

# 农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	58
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	58
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	农银海棠定开混合
基金主代码	006977
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 16 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	251,647,246.26 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制投资组合风险的前提下，追求资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、权证投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% + 中证全债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105798
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105799
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		许金超	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	证券时报
----------------	------

登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

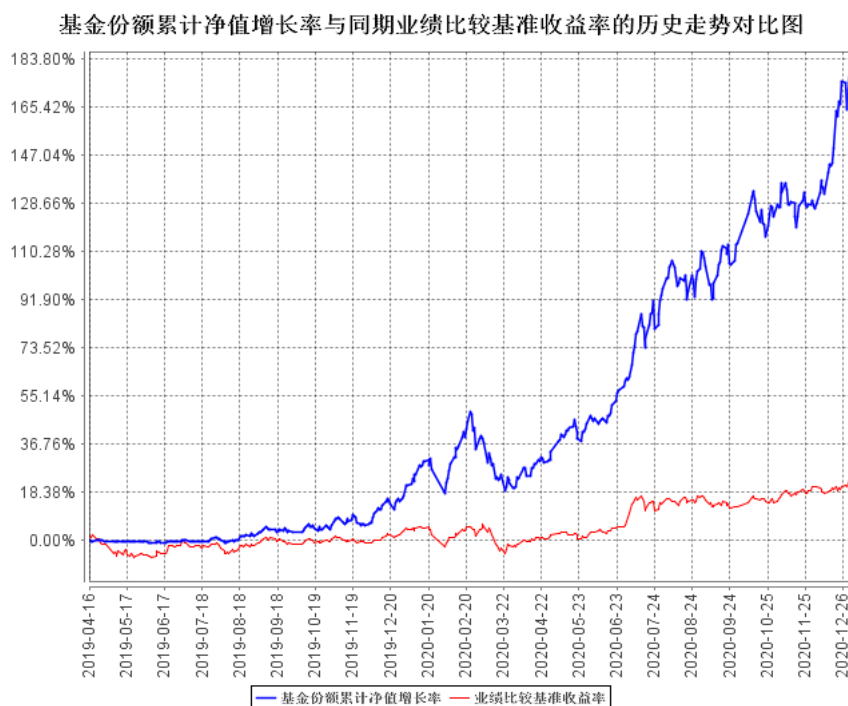
3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019年4月16日(基金合同生效日)-2019年12月31日	2018 年
本期已实现收益	188,996,170.90	10,465,093.54	-
本期利润	338,041,139.38	42,052,853.66	-
加权平均基金份额本期利润	1.3548	0.1703	-
本期加权平均净值利润率	89.33%	16.47%	-
本期基金份额净值增长率	137.01%	17.03%	-
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	125,923,027.78	10,465,093.54	-
期末可供分配基金份额利润	0.5004	0.0424	-
期末基金资产净值	559,261,973.53	288,950,672.86	-
期末基金份额净值	2.2224	1.1703	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	177.37%	17.03%	-

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	29.98%	1.95%	9.21%	0.64%	20.77%	1.31%
过去六个月	72.17%	1.97%	16.22%	0.87%	55.95%	1.10%
过去一年	137.01%	1.94%	18.88%	0.92%	118.13%	1.02%
自基金合同生效起至今	177.37%	1.53%	23.28%	0.84%	154.09%	0.69%

### 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



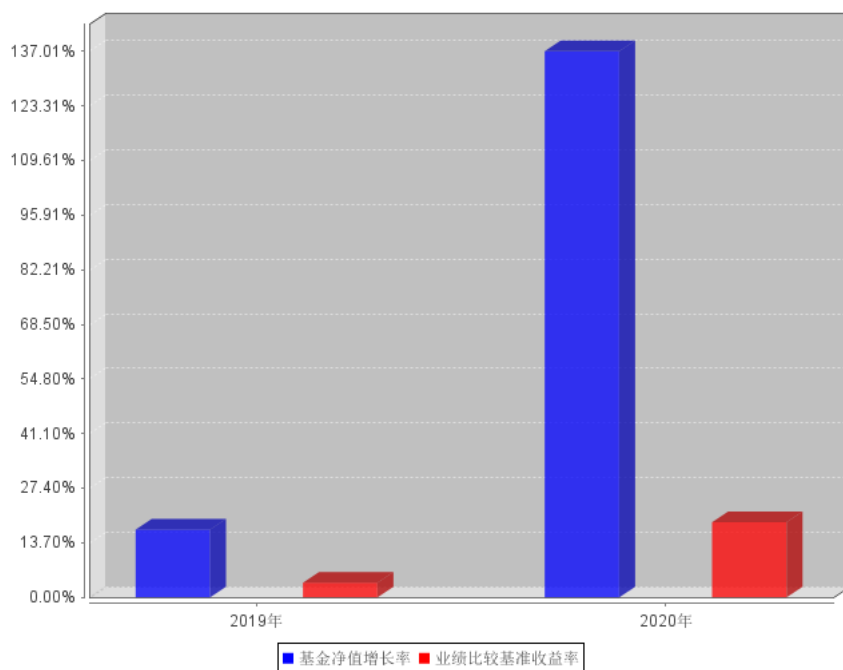
基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产净值的比例为 50%–95%，但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金建仓期为基金合同生效日（2019 年 4 月 16 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2020	2.9820	67,729,838.71	5,962,170.17	73,692,008.88	
2019	-	-	-	-	
合计	2.9820	67,729,838.71	5,962,170.17	73,692,008.88	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2020 年 12 月 31 日，公司共管理 60 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、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、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、农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金、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、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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）、农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
赵诣	本基金基金经理、投资部副总经理	2020 年 6 月 1 日	-	8	硕士。历任申银万国证券研究所机械行业分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司投资部副总经理、基金经理。

#### 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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度受疫情的影响，市场出现了较大的波动。进入二季度，随着国内和海外国家逐步进入复工复产阶段，各国均出台了较强的经济刺激政策，全球进入放水阶段，随着美股在宽松的货币环境下创出新高，国内市场也在二季度出现震荡上行的局面，随着进入三季度市场对于宽松预期的降低，市场进入区间震荡期，全年上证指数上涨 13.87%，深证成指上涨 38.73%，创业板指上涨 64.96%。

从全年来看，基金获得 137.53% 的收益，在操作上，整个四季度仓位处于一个相对稳定的水平，结构上也并未进行大的调整。在一季度经历了疫情冲击导致的大幅波动后，从二季度开始取得了较好的收益，主要原因在于由于市场对于海外疫情短期影响过于担忧，而忽视了优质公司的长期成长价值，因此在因外需原因而导致的下跌中，加仓了以光伏为主的全球供应链行业，使得在疫情影响衰减之后获得了较好的收益，同时随着行业基本面的回升，在 4 季度加仓了新能源汽车产业链的企业。目前组合持仓仍然主要集中在计算机、电子、机械、新能源、医药等行业。

展望 2021 年，上市公司的经营质量仍是我们最重要的关注因素，因此部分业绩稳定增长的优质公司，由于缺乏题材，导致在一季度股价表现不佳的情况下，反而是为明年后三个季度布局的好时机。同时，头部企业由于在低折现率、长久期、高流动性的情况下，给了很高的溢价，而中盘细分行业龙头由于关注度较低，估值、增速更匹配，因此也会存在较好的机会。整体上我们没

有特别大的变化，更加关注有“增量”的方向，一个是技术进步带来需求提升的方向，包括新能源和 5G 应用；另外一个是在“国内大循环为主体，国内国际双循环相互促进”定调下的国产替代、补短板的方向，尤其是以航空发动机、半导体为主的高端制造业。组合配置上仍然围绕科技+消费的方式，科技股方面，主要以 5G 产业链、新能源、高端制造为主；在消费股方面，主要以医疗服务、大众消费品为主。

#### 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 2.2224 元；本报告期基金份额净值增长率为 137.01%，业绩比较基准收益率为 18.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，由于疫情的影响，对过去的一年全球的经济都产生了较大的影响，也使得各国都通过释放流动性的方式来刺激经济，随着疫苗的逐步推出，部分国家随着大规模的接种，已经取得了明显的效果，随着覆盖人群的增加，疫情有望逐步得到控制，使得全球其他国家经济的重新得到恢复。这将导致今年有几个方面值得关注：疫苗顺利推出后，使得疫情得到控制；经济增长在后疫情时代能否顺利得到恢复；经济恢复后，流动性是否会逐步收紧；美国新一任政府对华政策等。由于流动性再继续加速宽松的概率较低，也就使得估值扩张的难度加大，因此今年更多的需要关注业绩的增长是否能消化掉之前过高的估值，主要以自下而上的机会为主。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

(1) 全面开展基金运作稽核工作，防范内幕交易，确保基金投资的独立性、公平性及合规性  
主要措施有：严格执行集中交易制度，确保研究、投资决策和交易隔离；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序。通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求。

## (2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内已实施过一次利润分配，分配方案为每 10 份基金份额派发红利 0.382 元，权益登记日为 2020 年 1 月 20 日，共配利润 73,692,008.88 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金 2020 年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 25041 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“农银海棠定开混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了农银海棠定开混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于农银海棠定开混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	农银海棠定开混合基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银海棠定开混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算农银海棠定开混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督农银海棠定开混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对农银海棠定开混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致农银海棠定开混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞   赵钰
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	67,605,336.93	44,302,795.98
结算备付金		260,500.89	631,719.20
存出保证金		72,469.07	84,420.50
交易性金融资产	7.4.7.2	487,232,458.84	244,866,663.14
其中：股票投资		487,232,458.84	244,866,663.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,223,402.25	-
应收利息	7.4.7.5	6,957.69	6,925.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		560,401,125.67	289,892,524.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		632,542.32	353,373.70
应付托管费		105,423.71	58,895.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	221,185.79	389,581.90
应交税费		0.32	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,000.00	140,000.00
负债合计		1,139,152.14	941,851.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	251,647,246.26	246,897,819.20
未分配利润	7.4.7.10	307,614,727.27	42,052,853.66
所有者权益合计		559,261,973.53	288,950,672.86
负债和所有者权益总计		560,401,125.67	289,892,524.08

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.2224 元，基金份额总额 251,647,246.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 4 月 16 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		347,052,839.42	46,251,211.22
1. 利息收入		293,197.59	1,187,838.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	263,491.40	588,219.16
债券利息收入		396.71	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,309.48	599,619.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		197,714,673.35	13,475,612.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	196,022,619.35	13,005,219.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	485,759.24	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,206,294.76	470,393.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	149,044,968.48	31,587,760.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		9,011,700.04	4,198,357.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,639,322.41	2,716,267.68

2. 托管费	7.4.10.2.2	939,887.07	452,711.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,233,135.89	882,350.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.47	-
7. 其他费用	7.4.7.20	199,353.20	147,028.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		338,041,139.38	42,052,853.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		338,041,139.38	42,052,853.66

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	246,897,819.20	42,052,853.66	288,950,672.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	338,041,139.38	338,041,139.38
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）	4,749,427.06	1,212,743.11	5,962,170.17
其中：1. 基金申购款	4,749,427.06	1,212,743.11	5,962,170.17
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）	-	-73,692,008.88	-73,692,008.88
五、期末所有者权益（基金净值）	251,647,246.26	307,614,727.27	559,261,973.53
项目	上年度可比期间 2019 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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）	246,897,819.20	-	246,897,819.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,052,853.66	42,052,853.66
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）	246,897,819.20	42,052,853.66	288,950,672.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 施卫	_____ Celine Zhang	_____ 丁煜琼
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金(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[2019]第 117 号《关于准予农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》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《农银汇理海棠三年定期开放混合型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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 246,711,110.45 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0222 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 4 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 246,897,819.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 186,708.75 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。

本基金以定期开放方式运作，即采取封闭期和开放期相结合的方式运作。自基金合同生效日(含该日)起或者自每一开放期结束之日次日(含该日)起至三年后的对应日的前一日的期间，为本基金的一个封闭期。本基金的第一个封闭期自基金合同生效之日(含该日)起至三年后的对应日的前一日止。下一个封闭期自第一个开放期结束之日次日(含该日)起至三年后的对应日的前一日止，以此类推。如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务(红利再投资除外)，也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理海棠三年定期开放混合型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(包括国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货等)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的相关规定。本基金投资于股票的比例范围为基金资产的 50%-95%，但应开放期流动性需要，每个开放期开始前 3 个月至开放期结束后 3 个月内不受前述比例限制。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资范围为基金资产净值的 0%-3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协



会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 4 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (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变动计入当期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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率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及由基金管理人缴纳的增值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，其处置价格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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	67,605,336.93	44,302,795.98
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：	67,605,336.93	44,302,795.98

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	306,599,730.24	487,232,458.84	180,632,728.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	306,599,730.24	487,232,458.84	180,632,728.60

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	213,278,903.02	244,866,663.14	31,587,760.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	213,278,903.02	244,866,663.14	31,587,760.12

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,807.79	6,602.96
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	117.20	284.30
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	32.70	38.00
合计	6,957.69	6,925.26



#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	221,185.79	389,581.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	221,185.79	389,581.90

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	140,000.00
合计	180,000.00	140,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	246,897,819.20	246,897,819.20
本期申购	4,749,427.06	4,749,427.06
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	251,647,246.26	251,647,246.26

注：

根据《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》及《农银汇理海棠三年定期开

放混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金为定期开放基金，每三年开放一次，封闭期内不办理申购与赎回业务(红利再投资除外)，也不上市交易；自每个封闭期结束之后的第一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

#### 7.4.7.10 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
上年度末	10,465,093.54	31,587,760.12	42,052,853.66
本期利润	188,996,170.90	149,044,968.48	338,041,139.38
本期基金份额交易产生的变动数	153,772.22	1,058,970.89	1,212,743.11
其中：基金申购款	153,772.22	1,058,970.89	1,212,743.11
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-73,692,008.88	-	-73,692,008.88
本期末	125,923,027.78	181,691,699.49	307,614,727.27

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年4月16日(基金合同生效日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	251,435.93	535,462.65
定期存款利息收入	-	41,222.22
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	10,655.35	11,198.70
其他	1,400.12	335.59
合计	263,491.40	588,219.16

#### 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金 合同生效日)至2019年12月 31日
卖出股票成交总额	762,660,525.55	218,094,910.84
减：卖出股票成本总额	566,637,906.20	205,089,691.71
买卖股票差价收入	196,022,619.35	13,005,219.13

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入	485,759.24	-
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	485,759.24	-

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	1,960,568.07	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	1,474,400.00	-
减：应收利息总额	408.83	-
买卖债券差价收入	485,759.24	-

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效 日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,206,294.76	470,393.20
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,206,294.76	470,393.20

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同 生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	149,044,968.48	31,587,760.12
——股票投资	149,044,968.48	31,587,760.12
——债券投资	-	-
——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	149,044,968.48	31,587,760.12

**7.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效 日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	2,233,135.89	882,350.62
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,233,135.89	882,350.62

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生
----	-----------------------	-----------------------------

	12 月 31 日	效日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
账户服务费	18,000.00	6,000.00
银行汇划费	1,353.20	628.00
其他	-	400.00
合计	199,353.20	147,028.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司(“农银汇理”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
农银汇理资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
东方汇理资产管理公司	基金管理人的股东
中铝资本控股有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,639,322.41	2,716,267.68
其中：支付销售机构的客户维护费	2,929,331.21	1,455,699.58

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	939,887.07	452,711.26

注：支付基金托管人中国工商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 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金的情况。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	67,605,336.93	251,435.93	44,302,795.98

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020年 6月23 日	-	2020 年6月 23日	2.6000	58,626,433.51	5,634,074.35	64,260,507.86	



2	2020年 1月20 日	-	2020 年1月 20日	0.3820	9,103,405.20	328,095.82	9,431,501.02	
合计	-	-		2.9820	67,729,838.71	5,962,170.17	73,692,008.88	

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
002850	科达利	2020年11月30日	2021年6月1日	非公开发行流通受限	60.47	87.05	71,109	4,299,961.23	6,190,038.45	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688065	凯赛生物	2020年8月5日	2021年2月18日	科创板锁定	133.45	83.79	4,630	617,873.50	387,947.70	-
688585	上纬新材	2020年9月21日	2021年3月29日	科创板锁定	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	创业板锁定	21.34	37.84	846	18,053.64	32,012.64	-

300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	创业板锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	创业板锁定	43.76	51.10	484	21,179.84	24,732.40	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	创业板锁定	138.02	126.67	159	21,945.18	20,140.53	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	创业板锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	创业板锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	创业板锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	创业板锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年6月7日	创业板锁定	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	创业板锁定	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	创业板锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	创业板锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-

注：

1. 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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。

3. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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。

#### **7.4.12.2 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。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

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

督和控制。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例、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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金管理人定期对

基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	67,605,336.93	-	-	-	67,605,336.93
结算备付金	260,500.89	-	-	-	260,500.89
存出保证金	72,469.07	-	-	-	72,469.07
交易性金融资产	-	-	-	487,232,458.84	487,232,458.84
应收证券清算款	-	-	-	5,223,402.25	5,223,402.25
应收利息	-	-	-	6,957.69	6,957.69
资产总计	67,938,306.89	-	-	492,462,818.78	560,401,125.67
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	632,542.32	632,542.32
应付托管费	-	-	-	105,423.71	105,423.71
应付交易费用	-	-	-	221,185.79	221,185.79
应交税费	-	-	-	0.32	0.32
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,139,152.14	1,139,152.14
利率敏感度缺口	67,938,306.89	-	-	491,323,666.64	559,261,973.53
上年度末 2019年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	44,302,795.98	-	-	-	44,302,795.98
结算备付金	631,719.20	-	-	-	631,719.20
存出保证金	84,420.50	-	-	-	84,420.50
交易性金融资产	-	-	-	244,866,663.14	244,866,663.14
应收利息	-	-	-	6,925.26	6,925.26
资产总计	45,018,935.68	-	-	244,873,588.40	289,892,524.08
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	353,373.70	353,373.70
应付托管费	-	-	-	58,895.62	58,895.62

应付交易费用	-	-	-	389,581.90	389,581.90
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	941,851.22	941,851.22
利率敏感度缺口	45,018,935.68	-	-	-243,931,737.18	288,950,672.86

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-	-
	市场利率平行下降25个基点	-	-

本基金本报告期末及上年度末无债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	487,232,458.84	87.12	244,866,663.14	84.74
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	487,232,458.84	87.12	244,866,663.14	84.74

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	43,969,614.34	-
	业绩比较基准下降5%	-43,969,614.34	-

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。为保证该方法所得结果的参考性，一般需要至少1年的基金净值数据，截至2019年12月31日，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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值



于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 480,339,591.94 元,属于第二层次的余额为 6,892,866.90 元,无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日:第一层次 244,193,846.98 元,第二层次 672,816.16 元,无第三层次)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	487,232,458.84	86.94
	其中：股票	487,232,458.84	86.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	67,865,837.82	12.11
8	其他各项资产	5,302,829.01	0.95
9	合计	560,401,125.67	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	439,141,178.09	78.52
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	16,065,442.51	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	5,613,780.88	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,728.88	0.01
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	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	47,869.75	0.01

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,277,669.00	4.70
R	文化、体育和娱乐业	20,140.53	0.00
S	综合	-	-
	合计	487,232,458.84	87.12

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300750	宁德时代	124,200	43,607,862.00	7.80
2	002460	赣锋锂业	422,123	42,718,847.60	7.64
3	000733	振华科技	706,800	41,595,180.00	7.44
4	601012	隆基股份	393,911	36,318,594.20	6.49
5	603308	应流股份	1,165,564	34,617,250.80	6.19
6	600438	通威股份	767,105	29,487,516.20	5.27
7	300037	新宙邦	277,100	28,097,940.00	5.02
8	002709	天赐材料	261,800	27,174,840.00	4.86
9	002044	美年健康	2,319,300	26,277,669.00	4.70
10	603179	新泉股份	762,139	25,836,512.10	4.62
11	300073	当升科技	391,600	25,395,260.00	4.54
12	688388	嘉元科技	221,993	19,566,463.02	3.50
13	603659	璞泰来	170,449	19,156,763.11	3.43
14	002850	科达利	206,509	18,916,284.45	3.38
15	603883	老百姓	255,697	16,065,442.51	2.87
16	000066	中国长城	668,272	12,690,485.28	2.27
17	603987	康德莱	643,300	10,093,377.00	1.80
18	688006	杭可科技	120,000	9,963,600.00	1.78
19	300101	振芯科技	472,300	7,613,476.00	1.36
20	002352	顺丰控股	63,400	5,593,782.00	1.00
21	688289	圣湘生物	48,805	5,561,329.75	0.99
22	688065	凯赛生物	4,630	387,947.70	0.07
23	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.01
24	688679	通源环境	3,139	47,869.75	0.01
25	300872	天阳科技	846	32,012.64	0.01

26	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
27	300861	美畅股份	484	24,732.40	0.00
28	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
29	300860	锋尚文化	159	20,140.53	0.00
30	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
31	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
32	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
33	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
34	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
35	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
36	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
37	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
38	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
39	605500	森林包装	762	14,980.92	0.00
40	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
41	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
42	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
43	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
44	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
45	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
46	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
47	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603308	应流股份	46,938,304.82	16.24
2	000733	振华科技	38,539,178.07	13.34
3	603019	中科曙光	32,552,114.23	11.27
4	300750	宁德时代	30,515,216.08	10.56
5	002044	美年健康	29,852,774.46	10.33
6	600438	通威股份	24,741,932.56	8.56
7	002460	赣锋锂业	24,156,518.64	8.36
8	601012	隆基股份	20,274,137.00	7.02
9	603179	新泉股份	19,540,975.71	6.76

10	603883	老百姓	19,469,245.14	6.74
11	688066	航天宏图	17,767,847.94	6.15
12	688388	嘉元科技	17,356,167.00	6.01
13	603659	璞泰来	16,266,275.10	5.63
14	300037	新宙邦	15,574,137.48	5.39
15	300073	当升科技	14,923,045.36	5.16
16	002798	帝欧家居	12,875,646.00	4.46
17	603359	东珠生态	12,214,890.19	4.23
18	002850	科达利	11,640,311.23	4.03
19	603987	康德莱	11,213,568.80	3.88
20	000066	中国长城	11,115,935.69	3.85
21	000876	新希望	10,126,249.00	3.50
22	002600	领益智造	9,931,059.32	3.44
23	002709	天赐材料	9,567,620.49	3.31
24	601865	福莱特	9,281,703.43	3.21
25	002299	圣农发展	8,518,619.14	2.95
26	300763	锦浪科技	8,486,844.00	2.94
27	300017	网宿科技	8,174,070.11	2.83
28	300101	振芯科技	7,544,360.73	2.61
29	600900	长江电力	7,274,836.60	2.52
30	002415	海康威视	7,137,859.00	2.47
31	002507	涪陵榨菜	7,036,493.00	2.44
32	300709	精研科技	6,931,307.00	2.40
33	688006	杭可科技	6,867,550.41	2.38
34	300724	捷佳伟创	6,191,055.00	2.14
35	000156	华数传媒	6,097,725.66	2.11
36	600305	恒顺醋业	6,092,839.00	2.11
37	300088	长信科技	5,989,738.00	2.07
38	300465	高伟达	5,911,839.00	2.05

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603019	中科曙光	39,433,907.38	13.65
2	002791	坚朗五金	38,187,939.90	13.22

3	603308	应流股份	37,504,748.19	12.98
4	600984	建设机械	29,916,653.85	10.35
5	000733	振华科技	27,504,343.58	9.52
6	300348	长亮科技	25,642,106.41	8.87
7	600438	通威股份	23,105,870.10	8.00
8	601865	福莱特	20,028,448.89	6.93
9	600584	长电科技	19,214,909.05	6.65
10	002507	涪陵榨菜	17,514,158.26	6.06
11	002475	立讯精密	17,494,858.08	6.05
12	688066	航天宏图	16,526,390.94	5.72
13	300750	宁德时代	15,902,958.20	5.50
14	603496	恒为科技	15,858,418.85	5.49
15	601012	隆基股份	14,444,090.03	5.00
16	300709	精研科技	14,254,165.12	4.93
17	603359	东珠生态	12,131,292.94	4.20
18	002798	帝欧家居	11,919,432.01	4.13
19	000876	新希望	11,684,855.44	4.04
20	600060	海信视像	11,510,884.50	3.98
21	002555	三七互娱	10,969,000.92	3.80
22	600305	恒顺醋业	10,589,335.60	3.66
23	001914	招商积余	10,447,752.00	3.62
24	002600	领益智造	10,044,500.72	3.48
25	000002	万科 A	9,609,534.00	3.33
26	000977	浪潮信息	9,196,188.00	3.18
27	002624	完美世界	9,132,462.96	3.16
28	600276	恒瑞医药	8,981,154.44	3.11
29	002299	圣农发展	8,957,490.03	3.10
30	300017	网宿科技	8,569,773.97	2.97
31	300747	锐科激光	8,392,821.50	2.90
32	600426	华鲁恒升	7,960,877.55	2.76
33	002850	科达利	7,890,233.00	2.73
34	600900	长江电力	7,672,664.08	2.66
35	300572	安车检测	7,666,202.68	2.65
36	002212	天融信	7,595,465.00	2.63
37	688388	嘉元科技	7,503,819.45	2.60
38	300763	锦浪科技	7,080,636.00	2.45
39	300759	康龙化成	7,009,773.74	2.43
40	002415	海康威视	6,894,509.00	2.39

41	300088	长信科技	6,661,093.00	2.31
42	300465	高伟达	6,596,793.00	2.28
43	300783	三只松鼠	6,415,746.00	2.22
44	002027	分众传媒	6,373,905.00	2.21
45	688981	中芯国际	5,837,224.75	2.02

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	659,958,733.42
卖出股票收入（成交）总额	762,660,525.55

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

2020 年 2 月 5 日，深圳新宙邦科技股份有限公司因股权激励方案不合规以及股权激励相关信息披露不真实、不准确违反了《上市公司股权激励管理办法》，被深圳证券交易所采取了监管关注的行政监管措施（创业板监管函〔2020〕第 13 号）。

2020 年 4 月 13 日，江西赣锋锂业股份有限公司因内幕信息知情人登记管理不规范问题（一是未对重大投资进行内幕信息知情人登记，二是内幕信息知情人登记不完整），违反了中国证监会《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，被中国证券监督管理委员会江西监管局采取了出具警示函的行政监管措施。

2020 年 9 月 15 日，美年大健康产业控股股份有限公司（以下简称“美年健康”）受到深圳证券交易所通报批评的处分，美年健康存在以下违规行为：一、未及时披露 2019 年业绩预告；二、控股股东非经营性资金占用，2020 年 4 月 30 日，美年健康披露控股股东、实际控制人的关联方于 2019 年 1 月至 12 月以资金拆借形式非经营性占用上市公司资金。截至 2020 年 4 月 30 日，资金占用累计发生额 1.85 亿元，占 2019 年度经审计净资产的 2.53%，日最高占用额 1.45 亿元，占 2019 年度经审计净资产的 1.99%，上述占用资金已全额偿还。

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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	72,469.07
2	应收证券清算款	5,223,402.25
3	应收股利	-
4	应收利息	6,957.69
5	应收申购款	-



6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,302,829.01

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,647	21,606.19	518,989.36	0.21%	251,128,256.90	99.79%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	11,099.68	0.0044%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年4月16日）基金份额总额	246,897,819.20
本报告期期初基金份额总额	246,897,819.20
本报告期基金总申购份额	4,749,427.06
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	251,647,246.26

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）董事会有关决议，自 2020 年 8 月 14 日起，高国鹏先生起任本公司副总经理职位。另根据本公司董事会有关决议，自 2020 年 9 月 11 日起，石永惠女士起任本公司副总经理职位。

本公司已分别于 2020 年 8 月 18 日、2020 年 9 月 15 日在中国证券报以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 6 万元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚情况。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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

长江证券	2	428,224,025.72	30.47%	398,805.77	30.61%	-
西藏东方财富证券	2	306,021,805.95	21.78%	284,998.99	21.87%	-
东方证券	2	147,783,154.54	10.52%	137,630.84	10.56%	-
中泰证券	2	142,873,737.75	10.17%	133,058.68	10.21%	-
安信证券	2	138,572,728.41	9.86%	129,054.03	9.91%	-
银河证券	2	66,942,346.69	4.76%	62,343.35	4.79%	-
中信证券	2	65,982,473.37	4.70%	61,450.03	4.72%	-
国泰君安	2	65,483,595.74	4.66%	60,984.49	4.68%	-
中信建投	2	28,982,962.94	2.06%	21,195.45	1.63%	-
申万宏源	2	11,603,929.27	0.83%	10,806.56	0.83%	-
兴业证券	2	2,149,578.69	0.15%	2,001.66	0.15%	-
西南证券	2	576,861.00	0.04%	537.24	0.04%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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。

2、本基金本报告期新增中信建投交易单元,无剔除交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
长江证券	-	-	118,700,000.00	33.17%	-	-
西藏东方财富证券	168,875.39	8.61%	-	-	-	-
东方证券	1,016,216.60	51.83%	103,800,000.00	29.01%	-	-
中泰证券	-	-	35,200,000.00	9.84%	-	-
安信证券	-	-	100,100,000.00	27.98%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	775,476.08	39.55%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站	2020年1月17日
2	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告的补充公告	证券时报、基金管理人网站	2020年1月18日
3	农银汇理海棠混合基金 2019 年第四季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020年1月21日
4	农银汇理基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度	证券时报、基金管理人网站	2020年3月13日

	报告的公告		
5	农银汇理海棠混合基金 2019 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 4 月 14 日
6	农银汇理海棠混合基金 2020 年一季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
7	关于农银汇理基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 5 月 29 日
8	农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 6 月 1 日
9	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书-2020 年第 2 次	证券时报、基金管理人网站	2020 年 6 月 4 日
10	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书摘要-2020 年第 2 次	证券时报、基金管理人网站	2020 年 6 月 4 日
11	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书摘要-2020 年第 3 次	证券时报、基金管理人网站	2020 年 6 月 22 日
12	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 6 月 22 日
13	农银汇理海棠混合基金二季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 7 月 20 日
14	农银汇理海棠混合基金 2020 年中期报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
15	农银汇理海棠混合基金产品资料概要	证券时报、基金管理人网站	2020 年 8 月 31 日
16	农银汇理海棠混合基金 2020 年第三季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 10 月 27 日

17	关于农银汇理基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 12 月 2 日
----	----------------------------------	--------------	-----------------



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理海棠三年定期开放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。

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。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

2021 年 3 月 29 日