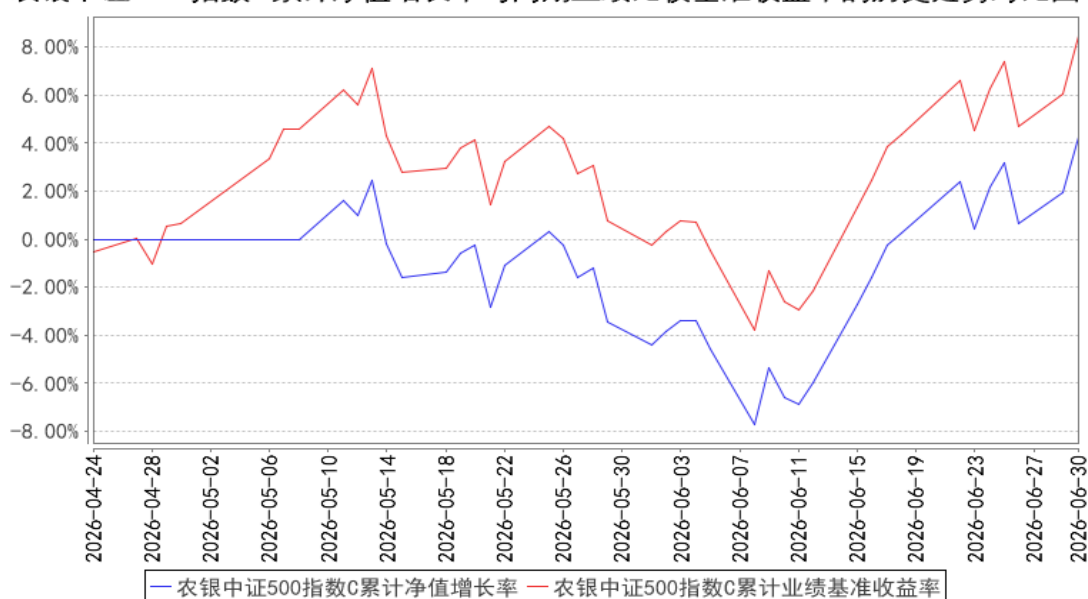
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	4.25%	1.51%	8.45%	1.60%	-4.20%	-0.09%

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

农银中证500指数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500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：本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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		
宋永安	本基金的基金经理	2014 年 2 月 10 日	—	18 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遵规守信情况的说明

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。

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

报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0229%，日均偏离度为 0.0162%，报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：

1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银中证 500 指数 A 基金份额净值为 2.3137 元,本报告期基金份额净值增长率为 20.51%,同期业绩比较基准收益率为 19.93%;截至本报告期末农银中证 500 指数 C 基金份额净值为 2.3131 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.25%,同期业绩比较基准收益率为 8.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、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

本报告期内,基金托管人在农银汇理中证 500 指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽

的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：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	5,361,076.67	3,432,372.11
结算备付金		514,491.17	19,907.39
存出保证金		55,954.22	8,129.06
交易性金融资产	6.4.7.2	169,634,659.97	87,559,353.80
其中：股票投资		161,042,275.45	85,943,199.50
基金投资		-	-
债券投资		8,592,384.52	1,616,154.30
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		832,269.12	-

应收股利		-	-
应收申购款		494,546.90	120,081.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		176,892,998.05	91,139,843.99
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		5,001,290.42	-
应付清算款		-	131,505.42
应付赎回款		1,948,751.61	309,266.17
应付管理人报酬		107,197.94	56,637.76
应付托管费		21,439.59	11,327.57
应付销售服务费		298.19	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		259.06	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	94,727.51	97,760.11
负债合计		7,173,964.32	606,497.03
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	73,353,471.88	47,154,074.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	96,365,561.85	43,379,272.95
净资产合计		169,719,033.73	90,533,346.96
负债和净资产总计		176,892,998.05	91,139,843.99

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 73,353,471.88 份，其中下属 A 类基金份额净值 2.3137 元，基金份额总额 72,351,424.72 份；下属 C 类基金份额净值 2.3131 元，基金份额总额 1,002,047.16 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		26,543,844.39	3,208,706.01
1. 利息收入		11,530.36	4,193.95

其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,530.36	4,193.95
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,298,647.78	57,307.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,183,151.94	-682,163.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	42,945.32	9,514.63
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	1,072,550.52	729,957.25
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	5,935,819.96	3,125,912.75
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	297,846.29	21,291.41
减：二、营业总支出		742,924.48	439,653.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	563,830.19	284,609.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	112,766.02	56,921.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	305.42	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,232.91	536.58
其中：卖出回购金融资产支出		12,232.91	536.58
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		88.96	-
8. 其他费用	6.4.7.23	53,700.98	97,585.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,800,919.91	2,769,052.41
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,800,919.91	2,769,052.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25,800,919.91	2,769,052.41

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：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	47,154,074.01	-	43,379,272.95	90,533,346.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	47,154,074.01	-	43,379,272.95	90,533,346.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	26,199,397.87	-	52,986,288.90	79,185,686.77
（一）、综合收益总额	-	-	25,800,919.91	25,800,919.91
（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）	26,199,397.87	-	27,185,368.99	53,384,766.86
其中：1. 基金申购款	115,615,390.62	-	131,067,883.64	246,683,274.26
2. 基金赎回款	-89,415,992.75	-	- 103,882,514.65	-193,298,507.40
（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	73,353,471.88	-	96,365,561.85	169,719,033.73
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	52,427,517.28	-	25,095,620.61	77,523,137.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	52,427,517.28	-	25,095,620.61	77,523,137.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-548,917.99	-	2,568,927.60	2,020,009.61
(一)、综合收益总额	-	-	2,769,052.41	2,769,052.41
(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)	-548,917.99	-	-200,124.81	-749,042.80
其中：1. 基金申购款	9,875,297.75	-	4,926,758.69	14,802,056.44
2. 基金赎回款	-10,424,215.74	-	-5,126,883.50	-15,551,099.24
(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	51,878,599.29	-	27,664,548.21	79,543,147.50

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 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》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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,免征增值税直至债券到期。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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(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 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	5,361,076.67
等于: 本金	5,360,300.17
加: 应计利息	776.50
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	5,361,076.67

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		140,876,526.10	-	161,042,275.45	20,165,749.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,508,399.92	87,184.52	8,592,384.52	-3,199.92
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,508,399.92	87,184.52	8,592,384.52	-3,199.92
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		149,384,926.02	87,184.52	169,634,659.97	20,162,549.43

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	6,494.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,602.08
其中：交易所市场	43,602.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	94,727.51

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银中证 500 指数 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	47,154,074.01	47,154,074.01
本期申购	114,576,510.17	114,576,510.17
本期赎回（以“-”号填列）	-89,379,159.46	-89,379,159.46
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	72,351,424.72	72,351,424.72

农银中证 500 指数 C

项目	本期 2026 年 4 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,038,880.45	1,038,880.45
本期赎回（以“-”号填列）	-36,833.29	-36,833.29
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	1,002,047.16	1,002,047.16

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 500 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,529,675.92	-10,150,402.97	43,379,272.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	53,529,675.92	-10,150,402.97	43,379,272.95
本期利润	19,754,817.28	5,880,127.73	25,634,945.01
本期基金份额交易产生的变动数	27,527,745.74	-1,492,203.01	26,035,542.73
其中：基金申购款	138,379,381.37	-8,505,360.31	129,874,021.06
基金赎回款	-110,851,635.63	7,013,157.30	-103,838,478.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,812,238.94	-5,762,478.25	95,049,760.69

农银中证 500 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	110,282.67	55,692.23	165,974.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,285,339.45	-135,513.19	1,149,826.26
其中：基金申购款	1,334,211.26	-140,348.68	1,193,862.58
基金赎回款	-48,871.81	4,835.49	-44,036.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,395,622.12	-79,820.96	1,315,801.16

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	10,947.98
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	535.87
其他	46.51
合计	11,530.36

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	135,932,673.44
减：卖出股票成本总额	116,597,265.11
减：交易费用	152,256.39
买卖股票差价收入	19,183,151.94

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	43,403.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-458.08
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	42,945.32

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	7,782,821.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,705,515.08
减：应计利息总额	77,764.81
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-458.08

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	1,072,550.52
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	1,072,550.52

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	5,935,819.96
股票投资	5,939,415.88
债券投资	-3,595.92
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	5,935,819.96

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	288,729.66
基金转换费收入	9,116.63
合计	297,846.29

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	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	70.00
账户维护费	9,000.00
合计	53,700.98

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	563,830.19	284,609.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	257,915.74	128,142.76
应支付基金管理人的净管理费	305,914.45	156,467.09

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	112,766.02	56,921.95

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 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支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

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 1 月 1 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
交通银行	5,361,076.67	10,947.98	2,624,746.80	4,119.59

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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（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
------	------	------	------	----------------	----------	----------------	-----------	------------	----------------	----

400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	公告重 大事项	0.00	-	-	41,300	124,465.48	0.00	-
--------	------	--------------------------	------------	------	---	---	--------	------------	------	---

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 5,001,290.42 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	8,592,384.52	1,616,154.30
合计	8,592,384.52	1,616,154.30

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。

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	5,361,076.67	-	-	-	5,361,076.67
结算备付金	514,491.17	-	-	-	514,491.17
存出保证金	55,954.22	-	-	-	55,954.22
交易性金融资产	8,592,384.52	-	-	161,042,275.45	169,634,659.97
应收申购款	-	-	-	494,546.90	494,546.90
应收清算款	-	-	-	832,269.12	832,269.12
资产总计	14,523,906.58	-	-	162,369,091.47	176,892,998.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,948,751.61	1,948,751.61
应付管理人报酬	-	-	-	107,197.94	107,197.94
应付托管费	-	-	-	21,439.59	21,439.59
卖出回购金融资产款	5,001,290.42	-	-	-	5,001,290.42
应付销售服务费	-	-	-	298.19	298.19
应交税费	-	-	-	259.06	259.06
其他负债	-	-	-	94,727.51	94,727.51
负债总计	5,001,290.42	-	-	2,172,673.90	7,173,964.32
利率敏感度缺口	9,522,616.16	-	-	160,196,417.57	169,719,033.73
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	3,432,372.11	-	-	-	3,432,372.11
结算备付金	19,907.39	-	-	-	19,907.39
存出保证金	8,129.06	-	-	-	8,129.06
交易性金融资产	1,616,154.30	-	-	85,943,199.50	87,559,353.80
应收申购款	-	-	-	120,081.63	120,081.63
资产总计	5,076,562.86	-	-	86,063,281.13	91,139,843.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	309,266.17	309,266.17
应付管理人报酬	-	-	-	56,637.76	56,637.76
应付托管费	-	-	-	11,327.57	11,327.57
应付清算款	-	-	-	131,505.42	131,505.42
其他负债	-	-	-	97,760.11	97,760.11
负债总计	-	-	-	606,497.03	606,497.03
利率敏感度缺口	5,076,562.86	-	-	85,456,784.10	90,533,346.96

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	-5,447.78	-1,157.97
	市场利率平行下降 25 个基点	5,447.78	1,157.97

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	161,042,275.45	94.89	85,943,199.50	94.93
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	161,042,275.45	94.89	85,943,199.50	94.93

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%	8,485,580.59	4,529,997.11
	业绩比较基准下降 5%	-8,485,580.59	-4,529,997.11

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	161,042,275.45	85,943,199.50
第二层次	8,592,384.52	1,616,154.30

第三层次	-	-
合计	169,634,659.97	87,559,353.80

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，确定相关股票和债券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	161,042,275.45	91.04
	其中：股票	161,042,275.45	91.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,592,384.52	4.86
	其中：债券	8,592,384.52	4.86
	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	5,875,567.84	3.32

8	其他各项资产	1,382,770.24	0.78
9	合计	176,892,998.05	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	524,793.00	0.31
B	采矿业	4,923,535.40	2.90
C	制造业	121,571,694.80	71.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,909,468.00	2.30
E	建筑业	947,777.50	0.56
F	批发和零售业	3,067,603.58	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,933,684.10	1.14
H	住宿和餐饮业	118,734.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,365,295.55	6.11
J	金融业	8,754,979.66	5.16
K	房地产业	649,591.00	0.38
L	租赁和商务服务业	1,421,792.60	0.84
M	科学研究和技术服务业	1,171,784.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	555,083.78	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	369,727.48	0.22
R	文化、体育和娱乐业	756,731.00	0.45
S	综合	—	—
	合计	161,042,275.45	94.89

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688498	源杰科技	1,600	3,017,600.00	1.78
2	300604	长川科技	6,200	2,116,804.00	1.25
3	001309	德明利	2,200	2,074,380.00	1.22
4	688347	华虹宏力	6,000	2,017,800.00	1.19
5	688120	华海清科	5,829	1,877,987.22	1.11
6	002008	大族激光	11,700	1,756,287.00	1.03
7	002281	光迅科技	6,749	1,734,088.06	1.02
8	300857	协创数据	4,920	1,672,308.00	0.99
9	300136	信维通信	13,600	1,621,800.00	0.96
10	688361	中科飞测	3,400	1,462,000.00	0.86
11	300223	北京君正	5,700	1,418,730.00	0.84
12	300475	香农芯创	4,700	1,410,000.00	0.83
13	002436	兴森科技	24,100	1,227,895.00	0.72
14	300285	国瓷材料	11,600	1,196,888.00	0.71
15	300666	江丰电子	3,200	1,179,520.00	0.69
16	300054	鼎龙股份	11,100	1,176,267.00	0.69
17	600105	永鼎股份	16,600	1,120,168.00	0.66
18	688200	华峰测控	2,100	1,102,710.00	0.65
19	688777	中控技术	9,200	1,081,000.00	0.64
20	688037	芯源微	2,400	1,053,720.00	0.62
21	601869	长飞光纤	1,900	1,037,210.00	0.61
22	000021	深科技	15,709	1,009,617.43	0.59
23	002851	麦格米特	6,000	1,003,080.00	0.59
24	300757	罗博特科	1,600	990,400.00	0.58
25	300548	长芯博创	3,300	917,400.00	0.54
26	300346	南大光电	9,900	917,235.00	0.54
27	002409	雅克科技	4,000	898,000.00	0.53
28	300567	精测电子	2,800	889,280.00	0.52
29	300620	光库科技	2,300	869,860.00	0.51
30	688313	仕佳光子	4,700	867,855.00	0.51
31	688019	安集科技	2,546	864,265.16	0.51
32	688002	睿创微纳	5,550	858,529.50	0.51
33	002185	华天科技	38,000	847,780.00	0.50
34	600498	烽火通信	11,500	846,400.00	0.50
35	002407	多氟多	16,700	838,841.00	0.49
36	002138	顺络电子	11,300	826,030.00	0.49
37	300395	菲利华	6,100	815,753.00	0.48
38	600879	航天电子	37,560	799,652.40	0.47

39	688017	绿的谐波	1,900	793,934.00	0.47
40	300390	天华新能	8,160	763,041.60	0.45
41	688469	芯联集成	71,700	760,737.00	0.45
42	301526	国际复材	16,100	751,387.00	0.44
43	688702	盛科通信	1,837	716,411.63	0.42
44	002273	水晶光电	20,015	710,132.20	0.42
45	300373	扬杰科技	4,500	707,535.00	0.42
46	300058	蓝色光标	51,260	705,337.60	0.42
47	603256	宏和科技	2,600	689,858.00	0.41
48	300037	新宙邦	7,400	687,090.00	0.40
49	300751	迈为股份	2,400	677,904.00	0.40
50	688172	燕东微	8,032	671,957.12	0.40
51	002821	凯莱英	2,700	437,400.00	0.26
51	600499	科达制造	16,300	224,940.00	0.13
52	301377	鼎泰高科	1,200	661,080.00	0.39
53	605358	立昂微	8,400	651,840.00	0.38
54	002738	中矿资源	10,500	619,395.00	0.36
55	600988	赤峰黄金	23,500	618,520.00	0.36
56	001389	广合科技	2,600	616,850.00	0.36
57	605589	圣泉集团	9,700	616,629.00	0.36
58	002126	银轮股份	12,300	612,540.00	0.36
59	600885	宏发股份	17,753	612,300.97	0.36
60	600141	兴发集团	12,668	595,015.96	0.35
61	000960	锡业股份	13,900	593,391.00	0.35
62	600392	盛和资源	19,910	592,720.70	0.35
63	600601	方正科技	42,600	589,584.00	0.35
64	000831	中国稀土	10,400	577,096.00	0.34
65	002812	恩捷股份	8,500	568,735.00	0.34
66	688099	晶晨股份	5,500	565,950.00	0.33
67	601179	中国西电	36,600	546,072.00	0.32
68	300570	太辰光	2,200	542,762.00	0.32
69	600378	昊华科技	7,200	542,736.00	0.32
70	301358	湖南裕能	7,100	538,677.00	0.32
71	002195	岩山科技	80,630	527,320.20	0.31
72	600497	驰宏锌锗	43,000	520,730.00	0.31
73	002850	科达利	2,700	511,110.00	0.30
74	688629	华丰科技	2,700	506,277.00	0.30
75	600157	永泰能源	310,800	500,388.00	0.29
76	002261	拓维信息	17,700	495,777.00	0.29
77	688052	纳芯微	1,700	490,127.00	0.29
78	688234	天岳先进	2,800	485,828.00	0.29
79	600711	盛屯矿业	44,100	483,777.00	0.29
80	002340	格林美	72,400	478,564.00	0.28

81	600909	华安证券	42,920	476,841.20	0.28
82	301200	大族数控	1,300	468,845.00	0.28
83	003031	中瓷电子	2,600	468,780.00	0.28
84	688235	百济神州	1,833	466,700.13	0.27
85	688411	海博思创	1,600	465,920.00	0.27
86	600143	金发科技	30,100	465,045.00	0.27
87	300017	网宿科技	35,400	460,554.00	0.27
88	002131	利欧股份	96,400	457,900.00	0.27
89	000783	长江证券	46,800	456,300.00	0.27
90	688027	国盾量子	900	453,609.00	0.27
91	301611	珂玛科技	2,500	450,175.00	0.27
92	600352	浙江龙盛	37,100	449,281.00	0.26
93	601555	东吴证券	56,680	448,905.60	0.26
94	002203	海亮股份	19,600	447,860.00	0.26
95	603659	璞泰来	15,300	442,629.00	0.26
96	300339	润和软件	11,400	439,014.00	0.26
97	601233	桐昆股份	20,200	437,330.00	0.26
98	002966	苏州银行	62,480	434,860.80	0.26
99	300759	康龙化成	14,800	428,164.00	0.25
100	688122	西部超导	6,700	420,827.00	0.25
101	688213	思特威	3,900	417,573.00	0.25
102	688220	翱捷科技	3,316	412,245.12	0.24
103	002472	双环传动	9,900	410,949.00	0.24
104	603308	应流股份	6,800	410,720.00	0.24
105	603129	春风动力	1,600	409,280.00	0.24
106	300458	全志科技	10,140	400,124.40	0.24
107	300207	欣旺达	21,000	398,790.00	0.23
108	601108	财通证券	46,100	398,765.00	0.23
109	300001	特锐德	10,400	393,432.00	0.23
110	002517	恺英网络	24,200	393,250.00	0.23
111	002601	龙佰集团	23,800	392,224.00	0.23
112	002797	第一创业	59,600	391,572.00	0.23
113	688387	信科移动	19,400	384,896.00	0.23
114	601958	金钼股份	13,600	382,296.00	0.23
115	600563	法拉电子	2,000	381,600.00	0.22
116	300115	长盈精密	13,600	379,984.00	0.22
117	688322	奥比中光	2,900	378,595.00	0.22
118	601991	大唐发电	53,100	375,948.00	0.22
119	688301	奕瑞科技	3,014	373,736.00	0.22
120	002155	湖南黄金	15,610	372,610.70	0.22
121	601198	东兴证券	27,400	372,366.00	0.22
122	688578	艾力斯	3,400	371,280.00	0.22
123	000703	恒逸石化	27,000	366,390.00	0.22

124	688385	复旦微电	5,101	363,650.29	0.21
125	603156	养元饮品	7,400	363,118.00	0.21
126	002465	海格通信	28,100	358,837.00	0.21
127	300454	深信服	3,700	355,940.00	0.21
128	603650	彤程新材	3,600	352,728.00	0.21
129	601665	齐鲁银行	60,900	351,393.00	0.21
130	603179	新泉股份	7,060	350,529.00	0.21
131	002056	横店东磁	11,400	347,472.00	0.20
132	600884	杉杉股份	25,500	345,525.00	0.20
133	002402	和而泰	13,300	343,539.00	0.20
134	600707	彩虹股份	20,200	341,178.00	0.20
135	688331	荣昌生物	2,600	338,676.00	0.20
136	300024	机器人	17,500	338,275.00	0.20
137	002130	沃尔核材	17,800	337,488.00	0.20
138	601162	天风证券	99,900	336,663.00	0.20
139	000060	中金岭南	44,000	333,080.00	0.20
140	300012	华测检测	24,000	332,640.00	0.20
141	002429	兆驰股份	31,900	331,441.00	0.20
142	000893	亚钾国际	8,100	331,209.00	0.20
143	300496	中科创达	5,300	327,487.00	0.19
144	000878	云南铜业	20,600	327,128.00	0.19
145	601099	太平洋	96,700	325,879.00	0.19
146	603379	三美股份	4,280	324,809.20	0.19
147	600109	国金证券	36,700	322,226.00	0.19
148	301536	星辰科技	2,500	321,775.00	0.19
149	002414	高德红外	24,200	320,892.00	0.19
150	000034	神州数码	11,560	320,790.00	0.19
151	002271	东方雨虹	27,000	320,490.00	0.19
152	002432	九安医疗	4,500	318,060.00	0.19
153	300474	景嘉微	5,250	317,520.00	0.19
154	688266	泽璟制药	2,700	314,982.00	0.19
155	600298	安琪酵母	8,700	314,940.00	0.19
156	600060	海信视像	11,300	314,931.00	0.19
157	300623	捷捷微电	7,000	314,930.00	0.19
158	603688	石英股份	3,800	313,918.00	0.18
159	688728	格科微	14,900	313,496.00	0.18
160	002487	大金重工	5,400	313,038.00	0.18
161	600256	广汇能源	63,200	312,208.00	0.18
162	688676	金盘科技	3,681	311,559.84	0.18
163	002444	巨星科技	10,000	311,000.00	0.18
164	002335	科华数据	7,310	310,309.50	0.18
165	300073	当升科技	6,400	307,456.00	0.18
166	300763	锦浪科技	3,400	307,190.00	0.18

167	002756	永兴材料	5,400	305,856.00	0.18
168	600021	上海电力	20,100	302,907.00	0.18
169	600699	均胜电子	14,000	302,540.00	0.18
170	603979	金诚信	5,100	301,053.00	0.18
171	002078	太阳纸业	24,100	301,009.00	0.18
172	603087	甘李药业	5,300	300,828.00	0.18
173	601615	明阳智能	26,000	300,820.00	0.18
174	601128	常熟银行	51,628	300,474.96	0.18
175	000733	振华科技	5,300	300,192.00	0.18
176	000661	长春高新	4,500	299,700.00	0.18
177	601696	中银证券	23,600	298,540.00	0.18
178	601577	长沙银行	34,200	297,882.00	0.18
179	603920	世运电路	6,200	297,848.00	0.18
180	300919	中伟新材	6,800	297,500.00	0.18
181	002025	航天电器	3,900	297,258.00	0.18
182	300432	富临精工	14,700	295,323.00	0.17
183	300748	金力永磁	9,560	294,926.00	0.17
184	002157	正邦科技	104,900	294,769.00	0.17
185	603606	东方电缆	7,080	293,890.80	0.17
186	300142	沃森生物	22,600	293,574.00	0.17
187	688343	云天励飞	3,500	285,810.00	0.17
188	000423	东阿阿胶	6,300	285,768.00	0.17
189	688169	石头科技	3,000	284,910.00	0.17
190	002252	上海莱士	64,900	281,666.00	0.17
191	688599	天合光能	19,800	279,576.00	0.16
192	000728	国元证券	37,300	279,377.00	0.16
193	688608	恒玄科技	1,660	277,535.40	0.16
194	300724	捷佳伟创	3,900	275,340.00	0.16
195	603290	斯达半导	1,800	275,292.00	0.16
196	688375	国博电子	2,589	270,032.70	0.16
197	002064	华峰化学	28,100	266,669.00	0.16
198	000786	北新建材	14,600	264,114.00	0.16
199	600171	上海贝岭	8,200	261,908.00	0.15
200	688180	君实生物	7,731	261,462.42	0.15
201	688018	乐鑫科技	2,040	260,956.80	0.15
202	001203	大中矿业	8,700	260,565.00	0.15
203	300972	万辰集团	1,500	260,115.00	0.15
204	603119	浙江荣泰	3,900	258,726.00	0.15
205	002831	裕同科技	7,215	256,565.40	0.15
206	000519	中兵红箭	12,129	255,558.03	0.15
207	300383	光环新网	20,400	253,776.00	0.15
208	300677	英科医疗	6,380	249,904.60	0.15
209	600177	雅戈尔	32,900	247,737.00	0.15

210	002673	西部证券	38,100	247,269.00	0.15
211	688187	时代电气	3,600	247,176.00	0.15
212	603160	汇顶科技	4,000	246,840.00	0.15
213	603806	福斯特	14,700	246,813.00	0.15
214	600516	方大炭素	39,900	246,183.00	0.15
215	300953	震裕科技	1,840	246,008.00	0.14
216	300679	电连技术	4,100	245,959.00	0.14
217	688188	柏楚电子	2,300	245,410.00	0.14
218	000559	万向钱潮	18,900	244,377.00	0.14
219	600642	申能股份	27,700	241,821.00	0.14
220	601699	潞安环能	16,700	238,476.00	0.14
221	000623	吉林敖东	13,442	238,326.66	0.14
222	600637	东方明珠	28,600	237,666.00	0.14
223	001696	宗申动力	11,400	237,234.00	0.14
224	002624	完美世界	19,100	237,222.00	0.14
225	300699	光威复材	8,260	236,649.00	0.14
226	300558	贝达药业	3,600	234,252.00	0.14
227	002318	久立特材	9,800	234,220.00	0.14
228	002085	万丰奥威	21,100	233,999.00	0.14
229	000983	山西焦煤	40,100	232,580.00	0.14
230	603345	安井食品	2,900	232,551.00	0.14
231	000750	国海证券	63,130	232,318.40	0.14
232	603699	纽威股份	4,600	231,380.00	0.14
233	002739	儒意电影	24,100	231,360.00	0.14
234	300487	蓝晓科技	3,900	229,515.00	0.14
235	603225	新凤鸣	11,656	229,040.40	0.13
236	300627	华测导航	8,040	228,336.00	0.13
237	600100	同方股份	33,300	228,105.00	0.13
238	688568	中科星图	5,500	228,085.00	0.13
239	600536	中国软件	8,094	227,603.28	0.13
240	600369	西南证券	56,400	226,728.00	0.13
241	000400	许继电气	10,400	225,680.00	0.13
242	002065	东华软件	31,600	225,624.00	0.13
243	002266	浙富控股	44,330	224,309.80	0.13
244	600595	中孚实业	39,800	223,676.00	0.13
245	002044	美年健康	44,400	223,332.00	0.13
246	002223	鱼跃医疗	8,689	222,959.74	0.13
247	603596	伯特利	8,913	221,398.92	0.13
248	000155	川能动力	18,400	220,432.00	0.13
249	688065	凯赛生物	4,600	220,110.00	0.13
250	688772	珠海冠宇	11,200	219,856.00	0.13
251	000629	钒钛股份	65,800	219,772.00	0.13
252	000032	深桑达 A	8,800	219,560.00	0.13

253	300003	乐普医疗	18,400	218,040.00	0.13
254	300002	神州泰岳	27,800	217,118.00	0.13
255	601016	节能风电	55,520	215,417.60	0.13
256	603444	吉比特	600	215,052.00	0.13
257	600985	淮北矿业	15,300	214,965.00	0.13
258	600521	华海药业	14,900	214,560.00	0.13
259	002430	杭氧股份	6,900	213,624.00	0.13
260	601216	君正集团	47,800	213,188.00	0.13
261	601997	贵阳银行	41,500	212,895.00	0.13
262	601212	白银有色	41,900	212,852.00	0.13
263	601717	中创智领	15,300	212,823.00	0.13
264	600862	中航高科	11,800	212,754.00	0.13
265	000683	博源化工	36,800	211,968.00	0.12
266	000039	中集集团	25,940	210,373.40	0.12
267	600863	华能蒙电	44,500	209,150.00	0.12
268	688297	中无人机	5,000	207,750.00	0.12
269	600704	物产中大	43,900	207,208.00	0.12
270	688617	惠泰医疗	1,141	207,159.96	0.12
271	601001	晋控煤业	11,900	206,941.00	0.12
272	600873	梅花生物	28,000	205,800.00	0.12
273	601990	南京证券	31,300	205,641.00	0.12
274	603766	隆鑫通用	17,200	205,196.00	0.12
275	000050	深天马 A	20,600	204,146.00	0.12
276	688538	和辉光电	78,456	203,985.60	0.12
277	000887	中鼎股份	11,400	203,946.00	0.12
278	603605	珀莱雅	3,400	203,728.00	0.12
279	000729	燕京啤酒	20,100	203,613.00	0.12
280	603077	和邦生物	87,640	203,324.80	0.12
281	600312	平高电气	11,500	203,090.00	0.12
282	002841	视源股份	5,800	200,274.00	0.12
283	601799	星宇股份	2,200	199,364.00	0.12
284	000967	盈峰环境	18,900	199,017.00	0.12
285	600765	中航重机	15,380	198,709.60	0.12
286	688615	合合信息	1,740	196,794.00	0.12
287	600332	白云山	9,800	196,392.00	0.12
288	600348	华阳股份	25,650	196,222.50	0.12
289	600166	福田汽车	67,300	195,843.00	0.12
290	688692	达梦数据	800	195,432.00	0.12
291	000830	鲁西化工	16,200	194,400.00	0.11
292	002683	广东宏大	6,600	193,314.00	0.11
293	002939	长城证券	23,100	192,654.00	0.11
294	002410	广联达	23,400	190,944.00	0.11
295	000062	深圳华强	6,000	190,920.00	0.11

296	601611	中国核建	17,100	190,665.00	0.11
297	002007	华兰生物	15,500	188,945.00	0.11
298	600901	江苏金租	32,820	188,715.00	0.11
299	600737	中粮糖业	15,200	187,416.00	0.11
300	600153	建发股份	23,500	186,355.00	0.11
301	600578	京能电力	28,400	183,180.00	0.11
302	000921	海信家电	6,700	183,044.00	0.11
303	603728	鸣志电器	3,000	182,760.00	0.11
304	603568	伟明环保	11,821	181,806.98	0.11
305	002926	华西证券	22,200	181,374.00	0.11
306	603298	杭叉集团	7,600	181,336.00	0.11
307	000591	太阳能	38,800	178,480.00	0.11
308	603341	龙旗科技	4,200	178,458.00	0.11
309	600398	海澜之家	34,100	178,343.00	0.11
310	000737	北方铜业	13,400	177,148.00	0.10
311	002603	以岭药业	11,800	177,000.00	0.10
312	600363	联创光电	4,900	175,322.00	0.10
313	600486	扬农化工	3,450	174,915.00	0.10
314	000738	航发控制	9,500	173,755.00	0.10
315	601000	唐山港	41,826	173,577.90	0.10
316	688248	南网科技	2,500	172,950.00	0.10
317	000528	柳 工	22,900	172,895.00	0.10
318	600008	首创环保	63,370	172,366.40	0.10
319	600208	衢州发展	60,400	170,932.00	0.10
320	600995	南网储能	13,800	169,740.00	0.10
321	688582	芯动联科	2,600	169,000.00	0.10
322	600998	九州通	36,022	168,943.18	0.10
323	688114	华大智造	3,300	168,564.00	0.10
324	000932	华菱钢铁	48,520	168,364.40	0.10
325	600435	北方导航	15,000	168,000.00	0.10
326	600170	上海建工	75,600	167,832.00	0.10
327	600316	洪都航空	6,000	167,640.00	0.10
328	603486	科沃斯	3,300	167,475.00	0.10
329	002152	广电运通	17,800	166,964.00	0.10
330	000987	越秀资本	21,225	165,979.50	0.10
331	002262	恩华药业	8,800	165,000.00	0.10
332	600483	福能股份	15,900	162,021.00	0.10
333	000951	中国重汽	8,300	161,933.00	0.10
334	600820	隧道股份	31,000	161,510.00	0.10
335	000997	新 大 陆	9,900	161,370.00	0.10
336	600161	天坛生物	13,900	160,962.00	0.09
337	601106	中国一重	48,500	160,050.00	0.09
338	688778	厦钨新能	2,940	159,936.00	0.09

339	600282	南钢股份	34,800	159,732.00	0.09
340	000009	中国宝安	25,520	158,989.60	0.09
341	002500	山西证券	30,760	158,721.60	0.09
342	600583	海油工程	31,500	158,445.00	0.09
343	603885	吉祥航空	15,300	157,437.00	0.09
344	688295	中复神鹰	2,600	157,404.00	0.09
345	603939	益丰药房	8,748	157,289.04	0.09
346	600562	国睿科技	7,300	154,906.00	0.09
347	603816	顾家家居	6,900	154,284.00	0.09
348	600546	山煤国际	14,100	154,113.00	0.09
349	000582	北部湾港	14,300	153,439.00	0.09
350	603338	浙江鼎力	3,600	153,000.00	0.09
351	003022	联泓新科	5,900	152,810.00	0.09
352	601666	平煤股份	21,200	151,580.00	0.09
353	600602	云赛智联	9,300	149,544.00	0.09
354	002312	川发龙蟒	16,300	149,471.00	0.09
355	600329	达仁堂	4,000	148,880.00	0.09
356	688318	财富趋势	2,080	148,324.80	0.09
357	600380	健康元	15,672	147,630.24	0.09
358	600390	五矿资本	32,200	146,832.00	0.09
359	601567	三星电气	9,800	146,412.00	0.09
360	600763	通策医疗	4,321	146,395.48	0.09
361	603565	中谷物流	14,900	146,169.00	0.09
362	000723	美锦能源	43,600	146,060.00	0.09
363	601156	东航物流	9,000	145,080.00	0.09
364	601880	辽港股份	105,090	145,024.20	0.09
365	600685	中船防务	5,700	145,008.00	0.09
366	600038	中直股份	5,700	144,153.00	0.08
367	300676	华大基因	4,100	143,746.00	0.08
368	601865	福莱特	13,600	142,936.00	0.08
369	601399	国机重装	40,800	142,800.00	0.08
370	600535	天士力	10,700	141,561.00	0.08
371	600511	国药股份	5,400	140,616.00	0.08
372	688336	三生国健	2,645	140,449.50	0.08
373	300718	长盛轴承	2,300	140,231.00	0.08
374	688281	华秦科技	2,775	139,388.25	0.08
375	300100	双林股份	5,000	138,900.00	0.08
376	600906	财达证券	18,600	138,756.00	0.08
377	000513	丽珠集团	4,798	138,614.22	0.08
378	600977	中国电影	10,700	138,244.00	0.08
379	002244	滨江集团	18,100	137,560.00	0.08
380	600816	建元信托	56,100	136,884.00	0.08
381	000739	普洛药业	8,200	136,612.00	0.08

382	688166	博瑞医药	3,900	136,539.00	0.08
383	600132	重庆啤酒	3,300	136,290.00	0.08
384	601236	红塔证券	19,900	135,718.00	0.08
385	000598	兴蓉环境	21,100	135,462.00	0.08
386	600970	中材国际	18,850	134,400.50	0.08
387	002299	圣农发展	8,800	133,408.00	0.08
388	601155	新城控股	12,900	132,354.00	0.08
389	300735	光弘科技	5,800	131,892.00	0.08
390	000883	湖北能源	30,300	130,896.00	0.08
391	688278	特宝生物	2,400	130,560.00	0.08
392	002120	韵达股份	20,500	130,380.00	0.08
393	600967	内蒙一机	12,000	130,200.00	0.08
394	300146	汤臣倍健	14,400	130,176.00	0.08
395	300144	宋城演艺	22,200	128,982.00	0.08
396	688363	华熙生物	3,500	125,195.00	0.07
397	000800	一汽解放	20,900	124,355.00	0.07
398	600131	国网信通	8,500	124,100.00	0.07
399	601608	中信重工	26,000	124,020.00	0.07
400	002568	百润股份	7,300	123,516.00	0.07
401	601866	中远海发	55,700	123,097.00	0.07
402	000027	深圳能源	19,820	122,884.00	0.07
403	600095	湘财股份	16,300	122,739.00	0.07
404	002583	海能达	15,700	120,733.00	0.07
405	601118	海南橡胶	24,500	120,540.00	0.07
406	600754	锦江酒店	6,600	118,734.00	0.07
407	603737	三棵树	4,902	118,138.20	0.07
408	600871	石化油服	58,000	117,740.00	0.07
409	600801	华新建材	7,536	117,561.60	0.07
410	603000	人民网	7,900	116,841.00	0.07
411	600126	杭钢股份	18,990	116,408.70	0.07
412	002984	森麒麟	8,900	116,323.00	0.07
413	600566	济川药业	5,200	115,388.00	0.07
414	600517	国网英大	24,500	114,660.00	0.07
415	000709	河钢股份	59,000	114,460.00	0.07
416	600655	豫园股份	27,700	113,847.00	0.07
417	003021	兆威机电	1,300	113,555.00	0.07
418	603589	口子窖	6,000	112,080.00	0.07
419	000088	盐田港	27,100	110,839.00	0.07
420	600598	北大荒	10,100	109,484.00	0.06
421	000825	太钢不锈	32,100	109,461.00	0.06
422	600350	山东高速	9,800	109,074.00	0.06
423	601598	中国外运	21,900	108,624.00	0.06
424	688349	三一重能	7,121	108,096.78	0.06

425	603858	步长制药	7,400	108,040.00	0.06
426	002423	中粮资本	13,100	107,813.00	0.06
427	688192	迪哲医药	2,700	107,811.00	0.06
428	600004	白云机场	14,700	106,722.00	0.06
429	688709	成都华微	2,800	106,652.00	0.06
430	001286	陕西能源	10,500	106,470.00	0.06
431	002773	康弘药业	5,200	106,340.00	0.06
432	600663	陆家嘴	16,900	106,132.00	0.06
433	600582	天地科技	23,700	105,465.00	0.06
434	601966	玲珑轮胎	10,300	104,957.00	0.06
435	301606	绿联科技	1,700	103,734.00	0.06
436	603899	晨光股份	5,000	103,150.00	0.06
437	600848	上海临港	13,700	102,613.00	0.06
438	688563	航材股份	2,000	102,460.00	0.06
439	601098	中南传媒	10,400	102,336.00	0.06
440	300957	贝泰妮	3,200	100,832.00	0.06
441	000429	粤高速 A	7,300	99,645.00	0.06
442	603233	大参林	6,512	97,875.36	0.06
443	601928	凤凰传媒	11,100	97,569.00	0.06
444	600968	海油发展	29,200	97,236.00	0.06
445	002508	老板电器	6,600	96,492.00	0.06
446	600062	华润双鹤	5,952	95,470.08	0.06
447	003035	南网能源	16,200	94,284.00	0.06
448	300888	稳健医疗	3,340	93,486.60	0.06
449	688425	铁建重工	22,900	92,058.00	0.05
450	600688	上海石化	31,400	92,002.00	0.05
451	688708	佳驰科技	1,800	91,440.00	0.05
452	002670	国盛证券	8,304	91,344.00	0.05
453	688561	奇安信	3,800	91,124.00	0.05
454	002032	苏泊尔	2,300	91,080.00	0.05
455	601808	中海油服	8,400	90,804.00	0.05
456	600295	鄂尔多斯	8,400	90,048.00	0.05
457	600098	广州发展	15,000	88,650.00	0.05
458	000539	粤电力 A	12,700	86,487.00	0.05
459	600808	马钢股份	34,500	86,250.00	0.05
460	002153	石基信息	11,908	86,094.84	0.05
461	000537	绿发电力	11,700	85,527.00	0.05
462	601298	青岛港	10,200	82,110.00	0.05
463	600292	电投水电	6,800	81,872.00	0.05
464	603833	欧派家居	2,700	81,297.00	0.05
465	600377	宁沪高速	7,000	80,990.00	0.05
466	002265	建设工业	4,600	80,040.00	0.05
467	000959	首钢股份	22,500	78,975.00	0.05

468	301301	川宁生物	9,700	77,018.00	0.05
469	603529	爱玛科技	3,900	76,089.00	0.04
470	002608	江苏国信	11,000	75,900.00	0.04
471	600032	浙江新能	10,500	74,025.00	0.04
472	600606	绿地控股	61,000	73,810.00	0.04
473	603786	科博达	1,800	73,638.00	0.04
474	600339	中油工程	23,800	73,066.00	0.04
475	301498	乖宝宠物	1,800	73,062.00	0.04
476	000785	居然智家	36,100	72,200.00	0.04
477	688520	神州细胞	2,100	71,841.00	0.04
478	601139	深圳燃气	12,600	71,316.00	0.04
479	300140	节能环境	13,500	67,095.00	0.04
480	000937	冀中能源	16,840	67,023.20	0.04
481	600764	中国海防	3,800	66,234.00	0.04
482	000898	鞍钢股份	34,500	64,515.00	0.04
483	603658	安图生物	2,200	63,844.00	0.04
484	688475	萤石网络	2,300	62,905.00	0.04
485	603175	超颖电子	700	62,363.00	0.04
486	601228	广州港	21,800	61,476.00	0.04
487	603049	中策橡胶	1,300	58,253.00	0.03
488	601019	山东出版	9,100	58,240.00	0.03
489	002461	珠江啤酒	6,600	49,962.00	0.03
490	601112	振石股份	2,700	49,221.00	0.03
491	600927	永安期货	3,900	48,555.00	0.03
492	002945	华林证券	3,600	48,348.00	0.03
493	600299	安迪苏	5,900	46,315.00	0.03
494	688819	天能股份	2,000	44,400.00	0.03
495	603092	德力佳	500	26,985.00	0.02
496	001221	悍高集团	600	24,132.00	0.01
497	001386	马可波罗	1,500	21,240.00	0.01

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	400174	中天 3	41,300	0.00	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	688498	源杰科技	3,095,697.05	3.42
2	001309	德明利	1,794,355.00	1.98

3	600487	亨通光电	1,561,270.00	1.72
4	688525	佰维存储	1,256,022.63	1.39
5	300136	信维通信	1,225,469.00	1.35
6	688235	百济神州	1,144,129.73	1.26
7	300857	协创数据	1,138,687.00	1.26
8	002008	大族激光	1,114,720.00	1.23
9	300475	香农芯创	1,103,515.00	1.22
10	600105	永鼎股份	1,090,525.00	1.20
11	688017	绿的谐波	1,079,753.00	1.19
12	688120	华海清科	1,079,590.00	1.19
13	300666	江丰电子	1,066,731.00	1.18
14	688037	芯源微	1,046,916.00	1.16
15	688361	中科飞测	1,042,150.35	1.15
16	300604	长川科技	1,034,704.00	1.14
17	002353	杰瑞股份	1,017,293.00	1.12
18	688019	安集科技	1,009,385.54	1.11
19	601869	长飞光纤	991,184.00	1.09
20	600549	厦门钨业	984,208.00	1.09

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	600487	亨通光电	4,107,191.00	4.54
2	688525	佰维存储	2,597,857.50	2.87
3	002353	杰瑞股份	2,057,666.00	2.27
4	301308	江波龙	1,952,657.00	2.16
5	600549	厦门钨业	1,678,495.00	1.85
6	000657	中钨高新	1,600,819.00	1.77
7	002156	通富微电	1,583,151.00	1.75
8	000426	兴业银锡	1,351,314.00	1.49
9	002202	金风科技	1,306,682.00	1.44
10	601168	西部矿业	1,250,509.00	1.38
11	002837	英维克	1,194,055.30	1.32
12	300450	先导智能	1,171,708.00	1.29
13	600118	中国卫星	1,113,296.00	1.23
14	600673	东阳光	1,103,660.58	1.22
15	000933	神火股份	1,075,680.00	1.19
16	002080	中材科技	973,559.00	1.08
17	688017	绿的谐波	971,883.20	1.07
18	300136	信维通信	971,791.00	1.07
19	600096	云天化	968,845.00	1.07
20	688235	百济神州	958,690.28	1.06

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	185,756,925.18
卖出股票收入（成交）总额	135,932,673.44

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	8,592,384.52	5.06
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	8,592,384.52	5.06

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	019792	25 国债 19	70,000	7,073,446.30	4.17
2	019785	25 国债 13	15,000	1,518,938.22	0.89

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	55,954.22
2	应收清算款	832,269.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	494,546.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,382,770.24

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	400174	中天 3	0.00	0.00	公告重大事项
---	--------	------	------	------	--------

§ 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 500 指数 A	5,345	13,536.28	297,367.97	0.41	72,054,056.75	99.59
农银中证 500 指数 C	35	28,629.92	0.00	0.00	1,002,047.16	100.00
合计	5,380	13,634.47	297,367.97	0.41	73,056,103.91	99.59

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 500 指数 A	221,630.18	0.3063
	农银中证 500 指数 C	0.00	0.0000
	合计	221,630.18	0.3021

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、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	农银中证 500 指数 A	0~10
	农银中证 500 指数 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 500 指数 A	0
	农银中证 500 指数 C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银中证 500 指数 A	农银中证 500 指数 C
基金合同生效日 (2011 年 11 月 29 日) 基金份额总额	711,358,644.30	—
本报告期期初基金份额总额	47,154,074.01	—
本报告期基金总申购份额	114,576,510.17	1,038,880.45
减：本报告期基金总赎回份额	89,379,159.46	36,833.29
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	72,351,424.72	1,002,047.16

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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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 (%)	
东方证券	2	321,689,598.62	100.00	63,662.96	100.00	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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(%)
东方证券	19,718,888.00	100.00	155,500,000.00	100.00	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 21 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 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 500 指数证券投资基金 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	农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理中证 500 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议等法律文件的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 23 日
5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2026 年第 1 次	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 23 日
6	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 23 日
7	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 23 日
8	农银汇理中证 500 指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 23 日
9	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2026 年第 2 次	中国证监会规定的媒介	2026 年 6 月 29 日
10	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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