

农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资
基金
2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 农银区间精选混合 |
| 交易代码 | 008078 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 141,055,218.93 份 |
| 投资目标 | 本基金通过调节组合的最大风险资产敞口，从而控制组合风险，实现组合锁定收益的目标。在组合风险敞口确定的前提下，基金管理人利用量化投资模型进行风险资产的配置，力争为投资者提供能获得一定程度超额收益的良好投资工具。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的资产配置策略涉及股票和非股票类资产在投资组合中的配置比例严格按照纪律进行调整，随着参照指数的市盈率（PE）累积到一定阈值之后，本基金将按照纪律逐渐降低股票类资产配置比例，相应增加非股票类资产比例，从而确保基金能够部分锁定收益；在参照指数的市盈率下跌到下一个阈值的下限时，本基金将按照纪律逐渐增加股票资产配置比例，相应减少非股票类资产比例，从而为基金争取更大的潜在收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金的股票组合主要采用多因子模型进行构建，并根据投资限制、风险约束和交易成本的条件进行优化。</p> |

| | <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。</p> <p>4、资产支持类证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货的投资中将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则；（1）避险：在市场风险大幅累积时，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；（2）有效管理：利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|-------------|----------------------|--------------|--|--|--------------------|-----|--|-------------------|--|---------------|----------|-----|--|-------------------|--|---------------|----------|-----|--|-------------------|--|---------------|----------|-----|--|-----------|--|--|---------------------|----|--|
| <p>业绩比较基准</p> | <p>本基金的业绩比较基准为 $I \times \text{中证 500 指数收益率} + (100\% - I) \times \text{中证全债指数收益率}$，其中 I 值在初期设定举例如下：</p> <table border="1" data-bbox="730 1361 1382 1843"> <thead> <tr> <th>参考指数的市盈率 (PE)</th> <th>股票类资产比例 (S)</th> <th>业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$PE \leq 18$</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>$75 \leq S < 95\%$</td> <td>75%</td> <td></td> </tr> <tr> <td>$18 < PE \leq 25$</td> <td></td> <td>$55\% \leq S$</td> </tr> <tr> <td>$< 75\%$</td> <td>55%</td> <td></td> </tr> <tr> <td>$25 < PE \leq 35$</td> <td></td> <td>$40\% \leq S$</td> </tr> <tr> <td>$< 55\%$</td> <td>40%</td> <td></td> </tr> <tr> <td>$35 < PE \leq 45$</td> <td></td> <td>$25\% \leq S$</td> </tr> <tr> <td>$< 40\%$</td> <td>25%</td> <td></td> </tr> <tr> <td>$PE > 45$</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>$0\% \leq S < 25\%$</td> <td>0%</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | 参考指数的市盈率 (PE) | 股票类资产比例 (S) | 业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I) | $PE \leq 18$ | | | $75 \leq S < 95\%$ | 75% | | $18 < PE \leq 25$ | | $55\% \leq S$ | $< 75\%$ | 55% | | $25 < PE \leq 35$ | | $40\% \leq S$ | $< 55\%$ | 40% | | $35 < PE \leq 45$ | | $25\% \leq S$ | $< 40\%$ | 25% | | $PE > 45$ | | | $0\% \leq S < 25\%$ | 0% | |
| 参考指数的市盈率 (PE) | 股票类资产比例 (S) | 业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $PE \leq 18$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $75 \leq S < 95\%$ | 75% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $18 < PE \leq 25$ | | $55\% \leq S$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $< 75\%$ | 55% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $25 < PE \leq 35$ | | $40\% \leq S$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $< 55\%$ | 40% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $35 < PE \leq 45$ | | $25\% \leq S$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $< 40\%$ | 25% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $PE > 45$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| $0\% \leq S < 25\%$ | 0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金的风险和收益水平随着参考指数市盈率的不断上涨，风险不断下降，从而锁定前期收益。本基金的预期风险和收益在投资初始阶段属于较高水平；随着参考指数市盈率的不断上涨，本基金将逐步降低预期风险与收益水平，转变为中等风险的证券投资基金</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | |
|-------|-------------------------------------|
| | 金；在临近参考指数最高的市盈率以后，本基金将变为低风险的证券投资基金。 |
| 基金管理人 | 农银汇理基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年1月1日—2020年3月31日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 5,767,204.50 |
| 2. 本期利润 | 3,602,563.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0147 |
| 4. 期末基金资产净值 | 136,902,344.32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9706 |

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。

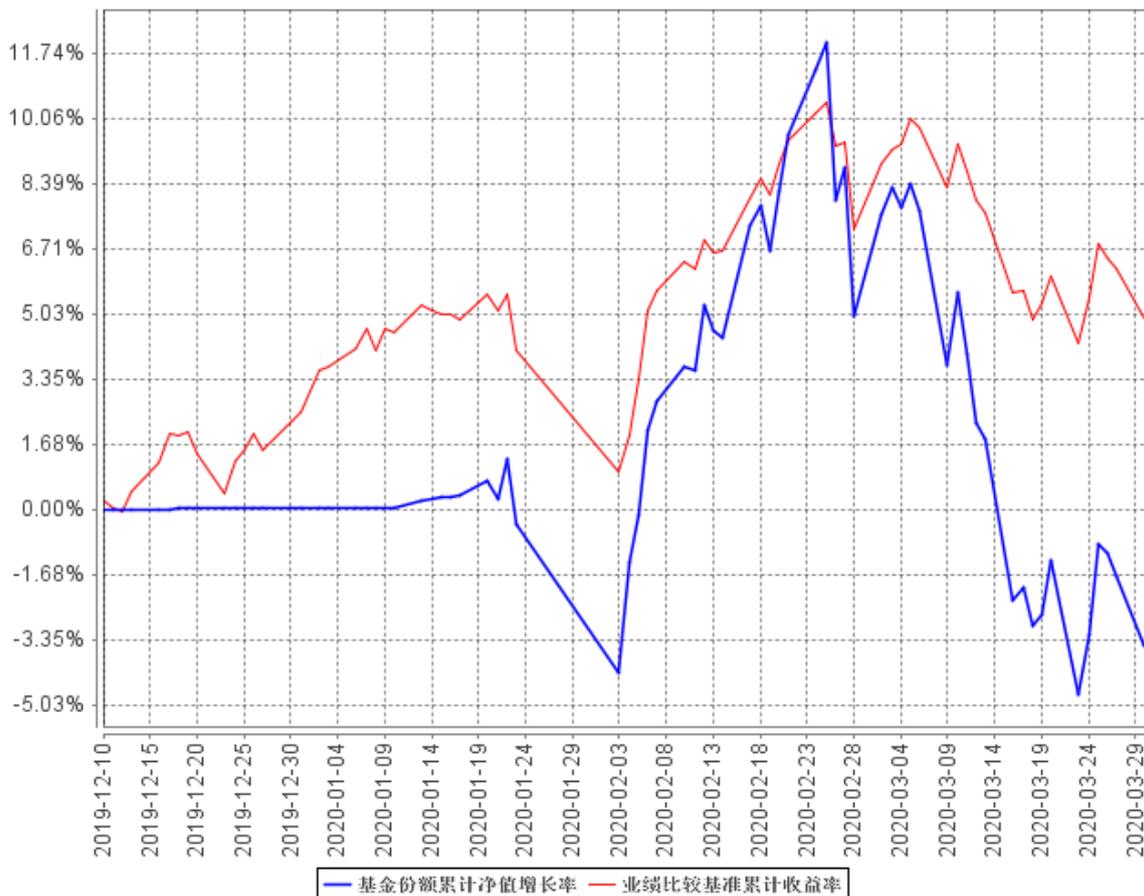
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -2.99% | 1.65% | 2.55% | 0.92% | -5.54% | 0.73% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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。

本基金的建仓期为自基金合同生效日(2019 年 12 月 10 日)起 6 个月。截至报告期末，本基金尚未完成建仓。

本基金基金合同生效至本报告期末不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2019年12月10日 | - | 12 | 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，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，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

报告期内，所有投资组合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未超过

该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 1 季度 A 股市场宽幅震荡，沪深 300 指数跌 10.02%，除创业板指小幅上涨外，其余主要指数均有所下跌，受益于流动性宽松和风险偏好提升的科技成长类指数相对表现较好，大盘红利类指数跌幅较大。行业表现分化明显，农林牧渔一枝独秀，涨幅超过 15%，部分受益于疫情的医药生物、计算机、通讯也表现较好，受疫情影响较大的休闲服务跌幅超过 20%，受经济下滑影响较大的周期类行业也跌幅较大。1 月市场震荡整理，景气度较高的电子、医药涨幅靠前，预期处于拐点的新能源车也表现较好；2 月受国内新冠疫情影响，市场探底回升，中下旬在风险偏好大幅提升和赚钱效应的影响下，场外资金加速入市，市场大幅走高，特别是部分科技成长类受疫情影响较小，产业处于上升周期和国产替代的加速期，同时受益于远程办公、互联网医疗、5G 新基建等主题热度提升，涨幅较大。3 月受海外疫情扩散等影响，海外资本市场（股市、商品）大幅下挫，市场担忧疫情短期难以控制，全球经济大幅下滑，A 股市场跟随大幅下调（风险偏好下降、盈利预测下调），前期涨幅较大的电子、计算机跌幅较大。

从因子表现来看，基本面因子整体表现较好，成长因子表现突出，盈余动量因子也表现较好，盈利能力因子和价值因子表现一般；技术类因子整体表现一般，反转因子大幅回撤，低波动、低流动性因子也表现一般，小市值因子有所表现。1/2 月的因子表现与 3 月分化比较明显；1/2 月，市场整体处于上涨过程中，风险偏好提升较快，成长因子、盈余动量因子表现优异，价值因子、小市值因子、反转因子、低波动、低流动因子均出现回撤；而 3 月，市场快速下跌，风险偏好急剧下降，市场更在乎安全性，价值因子、小市值因子、反转因子、低波动因子、低流动因子表现优异。

2020 年 1 季度 A 股市场宽幅震荡，沪深 300 指数跌 10.02%，除创业板指小幅上涨外，其余主要指数均有所下跌，受益于流动性宽松和风险偏好提升的科技成长类指数相对表现较好，大盘红利类指数跌幅较大。行业表现分化明显，农林牧渔一枝独秀，涨幅超过 15%，部分受益于疫情的医药生物、计算机、通讯也表现较好，受疫情影响较大的休闲服务跌幅超过 20%，受经济下滑影响较大的周期类行业也跌幅较大。1 月市场震荡整理，景气度较高的电子、医药涨幅靠前，预期处于拐点的新能源车也表现较好；2 月受国内新冠疫情影响，市场探底回升，中下旬在风险偏好大幅提升和赚钱效应的影响下，场外资金加速入市，市场大幅走高，特别是部分科技成长类受疫情影响较小，产业处于上升周期和国产替代的加速期，同时受益于远程办公、互联网医疗、5G 新

基建等主题热度提升，涨幅较大。3 月受海外疫情扩散等影响，海外资本市场（股市、商品）大幅下挫，市场担忧疫情短期难以控制，全球经济大幅下滑，A 股市场跟随大幅下调（风险偏好下降、盈利预测下调），前期涨幅较大的电子、计算机跌幅较大。

从因子表现来看，基本面因子整体表现较好，成长因子表现突出，盈余动量因子也表现较好，盈利能力因子和价值因子表现一般；技术类因子整体表现一般，反转因子大幅回撤，低波动、低流动性因子也表现一般，小市值因子有所表现。1/2 月的因子表现与 3 月分化比较明显；1/2 月，市场整体处于上涨过程中，风险偏好提升较快，成长因子、盈余动量因子表现优异，价值因子、小市值因子、反转因子、低波动、低流动因子均出现回撤；而 3 月，市场快速下跌，风险偏好急剧下降，市场更在乎安全性，价值因子、小市值因子、反转因子、低波动因子、低流动因子表现优异。

2020 年 1 季度基金处于中性的仓位，1 月至 2 月中旬基金处于建仓期，1 月仓位较低，2 月中旬左右建仓完毕，随后仓位在 70%左右；选股模型中价值因子、盈利因子、盈余动量因子、成长因子等基本面因子、分析师预期因子、流动性等技术类因子的权重较高；行业配置方面，食品饮料、医药生物、电气设备、计算机、电子等行业的权重较高。1 季度，组合表现一般；1 月，组合处于建仓期，仓位较低，落后于市场；2 月表现较好，组合构建上，景气度给予了较高权重，部分把握住了光伏、食品饮料、医药、消费电子、半导体、计算机的行情机会，对组合贡献较大；但是 2 月底 3 月初，组合对部分高涨幅、高估值的科技股减仓不够及时，导致组合在 3 月份经历了较大的回撤，表现不佳。

4.5 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 0.9706 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.99%，业绩比较基准收益率为 2.55%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 93,942,057.12 | 67.26 |
| | 其中：股票 | 93,942,057.12 | 67.26 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 63,000.00 | 0.05 |
| | 其中：债券 | 63,000.00 | 0.05 |
| | 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 | 43,112,387.85 | 30.87 |
| 8 | 其他资产 | 2,547,318.13 | 1.82 |
| 9 | 合计 | 139,664,763.10 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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 | 59,800,108.53 | 43.68 |
| 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 | 1,627,149.31 | 1.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 866,415.00 | 0.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,498,349.30 | 14.24 |
| J | 金融业 | 5,234,586.00 | 3.82 |
| 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 | 5,435,893.98 | 3.97 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 1,479,555.00 | 1.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 93,942,057.12 | 68.62 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000858 | 五粮液 | 31,700 | 3,651,840.00 | 2.67 |
| 2 | 002777 | 久远银海 | 83,660 | 3,258,557.00 | 2.38 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 145,400 | 3,222,064.00 | 2.35 |
| 4 | 300628 | 亿联网络 | 34,882 | 2,845,324.74 | 2.08 |
| 5 | 002624 | 完美世界 | 56,400 | 2,681,820.00 | 1.96 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 136,300 | 2,357,990.00 | 1.72 |
| 7 | 002709 | 天赐材料 | 116,600 | 2,276,032.00 | 1.66 |
| 8 | 300759 | 康龙化成 | 38,100 | 2,260,473.00 | 1.65 |
| 9 | 002555 | 三七互娱 | 68,600 | 2,240,476.00 | 1.64 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 8,500 | 2,224,450.00 | 1.62 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 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） | 63,000.00 | 0.05 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|-----------|------|
| 10 | 合计 | 63,000.00 | 0.05 |
|----|----|-----------|------|

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 123044 | 红相转债 | 630 | 63,000.00 | 0.05 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 95,616.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,426,523.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,913.43 |
| 5 | 应收申购款 | 17,264.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,547,318.13 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 525,221,090.63 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 29,568,407.64 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 413,734,279.34 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 141,055,218.93 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理区间精选灵活配置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、营业执照；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

9.2 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。

9.3 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

2020 年 4 月 22 日