

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45

8.3 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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 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	61
8.7 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	61
8.8 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	61
8.9 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	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 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	62
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 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	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 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	37,838,959.81 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-537,134.59	10,779,489.04	6,756,006.85
本期利润	-11,837,852.14	9,317,104.79	16,464,402.58
加权平均基金份额本期利润	-0.3265	0.2329	0.2783
本期加权平均净值利润率	-20.78%	13.74%	18.73%
本期基金份额净值增长率	-18.54%	14.36%	19.50%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	18,515,985.11	28,606,543.25	28,777,067.13
期末可供分配基金份额利润	0.4893	0.8282	0.5986
期末基金资产净值	56,354,944.92	63,146,827.53	76,853,754.90
期末基金份额净值	1.4893	1.8282	1.5986
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	48.93%	82.82%	59.86%

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 12 月 31 日。

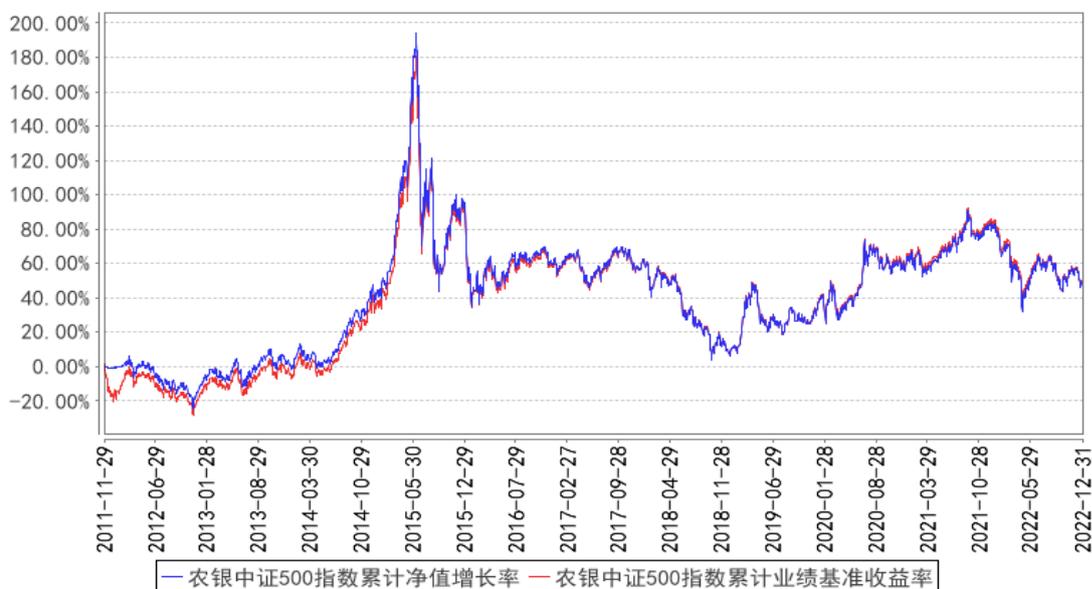
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.47%	0.98%	2.52%	0.97%	-0.05%	0.01%
过去六个月	-8.32%	1.04%	-8.66%	1.04%	0.34%	0.00%
过去一年	-18.54%	1.30%	-19.30%	1.31%	0.76%	-0.01%
过去三年	11.33%	1.28%	11.13%	1.28%	0.20%	0.00%
过去五年	-5.60%	1.33%	-5.27%	1.34%	-0.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.93%	1.50%	49.50%	1.53%	-0.57%	-0.03%

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

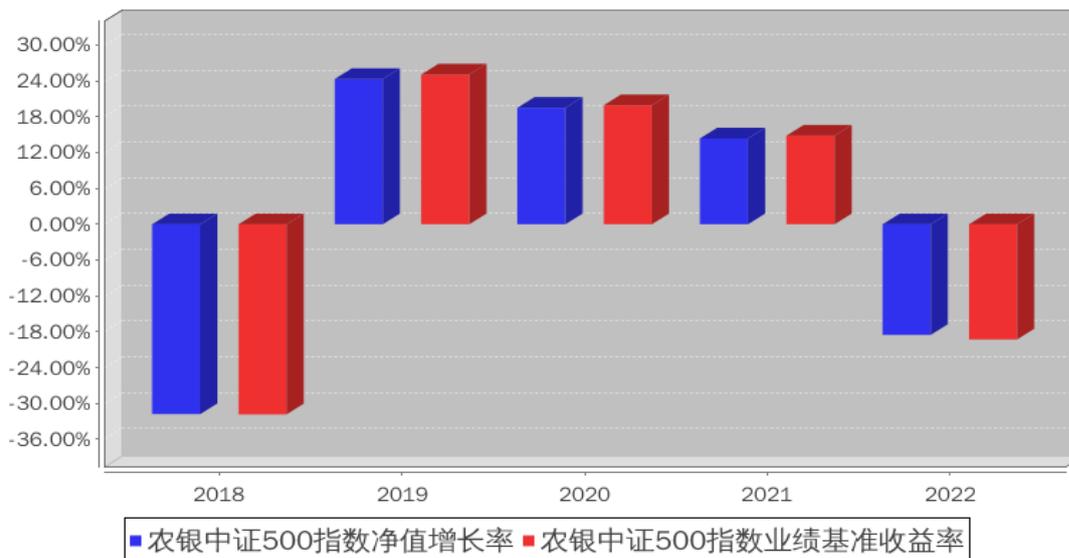
农银中证500指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年基金每年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指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2022 年 12 月 31 日，公司共管理 72 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基

金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、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。

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	-	15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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告风险管理委员会。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0283%，日均偏离度为 0.0175%，报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4893 元；本报告期基金份额净值增长率为-18.54%，业绩比较基准收益率为-19.30%。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司建立了比较完善的监察稽核制度和组织结构。公司督察长组织指导对基金包括本基金的监察稽核工作，监察稽核部具体监督检查基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并向公司总经理报告。公司风险管理委员会批准适用本基金的风险管理措施，定期回顾执行情况，并由风险控制部实施日常监控。督察长及监察稽核部对其他部门及人员执行业务进行稽核检查，督促其合规运作、加强风险控制。督察长定期编制监察稽核报告，提交总经理和董事会成员审阅。报告期内，公司监察稽核体系运行顺利，本基金没有出现违反法律规定的事项，有效的保证了本基金的合规运作。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

(1) 全面开展基金运作稽核工作，防范内幕交易，确保基金投资的独立性、公平性及合规性

主要措施有：严格执行集中交易制度，确保研究、投资决策和交易隔离；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序。通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求。

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金基金合同约定“在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 6 次，每次收益分配最低比例为收益分配基准日可供分配利润的 20%。收益分配基准日可供分配利润指当日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配”即本基金报告期无应分配利润金额。

2. 本基金报告期内没有实施利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

4.9 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 托管人对本年度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年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 22862 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	农银汇理中证 500 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了农银汇理中证 500 指数证券投资基金(以下简称“农银中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了农银中证 500 指数基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于农银中证 500 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>农银中证 500 指数基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括农银中证 500 指数基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银中证</p>

	<p>500 指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算农银中证 500 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督农银中证 500 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对农银中证 500 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致农银中证 500 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	赵钰 罗佳
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,541,512.25	2,378,998.19
结算备付金		23,114.51	2,093.30
存出保证金		2,191.24	4,295.51
交易性金融资产	7.4.7.2	54,036,703.17	60,979,432.60
其中：股票投资		53,424,577.42	59,979,232.60
基金投资		-	-
债券投资		612,125.75	1,000,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	96,228.58
应收股利		-	-
应收申购款		11,802.12	17,234.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	23,473.75
资产总计		56,615,323.29	63,501,756.87
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		10,651.62	101,658.35

应付管理人报酬		36,983.24	40,016.20
应付托管费		7,396.62	8,003.26
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	205,346.89	205,251.53
负债合计		260,378.37	354,929.34
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	37,838,959.81	34,540,284.28
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	18,515,985.11	28,606,543.25
净资产合计		56,354,944.92	63,146,827.53
负债和净资产总计		56,615,323.29	63,501,756.87

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4893 元，基金份额总额 37,838,959.81 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-10,977,790.34	10,421,175.88
1. 利息收入		20,685.66	34,966.48
其中：存款利息收入	7.4.7.13	20,685.66	27,510.04
债券利息收入		-	7,456.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		287,268.10	11,797,127.95
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-651,165.36	10,860,859.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	9,969.27	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	928,464.19	936,268.08
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）	7.4.7.20	-11,300,717.55	-1,462,384.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	14,973.45	51,465.70
减：二、营业总支出		860,061.80	1,104,071.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	426,489.10	508,626.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	85,297.70	101,725.27
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	48.22
其中：卖出回购金融资产支出		-	48.22
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	348,275.00	493,671.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,837,852.14	9,317,104.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,837,852.14	9,317,104.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,837,852.14	9,317,104.79

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53

期末净资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,298,675.53	-	-10,090,558.14	-6,791,882.61
（一）、综合收益总额	-	-	-11,837,852.14	-11,837,852.14
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,298,675.53	-	1,747,294.00	5,045,969.53
其中：1. 基金申购款	10,267,220.11	-	5,876,568.45	16,143,788.56
2. 基金赎回款	-6,968,544.58	-	-4,129,274.45	-11,097,819.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填	-	-	-	-

列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	37,838,959.81	-	18,515,985.11	56,354,944.92
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	48,076,687.77	-	28,777,067.13	76,853,754.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	48,076,687.77	-	28,777,067.13	76,853,754.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,536,403.49	-	-170,523.88	-13,706,927.37
(一)、综合收益总额	-	-	9,317,104.79	9,317,104.79
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-13,536,403.49	-	-9,487,628.67	-23,024,032.16
其中：1. 基金申购	19,095,243.03	-	13,176,332.22	32,271,575.25

款				
2. 基金赎回款	-32,631,646.52	-	-22,663,960.89	-55,295,607.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	34,540,284.28	-	28,606,543.25	63,146,827.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

程昆

毕宏燕

丁煜琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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。

本财务报表由本基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价

值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12

月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

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

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	2,541,512.25	2,378,998.19
等于：本金	2,540,971.90	2,378,998.19
加：应计利息	540.35	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,541,512.25	2,378,998.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	58,140,351.64	-	53,424,577.42	-4,715,774.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	599,760.00	12,185.75	612,125.75	180.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	599,760.00	12,185.75	612,125.75	180.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	58,740,111.64	12,185.75	54,036,703.17	-4,715,594.22	

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	53,393,109.27	-	59,979,232.60	6,586,123.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,001,200.00	-	1,000,200.00	-1,000.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,001,200.00	-	1,000,200.00	-1,000.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	54,394,309.27	-	60,979,432.60	6,585,123.33	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金额资产期末余额中无资产减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

7.4.7.6.2 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。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 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。

7.4.7.7.2 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。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	23,473.75
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	23,473.75

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.90	372.64
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	25,342.99	24,878.89
其中：交易所市场	25,342.99	24,878.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	205,346.89	205,251.53

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,540,284.28	34,540,284.28
本期申购	10,267,220.11	10,267,220.11

本期赎回（以“-”号填列）	-6,968,544.58	-6,968,544.58
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	37,838,959.81	37,838,959.81

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	38,662,389.61	-10,055,846.36	28,606,543.25
本期利润	-537,134.59	-11,300,717.55	-11,837,852.14
本期基金份额交易产生的变动数	3,676,335.26	-1,929,041.26	1,747,294.00
其中：基金申购款	11,458,229.91	-5,581,661.46	5,876,568.45
基金赎回款	-7,781,894.65	3,652,620.20	-4,129,274.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,801,590.28	-23,285,605.17	18,515,985.11

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	20,235.73	27,012.57
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	407.86	385.28
其他	42.07	112.19
合计	20,685.66	27,510.04

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	29,117,803.46	55,475,119.67
减：卖出股票成本总额	29,680,460.89	44,614,259.80

减：交易费用	88,507.93	-
买卖股票差价收入	-651,165.36	10,860,859.87

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	11,169.87	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,200.60	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	9,969.27	-

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,024,300.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,001,200.00	-
减：应计利息总额	24,300.00	-
减：交易费用	0.60	-
买卖债券差价收入	-1,200.60	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	928,464.19	936,268.08
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	928,464.19	936,268.08

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-11,300,717.55	-1,462,384.25
股票投资	-11,301,897.55	-1,461,384.25
债券投资	1,180.00	-1,000.00
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	-11,300,717.55	-1,462,384.25

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	12,817.83	44,902.91
基金转换费收入	2,155.62	6,562.79
合计	14,973.45	51,465.70

注：1. 本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。 2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	275.00	175.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
交易费用	-	145,496.11

合计	348,275.00	493,671.11
----	------------	------------

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
农银汇理资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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
中国农业银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
东方汇理资产管理公司	基金管理人的股东
中铝资本控股有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	426,489.10	508,626.49
其中：支付销售机构的客户维护费	191,868.58	228,519.19

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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,297.70	101,725.27

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

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

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,541,512.25	20,235.73	2,378,998.19	27,012.57

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
600038	中直股份	2022年12月26日	筹划重大资产重组停牌	46.41	2023年1月10日	51.05	2,500	128,427.93	116,025.00	-
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年1月10日	56.88	1,700	102,333.00	90,576.00	-

注：本基金截至 2022 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	612,125.75	1,000,200.00
合计	612,125.75	1,000,200.00

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	------	------	-----	----

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	2,541,512.25	-	-	-	2,541,512.25
结算备付金	23,114.51	-	-	-	23,114.51
存出保证金	2,191.24	-	-	-	2,191.24
交易性金融资产	612,125.75	-	-	53,424,577.42	54,036,703.17
应收申购款	-	-	-	11,802.12	11,802.12
资产总计	3,178,943.75	-	-	53,436,379.54	56,615,323.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,651.62	10,651.62
应付管理人报酬	-	-	-	36,983.24	36,983.24
应付托管费	-	-	-	7,396.62	7,396.62
其他负债	-	-	-	205,346.89	205,346.89
负债总计	-	-	-	260,378.37	260,378.37
利率敏感度缺口	3,178,943.75	-	-	53,176,001.17	56,354,944.92
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,378,998.19	-	-	-	2,378,998.19
结算备付金	2,093.30	-	-	-	2,093.30
存出保证金	4,295.51	-	-	-	4,295.51
交易性金融资产	1,000,200.00	-	-	59,979,232.60	60,979,432.60
应收清算款	-	-	-	96,228.58	96,228.58
应收申购款	-	-	-	17,234.94	17,234.94
其他资产	-	-	-	23,473.75	23,473.75
资产总计	3,385,587.00	-	-	60,116,169.87	63,501,756.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	101,658.35	101,658.35
应付管理人报酬	-	-	-	40,016.20	40,016.20
应付托管费	-	-	-	8,003.26	8,003.26
其他负债	-	-	-	205,251.53	205,251.53
负债总计	-	-	-	354,929.34	354,929.34
利率敏感度缺口	3,385,587.00	-	-	59,761,240.53	63,146,827.53

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。
	其他市场变量保持不变。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-58.61	-147.08
	市场利率平行下降 25 个基点	58.61	147.08

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	53,424,577.42	94.80	59,979,232.60	94.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,424,577.42	94.80	59,979,232.60	94.98

7.4.13.4.3.2 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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,808,727.16	3,158,265.48
	业绩比较基准下降 5%	-2,808,727.16	-3,158,265.48

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	53,217,976.42	59,864,776.60
第二层次	818,726.75	1,114,656.00
第三层次	-	-
合计	54,036,703.17	60,979,432.60

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，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）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	53,424,577.42	94.36
	其中：股票	53,424,577.42	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	612,125.75	1.08
	其中：债券	612,125.75	1.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,564,626.76	4.53
8	其他各项资产	13,993.36	0.02
9	合计	56,615,323.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	512,181.20	0.91

	业		
B	采矿业	2,341,097.16	4.15
C	制造业	32,356,016.80	57.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,793,765.10	3.18
E	建筑业	476,282.00	0.85
F	批发和零售业	2,267,918.72	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,195,010.04	2.12
H	住宿和餐饮业	138,880.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,803,021.23	6.75
J	金融业	4,667,831.92	8.28
K	房地产业	1,102,355.08	1.96
L	租赁和商务服务业	624,684.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	586,053.60	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	299,459.33	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,048.60	0.19
R	文化、体育和娱乐业	707,171.00	1.25
S	综合	319,918.22	0.57
	合计	53,297,694.00	94.58

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,541.92	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	75,341.50	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,883.42	0.23

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	002340	格林美	43,100	320,233.00	0.57
2	300012	华测检测	14,100	314,430.00	0.56
3	600157	永泰能源	186,400	285,192.00	0.51
4	002384	东山精密	11,500	284,395.00	0.50
5	688777	中控技术	2,900	263,407.00	0.47
6	300724	捷佳伟创	2,300	262,246.00	0.47
7	603613	国联股份	2,945	260,455.80	0.46
8	688122	西部超导	2,700	255,663.00	0.45
9	002422	科伦药业	9,500	252,795.00	0.45
10	300003	乐普医疗	11,000	252,670.00	0.45
11	600487	亨通光电	16,600	249,996.00	0.44
12	002385	大北农	27,900	248,310.00	0.44
13	603345	安井食品	1,500	242,820.00	0.43

14	002966	苏州银行	30,880	240,246.40	0.43
15	603606	东方电缆	3,500	237,405.00	0.42
16	600885	宏发股份	6,952	232,266.32	0.41
17	600765	中航重机	7,380	229,444.20	0.41
18	600079	人福医药	9,600	229,344.00	0.41
19	600096	云天化	10,800	227,232.00	0.40
20	002497	雅化集团	9,700	225,525.00	0.40
21	688063	派能科技	700	220,955.00	0.39
22	601555	东吴证券	33,580	219,277.40	0.39
23	600352	浙江龙盛	21,900	216,810.00	0.38
24	002625	光启技术	12,700	216,154.00	0.38
25	002407	多氟多	6,400	213,248.00	0.38
26	002603	以岭药业	7,000	209,720.00	0.37
27	000009	中国宝安	17,320	209,398.80	0.37
28	601058	赛轮轮胎	20,700	207,414.00	0.37
29	002738	中矿资源	3,100	206,646.00	0.37
30	601233	桐昆股份	14,200	205,190.00	0.36
31	600988	赤峰黄金	11,200	202,160.00	0.36
32	600489	中金黄金	24,500	200,655.00	0.36
33	000630	铜陵有色	64,000	199,680.00	0.35
34	600298	安琪酵母	4,400	198,968.00	0.35
35	603688	石英股份	1,500	196,980.00	0.35
36	300146	汤臣倍健	8,600	196,252.00	0.35
37	300390	天华超净	3,500	195,580.00	0.35
38	002028	思源电气	5,108	195,227.76	0.35
39	601108	财通证券	27,400	195,088.00	0.35
40	000807	云铝股份	17,500	194,600.00	0.35
41	603605	珀莱雅	1,160	194,276.80	0.34
42	600418	江淮汽车	14,700	193,011.00	0.34
43	300144	宋城演艺	13,200	192,720.00	0.34
44	300073	当升科技	3,400	191,760.00	0.34
45	603939	益丰药房	3,000	191,520.00	0.34
46	600536	中国软件	3,280	191,322.40	0.34
47	300037	新宙邦	4,400	191,268.00	0.34
48	600141	兴发集团	6,568	190,472.00	0.34
49	603517	绝味食品	3,100	189,379.00	0.34
50	600399	抚顺特钢	13,200	188,892.00	0.34
51	300699	光威复材	2,600	187,850.00	0.33
52	600859	王府井	6,640	186,849.60	0.33
53	300285	国瓷材料	6,700	184,719.00	0.33
54	601077	渝农商行	52,200	184,266.00	0.33
55	600873	梅花生物	18,000	183,240.00	0.33
56	300568	星源材质	8,600	182,836.00	0.32

57	688390	固德威	560	180,930.40	0.32
58	002185	华天科技	21,600	179,064.00	0.32
59	603456	九洲药业	4,200	178,206.00	0.32
60	002138	顺络电子	6,800	178,024.00	0.32
61	600563	法拉电子	1,100	175,868.00	0.31
62	600160	巨化股份	11,300	175,263.00	0.31
63	603816	顾家家居	4,100	175,111.00	0.31
64	601128	常熟银行	23,100	174,405.00	0.31
65	000783	长江证券	32,600	173,758.00	0.31
66	603589	口子窖	3,000	173,010.00	0.31
67	600153	建发股份	12,600	171,990.00	0.31
68	000629	钒钛股份	36,300	171,699.00	0.30
69	300357	我武生物	3,100	170,810.00	0.30
70	605358	立昂微	4,000	170,400.00	0.30
71	688099	晶晨股份	2,400	169,224.00	0.30
72	601699	潞安环能	10,000	168,500.00	0.30
73	601162	天风证券	58,500	167,895.00	0.30
74	000683	远兴能源	21,400	167,776.00	0.30
75	603596	伯特利	2,100	167,580.00	0.30
76	002192	融捷股份	1,700	166,430.00	0.30
77	600486	扬农化工	1,600	166,240.00	0.29
78	601607	上海医药	9,300	165,819.00	0.29
79	600392	盛和资源	11,810	165,340.00	0.29
80	688567	孚能科技	6,100	164,883.00	0.29
81	002568	百润股份	4,400	164,384.00	0.29
82	601168	西部矿业	16,100	164,220.00	0.29
83	000932	华菱钢铁	34,920	164,124.00	0.29
84	600521	华海药业	7,500	163,950.00	0.29
85	600161	天坛生物	6,900	163,737.00	0.29
86	600109	国金证券	18,800	163,560.00	0.29
87	002223	鱼跃医疗	5,089	162,135.54	0.29
88	600499	科达制造	11,400	161,994.00	0.29
89	600027	华电国际	27,500	161,700.00	0.29
90	000831	中国稀土	4,900	161,112.00	0.29
91	002797	第一创业	28,300	159,329.00	0.28
92	603077	和邦生物	52,140	158,505.60	0.28
93	600862	中航高科	7,000	156,030.00	0.28
94	002078	太阳纸业	13,500	155,520.00	0.28
95	601636	旗滨集团	13,600	154,904.00	0.27
96	000975	银泰黄金	14,029	154,880.16	0.27
97	000999	华润三九	3,300	154,473.00	0.27
98	002294	信立泰	4,700	154,395.00	0.27
99	688385	复旦微电	2,200	153,582.00	0.27

100	601872	招商轮船	27,400	153,166.00	0.27
101	002025	航天电器	2,300	152,375.00	0.27
102	600497	驰宏锌锗	30,100	152,306.00	0.27
103	600143	金发科技	15,700	152,133.00	0.27
104	002532	天山铝业	19,600	151,312.00	0.27
105	002268	电科网安	4,940	150,818.20	0.27
106	002299	圣农发展	6,300	149,247.00	0.26
107	300253	卫宁健康	14,500	149,060.00	0.26
108	601696	中银证券	14,100	149,037.00	0.26
109	600177	雅戈尔	23,400	148,122.00	0.26
110	603737	三棵树	1,300	147,979.00	0.26
111	601990	南京证券	18,600	147,498.00	0.26
112	600705	中航产融	44,700	146,616.00	0.26
113	002439	启明星辰	5,600	146,048.00	0.26
114	000591	太阳能	19,800	145,134.00	0.26
115	002624	完美世界	11,400	145,008.00	0.26
116	600348	华阳股份	10,100	143,925.00	0.26
117	002850	科达利	1,200	142,572.00	0.25
118	000998	隆平高科	8,800	141,416.00	0.25
119	000738	航发控制	5,500	141,020.00	0.25
120	600026	中远海能	11,700	140,985.00	0.25
121	000728	国元证券	22,100	139,893.00	0.25
122	600482	中国动力	9,100	139,139.00	0.25
123	600258	首旅酒店	5,600	138,880.00	0.25
124	600549	厦门钨业	7,100	138,805.00	0.25
125	002273	水晶光电	11,715	138,119.85	0.25
126	000519	中兵红箭	7,029	138,049.56	0.24
127	000988	华工科技	8,400	137,844.00	0.24
128	002673	西部证券	22,600	137,634.00	0.24
129	601997	贵阳银行	24,700	135,603.00	0.24
130	002507	涪陵榨菜	5,200	134,004.00	0.24
131	300604	长川科技	3,000	133,740.00	0.24
132	300136	信维通信	8,100	133,731.00	0.24
133	300363	博腾股份	3,200	130,720.00	0.23
134	002092	中泰化学	17,500	130,550.00	0.23
135	300832	新产业	2,600	130,364.00	0.23
136	000703	恒逸石化	18,500	130,055.00	0.23
137	002430	杭氧股份	3,300	129,888.00	0.23
138	002557	洽洽食品	2,591	129,550.00	0.23
139	600325	华发股份	14,258	129,177.48	0.23
140	002030	达安基因	8,288	128,961.28	0.23
141	600529	山东药玻	4,500	127,800.00	0.23
142	002056	横店东磁	6,800	127,432.00	0.23

143	002739	万达电影	9,100	127,400.00	0.23
144	300308	中际旭创	4,700	127,041.00	0.23
145	601198	东兴证券	16,400	126,608.00	0.22
146	600704	物产中大	26,300	126,503.00	0.22
147	601666	平煤股份	11,700	126,477.00	0.22
148	000729	燕京啤酒	11,900	126,378.00	0.22
149	002465	海格通信	15,500	125,860.00	0.22
150	002156	通富微电	7,600	125,248.00	0.22
151	603233	大参林	3,160	125,136.00	0.22
152	603444	吉比特	400	125,136.00	0.22
153	601016	节能风电	32,820	125,044.20	0.22
154	600879	航天电子	18,360	124,848.00	0.22
155	600655	豫园股份	16,400	124,804.00	0.22
156	603658	安图生物	2,000	123,700.00	0.22
157	300088	长信科技	20,700	123,579.00	0.22
158	688116	天奈科技	1,600	123,424.00	0.22
159	603267	鸿远电子	1,200	121,392.00	0.22
160	600415	小商品城	23,100	121,044.00	0.21
161	002409	雅克科技	2,400	120,888.00	0.21
162	600546	山煤国际	8,300	120,267.00	0.21
163	000830	鲁西化工	9,700	120,183.00	0.21
164	002353	杰瑞股份	4,300	120,013.00	0.21
165	002080	中材科技	5,600	120,008.00	0.21
166	000878	云南铜业	10,100	118,675.00	0.21
167	002683	广东宏大	4,400	118,624.00	0.21
168	000960	锡业股份	8,400	118,440.00	0.21
169	600516	方大炭素	19,300	118,116.00	0.21
170	000400	许继电气	5,900	117,823.00	0.21
171	000623	吉林敖东	7,842	117,551.58	0.21
172	600170	上海建工	45,000	117,000.00	0.21
173	600038	中直股份	2,500	116,025.00	0.21
174	002444	巨星科技	6,100	115,778.00	0.21
175	603160	汇顶科技	2,300	115,460.00	0.20
176	600637	东方明珠	17,300	115,045.00	0.20
177	002531	天顺风能	7,600	114,988.00	0.20
178	300017	网宿科技	20,600	114,948.00	0.20
179	601577	长沙银行	17,000	114,920.00	0.20
180	002372	伟星新材	5,360	114,382.40	0.20
181	300418	昆仑万维	7,900	113,839.00	0.20
182	600166	福田汽车	40,500	113,805.00	0.20
183	600642	申能股份	20,700	113,643.00	0.20
184	600739	辽宁成大	9,000	113,310.00	0.20
185	601456	国联证券	10,000	112,500.00	0.20

186	600699	均胜电子	8,000	112,400.00	0.20
187	688301	奕瑞科技	245	112,180.60	0.20
188	002203	海亮股份	9,900	111,870.00	0.20
189	000970	中科三环	8,195	111,779.80	0.20
190	603712	七一二	3,200	111,744.00	0.20
191	688002	睿创微纳	3,000	111,570.00	0.20
192	002326	永太科技	5,100	111,333.00	0.20
193	002508	老板电器	4,000	111,040.00	0.20
194	603026	胜华新材	1,200	110,760.00	0.20
195	000155	川能动力	6,200	110,608.00	0.20
196	600673	东阳光	12,718	110,519.42	0.20
197	300373	扬杰科技	2,100	110,460.00	0.20
198	000039	中集集团	15,540	109,401.60	0.19
199	600380	健康元	9,672	109,196.88	0.19
200	600909	华安证券	23,720	108,874.80	0.19
201	603127	昭衍新药	1,860	108,642.60	0.19
202	300676	华大基因	2,100	108,549.00	0.19
203	600056	中国医药	6,300	108,549.00	0.19
204	600867	通化东宝	11,800	108,324.00	0.19
205	600118	中国卫星	5,000	107,750.00	0.19
206	000750	国海证券	32,130	106,992.90	0.19
207	002065	东华软件	18,900	106,974.00	0.19
208	600985	淮北矿业	8,300	106,240.00	0.19
209	300058	蓝色光标	21,000	106,050.00	0.19
210	300244	迪安诊断	4,220	106,048.60	0.19
211	000739	普洛药业	4,900	105,546.00	0.19
212	600008	首创环保	37,170	105,191.10	0.19
213	600369	西南证券	28,000	105,000.00	0.19
214	002831	裕同科技	3,160	104,501.20	0.19
215	688009	中国通号	21,800	104,422.00	0.19
216	002152	广电运通	10,500	104,370.00	0.19
217	600372	中航电子	6,500	103,805.00	0.18
218	300558	贝达药业	2,100	103,467.00	0.18
219	600998	九州通	7,900	103,016.00	0.18
220	601880	辽港股份	63,490	102,853.80	0.18
221	600435	北方导航	8,800	102,080.00	0.18
222	000027	深圳能源	16,020	101,887.20	0.18
223	002936	郑州银行	43,355	101,884.25	0.18
224	002408	齐翔腾达	14,412	101,460.48	0.18
225	000547	航天发展	10,800	101,412.00	0.18
226	300070	碧水源	21,400	101,222.00	0.18
227	300474	景嘉微	1,850	100,954.50	0.18
228	000636	风华高科	6,800	100,844.00	0.18

229	002131	利欧股份	56,959	100,817.43	0.18
230	300866	安克创新	1,700	100,759.00	0.18
231	000513	丽珠集团	3,098	100,623.04	0.18
232	300026	红日药业	17,700	100,536.00	0.18
233	002506	协鑫集成	34,500	100,395.00	0.18
234	603883	老百姓	2,476	100,203.72	0.18
235	002926	华西证券	13,300	100,149.00	0.18
236	002212	天融信	10,000	99,900.00	0.18
237	300682	朗新科技	4,500	98,910.00	0.18
238	300383	光环新网	12,100	98,736.00	0.18
239	600378	昊华科技	2,300	98,693.00	0.18
240	002183	怡亚通	15,300	98,379.00	0.17
241	002572	索菲亚	5,400	98,064.00	0.17
242	600820	隧道股份	18,600	98,022.00	0.17
243	600271	航天信息	9,400	97,854.00	0.17
244	002195	二三四五	48,230	96,942.30	0.17
245	300296	利亚德	17,100	96,786.00	0.17
246	002250	联化科技	6,244	96,782.00	0.17
247	603858	步长制药	4,600	96,646.00	0.17
248	600390	五矿资本	19,000	96,520.00	0.17
249	603893	瑞芯微	1,400	96,334.00	0.17
250	002500	山西证券	18,160	96,248.00	0.17
251	600863	内蒙华电	27,500	95,975.00	0.17
252	600580	卧龙电驱	7,700	95,942.00	0.17
253	000887	中鼎股份	6,600	95,502.00	0.17
254	600848	上海临港	8,000	95,360.00	0.17
255	600021	上海电力	9,500	95,095.00	0.17
256	688779	长远锂科	6,500	94,835.00	0.17
257	002368	太极股份	3,370	94,798.10	0.17
258	002958	青农商行	32,800	94,792.00	0.17
259	601958	金钼股份	8,200	94,710.00	0.17
260	300024	机器人	10,500	94,290.00	0.17
261	688538	和辉光电	35,100	94,068.00	0.17
262	603156	养元饮品	4,200	93,534.00	0.17
263	300009	安科生物	9,924	92,888.64	0.16
264	300001	特锐德	6,100	92,781.00	0.16
265	688256	寒武纪	1,700	92,752.00	0.16
266	002244	滨江集团	10,500	92,715.00	0.16
267	600755	厦门国贸	12,968	92,591.52	0.16
268	688521	芯原股份	2,100	92,547.00	0.16
269	600208	新湖中宝	36,300	92,202.00	0.16
270	002155	湖南黄金	7,100	91,945.00	0.16
271	002511	中顺洁柔	6,600	90,684.00	0.16

272	600316	洪都航空	3,600	90,684.00	0.16
273	000060	中金岭南	22,100	90,610.00	0.16
274	603885	吉祥航空	5,600	90,608.00	0.16
275	300850	新强联	1,700	90,576.00	0.16
276	000050	深天马 A	10,400	90,064.00	0.16
277	000997	新大陆	6,900	89,769.00	0.16
278	603927	中科软	3,020	89,422.20	0.16
279	601992	金隅集团	35,200	89,408.00	0.16
280	600060	海信视像	6,600	89,364.00	0.16
281	600511	国药股份	3,200	89,280.00	0.16
282	601005	重庆钢铁	56,500	89,270.00	0.16
283	601231	环旭电子	5,500	89,265.00	0.16
284	600315	上海家化	2,800	89,180.00	0.16
285	300776	帝尔激光	700	88,200.00	0.16
286	688185	康希诺	600	87,612.00	0.16
287	601717	郑煤机	7,700	85,932.00	0.15
288	300251	光线传媒	9,900	85,734.00	0.15
289	600201	生物股份	9,490	85,504.90	0.15
290	600528	中铁工业	11,200	85,456.00	0.15
291	600801	华新水泥	5,736	85,007.52	0.15
292	000021	深科技	7,909	84,547.21	0.15
293	002939	长城证券	10,200	84,456.00	0.15
294	600566	济川药业	3,100	84,382.00	0.15
295	300168	万达信息	10,000	84,300.00	0.15
296	600066	宇通客车	11,200	84,112.00	0.15
297	600171	上海贝岭	4,800	83,664.00	0.15
298	000825	太钢不锈	19,300	83,376.00	0.15
299	603218	日月股份	4,100	83,230.00	0.15
300	002373	千方科技	9,300	82,956.00	0.15
301	600598	北大荒	6,000	82,560.00	0.15
302	600906	财达证券	10,900	82,513.00	0.15
303	600839	四川长虹	31,100	82,104.00	0.15
304	600282	南钢股份	26,000	81,900.00	0.15
305	600535	天士力	7,600	81,776.00	0.15
306	300677	英科医疗	3,880	81,596.40	0.14
307	600970	中材国际	9,550	81,366.00	0.14
308	600827	百联股份	6,700	81,204.00	0.14
309	601866	中远海发	33,400	80,828.00	0.14
310	601665	齐鲁银行	19,300	80,481.00	0.14
311	601778	晶科科技	14,600	80,300.00	0.14
312	600500	中化国际	12,113	80,066.93	0.14
313	002127	南极电商	16,600	79,846.00	0.14
314	601179	中国西电	17,300	79,753.00	0.14

315	002128	电投能源	6,400	78,976.00	0.14
316	000709	河钢股份	34,900	78,874.00	0.14
317	002153	石基信息	5,260	78,847.40	0.14
318	600498	烽火通信	6,000	78,840.00	0.14
319	603568	伟明环保	4,251	78,771.03	0.14
320	002595	豪迈科技	3,400	78,710.00	0.14
321	300861	美畅股份	1,600	78,656.00	0.14
322	300888	稳健医疗	1,100	78,650.00	0.14
323	000930	中粮科技	9,400	78,584.00	0.14
324	000012	南玻 A	11,595	77,802.45	0.14
325	300182	捷成股份	17,400	77,778.00	0.14
326	603000	人民网	4,600	77,602.00	0.14
327	600398	海澜之家	14,600	77,380.00	0.14
328	002701	奥瑞金	15,232	76,921.60	0.14
329	000987	越秀资本	12,725	76,222.75	0.14
330	002019	亿帆医药	6,200	75,950.00	0.13
331	002124	天邦食品	12,420	75,886.20	0.13
332	600959	江苏有线	25,300	75,141.00	0.13
333	002396	星网锐捷	3,900	74,724.00	0.13
334	002985	北摩高科	1,655	74,640.50	0.13
335	000581	威孚高科	4,200	74,466.00	0.13
336	000401	冀东水泥	9,000	74,070.00	0.13
337	000598	兴蓉环境	15,100	73,839.00	0.13
338	000778	新兴铸管	20,200	73,730.00	0.13
339	600895	张江高科	6,500	73,710.00	0.13
340	603707	健友股份	4,060	73,242.40	0.13
341	300115	长盈精密	7,064	72,971.12	0.13
342	600582	天地科技	14,000	72,800.00	0.13
343	002670	国盛金控	9,804	72,647.64	0.13
344	688208	道通科技	2,300	72,565.00	0.13
345	688690	纳微科技	1,400	72,478.00	0.13
346	300618	寒锐钴业	1,800	72,090.00	0.13
347	600663	陆家嘴	7,400	72,076.00	0.13
348	600297	广汇汽车	34,200	71,820.00	0.13
349	002249	大洋电机	14,000	71,680.00	0.13
350	600718	东软集团	7,200	71,640.00	0.13
351	002690	美亚光电	2,990	71,461.00	0.13
352	600507	方大特钢	11,805	71,066.10	0.13
353	002266	浙富控股	18,130	70,888.30	0.13
354	603225	新凤鸣	6,456	70,241.28	0.12
355	600517	国网英大	14,500	70,180.00	0.12
356	600329	达仁堂	2,400	69,840.00	0.12
357	300482	万孚生物	2,190	69,795.30	0.12

358	000883	湖北能源	16,600	69,720.00	0.12
359	002505	鹏都农牧	26,830	69,221.40	0.12
360	300212	易华录	3,380	68,985.80	0.12
361	000656	金科股份	36,000	68,760.00	0.12
362	600409	三友化工	10,400	68,744.00	0.12
363	603866	桃李面包	4,458	68,653.20	0.12
364	601000	唐山港	25,026	68,571.24	0.12
365	002002	鸿达兴业	21,100	68,364.00	0.12
366	600259	广晟有色	1,700	68,340.00	0.12
367	600022	山东钢铁	46,150	68,302.00	0.12
368	600871	石化油服	34,300	67,914.00	0.12
369	600064	南京高科	10,260	67,818.60	0.12
370	601106	中国一重	23,100	67,683.00	0.12
371	000089	深圳机场	8,600	67,596.00	0.12
372	000785	居然之家	16,500	67,485.00	0.12
373	600567	山鹰国际	27,200	67,456.00	0.12
374	300376	易事特	9,800	66,934.00	0.12
375	002429	兆驰股份	19,100	66,659.00	0.12
376	600216	浙江医药	5,700	66,633.00	0.12
377	002468	申通快递	6,400	66,112.00	0.12
378	600782	新钢股份	16,100	65,849.00	0.12
379	688029	南微医学	800	65,704.00	0.12
380	002081	金螳螂	13,400	64,990.00	0.12
381	601333	广深铁路	28,600	64,922.00	0.12
382	601718	际华集团	22,200	64,602.00	0.11
383	600667	太极实业	12,400	63,984.00	0.11
384	601187	厦门银行	11,100	63,603.00	0.11
385	601118	海南橡胶	14,400	63,072.00	0.11
386	002010	传化智联	11,800	63,012.00	0.11
387	002191	劲嘉股份	8,700	62,901.00	0.11
388	600728	佳都科技	11,900	62,832.00	0.11
389	600737	中粮糖业	9,000	62,460.00	0.11
390	600597	光明乳业	5,800	62,408.00	0.11
391	000540	中天金融	41,300	62,363.00	0.11
392	300463	迈克生物	3,600	62,280.00	0.11
393	000537	广宇发展	4,700	62,181.00	0.11
394	600376	首开股份	10,900	62,021.00	0.11
395	600062	华润双鹤	3,452	61,756.28	0.11
396	600155	华创阳安	9,500	61,750.00	0.11
397	002221	东华能源	8,006	61,085.78	0.11
398	601156	东航物流	4,000	61,040.00	0.11
399	002745	木林森	7,500	60,825.00	0.11
400	300072	海新能科	13,900	60,604.00	0.11

401	601098	中南传媒	6,000	59,880.00	0.11
402	600131	国网信通	4,000	59,840.00	0.11
403	600967	内蒙一机	7,200	59,472.00	0.11
404	603379	三美股份	2,080	59,196.80	0.11
405	002416	爱施德	6,220	58,965.60	0.10
406	600126	杭钢股份	14,190	58,604.70	0.10
407	000156	华数传媒	7,800	58,422.00	0.10
408	601991	大唐发电	20,900	58,311.00	0.10
409	600808	马钢股份	20,400	57,324.00	0.10
410	002048	宁波华翔	4,100	56,990.00	0.10
411	601568	北元集团	10,040	56,926.80	0.10
412	000937	冀中能源	8,900	56,604.00	0.10
413	603228	景旺电子	2,794	56,550.56	0.10
414	002423	中粮资本	7,800	55,848.00	0.10
415	002281	光迅科技	3,549	55,790.28	0.10
416	001914	招商积余	3,600	55,368.00	0.10
417	600901	江苏租赁	10,100	55,348.00	0.10
418	600373	中文传媒	5,700	54,549.00	0.10
419	003035	南网能源	9,600	54,432.00	0.10
420	600095	湘财股份	7,200	54,432.00	0.10
421	603056	德邦股份	2,600	54,158.00	0.10
422	000559	万向钱潮	11,100	54,057.00	0.10
423	000898	鞍钢股份	20,200	53,934.00	0.10
424	300630	普利制药	2,177	53,684.82	0.10
425	002434	万里扬	6,600	53,130.00	0.09
426	000402	金融街	10,100	53,025.00	0.09
427	688289	圣湘生物	2,400	52,680.00	0.09
428	301029	怡合达	800	52,592.00	0.09
429	002867	周大生	3,700	51,911.00	0.09
430	603317	天味食品	1,886	51,827.28	0.09
431	600556	天下秀	7,600	51,224.00	0.09
432	601598	中国外运	13,300	51,072.00	0.09
433	601608	中信重工	14,600	50,954.00	0.09
434	601611	中国核建	6,700	50,920.00	0.09
435	601928	凤凰传媒	6,400	50,688.00	0.09
436	000563	陕国投 A	16,666	50,497.98	0.09
437	600707	彩虹股份	12,100	50,094.00	0.09
438	002948	青岛银行	14,830	49,828.80	0.09
439	600195	中牧股份	4,287	49,814.94	0.09
440	000959	首钢股份	13,200	49,764.00	0.09
441	300257	开山股份	3,300	49,500.00	0.09
442	600968	海油发展	17,100	49,248.00	0.09
443	001203	大中矿业	3,800	49,134.00	0.09

444	600167	联美控股	7,730	48,853.60	0.09
445	002110	三钢闽光	10,350	48,645.00	0.09
446	000967	盈峰环境	10,700	48,578.00	0.09
447	688188	柏楚电子	220	47,757.60	0.08
448	002705	新宝股份	2,800	46,620.00	0.08
449	603650	彤程新材	1,500	46,245.00	0.08
450	000415	渤海租赁	20,900	46,189.00	0.08
451	000990	诚志股份	5,100	44,880.00	0.08
452	600307	酒钢宏兴	26,400	43,560.00	0.08
453	002925	盈趣科技	2,600	42,952.00	0.08
454	002242	九阳股份	2,600	42,848.00	0.08
455	601828	美凯龙	9,100	42,679.00	0.08
456	300869	康泰医学	1,300	42,341.00	0.08
457	600339	中油工程	14,100	42,018.00	0.07
458	603638	艾迪精密	2,800	41,776.00	0.07
459	600764	中国海防	1,800	41,328.00	0.07
460	000031	大悦城	10,800	40,608.00	0.07
461	600623	华谊集团	6,400	40,448.00	0.07
462	688819	天能股份	1,100	40,414.00	0.07
463	002653	海思科	1,800	40,050.00	0.07
464	002399	海普瑞	3,100	39,835.00	0.07
465	002146	荣盛发展	18,300	39,711.00	0.07
466	600928	西安银行	11,200	39,424.00	0.07
467	688006	杭可科技	900	39,393.00	0.07
468	601969	海南矿业	5,100	37,791.00	0.07
469	600006	东风汽车	6,700	37,386.00	0.07
470	600648	外高桥	3,100	37,045.00	0.07
471	603719	良品铺子	1,000	36,870.00	0.07
472	600787	中储股份	7,400	36,778.00	0.07
473	688088	虹软科技	1,600	36,016.00	0.06
474	002563	森马服饰	6,800	35,632.00	0.06
475	000961	中南建设	16,100	35,259.00	0.06
476	600377	宁沪高速	4,200	34,524.00	0.06
477	000553	安道麦 A	3,800	34,390.00	0.06
478	000869	张裕 A	1,100	33,264.00	0.06
479	601298	青岛港	5,900	33,099.00	0.06
480	601869	长飞光纤	1,000	32,630.00	0.06
481	600350	山东高速	5,700	32,433.00	0.06
482	601139	深圳燃气	4,900	32,046.00	0.06
483	000062	深圳华强	2,610	31,868.10	0.06
484	002945	华林证券	2,300	30,314.00	0.05
485	601228	广州港	9,200	28,980.00	0.05
486	600299	安迪苏	3,500	28,910.00	0.05

487	001872	招商港口	1,900	27,284.00	0.05
488	603868	飞科电器	400	26,932.00	0.05
489	603355	莱克电气	960	26,918.40	0.05
490	601158	重庆水务	4,900	25,137.00	0.04
491	600956	新天绿能	2,600	25,064.00	0.04
492	300741	华宝股份	1,000	23,530.00	0.04
493	600917	重庆燃气	2,700	21,492.00	0.04
494	600927	永安期货	1,300	20,956.00	0.04
495	001227	兰州银行	5,500	20,735.00	0.04
496	603786	科博达	300	19,749.00	0.04
497	600032	浙江新能	1,700	19,533.00	0.03
498	002901	大博医疗	500	17,015.00	0.03
499	688772	珠海冠宇	900	16,776.00	0.03

8.3.2 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	601136	首创证券	4,325	75,341.50	0.13
2	001301	尚太科技	873	51,541.92	0.09

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300769	德方纳米	408,492.00	0.65
2	002340	格林美	373,567.00	0.59
3	300073	当升科技	352,332.00	0.56
4	600096	云天化	349,786.00	0.55
5	300012	华测检测	349,288.00	0.55
6	002407	多氟多	348,863.00	0.55
7	002756	永兴材料	346,875.00	0.55
8	002497	雅化集团	341,772.00	0.54
9	002240	盛新锂能	334,210.00	0.53
10	688180	君实生物	321,545.60	0.51
11	300390	天华超净	294,046.00	0.47
12	688122	西部超导	287,407.85	0.46
13	300003	乐普医疗	257,942.00	0.41
14	600499	科达制造	253,591.00	0.40
15	603026	胜华新材	247,008.00	0.39
16	601058	赛轮轮胎	245,798.00	0.39

17	603606	东方电缆	244,867.00	0.39
18	688063	派能科技	243,116.00	0.39
19	002738	中矿资源	238,524.00	0.38
20	603345	安井食品	232,059.00	0.37

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601615	明阳智能	510,842.00	0.81
2	600256	广汇能源	460,653.00	0.73
3	600522	中天科技	437,138.00	0.69
4	000733	振华科技	383,322.00	0.61
5	002180	纳思达	368,849.00	0.58
6	600732	爱旭股份	363,990.00	0.58
7	002340	格林美	360,911.72	0.57
8	600188	兖矿能源	343,401.00	0.54
9	300769	德方纳米	335,350.00	0.53
10	000983	山西焦煤	330,109.50	0.52
11	002756	永兴材料	298,703.00	0.47
12	601117	中国化学	293,788.00	0.47
13	000723	美锦能源	288,206.00	0.46
14	600233	圆通速递	285,232.00	0.45
15	600875	东方电气	276,877.00	0.44
16	600884	杉杉股份	255,545.90	0.40
17	605117	德业股份	252,976.00	0.40
18	002240	盛新锂能	251,237.00	0.40
19	300751	迈为股份	245,325.00	0.39
20	600039	四川路桥	244,461.00	0.39

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。

8.4.3 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	34,427,703.26
卖出股票收入（成交）总额	29,117,803.46

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。

8.5 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	612,125.75	1.09

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	612,125.75	1.09

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019666	22 国债 01	6,000	612,125.75	1.09

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	2,191.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,802.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,993.36

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,785	7,907.83	297,367.97	0.79	37,541,591.84	99.21

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	14.30	0.0000

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 11 月 29 日) 基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	34,540,284.28
本报告期基金总申购份额	10,267,220.11
减：本报告期基金总赎回份额	6,968,544.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	37,838,959.81

注：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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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”)第五届董事会第一次会议决议,原本公司董事长许金超先生自 2022 年 9 月 26 日离任本公司董事长职务;黄涛先生自 2022 年 9 月 26 日任职本公司董事长职位。

本公司已于 2022 年 9 月 28 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,徐铁任交通银行资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所,报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 5 万元,该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
高华证券	2	28,367,159.90	44.92	26,419.71	48.59	-
东方证券	2	22,230,568.82	35.20	16,256.99	29.90	-
国信证券	2	12,558,474.00	19.88	11,696.21	21.51	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请,集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后,研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价,做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期新增东方证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
高华证券	599,760.00	100.00	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 01 月 21 日
2	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2021 年年度报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 03 月 29 日
3	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 04 月 21 日
4	农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人	2022 年 06 月 29 日
5	农银汇理中证 500 指数证券投资基金-招募说明书更新-2022 年 1 号	上海证券报、基金管理人	2022 年 06 月 29 日
6	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 07 月 20 日
7	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年中期报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 08 月 30 日
8	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	上海证券报、基金管理人	2022 年 10 月 26 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

13.3 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

2023 年 3 月 29 日