

# 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 22 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 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 .....             | 11        |
| 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>36</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 36        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 37        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 47        |
| 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 .....      | 48        |
| 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 .....   | 48        |
| 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 .....   | 48        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 48        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 48        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 48        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 48        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 49        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 50        |
| 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 .....   | 50        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>50</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 51        |
| 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 .....   | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 51        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 51        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 51        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 53        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>53</b> |
| 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 ..... | 53        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 农银沪深 300 指数         |                 |
| 基金主代码           | 660008              |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                 |
| 基金合同生效日         | 2011 年 4 月 12 日     |                 |
| 基金管理人           | 农银汇理基金管理有限公司        |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 340,597,827.65 份    |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 农银沪深 300 指数 A       | 农银沪深 300 指数 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 660008              | 005152          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 328,390,885.16 份    | 12,206,942.49 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在 4% 以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。 |
| 投资策略   | 本基金原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。  |
| 业绩比较基准 | 95%×沪深 300 指数+5%×同期银行活期存款利率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                     | 基金托管人               |
|-------------|------|---------------------------|---------------------|
| 名称          |      | 农银汇理基金管理有限公司              | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 翟爱东                       | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-61095588              | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | xuxin@abc-ca.com          | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-61095599              | 95588               |
| 传真          |      | 021-61095556              | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码        |      | 200120                    | 100140              |

|       |    |    |
|-------|----|----|
| 法定代表人 | 黄涛 | 廖林 |
|-------|----|----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。                                |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                       |
|--------|--------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 农银汇理基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数<br>据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |               |
|-------------------|-------------------------------------|---------------|
|                   | 农银沪深 300 指数 A                       | 农银沪深 300 指数 C |
| 本期已实现收益           | -2,039,744.48                       | -230,091.75   |
| 本期利润              | 6,501,667.63                        | -390,201.03   |
| 加权平均基金份额<br>本期利润  | 0.0198                              | -0.0326       |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 1.50%                               | -2.51%        |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 1.39%                               | 1.19%         |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |               |
| 期末可供分配利<br>润      | 104,670,016.71                      | 3,514,842.93  |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 0.3187                              | 0.2879        |
| 期末基金资产净<br>值      | 433,060,901.87                      | 15,721,785.42 |
| 期末基金份额净<br>值      | 1.3187                              | 1.2879        |
| 3.1.3 累计期<br>末指标  | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |               |

|             |        |        |
|-------------|--------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 31.87% | 15.79% |
|-------------|--------|--------|

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银沪深 300 指数 A

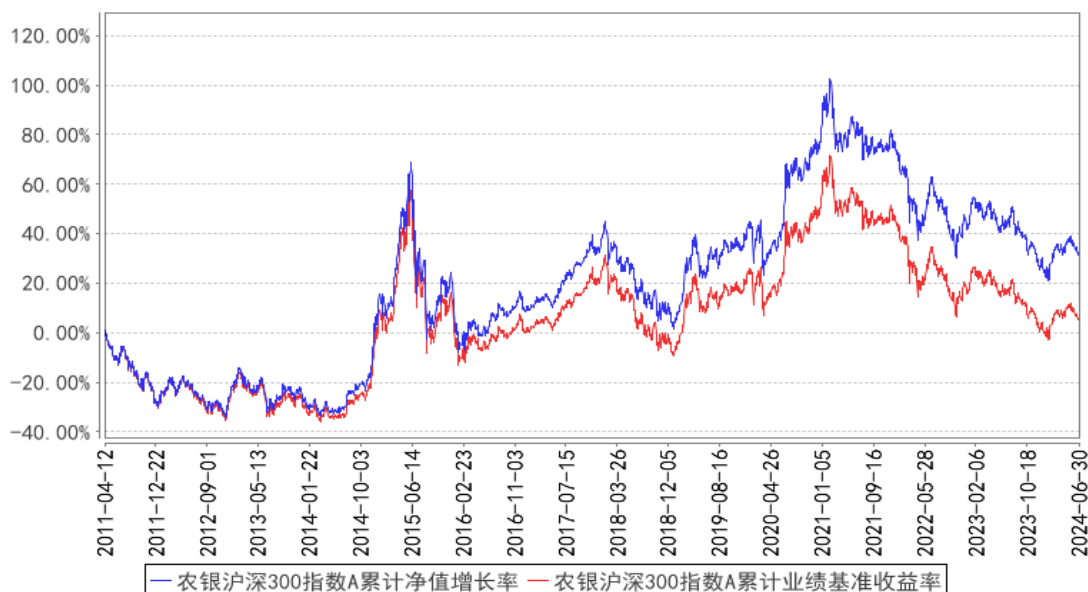
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -2.49%   | 0.46%       | -3.14%     | 0.46%         | 0.65%  | 0.00%  |
| 过去三个月      | -1.18%   | 0.71%       | -2.03%     | 0.72%         | 0.85%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.39%    | 0.85%       | 0.87%      | 0.85%         | 0.52%  | 0.00%  |
| 过去一年       | -8.05%   | 0.83%       | -9.39%     | 0.83%         | 1.34%  | 0.00%  |
| 过去三年       | -28.49%  | 0.99%       | -32.21%    | 0.99%         | 3.72%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 31.87%   | 1.30%       | 5.31%      | 1.29%         | 26.56% | 0.01%  |

农银沪深 300 指数 C

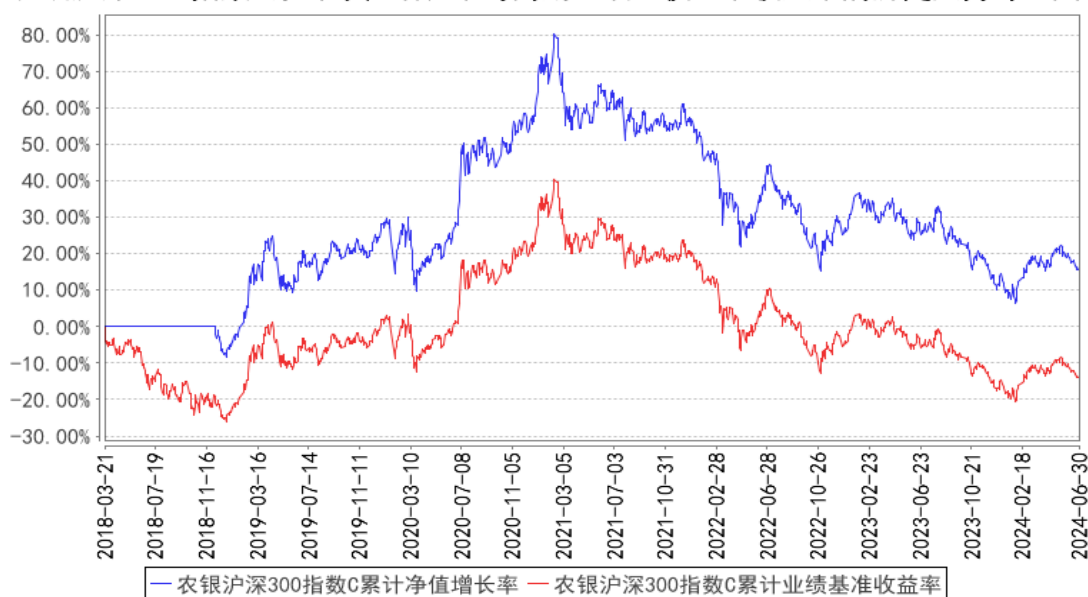
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -2.53%   | 0.46%       | -3.14%     | 0.46%         | 0.61%  | 0.00%  |
| 过去三个月      | -1.29%   | 0.71%       | -2.03%     | 0.72%         | 0.74%  | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.19%    | 0.85%       | 0.87%      | 0.85%         | 0.32%  | 0.00%  |
| 过去一年       | -8.42%   | 0.82%       | -9.39%     | 0.83%         | 0.97%  | -0.01% |
| 过去三年       | -29.36%  | 0.99%       | -32.21%    | 0.99%         | 2.85%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 15.79%   | 1.06%       | -13.88%    | 1.15%         | 29.67% | -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

农银沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 83 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、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、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金、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、农银汇理国企优选混合型证券投资基金、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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-----------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 宋永安 | 本基金的基金经理 | 2012 年 8 月 3 日  | -    | 16 年   | 硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。 |

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0255%，日均偏离度为 0.0158%，符合基金合同契约规定的日均偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制不超过 4%。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 指数中成份股票的调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.3187 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.39%；截至本报告期末农银沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.2879 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.19%；同期业绩比较基准收益率为 0.87%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动化指数产品，我们将坚持指数被动化投资理念，

运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会会计字[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）、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》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。

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

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

本报告期内，本基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 19,225,341.02          | 13,439,624.32            |
| 结算备付金      |         | 30,660.35              | 16,767.11                |
| 存出保证金      |         | 6,228.63               | 12,337.25                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 435,576,595.10         | 418,290,021.09           |
| 其中：股票投资    |         | 425,974,653.59         | 407,133,851.23           |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 9,601,941.51           | 11,156,169.86            |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | -                        |

|               |            |                   |                    |
|---------------|------------|-------------------|--------------------|
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                 | -                  |
| 其中：债券投资       |            | -                 | -                  |
| 资产支持证券投资      |            | -                 | -                  |
| 其他投资          |            | -                 | -                  |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                 | -                  |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                 | -                  |
| 应收清算款         |            | -                 | -                  |
| 应收股利          |            | -                 | -                  |
| 应收申购款         |            | 210,456.02        | 274,536.21         |
| 递延所得税资产       |            | -                 | -                  |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                 | -                  |
| 资产总计          |            | 455,049,281.12    | 432,033,285.98     |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|               |            | <b>2024年6月30日</b> | <b>2023年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                   |                    |
| 短期借款          |            | -                 | -                  |
| 交易性金融负债       |            | -                 | -                  |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                 | -                  |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                 | -                  |
| 应付清算款         |            | 151.44            | 1,946,090.59       |
| 应付赎回款         |            | 5,761,041.30      | 532,039.89         |
| 应付管理人报酬       |            | 230,641.76        | 214,706.11         |
| 应付托管费         |            | 57,660.41         | 53,676.51          |
| 应付销售服务费       |            | 9,432.79          | 2,991.58           |
| 应付投资顾问费       |            | -                 | -                  |
| 应交税费          |            | -                 | -                  |
| 应付利润          |            | -                 | -                  |
| 递延所得税负债       |            | -                 | -                  |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 207,666.13        | 258,619.08         |
| 负债合计          |            | 6,266,593.83      | 3,008,123.76       |
| <b>净资产：</b>   |            |                   |                    |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 340,597,827.65    | 330,032,063.95     |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                 | -                  |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 108,184,859.64    | 98,993,098.27      |
| 净资产合计         |            | 448,782,687.29    | 429,025,162.22     |
| 负债和净资产总计      |            | 455,049,281.12    | 432,033,285.98     |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 340,597,827.65 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.3187 元，基金份额总额 328,390,885.16 份；下属 C 类基金份额净值 1.2879 元，基金份额总额 12,206,942.49 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 8,018,487.74                             | 2,895,215.94                                  |
| 1. 利息收入                |            | 31,795.81                                | 44,329.01                                     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 31,795.81                                | 44,329.01                                     |
| 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）      |            | -434,296.16                              | 4,497,448.85                                  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | -5,474,495.48                            | -676,418.05                                   |
| 基金投资收益                 |            | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | 59,860.68                                | -   |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.17   | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.18   | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.19   | 4,980,338.64                             | 5,173,866.90                                  |
| 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   | 8,381,302.83                             | -1,674,266.75                                 |
| 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   | 39,685.26                                | 27,704.83                                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 1,907,021.14                             | 1,919,722.77                                  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 1,339,455.02                             | 1,369,148.83                                  |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -  | -   |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 334,863.75                               | 342,287.20                                    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 30,592.50                                | 11,281.73                                     |
| 4. 投资顾问费               |            | -  | -   |
| 5. 利息支出                |            | 4,192.55                                 | -   |

|                            |          |              |            |
|----------------------------|----------|--------------|------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 4,192.55     | -          |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22 | -            | -          |
| 7. 税金及附加                   |          | -            | -          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23 | 197,917.32   | 197,005.01 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 6,111,466.60 | 975,493.17 |
| 减：所得税费用                    |          | -            | -          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 6,111,466.60 | 975,493.17 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -            | -          |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | 6,111,466.60 | 975,493.17 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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                           | 330,032,063.95                        | -      | 98,993,098.27  | 429,025,162.22  |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -              | -               |
| 其他                                  | -                                     | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                           | 330,032,063.95                        | -      | 98,993,098.27  | 429,025,162.22  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 10,565,763.70                         | -      | 9,191,761.37   | 19,757,525.07   |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | 6,111,466.60   | 6,111,466.60    |
| (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) | 10,565,763.70                         | -      | 3,080,294.77   | 13,646,058.47   |
| 其中：1. 基金申购款                         | 128,831,133.34                        | -      | 40,371,289.60  | 169,202,422.94  |
| 2. 基金赎回                             | -                                     | -      | -37,290,994.83 | -155,556,364.47 |



|  |  |        |                |                |
|--|--|--------|----------------|----------------|
| 回款                                       | 118,265,369.64                             |        |                |                |
| (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                                | 340,597,827.65                             | -      | 108,184,859.64 | 448,782,687.29 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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                                | 310,502,398.02                             | -      | 133,829,011.27 | 444,331,409.29 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 310,502,398.02                             | -      | 133,829,011.27 | 444,331,409.29 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 1,524,424.09                               | -      | 1,518,633.44   | 3,043,057.53   |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | 975,493.17     | 975,493.17     |
| (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)      | 1,524,424.09                               | -      | 543,140.27     | 2,067,564.36   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 27,317,372.41                              | -      | 13,156,449.93  | 40,473,822.34  |
| 2. 基金赎回款                                 | -25,792,948.32                             | -      | -12,613,309.66 | -38,406,257.98 |
| (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        | 312,026,822.11 | - | 135,347,644.71 | 447,374,466.82 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据基金管理人农银汇理基金管理有限公司 2018 年 3 月 20 日《农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2018 年 3 月 21 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额);C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于沪深 300 指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数+5%×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》、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[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。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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 19,225,341.02          |
| 等于：本金          | 19,223,573.34          |
| 加：应计利息         | 1,767.68               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 19,225,341.02          |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |           |                |                |
|---------------|------------------------|-----------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 应计利息      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 445,870,034.01         | -         | 425,974,653.59 | -19,895,380.42 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -         | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 80,091.51 | 9,601,941.51   | -750.00        |
|               | 银行间市场                  | -         | -              | -              |
|               | 合计                     | 80,091.51 | 9,601,941.51   | -750.00        |
| 资产支持证券        | -                      | -         | -              | -              |
| 基金            | -                      | -         | -              | -              |
| 其他            | -                      | -         | -              | -              |
| 合计            | 455,392,634.01         | 80,091.51 | 435,576,595.10 | -19,896,130.42 |

## 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 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -               |
| 应付赎回费       | 750.01          |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 69,894.64       |
| 其中：交易所市场    | 69,894.64       |
| 银行间市场       | -               |
| 应付利息        | -               |
| 预提费用        | 87,021.48       |
| 应付指数使用费     | 50,000.00       |
| 合计          | 207,666.13      |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 农银沪深 300 指数 A

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 322,265,303.63                        | 322,265,303.63 |
| 本期申购          | 34,835,055.50                         | 34,835,055.50  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -28,709,473.97                        | -28,709,473.97 |
| 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           | 328,390,885.16                        | 328,390,885.16 |

##### 农银沪深 300 指数 C

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 7,766,760.32                          | 7,766,760.32   |
| 本期申购          | 93,996,077.84                         | 93,996,077.84  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -89,555,895.67                        | -89,555,895.67 |
| 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           | 12,206,942.49                         | 12,206,942.49  |

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

农银沪深 300 指数 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末           | 313,645,211.25 | -216,770,460.79 | 96,874,750.46  |
| 加：会计政策变更       | -              | -               | -              |
| 前期差错更正         | -              | -               | -              |
| 其他             | -              | -               | -              |
| 本期期初           | 313,645,211.25 | -216,770,460.79 | 96,874,750.46  |
| 本期利润           | -2,039,744.48  | 8,541,412.11    | 6,501,667.63   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,961,080.51   | -4,667,481.89   | 1,293,598.62   |
| 其中：基金申购款       | 33,851,582.09  | -23,249,800.19  | 10,601,781.90  |
| 基金赎回款          | -27,890,501.58 | 18,582,318.30   | -9,308,183.28  |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -              |
| 本期末            | 317,566,547.28 | -212,896,530.57 | 104,670,016.71 |

农银沪深 300 指数 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 7,267,557.80   | -5,149,209.99  | 2,118,347.81   |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -              |
| 前期差错更正         | -              | -              | -              |
| 其他             | -              | -              | -              |
| 本期期初           | 7,267,557.80   | -5,149,209.99  | 2,118,347.81   |
| 本期利润           | -230,091.75    | -160,109.28    | -390,201.03    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,279,499.17   | -2,492,803.02  | 1,786,696.15   |
| 其中：基金申购款       | 87,614,511.82  | -57,845,004.12 | 29,769,507.70  |
| 基金赎回款          | -83,335,012.65 | 55,352,201.10  | -27,982,811.55 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 11,316,965.22  | -7,802,122.29  | 3,514,842.93   |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 31,325.83                             |
| 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 | 409.59                                |
| 其他        | 60.39                                 |
| 合计        | 31,795.81                             |



#### 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 40,903,390.59        |
| 减：卖出股票成本总额 | 46,265,151.35        |
| 减：交易费用     | 112,734.72           |
| 买卖股票差价收入   | -5,474,495.48        |

#### 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                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 82,270.68            |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -22,410.00           |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                    |
| 合计                           | 59,860.68            |

##### 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                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 11,225,500.00        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,022,410.00        |
| 减：应计利息总额               | 225,500.00           |
| 减：交易费用                 | -                    |
| 买卖债券差价收入               | -22,410.00           |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 4,980,338.64                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                               |
| 合计            | 4,980,338.64                    |

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 8,381,302.83                    |

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 股票投资                   | 8,360,742.83 |
| 债券投资                   | 20,560.00    |
| 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                     | 8,381,302.83 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 39,202.47                  |
| 基金转换费收入 | 482.79                     |
| 合计      | 39,685.26                  |

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 27,349.14                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 1,895.84                   |
| 账户维护费   | 9,000.00                   |
| 指数使用费   | 100,000.00                 |
| 合计      | 197,917.32                 |

#### 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 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,339,455.02                             | 1,369,148.83                                  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 546,950.54                               | 552,465.60                                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 792,504.48                               | 816,683.23                                    |

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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 334,863.75                      | 342,287.20                      |

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |               |          |
|----------------|---------------------------------|---------------|----------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |               |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |               |          |
|                | 农银沪深 300 指数 A                   | 农银沪深 300 指数 C | 合计       |
| 工商银行           | 0.00                            | 3,408.71      | 3,408.71 |
| 合计             | 0.00                            | 3,408.71      | 3,408.71 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |               |          |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |               |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |               |          |
|                | 农银沪深 300 指数 A                   | 农银沪深 300 指数 C | 合计       |
| 合计             | -                               | -             | -        |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给农银汇理，再由农银汇理计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.40%/ 当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。

##### 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<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 |           | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |           |
|-------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                           | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 工商银行  | 19,225,341.02                  | 31,325.83 | 24,225,159.75                   | 43,930.21 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |     |        |       |        |          |          |          |    |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 603082               | 北自科技 | 2024年1月23日 | 6个月 | 主板锁定   | 21.28 | 29.49  | 107      | 2,276.96 | 3,155.43 | -  |

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期

内不得转让：

- 1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。
- 2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。
- 3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。
- 4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了“三层架构、三道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，

对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了层次明晰、权责统一、监管明确的三道内部控制防线，实现了业务经营部门、风险管理部门、审计部门的分工协作，前、中、后台的相互制约，以及对公司决策层、管理层、操作层的全面监督和控制。”

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 9,601,941.51           | 11,156,169.86            |
| 合计     | 9,601,941.51           | 11,156,169.86            |

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

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因



开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024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              | 19,225,341.02 | -    | -    | -               | 19,225,341.02  |
| 结算备付金             | 30,660.35     | -    | -    | -               | 30,660.35      |
| 存出保证金             | 6,228.63      | -    | -    | -               | 6,228.63       |
| 交易性金融资产           | 9,601,941.51  | -    | -    | -425,974,653.59 | 435,576,595.10 |
| 应收申购款             | -             | -    | -    | 210,456.02      | 210,456.02     |
| 资产总计              | 28,864,171.51 | -    | -    | -426,185,109.61 | 455,049,281.12 |
| 负债                |               |      |      |                 |                |
| 应付赎回款             | -             | -    | -    | 5,761,041.30    | 5,761,041.30   |
| 应付管理人报酬           | -             | -    | -    | 230,641.76      | 230,641.76     |
| 应付托管费             | -             | -    | -    | 57,660.41       | 57,660.41      |
| 应付清算款             | -             | -    | -    | 151.44          | 151.44         |
| 应付销售服务费           | -             | -    | -    | 9,432.79        | 9,432.79       |
| 其他负债              | -             | -    | -    | 207,666.13      | 207,666.13     |
| 负债总计              | -             | -    | -    | 6,266,593.83    | 6,266,593.83   |
| 利率敏感度缺口           | 28,864,171.51 | -    | -    | -419,918,515.78 | 448,782,687.29 |

| 上年度末<br>2023 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                     | 13,439,624.32 | -     | -     | -               | 13,439,624.32  |
| 结算备付金                    | 16,767.11     | -     | -     | -               | 16,767.11      |
| 存出保证金                    | 12,337.25     | -     | -     | -               | 12,337.25      |
| 交易性金融资产                  | 11,156,169.86 | -     | -     | -407,133,851.23 | 418,290,021.09 |
| 应收申购款                    | 994.04        | -     | -     | 273,542.17      | 274,536.21     |
| 资产总计                     | 24,625,892.58 | -     | -     | -407,407,393.40 | 432,033,285.98 |
| 负债                       |               |       |       |                 |                |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 532,039.89      | 532,039.89     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 214,706.11      | 214,706.11     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 53,676.51       | 53,676.51      |
| 应付清算款                    | -             | -     | -     | 1,946,090.59    | 1,946,090.59   |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 2,991.58        | 2,991.58       |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 258,619.08      | 258,619.08     |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 3,008,123.76    | 3,008,123.76   |
| 利率敏感度缺口                  | 24,625,892.58 | -     | -     | -404,399,269.64 | 429,025,162.22 |

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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|               | 市场利率上升 25 个基点        | -13,891.61                  | -8,883.10              |
| 市场利率下降 25 个基点 | 13,891.61            | 8,883.10                    |                        |

#### 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<br>2024年6月30日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 425,974,653.59    | 94.92            | 407,133,851.23      | 94.90            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -                | -                   | -                |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -                | -                   | -                |
| 其他            | -                 | -                | -                   | -                |
| 合计            | 425,974,653.59    | 94.92            | 407,133,851.23      | 94.90            |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
| -  | -                    | 22,293,574.01               | 21,342,445.34     |
| -  | -                    | -22,293,574.01              | -21,342,445.34    |

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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 425,971,498.16         | 407,100,108.79           |
| 第二层次          | 9,601,941.51           | 11,156,169.86            |
| 第三层次          | 3,155.43               | 33,742.44                |
| 合计            | 435,576,595.10         | 418,290,021.09           |

##### 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              | 425,974,653.59 | 93.61  |
|   | 其中：股票             | 425,974,653.59 | 93.61  |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 9,601,941.51   | 2.11   |
|   | 其中：债券             | 9,601,941.51   | 2.11   |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 19,256,001.37  | 4.23   |
| 8 | 其他各项资产            | 216,684.65     | 0.05   |
| 9 | 合计                | 455,049,281.12 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 5,390,540.40   | 1.20         |
| B  | 采矿业              | 26,013,845.97  | 5.80         |
| C  | 制造业              | 221,934,850.39 | 49.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,977,206.22  | 4.45         |
| E  | 建筑业              | 9,554,623.27   | 2.13         |
| F  | 批发和零售业           | 1,060,405.59   | 0.24         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 16,037,004.66  | 3.57         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 19,344,055.51  | 4.31         |
| J  | 金融业              | 94,821,325.25  | 21.13        |
| K  | 房地产业             | 3,906,500.80   | 0.87         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,403,304.26   | 0.76         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,364,111.36   | 0.75         |
| 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   | 1,163,724.48   | 0.26  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -              | -     |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 425,971,498.16 | 94.92 |

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）  | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -        | -            |
| B  | 采矿业              | -        | -            |
| C  | 制造业              | 3,155.43 | 0.00         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -        | -            |
| E  | 建筑业              | -        | -            |
| F  | 批发和零售业           | -        | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -        | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -        | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -        | -            |
| J  | 金融业              | -        | -            |
| K  | 房地产业             | -        | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -        | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -        | -            |
| 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               | 3,155.43 | 0.00         |

### 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<br>(股) | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 15,246    | 22,371,827.94 | 4.99             |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 63,120    | 11,363,493.60 | 2.53             |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 258,638   | 10,697,267.68 | 2.38             |
| 4  | 600036 | 招商银行  | 297,673   | 10,177,439.87 | 2.27             |
| 5  | 600900 | 长江电力  | 294,075   | 8,504,649.00  | 1.90             |
| 6  | 601328 | 交通银行  | 1,027,010 | 7,671,764.70  | 1.71             |
| 7  | 000333 | 美的集团  | 117,482   | 7,577,589.00  | 1.69             |
| 8  | 601899 | 紫金矿业  | 395,362   | 6,946,510.34  | 1.55             |
| 9  | 601166 | 兴业银行  | 349,359   | 6,155,705.58  | 1.37             |
| 10 | 000858 | 五粮液   | 46,442    | 5,946,433.68  | 1.33             |
| 11 | 002594 | 比亚迪   | 21,758    | 5,444,939.50  | 1.21             |
| 12 | 601988 | 中国银行  | 1,099,205 | 5,078,327.10  | 1.13             |
| 13 | 002475 | 立讯精密  | 121,040   | 4,758,082.40  | 1.06             |
| 14 | 600030 | 中信证券  | 234,765   | 4,279,765.95  | 0.95             |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗  | 14,700    | 4,276,377.00  | 0.95             |
| 16 | 000651 | 格力电器  | 108,506   | 4,255,605.32  | 0.95             |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药  | 107,426   | 4,131,603.96  | 0.92             |
| 18 | 600887 | 伊利股份  | 152,844   | 3,949,488.96  | 0.88             |
| 19 | 601939 | 建设银行  | 523,407   | 3,873,211.80  | 0.86             |
| 20 | 600309 | 万华化学  | 44,925    | 3,632,635.50  | 0.81             |
| 21 | 000725 | 京东方 A | 887,696   | 3,630,676.64  | 0.81             |
| 22 | 601088 | 中国神华  | 79,491    | 3,527,015.67  | 0.79             |
| 23 | 300059 | 东方财富  | 303,537   | 3,205,350.72  | 0.71             |
| 24 | 601816 | 京沪高铁  | 589,900   | 3,167,763.00  | 0.71             |
| 25 | 300308 | 中际旭创  | 21,540    | 2,969,935.20  | 0.66             |
| 26 | 002714 | 牧原股份  | 65,440    | 2,853,184.00  | 0.64             |
| 27 | 601857 | 中国石油  | 272,508   | 2,812,282.56  | 0.63             |
| 28 | 002415 | 海康威视  | 89,550    | 2,767,990.50  | 0.62             |
| 29 | 601668 | 中国建筑  | 500,169   | 2,655,897.39  | 0.59             |
| 30 | 600919 | 江苏银行  | 352,750   | 2,620,932.50  | 0.58             |
| 31 | 601138 | 工业富联  | 95,200    | 2,608,480.00  | 0.58             |
| 32 | 600690 | 海尔智家  | 90,800    | 2,576,904.00  | 0.57             |
| 33 | 300498 | 温氏股份  | 128,020   | 2,537,356.40  | 0.57             |
| 34 | 000568 | 泸州老窖  | 17,520    | 2,513,944.80  | 0.56             |
| 35 | 600809 | 山西汾酒  | 11,840    | 2,496,819.20  | 0.56             |
| 36 | 601919 | 中远海控  | 157,800   | 2,444,322.00  | 0.54             |
| 37 | 601985 | 中国核电  | 226,800   | 2,417,688.00  | 0.54             |
| 38 | 600406 | 国电南瑞  | 96,630    | 2,411,884.80  | 0.54             |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 39 | 601225 | 陕西煤业   | 93,100  | 2,399,187.00 | 0.53 |
| 40 | 002371 | 北方华创   | 7,500   | 2,399,175.00 | 0.53 |
| 41 | 603259 | 药明康德   | 60,544  | 2,372,719.36 | 0.53 |
| 42 | 000001 | 平安银行   | 233,315 | 2,368,147.25 | 0.53 |
| 43 | 600941 | 中国移动   | 21,700  | 2,332,750.00 | 0.52 |
| 44 | 600000 | 浦发银行   | 282,145 | 2,322,053.35 | 0.52 |
| 45 | 601601 | 中国太保   | 82,341  | 2,294,020.26 | 0.51 |
| 46 | 300124 | 汇川技术   | 44,706  | 2,293,417.80 | 0.51 |
| 47 | 601728 | 中国电信   | 372,911 | 2,293,402.65 | 0.51 |
| 48 | 000792 | 盐湖股份   | 130,700 | 2,280,715.00 | 0.51 |
| 49 | 600028 | 中国石化   | 351,011 | 2,218,389.52 | 0.49 |
| 50 | 601766 | 中国中车   | 291,984 | 2,192,799.84 | 0.49 |
| 51 | 600150 | 中国船舶   | 53,400  | 2,173,914.00 | 0.48 |
| 52 | 300274 | 阳光电源   | 34,940  | 2,167,328.20 | 0.48 |
| 53 | 600050 | 中国联通   | 458,550 | 2,155,185.00 | 0.48 |
| 54 | 688981 | 中芯国际   | 46,690  | 2,152,409.00 | 0.48 |
| 55 | 000063 | 中兴通讯   | 76,717  | 2,145,774.49 | 0.48 |
| 56 | 600031 | 三一重工   | 129,869 | 2,142,838.50 | 0.48 |
| 57 | 000338 | 潍柴动力   | 130,276 | 2,115,682.24 | 0.47 |
| 58 | 002352 | 顺丰控股   | 58,700  | 2,095,003.00 | 0.47 |
| 59 | 601169 | 北京银行   | 355,633 | 2,076,896.72 | 0.46 |
| 60 | 601012 | 隆基绿能   | 145,817 | 2,044,354.34 | 0.46 |
| 61 | 603501 | 韦尔股份   | 20,390  | 2,026,154.30 | 0.45 |
| 62 | 600837 | 海通证券   | 231,766 | 1,983,916.96 | 0.44 |
| 63 | 000100 | TCL 科技 | 450,975 | 1,948,212.00 | 0.43 |
| 64 | 600016 | 民生银行   | 510,964 | 1,936,553.56 | 0.43 |
| 65 | 002230 | 科大讯飞   | 44,065  | 1,892,591.75 | 0.42 |
| 66 | 600660 | 福耀玻璃   | 38,535  | 1,845,826.50 | 0.41 |
| 67 | 002142 | 宁波银行   | 79,140  | 1,745,828.40 | 0.39 |
| 68 | 601229 | 上海银行   | 238,996 | 1,735,110.96 | 0.39 |
| 69 | 600089 | 特变电工   | 121,280 | 1,682,153.60 | 0.37 |
| 70 | 600938 | 中国海油   | 50,200  | 1,656,600.00 | 0.37 |
| 71 | 601390 | 中国中铁   | 247,523 | 1,613,849.96 | 0.36 |
| 72 | 000625 | 长安汽车   | 119,189 | 1,600,708.27 | 0.36 |
| 73 | 688041 | 海光信息   | 22,700  | 1,596,264.00 | 0.36 |
| 74 | 603986 | 兆易创新   | 16,224  | 1,551,338.88 | 0.35 |
| 75 | 600104 | 上汽集团   | 111,447 | 1,544,655.42 | 0.34 |
| 76 | 688012 | 中微公司   | 10,900  | 1,539,734.00 | 0.34 |
| 77 | 601688 | 华泰证券   | 122,807 | 1,521,578.73 | 0.34 |
| 78 | 601006 | 大秦铁路   | 211,754 | 1,516,158.64 | 0.34 |
| 79 | 600048 | 保利发展   | 172,977 | 1,515,278.52 | 0.34 |
| 80 | 600905 | 三峡能源   | 344,600 | 1,502,456.00 | 0.33 |
| 81 | 600219 | 南山铝业   | 391,900 | 1,493,139.00 | 0.33 |



|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 82  | 002027 | 分众传媒 | 243,763 | 1,477,203.78 | 0.33 |
| 83  | 600436 | 片仔癀  | 7,100   | 1,470,907.00 | 0.33 |
| 84  | 603019 | 中科曙光 | 35,420  | 1,469,930.00 | 0.33 |
| 85  | 601211 | 国泰君安 | 108,000 | 1,463,400.00 | 0.33 |
| 86  | 601888 | 中国中免 | 23,152  | 1,446,768.48 | 0.32 |
| 87  | 603993 | 洛阳钼业 | 169,500 | 1,440,750.00 | 0.32 |
| 88  | 601818 | 光大银行 | 447,267 | 1,417,836.39 | 0.32 |
| 89  | 600019 | 宝钢股份 | 213,109 | 1,417,174.85 | 0.32 |
| 90  | 603288 | 海天味业 | 39,929  | 1,376,352.63 | 0.31 |
| 91  | 600585 | 海螺水泥 | 57,691  | 1,360,930.69 | 0.30 |
| 92  | 601658 | 邮储银行 | 267,500 | 1,356,225.00 | 0.30 |
| 93  | 601989 | 中国重工 | 274,956 | 1,355,533.08 | 0.30 |
| 94  | 688111 | 金山办公 | 5,800   | 1,319,500.00 | 0.29 |
| 95  | 600886 | 国投电力 | 71,760  | 1,308,902.40 | 0.29 |
| 96  | 601009 | 南京银行 | 124,734 | 1,295,986.26 | 0.29 |
| 97  | 600795 | 国电电力 | 215,118 | 1,288,556.82 | 0.29 |
| 98  | 000807 | 云铝股份 | 93,800  | 1,267,238.00 | 0.28 |
| 99  | 600438 | 通威股份 | 65,200  | 1,245,972.00 | 0.28 |
| 100 | 601628 | 中国人寿 | 40,119  | 1,245,694.95 | 0.28 |
| 101 | 600999 | 招商证券 | 89,294  | 1,242,079.54 | 0.28 |
| 102 | 688008 | 澜起科技 | 21,612  | 1,235,341.92 | 0.28 |
| 103 | 000938 | 紫光股份 | 55,261  | 1,235,083.35 | 0.28 |
| 104 | 000425 | 徐工机械 | 171,024 | 1,222,821.60 | 0.27 |
| 105 | 600547 | 山东黄金 | 43,651  | 1,195,164.38 | 0.27 |
| 106 | 300014 | 亿纬锂能 | 29,700  | 1,185,624.00 | 0.26 |
| 107 | 600893 | 航发动力 | 32,322  | 1,181,369.10 | 0.26 |
| 108 | 002304 | 洋河股份 | 14,623  | 1,180,661.02 | 0.26 |
| 109 | 300015 | 爱尔眼科 | 112,764 | 1,163,724.48 | 0.26 |
| 110 | 601669 | 中国电建 | 207,562 | 1,160,271.58 | 0.26 |
| 111 | 002179 | 中航光电 | 29,974  | 1,140,510.70 | 0.25 |
| 112 | 000002 | 万科 A | 163,931 | 1,136,041.83 | 0.25 |
| 113 | 600926 | 杭州银行 | 85,500  | 1,115,775.00 | 0.25 |
| 114 | 002241 | 歌尔股份 | 56,720  | 1,106,607.20 | 0.25 |
| 115 | 600584 | 长电科技 | 34,800  | 1,103,508.00 | 0.25 |
| 116 | 600760 | 中航沈飞 | 27,440  | 1,100,344.00 | 0.25 |
| 117 | 000538 | 云南白药 | 21,387  | 1,093,945.05 | 0.24 |
| 118 | 688256 | 寒武纪  | 5,300   | 1,052,951.00 | 0.23 |
| 119 | 600489 | 中金黄金 | 70,700  | 1,046,360.00 | 0.23 |
| 120 | 002050 | 三花智控 | 52,922  | 1,009,751.76 | 0.22 |
| 121 | 601916 | 浙商银行 | 363,400 | 1,002,984.00 | 0.22 |
| 122 | 600111 | 北方稀土 | 58,055  | 998,546.00   | 0.22 |
| 123 | 600011 | 华能国际 | 102,800 | 988,936.00   | 0.22 |
| 124 | 002252 | 上海莱士 | 126,038 | 985,617.16   | 0.22 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 125 | 600009 | 上海机场 | 30,122  | 971,434.50 | 0.22 |
| 126 | 600426 | 华鲁恒升 | 35,900  | 956,376.00 | 0.21 |
| 127 | 601186 | 中国铁建 | 110,754 | 949,161.78 | 0.21 |
| 128 | 300408 | 三环集团 | 32,300  | 942,837.00 | 0.21 |
| 129 | 600958 | 东方证券 | 122,352 | 929,875.20 | 0.21 |
| 130 | 000166 | 申万宏源 | 213,639 | 920,784.09 | 0.21 |
| 131 | 002311 | 海大集团 | 19,400  | 912,770.00 | 0.20 |
| 132 | 688271 | 联影医疗 | 8,271   | 907,328.70 | 0.20 |
| 133 | 600989 | 宝丰能源 | 52,000  | 901,160.00 | 0.20 |
| 134 | 601901 | 方正证券 | 115,539 | 893,116.47 | 0.20 |
| 135 | 000157 | 中联重科 | 116,154 | 892,062.72 | 0.20 |
| 136 | 003816 | 中国广核 | 190,400 | 881,552.00 | 0.20 |
| 137 | 300433 | 蓝思科技 | 48,148  | 878,701.00 | 0.20 |
| 138 | 002049 | 紫光国微 | 16,620  | 874,212.00 | 0.19 |
| 139 | 000776 | 广发证券 | 71,224  | 866,796.08 | 0.19 |
| 140 | 600674 | 川投能源 | 46,100  | 864,375.00 | 0.19 |
| 141 | 000977 | 浪潮信息 | 23,500  | 854,695.00 | 0.19 |
| 142 | 002001 | 新和成  | 44,464  | 853,708.80 | 0.19 |
| 143 | 601377 | 兴业证券 | 167,039 | 845,217.34 | 0.19 |
| 144 | 000596 | 古井贡酒 | 4,000   | 844,280.00 | 0.19 |
| 145 | 600115 | 中国东航 | 207,278 | 831,184.78 | 0.19 |
| 146 | 601111 | 中国国航 | 110,881 | 818,301.78 | 0.18 |
| 147 | 300122 | 智飞生物 | 28,950  | 811,468.50 | 0.18 |
| 148 | 688036 | 传音控股 | 10,260  | 785,300.40 | 0.17 |
| 149 | 000768 | 中航西飞 | 32,439  | 779,509.17 | 0.17 |
| 150 | 601800 | 中国交建 | 86,244  | 771,021.36 | 0.17 |
| 151 | 600029 | 南方航空 | 130,764 | 770,199.96 | 0.17 |
| 152 | 600010 | 包钢股份 | 549,843 | 769,780.20 | 0.17 |
| 153 | 600188 | 兖矿能源 | 33,650  | 764,864.50 | 0.17 |
| 154 | 001979 | 招商蛇口 | 86,355  | 759,060.45 | 0.17 |
| 155 | 002460 | 赣锋锂业 | 26,400  | 756,360.00 | 0.17 |
| 156 | 002601 | 龙佰集团 | 40,700  | 755,799.00 | 0.17 |
| 157 | 002236 | 大华股份 | 48,400  | 748,264.00 | 0.17 |
| 158 | 601633 | 长城汽车 | 29,304  | 741,391.20 | 0.17 |
| 159 | 002648 | 卫星化学 | 40,800  | 733,584.00 | 0.16 |
| 160 | 601117 | 中国化学 | 88,700  | 730,888.00 | 0.16 |
| 161 | 600161 | 天坛生物 | 29,600  | 722,240.00 | 0.16 |
| 162 | 002466 | 天齐锂业 | 24,100  | 720,831.00 | 0.16 |
| 163 | 000661 | 长春高新 | 7,800   | 715,806.00 | 0.16 |
| 164 | 603799 | 华友钴业 | 32,318  | 715,197.34 | 0.16 |
| 165 | 600346 | 恒力石化 | 51,161  | 713,695.95 | 0.16 |
| 166 | 002493 | 荣盛石化 | 73,600  | 710,976.00 | 0.16 |
| 167 | 000786 | 北新建材 | 23,600  | 699,976.00 | 0.16 |

|     |        |        |         |            |      |
|-----|--------|--------|---------|------------|------|
| 168 | 600023 | 浙能电力   | 98,300  | 698,913.00 | 0.16 |
| 169 | 601838 | 成都银行   | 46,000  | 698,740.00 | 0.16 |
| 170 | 000983 | 山西焦煤   | 67,400  | 694,894.00 | 0.15 |
| 171 | 603369 | 今世缘    | 15,000  | 693,000.00 | 0.15 |
| 172 | 600196 | 复星医药   | 31,042  | 687,269.88 | 0.15 |
| 173 | 300782 | 卓胜微    | 8,840   | 687,221.60 | 0.15 |
| 174 | 688223 | 晶科能源   | 95,359  | 677,048.90 | 0.15 |
| 175 | 300418 | 昆仑万维   | 21,000  | 677,040.00 | 0.15 |
| 176 | 002129 | TCL 中环 | 78,150  | 675,997.50 | 0.15 |
| 177 | 600372 | 中航机载   | 56,400  | 675,108.00 | 0.15 |
| 178 | 600845 | 宝信软件   | 21,057  | 672,350.01 | 0.15 |
| 179 | 601868 | 中国能建   | 314,300 | 666,316.00 | 0.15 |
| 180 | 601872 | 招商轮船   | 78,800  | 665,860.00 | 0.15 |
| 181 | 601360 | 三六零    | 86,600  | 665,088.00 | 0.15 |
| 182 | 601788 | 光大证券   | 45,200  | 660,824.00 | 0.15 |
| 183 | 601021 | 春秋航空   | 11,700  | 659,061.00 | 0.15 |
| 184 | 600085 | 同仁堂    | 17,185  | 656,638.85 | 0.15 |
| 185 | 300661 | 圣邦股份   | 7,880   | 652,306.40 | 0.15 |
| 186 | 600176 | 中国巨石   | 58,794  | 649,673.70 | 0.14 |
| 187 | 605499 | 东鹏饮料   | 3,000   | 647,250.00 | 0.14 |
| 188 | 600233 | 圆通速递   | 41,000  | 641,650.00 | 0.14 |
| 189 | 002180 | 纳思达    | 24,100  | 636,722.00 | 0.14 |
| 190 | 002938 | 鹏鼎控股   | 16,000  | 636,160.00 | 0.14 |
| 191 | 600570 | 恒生电子   | 35,985  | 635,495.10 | 0.14 |
| 192 | 601995 | 中金公司   | 21,400  | 633,654.00 | 0.14 |
| 193 | 600600 | 青岛啤酒   | 8,500   | 618,545.00 | 0.14 |
| 194 | 300347 | 泰格医药   | 12,600  | 612,360.00 | 0.14 |
| 195 | 002736 | 国信证券   | 70,300  | 610,907.00 | 0.14 |
| 196 | 601066 | 中信建投   | 31,700  | 609,908.00 | 0.14 |
| 197 | 000895 | 双汇发展   | 25,481  | 605,683.37 | 0.13 |
| 198 | 600015 | 华夏银行   | 94,442  | 604,428.80 | 0.13 |
| 199 | 002271 | 东方雨虹   | 48,700  | 600,958.00 | 0.13 |
| 200 | 600745 | 闻泰科技   | 21,200  | 598,900.00 | 0.13 |
| 201 | 601689 | 拓普集团   | 11,100  | 595,071.00 | 0.13 |
| 202 | 600741 | 华域汽车   | 36,312  | 594,790.56 | 0.13 |
| 203 | 603392 | 万泰生物   | 9,002   | 593,051.76 | 0.13 |
| 204 | 600183 | 生益科技   | 28,000  | 589,680.00 | 0.13 |
| 205 | 601100 | 恒立液压   | 12,612  | 587,466.96 | 0.13 |
| 206 | 601336 | 新华保险   | 19,488  | 585,224.64 | 0.13 |
| 207 | 001965 | 招商公路   | 48,400  | 574,024.00 | 0.13 |
| 208 | 000963 | 华东医药   | 20,539  | 571,189.59 | 0.13 |
| 209 | 600362 | 江西铜业   | 23,675  | 560,624.00 | 0.12 |
| 210 | 600027 | 华电国际   | 80,400  | 557,976.00 | 0.12 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 211 | 300896 | 爱美客  | 3,240   | 557,604.00 | 0.12 |
| 212 | 002920 | 德赛西威 | 6,400   | 557,376.00 | 0.12 |
| 213 | 601881 | 中国银河 | 50,200  | 545,172.00 | 0.12 |
| 214 | 601699 | 潞安环能 | 30,000  | 543,900.00 | 0.12 |
| 215 | 002459 | 晶澳科技 | 47,312  | 529,894.40 | 0.12 |
| 216 | 300033 | 同花顺  | 5,100   | 528,870.00 | 0.12 |
| 217 | 688126 | 沪硅产业 | 38,097  | 526,119.57 | 0.12 |
| 218 | 601898 | 中煤能源 | 42,100  | 525,408.00 | 0.12 |
| 219 | 000999 | 华润三九 | 12,000  | 510,960.00 | 0.11 |
| 220 | 601618 | 中国中冶 | 164,360 | 509,516.00 | 0.11 |
| 221 | 600332 | 白云山  | 17,300  | 507,409.00 | 0.11 |
| 222 | 300832 | 新产业  | 7,500   | 505,800.00 | 0.11 |
| 223 | 600026 | 中远海能 | 32,400  | 505,764.00 | 0.11 |
| 224 | 601998 | 中信银行 | 74,624  | 499,980.80 | 0.11 |
| 225 | 688396 | 华润微  | 13,300  | 497,952.00 | 0.11 |
| 226 | 600039 | 四川路桥 | 63,080  | 497,701.20 | 0.11 |
| 227 | 600515 | 海南机场 | 158,000 | 496,120.00 | 0.11 |
| 228 | 002916 | 深南电路 | 4,680   | 495,003.60 | 0.11 |
| 229 | 002709 | 天赐材料 | 28,000  | 491,680.00 | 0.11 |
| 230 | 601607 | 上海医药 | 25,600  | 489,216.00 | 0.11 |
| 231 | 000301 | 东方盛虹 | 61,100  | 486,967.00 | 0.11 |
| 232 | 600415 | 小商品城 | 64,600  | 479,332.00 | 0.11 |
| 233 | 000876 | 新希望  | 52,180  | 476,925.20 | 0.11 |
| 234 | 000408 | 藏格矿业 | 19,800  | 476,586.00 | 0.11 |
| 235 | 601878 | 浙商证券 | 44,400  | 475,968.00 | 0.11 |
| 236 | 600875 | 东方电气 | 25,600  | 472,320.00 | 0.11 |
| 237 | 300316 | 晶盛机电 | 16,400  | 471,172.00 | 0.10 |
| 238 | 600588 | 用友网络 | 47,109  | 471,090.00 | 0.10 |
| 239 | 601877 | 正泰电器 | 24,600  | 468,876.00 | 0.10 |
| 240 | 002555 | 三七互娱 | 35,700  | 465,885.00 | 0.10 |
| 241 | 002812 | 恩捷股份 | 14,700  | 465,255.00 | 0.10 |
| 242 | 300450 | 先导智能 | 27,500  | 457,325.00 | 0.10 |
| 243 | 002074 | 国轩高科 | 23,800  | 455,770.00 | 0.10 |
| 244 | 600803 | 新奥股份 | 21,700  | 451,360.00 | 0.10 |
| 245 | 605117 | 德业股份 | 6,024   | 447,824.16 | 0.10 |
| 246 | 688599 | 天合光能 | 26,400  | 446,688.00 | 0.10 |
| 247 | 600025 | 华能水电 | 41,400  | 446,292.00 | 0.10 |
| 248 | 300628 | 亿联网络 | 11,980  | 440,504.60 | 0.10 |
| 249 | 300223 | 北京君正 | 7,900   | 437,976.00 | 0.10 |
| 250 | 002007 | 华兰生物 | 27,506  | 434,319.74 | 0.10 |
| 251 | 600460 | 士兰微  | 24,200  | 423,742.00 | 0.09 |
| 252 | 300496 | 中科创达 | 9,200   | 419,428.00 | 0.09 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 253 | 300751 | 迈为股份 | 3,500  | 418,180.00 | 0.09 |
| 254 | 601238 | 广汽集团 | 53,900 | 417,186.00 | 0.09 |
| 255 | 603260 | 合盛硅业 | 8,900  | 415,719.00 | 0.09 |
| 256 | 300142 | 沃森生物 | 36,500 | 415,370.00 | 0.09 |
| 257 | 000733 | 振华科技 | 9,800  | 406,994.00 | 0.09 |
| 258 | 601799 | 星宇股份 | 3,600  | 403,344.00 | 0.09 |
| 259 | 600918 | 中泰证券 | 69,600 | 394,632.00 | 0.09 |
| 260 | 002821 | 凯莱英  | 5,980  | 393,484.00 | 0.09 |
| 261 | 601865 | 福莱特  | 19,100 | 383,910.00 | 0.09 |
| 262 | 601319 | 中国人保 | 74,300 | 382,645.00 | 0.09 |
| 263 | 603659 | 璞泰来  | 26,865 | 379,602.45 | 0.08 |
| 264 | 300759 | 康龙化成 | 20,400 | 379,032.00 | 0.08 |
| 265 | 301269 | 华大九天 | 4,900  | 377,545.00 | 0.08 |
| 266 | 600018 | 上港集团 | 65,100 | 376,278.00 | 0.08 |
| 267 | 688009 | 中国通号 | 62,500 | 375,000.00 | 0.08 |
| 268 | 603195 | 公牛集团 | 4,833  | 372,720.96 | 0.08 |
| 269 | 300999 | 金龙鱼  | 13,600 | 371,960.00 | 0.08 |
| 270 | 603806 | 福斯特  | 25,056 | 368,323.20 | 0.08 |
| 271 | 300413 | 芒果超媒 | 17,450 | 364,705.00 | 0.08 |
| 272 | 601059 | 信达证券 | 24,500 | 348,145.00 | 0.08 |
| 273 | 300919 | 中伟股份 | 11,200 | 347,088.00 | 0.08 |
| 274 | 600061 | 国投资本 | 60,744 | 343,203.60 | 0.08 |
| 275 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,600  | 339,920.00 | 0.08 |
| 276 | 688303 | 大全能源 | 16,200 | 330,318.00 | 0.07 |
| 277 | 000617 | 中油资本 | 59,700 | 329,544.00 | 0.07 |
| 278 | 002603 | 以岭药业 | 21,000 | 321,930.00 | 0.07 |
| 279 | 688187 | 时代电气 | 6,500  | 320,970.00 | 0.07 |
| 280 | 300454 | 深信服  | 6,300  | 318,339.00 | 0.07 |
| 281 | 000708 | 中信特钢 | 23,300 | 316,181.00 | 0.07 |
| 282 | 300442 | 润泽科技 | 12,400 | 296,980.00 | 0.07 |
| 283 | 002410 | 广联达  | 30,940 | 296,405.20 | 0.07 |
| 284 | 002841 | 视源股份 | 9,500  | 280,535.00 | 0.06 |
| 285 | 688363 | 华熙生物 | 4,900  | 277,193.00 | 0.06 |
| 286 | 603899 | 晨光股份 | 8,400  | 262,752.00 | 0.06 |
| 287 | 600732 | 爱旭股份 | 27,800 | 251,590.00 | 0.06 |
| 288 | 601808 | 中海油服 | 14,100 | 242,520.00 | 0.05 |
| 289 | 300979 | 华利集团 | 3,800  | 231,230.00 | 0.05 |
| 290 | 601236 | 红塔证券 | 35,800 | 229,836.00 | 0.05 |
| 291 | 601698 | 中国卫通 | 16,000 | 225,440.00 | 0.05 |
| 292 | 603833 | 欧派家居 | 4,031  | 215,900.36 | 0.05 |
| 293 | 300957 | 贝泰妮  | 4,300  | 207,776.00 | 0.05 |
| 294 | 688082 | 盛美上海 | 2,200  | 185,922.00 | 0.04 |
| 295 | 000800 | 一汽解放 | 23,500 | 184,005.00 | 0.04 |

|     |        |      |       |            |      |
|-----|--------|------|-------|------------|------|
| 296 | 603296 | 华勤技术 | 2,300 | 127,029.00 | 0.03 |
| 297 | 001289 | 龙源电力 | 3,800 | 65,550.00  | 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<br>(股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|----------|------------------|
| 1  | 603082 | 北自科技 | 107       | 3,155.43 | 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  | 600900 | 长江电力 | 2,328,251.00 | 0.54            |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 2,280,423.00 | 0.53            |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 1,408,514.00 | 0.33            |
| 4  | 600219 | 南山铝业 | 1,373,559.00 | 0.32            |
| 5  | 000807 | 云铝股份 | 1,334,031.00 | 0.31            |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 1,049,375.00 | 0.24            |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 948,933.00   | 0.22            |
| 8  | 601998 | 中信银行 | 840,829.00   | 0.20            |
| 9  | 601328 | 交通银行 | 785,298.00   | 0.18            |
| 10 | 600161 | 天坛生物 | 779,839.00   | 0.18            |
| 11 | 601899 | 紫金矿业 | 755,435.00   | 0.18            |
| 12 | 300418 | 昆仑万维 | 744,295.00   | 0.17            |
| 13 | 603259 | 药明康德 | 729,894.00   | 0.17            |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 728,277.00   | 0.17            |
| 15 | 000858 | 五粮液  | 664,410.00   | 0.15            |
| 16 | 002371 | 北方华创 | 606,540.00   | 0.14            |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 604,016.00   | 0.14            |
| 18 | 600027 | 华电国际 | 603,243.00   | 0.14            |
| 19 | 001965 | 招商公路 | 589,272.00   | 0.14            |
| 20 | 601939 | 建设银行 | 579,668.00   | 0.14            |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 1,394,036.00 | 0.32            |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 1,177,782.00 | 0.27            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 3  | 601328 | 交通银行 | 956,584.00 | 0.22 |
| 4  | 600919 | 江苏银行 | 883,915.00 | 0.21 |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 843,223.00 | 0.20 |
| 6  | 601899 | 紫金矿业 | 837,100.00 | 0.20 |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 783,428.00 | 0.18 |
| 8  | 601998 | 中信银行 | 756,538.00 | 0.18 |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 724,019.00 | 0.17 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 608,832.00 | 0.14 |
| 11 | 603993 | 洛阳钼业 | 569,653.00 | 0.13 |
| 12 | 300124 | 汇川技术 | 560,238.00 | 0.13 |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 541,376.00 | 0.13 |
| 14 | 002202 | 金风科技 | 535,439.64 | 0.12 |
| 15 | 601939 | 建设银行 | 516,321.00 | 0.12 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 512,919.00 | 0.12 |
| 17 | 000858 | 五粮液  | 503,919.00 | 0.12 |
| 18 | 601615 | 明阳智能 | 498,770.00 | 0.12 |
| 19 | 600219 | 南山铝业 | 493,748.00 | 0.12 |
| 20 | 603799 | 华友钴业 | 483,139.00 | 0.11 |

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 | 56,745,210.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 40,903,390.59 |

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      | 9,601,941.51 | 2.14         |
| 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        | 9,601,941.51 | 2.14         |

## 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<br>(张) | 公允价值         | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 019733 | 24 国债 02 | 95,000    | 9,601,941.51 | 2.14             |

## 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。

## 7.12 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

2023 年 11 月 27 日，招商银行股份有限公司因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为；违反规定办理结汇、售汇业务行为；违反规定办理资本项目资金收付行为，被国家外汇管理局深圳市分局没收违法所得人民币 89.03 万元，罚款人民币 475 万元。

2023 年 12 月 13 日，招商银行股份有限公司因未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足，被国家金融监督管理总局深圳监管局处以罚款 160 万。

2024 年 6 月 24 日，招商银行股份有限公司因招商银行理财业务存在以下违法违规行为：一、未能有效穿透识别底层资产；二、信息披露不规范，被国家金融监督管理总局罚款 350 万元。

2023 年 8 月 8 日，交通银行股份有限公司因贷后管理不到位严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会商丘监管分局处以罚款 25 万元。



2024 年 6 月 3 日，交通银行股份有限公司因安全测试存在薄弱环节、运行管理存在漏洞、数据安全管理工作不足、灾备管理不足，被国家金融监督管理总局罚款 160 万元。

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 6,228.63   |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 210,456.02 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 216,684.65 |

### 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  | 603082 | 北自科技 | 3,155.43    | 0.00          | 主板锁定     |

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别          | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |            |                |            |
|---------------|-----------|-----------|--------------|------------|----------------|------------|
|               |           |           | 机构投资者        |            | 个人投资者          |            |
|               |           |           | 持有份额         | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 农银沪深 300 指数 A | 34,005    | 9,657.14  | 4,125,205.76 | 1.26       | 324,265,679.40 | 98.74      |
| 农银沪深 300 指数 C | 323       | 37,792.39 | 0.00         | 0.00       | 12,206,942.49  | 100.00     |
| 合计            | 34,328    | 9,921.87  | 4,125,205.76 | 1.21       | 336,472,621.89 | 98.79      |

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 | 农银沪深 300 指数 A | 55,061.25  | 0.0168       |
|                  | 农银沪深 300 指数 C | 0.00       | 0.0000       |
|                  | 合计            | 55,061.25  | 0.0162       |

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别          | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|---------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 农银沪深 300 指数 A | 0                  |
|                                | 农银沪深 300 指数 C | 0                  |
|                                | 合计            | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 农银沪深 300 指数 A | 0~10               |
|                                | 农银沪深 300 指数 C | 0                  |
|                                | 合计            | 0~10               |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 农银沪深 300 指数 A | 农银沪深 300 指数 C |
|----|---------------|---------------|
|----|---------------|---------------|

|  |                  |               |
|--|------------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2011 年 4 月 12<br>日) 基金份额总额 | 3,297,550,055.44 | -             |
| 本报告期期初基金<br>份额总额                       | 322,265,303.63   | 7,766,760.32  |
| 本报告期基金总申<br>购份额                        | 34,835,055.50    | 93,996,077.84 |
| 减: 本报告期基金<br>总赎回份额                     | 28,709,473.97    | 89,555,895.67 |
| 本报告期基金拆分<br>变动份额                       | -                | -             |
| 本报告期期末基金<br>份额总额                       | 328,390,885.16   | 12,206,942.49 |

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”)第五届董事会第十五次会议决议, 高国鹏先生自 2024 年 6 月 27 日离任本公司副总经理职务。

本公司已于 2024 年 6 月 29 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

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1 | 内容 |
|------|----|
|------|----|

|                       |                                   |
|-----------------------|-----------------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 管理人及高级管理人员                        |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024 年 2 月 2 日                    |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会上海监管局                  |
| 受到的具体措施类型             | 行政监管措施。<br>公司：责令改正；高级管理人员：警示函。    |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 内部控制不健全，违反《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已按照法律法规及监管要求及时完成整改工作。           |
| 其他                    | 无                                 |

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 申万宏源证券 | 2      | 96,292,648.87 | 98.63            | 84,762.54 | 98.53          | -  |
| 中金公司   | 2      | 1,333,183.00  | 1.37             | 1,261.10  | 1.47           | -  |

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 |

|        |              |        |               |        |   | (%) |
|--------|--------------|--------|---------------|--------|---|-----|
| 申万宏源证券 | 9,522,600.00 | 100.00 | 48,800,000.00 | 100.00 | - | -   |
| 中金公司   | -            | -      | -             | -      | - | -   |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                    | 法定披露方式        | 法定披露日期          |
|----|---|---------------|-----------------|
| 1  | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告      | 上海证券报、基金管理人网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 2  | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2023 年年度报告          | 上海证券报、基金管理人网站 | 2024 年 3 月 28 日 |
| 3  | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告      | 上海证券报、基金管理人网站 | 2024 年 4 月 18 日 |
| 4  | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金-招募说明书更新-2024 年第 1 次 | 上海证券报、基金管理人网站 | 2024 年 6 月 28 日 |
| 5  | 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要更新           | 上海证券报、基金管理人网站 | 2024 年 6 月 28 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、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 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

2024 年 8 月 29 日