

农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 3 月 26 日（基金合同生效）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17

6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金
基金简称	农银量化智慧混合
基金主代码	005638
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 26 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	503,896,476.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用量化投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用量化方法进行投资，通过数量化选股模型进行个股选择。在投资过程中，本基金将结合风险模型及优化，构建股票投资组合，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争获取长期稳定的超额收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	王永民
	联系电话	021-61095588	010-66594896
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		021-61095599	95566
传真		021-61095556	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区复兴门内大街 1

	区银城路 9 号 50 层	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 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	于进	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 3 月 26 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,473,747.53
本期利润	-22,782,426.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0371
本期加权平均净值利润率	-3.73%
本期基金份额净值增长率	-4.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-22,733,061.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0451
期末基金资产净值	481,163,414.45
期末基金份额净值	0.9549
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.51%

注： 1、本基金的基金合同于 2018 年 3 月 26 日生效，至 2018 年 6 月 30 日不满半年。

2、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。

3、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。

4、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

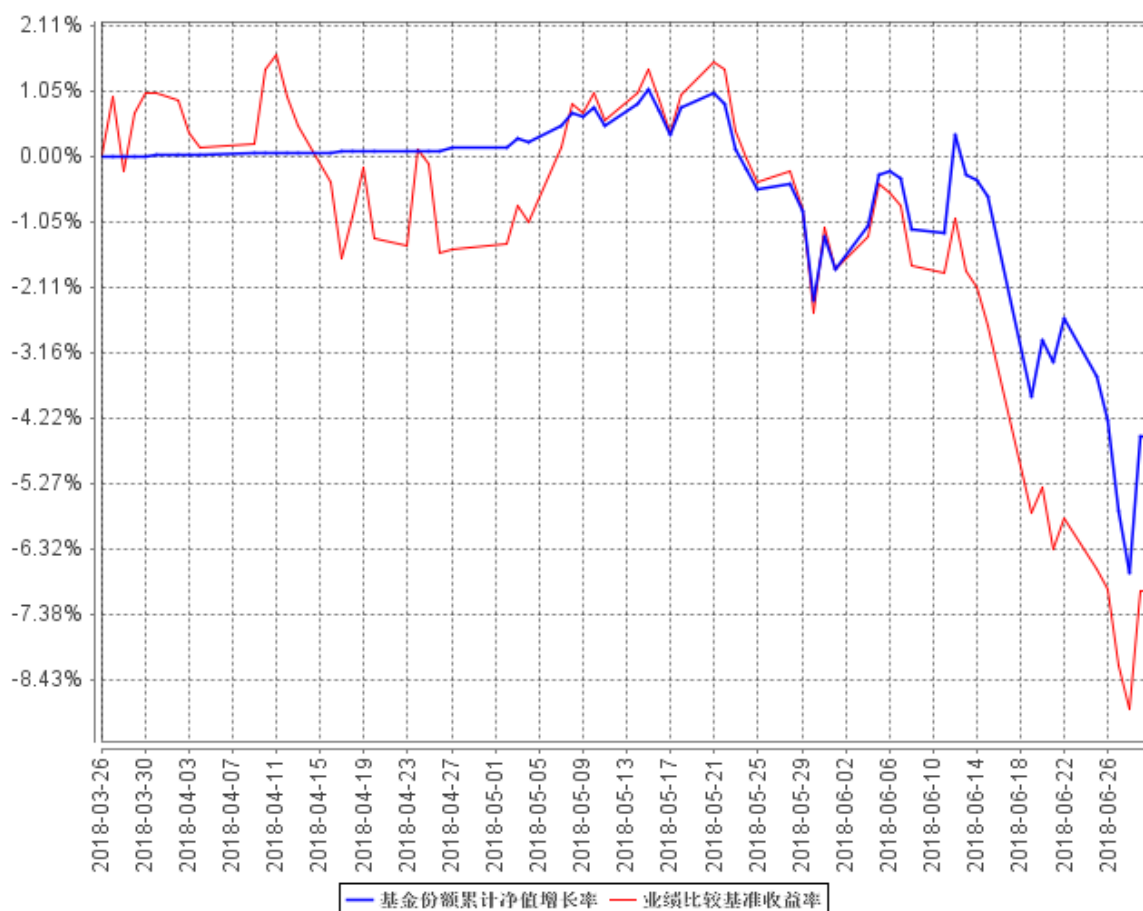
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.26%	1.16%	-5.94%	1.04%	2.68%	0.12%

过去三个月	-4.52%	0.73%	-7.95%	0.87%	3.43%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-4.51%	0.70%	-7.00%	0.86%	2.49%	-0.16%

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

基金份额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



本基金合同生效日为 2018 年 3 月 26 日，至 2018 年 6 月 30 日不满一年。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金建仓期为基金合同生效日起六个月，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。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2018 年 6 月 30 日，公司共管理 45 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、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财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 14 天理财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、农银汇理物联网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、农银汇理金利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、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、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、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇

理金鸿一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理永益定期开放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。

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		
魏刚	本基金基金经理	2018 年 3 月 26 日	—	11	硕士研究生。历任华泰证券股份有限公司金融工程研究员、华泰证券股份有限公司投资经理、嘉合基金管理有限公司投资经理、东证融汇证券资产管理有限公司投资主办人，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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。

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

2018 年上半年沪深 A 股市场整体处于下跌趋势。受地产政策放松预期、经济增长提速预期等的影响，1 月份市场在地产、银行等行业的带领下快速拉升，进入 2 月后市场快速回调，抹掉 1 月的涨幅；3、4 月份由于受到中兴通信被制裁、资管新规出台严监管预期等的影响，投资者风险偏好下降，市场出现了小幅下跌。4 月中下旬央行进行了降准、资管新规也在月底落地，市场信心有所企稳；同时伴随着年报、一季报的逐步披露完毕，在市场整体风险偏好不是很高的情况下，投资者追捧一季报业绩较好的消费板块，食品饮料等行业录得较大涨幅，带动市场 5 月小幅上涨。但由于 5 月的金融数据较差，市场开始担心经济下行，6 月初贸易战继续升温，带动市场下跌；随着市场下跌，股权质押风险逐步暴露、扩散，同时伴随人民币贬值幅度较大，投资者信心急剧下降，市场大幅下跌。上半年在市场整体处于下跌趋势的情形下，投资者追逐安全性、确定性，避险需求较高，价值因子、盈利因子、大市值因子等表现较好。

2018 年上半年仓位一直不高，前期组合仓位较低，5 月逐步进行了加仓，提升了仓位，6 月仓位整体稳定。上半年选股模型中价值因子、盈利因子的权重较高，行业配置方面银行、非银、食品饮料、医药生物、家电等行业配置相对较高，组合取得了一定的相对收益。

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 0.9549 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.51%，业绩比较基准收益率为-7.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，我们认为下半年宏观经济将处于缓慢下行的态势，同时结合房地产相关

监管政策的影响，对部分周期股的表现可能会形成一定压制。目前央行的货币政策口风出现了一定的调整，我们认为下半年流动性可能会边际改善。同时，我们认为贸易战的影响短期难以消除，这将对市场风险偏好产生影响。整体上看，我们认为下半年市场不会像上半年那样大幅下挫，随着市场的大幅下挫，市场风险得到了部分释放，部分股票估值大幅下降，将存在结构性机会，其中我们认为科技成长股将获得相对表现。仓位方面，下半年我们将保持中性的仓位；配置方面，逐步降低周期类板块的配置，逐步增加电子、计算机等成长板块的配置。在选股模型中，小幅调高成长因子的权重。

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及适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。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

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

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合规守信情况声明

本报告期，本基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	65,726,198.28	-
结算备付金		8,521,169.34	-
存出保证金		202,767.59	-
交易性金融资产	6.4.7.2	364,973,940.10	-
其中：股票投资		357,200,427.50	-
基金投资		-	-
债券投资		7,773,512.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	48,000,000.00	-
应收证券清算款		757,642.31	-
应收利息	6.4.7.5	60,338.11	-
应收股利		-	-
应收申购款		32,551.17	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		488,274,606.90	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,763,565.48	-
应付赎回款		2,720,758.97	-
应付管理人报酬		625,236.26	-
应付托管费		104,206.06	-

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	742,164.48	-
应交税费		34.10	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	155,227.10	-
负债合计		7,111,192.45	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	503,896,476.13	-
未分配利润	6.4.7.10	-22,733,061.68	-
所有者权益合计		481,163,414.45	-
负债和所有者权益总计		488,274,606.90	-

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9549 元，基金份额总额 503,896,476.13 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 3 月 26 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-18,798,717.74	-
1.利息收入		2,426,931.51	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,868,437.45	-
债券利息收入		5,671.75	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		552,822.31	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,834,087.64	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,484,299.41	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,650,211.77	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	-14,308,679.15	-

号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	917,117.54	-
减：二、费用		3,983,708.94	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,407,997.23	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	401,332.89	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,020,039.96	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.65	-
7. 其他费用	6.4.7.20	154,335.21	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-22,782,426.68	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-22,782,426.68	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	745,714,692.96	-	745,714,692.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,782,426.68	-22,782,426.68
三、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)	-241,818,216.83	49,365.00	-241,768,851.83
其中：1.基金申购款	4,329,577.03	-23,564.18	4,306,012.85

2. 基金赎回款	-246,147,793.86	72,929.18	-246,074,864.68
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	503,896,476.13	-22,733,061.68	481,163,414.45
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.4 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 许金超	_____ 刘志勇	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]152 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 745,714,692.96 份,经普华永道中天会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为普华永道中天验字(2018)第 215 号验资报告。《农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2018 年 3 月 26 日正式生效。本基金的管理人为农银汇理基金管理有限公司,托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、最新适用的基金合同及《农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、债券(国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、定期存款、协议存款、同业存单、权证、股指期货等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%,其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准采用:中证 800 指数收益率 $\times$ 75%+中证全债指数收益率 $\times$ 25%。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇

理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年上半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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 3 月 26 日至 2018 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

6.4.4.5 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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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。当本基金依法 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 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或者发行价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后的净额确认为利息收入。

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确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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。

6.4.4.10 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。

其他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。

6.4.4.11 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所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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：

对于证券交易所上市的股票，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[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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费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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	65,726,198.28
定期存款	-
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	-
合计：	65,726,198.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	371,527,348.85	357,200,427.50	-14,326,921.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,773,512.60	18,242.20
	银行间市场	-	-
	合计	7,773,512.60	18,242.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	379,282,619.25	364,973,940.10	-14,308,679.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	48,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	48,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,870.09
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,451.05
应收债券利息	58,079.64
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-12,144.84
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	82.17
合计	60,338.11

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

交易所市场应付交易费用	742,164.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	742,164.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,794.79
预提费用	148,432.31
合计	155,227.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	745,714,692.96	745,714,692.96
本期申购	4,329,577.03	4,329,577.03
本期赎回(以“-”号填列)	-246,147,793.86	-246,147,793.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	503,896,476.13	503,896,476.13

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2018 年 2 月 23 日至 2018 年 3 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 745,299,083.53 元。根据《农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 415,609.43 元，在本基金成立后，折算为 415,609.43 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2018 年 3 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 4 月 25 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2018 年 4 月 26 日起开始办理。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,473,747.53	-14,308,679.15	-22,782,426.68
本期基金份额交易产生的变动数	41,249.67	8,115.33	49,365.00
其中：基金申购款	-7,966.23	-15,597.95	-23,564.18
基金赎回款	49,215.90	23,713.28	72,929.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,432,497.86	-14,300,563.82	-22,733,061.68

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	491,877.41
定期存款利息收入	1,362,666.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,656.09
其他	237.28
合计	1,868,437.45

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	207,065,847.88
减：卖出股票成本总额	218,550,147.29
买卖股票差价收入	-11,484,299.41

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,650,211.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,650,211.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,308,679.15
——股票投资	-14,326,921.35
——债券投资	18,242.20
——资产支持证券投资	-
——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	-14,308,679.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	903,128.19
转换费	13,989.35
合计	917,117.54

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，赎回费总额归入基金资产的比例随着持有期限而变化。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成, 其中赎回费部分归入基金资产的比例随着持有期限而变化。

6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,020,039.96
银行间市场交易费用	-
合计	1,020,039.96

6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	24,163.67
信息披露费	124,268.64
银行汇划费	5,902.90
合计	154,335.21

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

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要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、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.10.1 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

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

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 2018 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,407,997.23	—
其中：支付销售机构的客户维护费	1,322,829.74	—

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月26日(基金合同生效 日)至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	401,332.89	-

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2018年3月26日(基金合同生效日) 至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国银行	65,726,198.28	491,877.41	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2018 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	可流通日	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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018 年 5 月 7 日	公告重大事件	7.47	2018 年 8 月 20 日	7.25	39,700	295,963.00	296,559.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

6.4.13 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、二道防线”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。公司建立了管理和控制各类单项风险的二道防线机制，明确了相应防线的责任主体和职责。督察长及其指导下的监察稽核部对公司的风险管理进行监督检查。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	—
AAA 以下	2,755,516.40	—
未评级	5,017,996.20	—
合计	7,773,512.60	—

注：未评级的债券投资包括国债、央行票据和政策性银行金融债

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,726,198.28	-	-	-	65,726,198.28
结算备付金	8,521,169.34	-	-	-	8,521,169.34
存出保证金	202,767.59	-	-	-	202,767.59
交易性金融资产	7,773,512.60	-	-	357,200,427.50	364,973,940.10
买入返售金融资产	48,000,000.00	-	-	-	48,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	757,642.31	757,642.31
应收利息	-	-	-	60,338.11	60,338.11
应收申购款	-	-	-	32,551.17	32,551.17
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	130,223,647.81	-	-	358,050,959.09	488,274,606.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,763,565.48	2,763,565.48
应付赎回款	-	-	-	2,720,758.97	2,720,758.97
应付管理人报酬	-	-	-	625,236.26	625,236.26
应付托管费	-	-	-	104,206.06	104,206.06
应付交易费用	-	-	-	742,164.48	742,164.48
应交税费	-	-	-	34.10	34.10
其他负债	-	-	-	155,227.10	155,227.10
负债总计	-	-	-	7,111,192.45	7,111,192.45
利率敏感度缺口	130,223,647.81	-	-	350,939,766.64	481,163,414.45
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-33,720.22	-
	市场利率平行下降 25 个基点	33,720.22	

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	357,200,427.50	74.24	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,773,512.60	1.62	-	-
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	364,973,940.10	75.85	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至本报告期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期末其他价格风险敏感性分析。

§ 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	357,200,427.50	73.16
	其中：股票	357,200,427.50	73.16
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	7,773,512.60	1.59
	其中：债券	7,773,512.60	1.59
	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	48,000,000.00	9.83
	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	74,247,367.62	15.21
8	其他各项资产	1,053,299.18	0.22
9	合计	488,274,606.90	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	12,215,284.08	2.54
C	制造业	201,619,679.14	41.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供	19,067,413.24	3.96

	应业		
E	建筑业	5,050,944.12	1.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,177,267.74	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,071,582.90	1.68
J	金融业	67,673,142.00	14.06
K	房地产业	7,741,230.25	1.61
L	租赁和商务服务业	5,802,865.20	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,477,956.00	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,777,681.23	1.41
R	文化、体育和娱乐业	5,525,381.60	1.15
S	综合	-	-
	合计	357,200,427.50	74.24

7.2.2 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	273,600	16,027,488.00	3.33
2	601398	工商银行	2,069,500	11,009,740.00	2.29
3	600519	贵州茅台	13,400	9,801,564.00	2.04
4	601939	建设银行	1,317,500	8,629,625.00	1.79
5	000333	美的集团	163,263	8,525,593.86	1.77
6	000651	格力电器	177,600	8,373,840.00	1.74
7	600036	招商银行	287,000	7,588,280.00	1.58
8	000858	五粮液	90,400	6,870,400.00	1.43
9	600030	中信证券	410,000	6,793,700.00	1.41

10	600104	上汽集团	180,594	6,318,984.06	1.31
11	600031	三一重工	680,600	6,104,982.00	1.27
12	600585	海螺水泥	178,600	5,979,528.00	1.24
13	000636	风华高科	372,836	5,920,635.68	1.23
14	002027	分众传媒	606,360	5,802,865.20	1.21
15	000338	潍柴动力	648,000	5,670,000.00	1.18
16	600028	中国石化	871,700	5,657,333.00	1.18
17	601006	大秦铁路	675,900	5,549,139.00	1.15
18	603568	伟明环保	216,520	5,477,956.00	1.14
19	601088	中国神华	274,556	5,474,646.64	1.14
20	000418	小天鹅 A	78,200	5,423,170.00	1.13
21	300347	泰格医药	83,729	5,180,313.23	1.08
22	000425	徐工机械	1,220,300	5,174,072.00	1.08
23	600741	华域汽车	217,900	5,168,588.00	1.07
24	600737	中粮糖业	683,745	5,155,437.30	1.07
25	002304	洋河股份	39,021	5,135,163.60	1.07
26	600516	方大炭素	206,100	5,024,718.00	1.04
27	000768	中航飞机	316,700	4,953,188.00	1.03
28	300113	顺网科技	283,900	4,942,699.00	1.03
29	002019	亿帆医药	280,003	4,942,052.95	1.03
30	300251	光线传媒	480,300	4,889,454.00	1.02
31	600081	东风科技	478,625	4,834,112.50	1.00
32	002078	太阳纸业	494,205	4,788,846.45	1.00
33	002061	浙江交科	454,096	4,754,385.12	0.99
34	600236	桂冠电力	828,348	4,729,867.08	0.98
35	600566	济川药业	98,100	4,727,439.00	0.98
36	601100	恒立液压	224,140	4,680,043.20	0.97
37	601628	中国人寿	207,000	4,661,640.00	0.97
38	600323	瀚蓝环境	305,630	4,651,688.60	0.97
39	600995	文山电力	615,860	4,625,108.60	0.96
40	002626	金达威	265,400	4,604,690.00	0.96
41	600029	南方航空	537,200	4,539,340.00	0.94
42	600390	五矿资本	581,400	4,505,850.00	0.94
43	603288	海天味业	61,100	4,499,404.00	0.94
44	601328	交通银行	783,600	4,497,864.00	0.93
45	600308	华泰股份	886,971	4,417,115.58	0.92
46	600160	巨化股份	599,960	4,391,707.20	0.91

47	600567	山鹰纸业	1, 117, 121	4, 312, 087. 06	0. 90
48	600340	华夏幸福	156, 907	4, 040, 355. 25	0. 84
49	000725	京东方 A	1, 139, 500	4, 033, 830. 00	0. 84
50	300073	当升科技	118, 100	4, 022, 486. 00	0. 84
51	600276	恒瑞医药	52, 260	3, 959, 217. 60	0. 82
52	601601	中国太保	124, 300	3, 958, 955. 00	0. 82
53	002449	国星光电	366, 576	3, 900, 368. 64	0. 81
54	600681	百川能源	292, 601	3, 792, 108. 96	0. 79
55	000717	韶钢松山	567, 900	3, 725, 424. 00	0. 77
56	000002	万科 A	150, 380	3, 699, 348. 00	0. 77
57	600809	山西汾酒	56, 929	3, 580, 264. 81	0. 74
58	600884	杉杉股份	119, 400	2, 638, 740. 00	0. 55
59	600563	法拉电子	52, 700	2, 608, 123. 00	0. 54
60	600801	华新水泥	172, 900	2, 598, 687. 00	0. 54
61	600760	中航沈飞	71, 700	2, 584, 068. 00	0. 54
62	300373	扬杰科技	89, 300	2, 553, 980. 00	0. 53
63	600967	内蒙一机	199, 700	2, 544, 178. 00	0. 53
64	601908	京运通	551, 200	2, 524, 496. 00	0. 52
65	600038	中直股份	62, 600	2, 503, 374. 00	0. 52
66	300014	亿纬锂能	138, 500	2, 437, 600. 00	0. 51
67	002410	广联达	86, 100	2, 387, 553. 00	0. 50
68	002236	大华股份	105, 400	2, 376, 770. 00	0. 49
69	600887	伊利股份	77, 500	2, 162, 250. 00	0. 45
70	600690	青岛海尔	109, 188	2, 102, 960. 88	0. 44
71	600115	东方航空	315, 527	2, 088, 788. 74	0. 43
72	002044	美年健康	70, 680	1, 597, 368. 00	0. 33
73	002460	赣锋锂业	35, 150	1, 356, 087. 00	0. 28
74	600900	长江电力	75, 600	1, 220, 184. 00	0. 25
75	600508	上海能源	101, 433	1, 083, 304. 44	0. 23
76	600845	宝信软件	28, 134	741, 330. 90	0. 15
77	002343	慈文传媒	33, 880	635, 927. 60	0. 13
78	603866	桃李面包	10, 100	577, 114. 00	0. 12
79	000568	泸州老窖	6, 000	365, 160. 00	0. 08
80	600380	健康元	27, 000	320, 220. 00	0. 07
81	601390	中国中铁	39, 700	296, 559. 00	0. 06
82	300747	锐科激光	1, 543	123, 995. 48	0. 03
83	603587	地素时尚	2, 442	100, 879. 02	0. 02

84	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
85	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
86	300750	宁德时代	500	35,980.00	0.01
87	601138	工业富联	1,000	18,440.00	0.00
88	600436	片仔癀	100	11,193.00	0.00
89	002415	海康威视	87	3,230.31	0.00
90	000581	威孚高科	100	2,211.00	0.00
91	002146	荣盛发展	100	873.00	0.00
92	600606	绿地控股	100	654.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	16,960,750.00	3.52
2	601398	工商银行	12,394,018.00	2.58
3	601939	建设银行	9,855,950.74	2.05
4	600519	贵州茅台	9,561,877.00	1.99
5	000333	美的集团	8,706,160.08	1.81
6	000651	格力电器	8,423,707.00	1.75
7	600036	招商银行	8,402,168.15	1.75
8	300251	光线传媒	8,323,698.00	1.73
9	600104	上汽集团	8,299,665.47	1.72
10	600030	中信证券	8,056,579.00	1.67
11	000768	中航飞机	7,076,061.92	1.47
12	000858	五粮液	6,917,825.35	1.44
13	600585	海螺水泥	6,222,474.97	1.29
14	600236	桂冠电力	6,211,338.32	1.29
15	600028	中国石化	6,082,129.00	1.26
16	002027	分众传媒	5,995,968.46	1.25
17	601006	大秦铁路	5,852,228.00	1.22

18	600031	三一重工	5,813,237.20	1.21
19	601088	中国神华	5,696,415.70	1.18
20	600029	南方航空	5,502,431.00	1.14

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000786	北新建材	4,966,061.68	1.03
2	002001	新和成	4,698,347.10	0.98
3	300176	鸿特科技	4,631,039.00	0.96
4	600216	浙江医药	4,617,600.78	0.96
5	000780	平庄能源	4,585,841.14	0.95
6	000631	顺发恒业	4,551,268.20	0.95
7	600173	卧龙地产	4,435,142.19	0.92
8	300027	华谊兄弟	4,268,450.14	0.89
9	000513	丽珠集团	4,232,932.65	0.88
10	000537	广宇发展	4,196,993.16	0.87
11	002415	海康威视	4,094,668.00	0.85
12	601688	华泰证券	4,073,116.63	0.85
13	000672	上峰水泥	3,993,571.00	0.83
14	600703	三安光电	3,596,738.80	0.75
15	600572	康恩贝	3,524,669.00	0.73
16	000789	万年青	3,322,255.76	0.69
17	300251	光线传媒	3,079,913.80	0.64
18	000603	盛达矿业	3,040,527.52	0.63
19	600011	华能国际	2,878,457.02	0.60
20	600083	博信股份	2,836,933.37	0.59

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	590,077,496.14
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	207,065,847.88
--------------	----------------

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,017,996.20	1.04
	其中：政策性金融债	5,017,996.20	1.04
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）	2,755,516.40	0.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,773,512.60	1.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	49,990	5,017,996.20	1.04
2	123001	蓝标转债	31,720	2,755,516.40	0.57

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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

2018 年 2 月 12 日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）受到中国银行保险监

督管理委员会（以下简称“银保监会”）行政处罚（银监罚决字[2018]1号）。处罚书指出：招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等问题，对招商银行给予罚款的行政处罚。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

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	202,767.59
2	应收证券清算款	757,642.31
3	应收股利	-
4	应收利息	60,338.11
5	应收申购款	32,551.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,053,299.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	2,755,516.40	0.57

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
16,831	29,938.59	1,863,336.01	0.37%	502,033,140.12	99.63%

8.2 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	0.00	0.0000%

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的情况

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2018 年 3 月 26 日 ）基金份额总额	745,714,692.96
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,329,577.03
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	246,147,793.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	503,896,476.13

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，基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2018 年 4 月 3 日在指定媒体及公司网站上刊登了《农银汇理基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，刘志勇先生自 2018 年 4 月 3 日起担任农银汇理基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

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

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内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。

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	
国泰君安	2	796,913,268.13	100.00%	742,164.48	100.00%	-

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、上述交易单元均为本报告期内新增交易单元,本报告期内无剔除交易单元。

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
国泰君安	7,767,784.59	100.00%	2,003,000,000.00	100.00%	-	-

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	农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 9 日
2	农银量化智慧动力混合基金-基	中国证券报、上海证	2018 年 2 月 9 日

	金合同	券报、证券时报、证券日报	
3	农银量化智慧动力混合基金-基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 9 日
4	农银量化智慧动力混合基金-托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 9 日
5	农银量化智慧动力混合基金-招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 9 日
6	农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 27 日
7	农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 4 月 24 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

本基金本报告期内不存在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

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会有关决议，本公司注册资本由人民币 200,000,001 元增加至人民币 1,750,000,001 元，增加注册资本后，本公司股东及股东出资比例均保持不变。本公司根据相关法律法规及规范性文件的规定，结合上述增资事项同步修改了公司章程中的有关内容。上述增资事项已按规定向中国证券监督管理委员会及中国证券监督管理委员会上海监管局备案，相应的工商变更手续于 2018 年 6 月 21 日在上海市工商行政管理局办理完毕。

本公司已于 2018 年 6 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述增加注册资本及修改公司章程的公告。

§ 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、《农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理量化智慧动力混合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。

12.2 存放地点

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

2018 年 8 月 27 日