

农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 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	10
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.....	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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金
基金简称	农银平衡双利混合
基金主代码	660003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 8 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	175,421,784.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在红利股票和高息债券等不同类型资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
投资策略	本基金将在对宏观经济走势和证券市场科学预期的基础上，采取灵活的资产配置策略，构建具有弹性的股票债券平衡组合，寻求经风险调整后的收益水平最大化。在股票投资中以分红类型的股票为投资重点，以获取上市公司分红和股票增值的收益；在债券投资中重点关注高票息券种，通过多样化的投资手段达到提高债券组合收益水平并规避市场风险的目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中证全债指数×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码	200120	200336
法定代表人	许金超	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	71,623,936.19
本期利润	28,968,215.55
加权平均基金份额本期利润	0.1632
本期加权平均净值利润率	6.78%
本期基金份额净值增长率	6.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	261,831,726.02
期末可供分配基金份额利润	1.4926
期末基金资产净值	437,253,510.45
期末基金份额净值	2.4926
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	386.84%

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

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

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

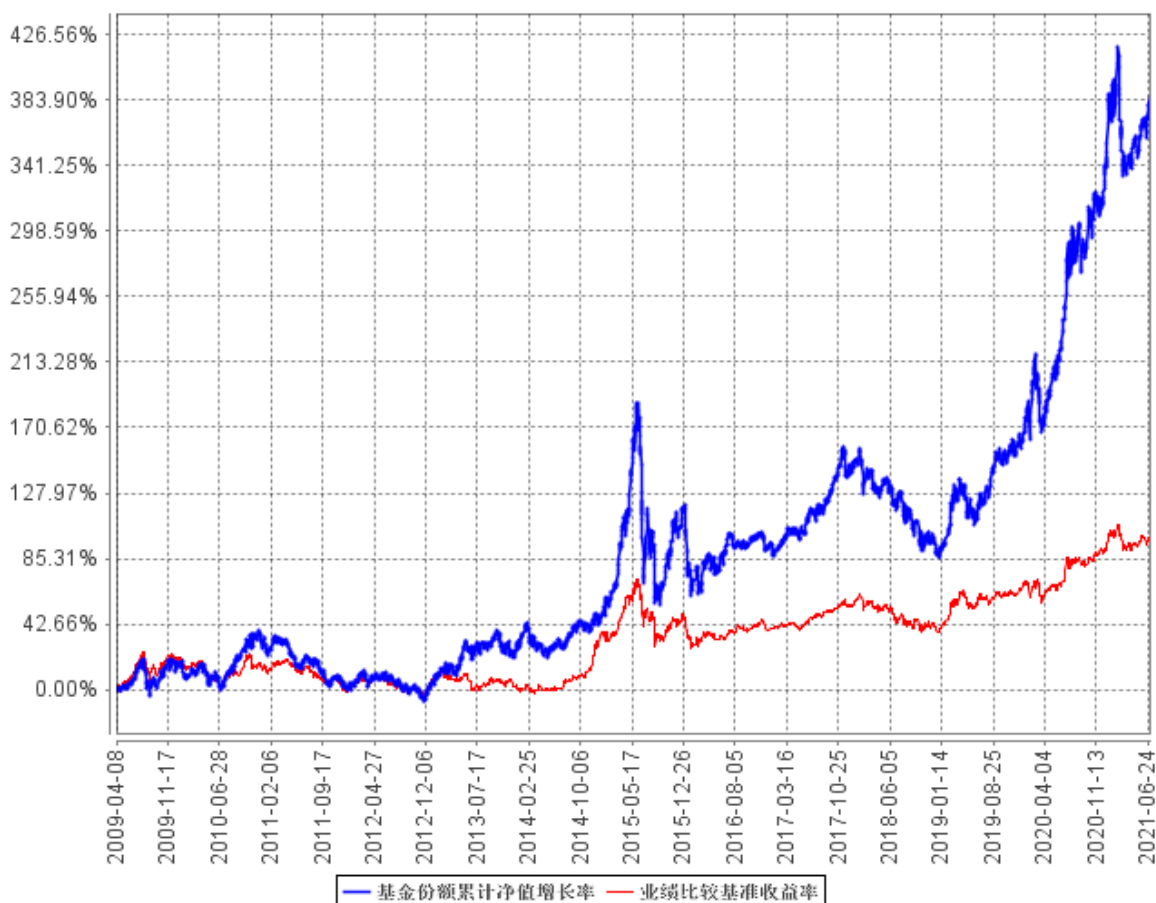
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.25%	0.78%	-1.02%	0.45%	4.27%	0.33%
过去三个月	9.90%	0.72%	2.57%	0.54%	7.33%	0.18%
过去六个月	6.65%	1.21%	1.42%	0.73%	5.23%	0.48%
过去一年	39.99%	1.31%	15.35%	0.73%	24.64%	0.58%
过去三年	117.46%	1.30%	35.06%	0.74%	82.40%	0.56%
自基金合同生效起至今	386.84%	1.34%	98.00%	0.82%	288.84%	0.52%

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



注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 30%-80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%）。本基金建仓期为基金合同生效日（2009 年 4 月 8 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。公司法定代表人为许金超先生。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 62 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金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）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金及农银汇理金盛债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2014 年 4 月 15 日	-	13	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理，农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金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

1 月市场大幅波动，出现明显的倒 V 型走势，风格、行业上均出现剧烈的切换。化工、银行、电气设备在 1 月表现较佳。2 月市场继续大幅波动，风格出现极端切换。周期类大幅跑赢市场，而前期涨幅大、估值较高的板块如电气设备、食品饮料等跌幅居前。3 月市场延续 2 月跌势，之后整理企稳，风格上小市值占优。品种上防御类以及碳中和主题偏强，周期、消费和成长表现普遍不佳。本基金在年初提前做了较多的均衡，在周期类上重点配置化工，在成长类中重点配置电新，在消费类中重点配置白酒，在一定程度上降低了组合的波动性。春节后股市大幅下挫，本基金将仓位逐步下调至相对低位，在此过程中，减配了计算机、医药、白酒等估值相对偏高的板块，同时增配了金融等低估值防御板块。3 月市场的寻底过程中，本基金维持了一个相对低的仓位，增配家电，减配电新和医药，并尝试适度增持一些 PEG 相对合理的中小市值股票。

4 月市场季报年报陆续披露，在去年低基数以及经济复苏的背景下，上市公司年报季报普遍偏强，叠加国内外流动性在 4 月份边际好转，市场出现一轮较为明显的反弹。本基金在反弹中增持了若干质优次新股以及业绩增长趋势较佳的中小盘个股，减持了部分预期偏高的个股以及基本面不及预期的保险股。5 月市场震荡上行，市场活跃度进一步提高。在月中国务院对大宗价格表示关注后，国内的钢铁煤炭价格出现大幅回调，市场对于通胀担忧大幅缓解，市场风险偏好进一步提升。虽然主题投资层出不穷，但本基金的持仓仍以基本面为主要考量，持仓上变化不大。6 月国内外市场的流动性保持宽松，经济基本面则有边际减弱迹象。市场风格延续之前的情况，成长占优，特别是科技成长板块表现明显优于低估值及周期板块。本基金在 6 月主要减配了家电和家具，同时增配了成长性较佳的电新、电子、医药。

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 2.4926 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.65%，业绩比较基准收益率为 1.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观的角度看，随着主动补库存动力的衰竭，经济的动能可能会减弱，GDP 增速在下半年可能会逐步回到正常的状态。其中，过去一年多，出口在疫情催化下持续井喷，但随着海外消费刺激政策的退出以及海外供应链的逐步恢复，出口在边际上有走弱的可能。投资方面，由于出口刺激和国产替代，制造业投资有望保持较好的增长，但是在保持定力、积极调整产业结构的政策取向下，地产基建等偏总量的投资有可能会继续疲弱。消费方面，总量上仍未恢复到疫前水平，主要由于出行相关领域，特别是餐饮、旅游等领域的消费恢复较弱。总体而言，经济增速开始回落，但幅度相对可控。

从流动性的角度看，国内国外的流动性有望保持相对宽松的状态。对于欧美发达国家而言，目前普遍深陷高债务泥潭，在大国博弈的背景下，很难主动刺破债务泡沫。更为可行的办法是通过长期低利率刺激经济增长，以时间换空间。国内方面，由于自疫情以来我们在流动性上的放松远比海外要克制，从能力的角度来看，维持当前宽松状态压力并不大。从意愿的角度，由于下半年经济动能有所减弱，为保持经济的韧性，流动性也不会大幅收紧，更可能的选择是维持现状。

政策方面，公平和效率的再平衡将会持续。但是，我们应该认识到，这种再平衡，是为经济长期平稳发展所做的未雨绸缪。追求长期平稳发展才是我们目的，因此，不会出现极端的只求公平、摒弃效率的情况。如果只是从教培行业的整治线性外推对各类民营资本的严格限制和打压，可能会导致严重的投资误判。产业政策方面，在大国博弈的背景下，发展高端制造，补齐制造短板是必由之路，国产替代将继续获得大量的政策鼓励和扶持，相关产业方兴未艾。

从资本市场的角度，由于经济边际趋缓，流动性有望保持，政策扶持国产替代，因此出现结构性行情的概率较大。相对而言，偏制造端的成长板块盈利增长的韧性更强，相关的领域诸如电动车、光伏、半导体、CDMO 等在盈利增速以及确定性方面会更强一些，更值得关注。但是另一方面，上述行业短期有交易拥挤的风险，中期或有产能过剩问题，后续仍需密切跟踪。

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、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

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 3.314 元；权益登记日为 2021 年 1 月 18 日，分配利润共计 57280076.74 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，基金托管人在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	143,072,179.64	96,777,365.11
结算备付金		499,170.10	895,012.44
存出保证金		116,709.56	108,572.34
交易性金融资产	6.4.7.2	290,891,010.28	364,916,992.52
其中：股票投资		290,891,010.28	364,916,992.52
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,198,981.37	4,609,006.40
应收利息	6.4.7.5	27,969.82	19,829.69
应收股利		-	-
应收申购款		144,893.13	123,071.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		439,950,913.90	467,449,850.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		1,559,428.99	1,953,518.92
应付管理人报酬		525,327.61	559,580.20
应付托管费		87,554.62	93,263.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	436,493.86	437,920.21
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	88,598.37	149,947.00
负债合计		2,697,403.45	3,194,229.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	175,421,784.43	174,737,947.87
未分配利润	6.4.7.10	261,831,726.02	289,517,672.65
所有者权益合计		437,253,510.45	464,255,620.52
负债和所有者权益总计		439,950,913.90	467,449,850.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.4926 元，基金份额总额 175,421,784.43 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		34,272,114.33	108,334,090.03
1.利息收入		546,466.65	376,717.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	546,466.65	338,211.66
债券利息收入		-	0.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	38,504.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		76,318,915.53	50,450,249.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	75,683,527.30	49,040,961.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	397.64
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	635,388.23	1,408,890.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-42,655,720.64	57,457,068.39
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	62,452.79	50,054.93
减：二、费用		5,303,898.78	4,530,475.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,192,623.02	2,723,396.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	532,103.91	453,899.37

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,476,539.29	1,250,198.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	102,632.56	102,980.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,968,215.55	103,803,614.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,968,215.55	103,803,614.86

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	174,737,947.87	289,517,672.65	464,255,620.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,968,215.55	28,968,215.55
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）	683,836.56	625,914.56	1,309,751.12
其中：1. 基金申购款	30,463,430.66	44,288,278.81	74,751,709.47
2. 基金赎回款	-29,779,594.10	-43,662,364.25	-73,441,958.35
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）	-	-57,280,076.74	-57,280,076.74
五、期末所有者权益（基金净值）	175,421,784.43	261,831,726.02	437,253,510.45
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	219,190,171.34	143,093,592.66	362,283,764.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	103,803,614.86	103,803,614.86
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)	-18,709,142.38	-13,390,915.69	-32,100,058.07
其中：1.基金申购款	28,481,384.53	20,705,596.25	49,186,980.78
2.基金赎回款	-47,190,526.91	-34,096,511.94	-81,287,038.85
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)	-	-28,198,530.10	-28,198,530.10
五、期末所有者权益(基金净值)	200,481,028.96	205,307,761.73	405,788,790.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 许金超 毕宏燕 丁煜琼
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理平衡双利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》、《农银汇理平衡双利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[2009]74号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为6,465,518,027.79份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(09)第0008号验资报告。《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2009年4月8日正式生效。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新适用的《农银汇理平衡双利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，包括国内依法上市的股票、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。基金的投资组合为：股票投资比例范围为基金资产的 30%-80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数×55%+中证全债指数×45%”。

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颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内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

本基金在本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期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[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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资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,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	143,072,179.64
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：	143,072,179.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	239,019,156.85	290,891,010.28	51,871,853.43
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	239,019,156.85	290,891,010.28	51,871,853.43

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	27,720.41
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	202.14
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	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	47.25
合计	27,969.82

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	436,493.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	436,493.86

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,295.81
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	88,598.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,737,947.87	174,737,947.87
本期申购	30,463,430.66	30,463,430.66
本期赎回(以“-”号填列)	-29,779,594.10	-29,779,594.10
- 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	175,421,784.43	175,421,784.43

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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
上年度末	297,577,569.33	-8,059,896.68	289,517,672.65
本期利润	71,623,936.19	-42,655,720.64	28,968,215.55
本期基金份额交易产生的变动数	-419,088.59	1,045,003.15	625,914.56
其中：基金申购款	49,426,816.85	-5,138,538.04	44,288,278.81
基金赎回款	-49,845,905.44	6,183,541.19	-43,662,364.25
本期已分配利润	-57,280,076.74	-	-57,280,076.74
本期末	311,502,340.19	-49,670,614.17	261,831,726.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,283.32
其他	923.03
合计	546,466.65

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	520,564,322.45
减：卖出股票成本总额	444,880,795.15
买卖股票差价收入	75,683,527.30

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债券赎回差价收入。

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债券申购差价收入。

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买卖贵金属差价收入。

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赎回差价收入。

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申购差价收入。

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买卖权证差价收入。

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	635,388.23
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	635,388.23

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-42,655,720.64
——股票投资	-42,655,720.64
——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	-42,655,720.64

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	60,764.93
转换费	1,687.86
合计	62,452.79

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，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,476,539.29
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	1,476,539.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户服务费	9,000.00
清算所账户服务费	9,000.00
银行汇划费	330.00
合计	102,632.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,192,623.02	2,723,396.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,114,994.29	942,677.36

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	532,103.91	453,899.37

注：支付基金托管人交通银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
交通银行	143,072,179.64	541,260.30	90,089,998.87	331,736.76

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 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	2021年 1月18日	-	2021 年1月 18日	3.3140	42,465,230.60	14,814,846.14	57,280,076.74	
合计	-	-	-	3.3140	42,465,230.60	14,814,846.14	57,280,076.74	

6.4.12 期末（2021 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
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	科创板锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	创业板锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300993	玉马	2021年	2021	创业板	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

	遮阳	5月17日	2021年11月24日	锁定						
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与因转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

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 2021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	143,072,179.64	-	-	-	143,072,179.64
结算备付金	499,170.10	-	-	-	499,170.10
存出保证金	116,709.56	-	-	-	116,709.56
交易性金融资产	-	-	-	290,891,010.28	290,891,010.28
应收证券清算款	-	-	-	5,198,981.37	5,198,981.37
应收利息	-	-	-	27,969.82	27,969.82
应收申购款	-	-	-	144,893.13	144,893.13
资产总计	143,688,059.30	-	-	296,262,854.60	439,950,913.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,559,428.99	1,559,428.99

应付管理人报酬	-	-	-	525,327.61	525,327.61
应付托管费	-	-	-	87,554.62	87,554.62
应付交易费用	-	-	-	436,493.86	436,493.86
其他负债	-	-	-	88,598.37	88,598.37
负债总计	-	-	-	2,697,403.45	2,697,403.45
利率敏感度缺口	143,688,059.30	-	-	-293,565,451.15	437,253,510.45
上年度末 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	96,777,365.11	-	-	-	96,777,365.11
结算备付金	895,012.44	-	-	-	895,012.44
存出保证金	108,572.34	-	-	-	108,572.34
交易性金融资产	-	-	-	-364,916,992.52	364,916,992.52
应收证券清算款	-	-	-	4,609,006.40	4,609,006.40
应收利息	-	-	-	19,829.69	19,829.69
应收申购款	-	-	-	123,071.72	123,071.72
资产总计	97,780,949.89	-	-	-369,668,900.33	467,449,850.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,953,518.92	1,953,518.92
应付管理人报酬	-	-	-	559,580.20	559,580.20
应付托管费	-	-	-	93,263.37	93,263.37
应付交易费用	-	-	-	437,920.21	437,920.21
其他负债	-	-	-	149,947.00	149,947.00
负债总计	-	-	-	3,194,229.70	3,194,229.70
利率敏感度缺口	97,780,949.89	-	-	-366,474,670.63	464,255,620.52

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

6.4.13.4.1.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020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	
--	-----	--

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	290,891,010.28	66.53	364,916,992.52	78.60
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	290,891,010.28	66.53	364,916,992.52	78.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	32,960,407.54	37,544,525.26

	业绩比较基准下降 5%	-32,960,407.54	-37,544,525.26
--	-------------	----------------	----------------

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

§ 7 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	290,891,010.28	66.12
	其中：股票	290,891,010.28	66.12
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	143,571,349.74	32.63
8	其他各项资产	5,488,553.88	1.25
9	合计	439,950,913.90	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	1,188,768.00	0.27
C	制造业	230,899,776.95	52.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	49,173.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,665,260.00	0.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,774,282.21	2.01
J	金融业	24,707,277.40	5.65
K	房地产业	714,300.00	0.16
L	租赁和商务服务业	9,969,652.40	2.28
M	科学研究和技术服务业	11,898,485.49	2.72
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	290,891,010.28	66.53

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	002812	恩捷股份	64,900	15,193,090.00	3.47
2	002709	天赐材料	121,380	12,936,680.40	2.96
3	300750	宁德时代	22,800	12,193,440.00	2.79
4	000733	振华科技	182,100	11,120,847.00	2.54
5	603259	药明康德	69,652	10,906,806.68	2.49
6	600036	招商银行	199,500	10,810,905.00	2.47
7	000858	五粮液	29,620	8,823,501.80	2.02
8	601058	赛轮轮胎	848,400	8,475,516.00	1.94
9	600882	妙可蓝多	119,500	8,341,100.00	1.91
10	601398	工商银行	1,598,900	8,266,313.00	1.89
11	300979	华利集团	70,000	7,973,000.00	1.82
12	300496	中科创达	47,600	7,476,056.00	1.71
13	603659	璞泰来	53,653	7,328,999.80	1.68
14	300919	中伟股份	44,900	7,318,700.00	1.67
15	300171	东富龙	172,200	6,999,930.00	1.60
16	601012	隆基股份	78,260	6,952,618.40	1.59
17	002850	科达利	75,050	6,559,370.00	1.50
18	300408	三环集团	148,100	6,282,402.00	1.44
19	002027	分众传媒	657,640	6,188,392.40	1.42
20	300037	新宙邦	60,200	6,026,020.00	1.38
21	002304	洋河股份	28,200	5,843,040.00	1.34
22	603308	应流股份	272,580	5,628,777.00	1.29
23	688169	石头科技	4,421	5,574,881.00	1.27
24	300035	中科电气	206,400	5,046,480.00	1.15
25	688617	惠泰医疗	12,283	4,679,700.17	1.07

26	300274	阳光电源	38,900	4,475,834.00	1.02
27	002594	比亚迪	17,600	4,417,600.00	1.01
28	300910	瑞丰新材	41,600	4,349,280.00	0.99
29	300122	智飞生物	21,700	4,052,041.00	0.93
30	601888	中国中免	12,600	3,781,260.00	0.86
31	300782	卓胜微	6,900	3,708,750.00	0.85
32	002415	海康威视	52,200	3,366,900.00	0.77
33	300896	爱美客	4,260	3,360,628.80	0.77
34	600702	舍得酒业	15,500	3,313,590.00	0.76
35	002460	赣锋锂业	24,500	2,966,705.00	0.68
36	300604	长川科技	41,700	2,844,357.00	0.65
37	300763	锦浪科技	15,470	2,793,882.00	0.64
38	000938	紫光股份	123,400	2,699,992.00	0.62
39	600754	锦江酒店	46,800	2,665,260.00	0.61
40	000739	普洛药业	87,200	2,563,680.00	0.59
41	603901	永创智能	131,000	2,361,930.00	0.54
42	000651	格力电器	42,400	2,209,040.00	0.51
43	002371	北方华创	7,900	2,191,302.00	0.50
44	603369	今世缘	39,600	2,144,736.00	0.49
45	300059	东方财富	60,600	1,987,074.00	0.45
46	002920	德赛西威	17,700	1,948,416.00	0.45
47	603517	绝味食品	17,900	1,508,791.00	0.35
48	002142	宁波银行	38,400	1,496,448.00	0.34
49	688696	极米科技	1,589	1,322,048.00	0.30
50	300687	赛意信息	59,800	1,277,926.00	0.29
51	601567	三星医疗	59,500	1,267,350.00	0.29
52	601088	中国神华	60,900	1,188,768.00	0.27
53	603801	志邦家居	35,020	1,119,239.20	0.26
54	601009	南京银行	105,900	1,114,068.00	0.25
55	603816	顾家家居	13,404	1,035,861.12	0.24
56	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	0.24
57	605117	德业股份	7,500	957,000.00	0.22
58	688029	南微医学	3,044	948,784.36	0.22
59	600926	杭州银行	63,400	935,150.00	0.21
60	600438	通威股份	21,000	908,670.00	0.21
61	688005	容百科技	7,184	870,700.80	0.20
62	603755	日辰股份	13,600	848,912.00	0.19
63	300850	新强联	9,200	806,748.00	0.18
64	300725	药石科技	4,960	788,193.60	0.18

65	000002	万科 A	30,000	714,300.00	0.16
66	688131	皓元医药	1,799	622,795.81	0.14
67	688408	中信博	2,044	410,435.20	0.09
68	300759	康龙化成	1,700	368,883.00	0.08
69	603833	欧派家居	2,300	326,508.00	0.07
70	603899	晨光文具	3,600	304,416.00	0.07
71	688161	威高骨科	2,833	300,439.65	0.07
72	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.06
73	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.05
74	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.04
75	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
76	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
77	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
78	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
79	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
80	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
81	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
82	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
83	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
84	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
85	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
86	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
87	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
88	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
89	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
90	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
91	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
92	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
93	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
94	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
95	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	000651	格力电器	16,843,046.60	3.63
2	601318	中国平安	12,381,882.00	2.67
3	601398	工商银行	11,006,545.55	2.37
4	000858	五粮液	10,845,313.00	2.34
5	603259	药明康德	10,205,878.20	2.20
6	300496	中科创达	9,534,203.80	2.05
7	603659	璞泰来	9,496,351.40	2.05
8	601012	隆基股份	9,265,283.92	2.00
9	002812	恩捷股份	8,989,495.00	1.94
10	601058	赛轮轮胎	8,408,581.00	1.81
11	688169	石头科技	8,131,750.84	1.75
12	000333	美的集团	8,111,115.27	1.75
13	601166	兴业银行	7,767,917.51	1.67
14	002311	海大集团	7,744,025.84	1.67
15	300750	宁德时代	7,535,665.98	1.62
16	300122	智飞生物	7,488,499.00	1.61
17	300408	三环集团	7,162,050.78	1.54
18	300014	亿纬锂能	7,058,087.00	1.52
19	000568	泸州老窖	6,836,187.00	1.47
20	300979	华利集团	6,716,892.00	1.45

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	19,658,803.75	4.23
2	000568	泸州老窖	18,358,447.08	3.95
3	601233	桐昆股份	15,261,868.60	3.29
4	000651	格力电器	14,086,314.25	3.03
5	000333	美的集团	13,691,849.46	2.95
6	600309	万华化学	12,221,613.00	2.63
7	603369	今世缘	12,071,463.94	2.60
8	600690	海尔智家	11,646,991.35	2.51
9	600519	贵州茅台	11,621,468.00	2.50
10	601318	中国平安	11,355,433.00	2.45
11	601899	紫金矿业	11,029,114.50	2.38

12	600438	通威股份	10,819,669.37	2.33
13	000725	京东方 A	10,447,199.00	2.25
14	601012	隆基股份	10,257,267.24	2.21
15	000858	五粮液	10,133,534.00	2.18
16	601021	春秋航空	9,502,548.90	2.05
17	300896	爱美客	9,325,976.20	2.01
18	603816	顾家家居	8,646,025.42	1.86
19	603128	华贸物流	8,466,928.07	1.82
20	002850	科达利	8,359,586.21	1.80

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	413,510,533.55
卖出股票收入（成交）总额	520,564,322.45

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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。

7.12.2 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。

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	116,709.56
2	应收证券清算款	5,198,981.37
3	应收股利	-
4	应收利息	27,969.82
5	应收申购款	144,893.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,488,553.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
57,207	3,066.44	4,011,243.45	2.29%	171,410,540.98	97.71%

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	1,985.10	0.0011%

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（2009年4月8日）基金份额总额	6,465,518,027.79
本报告期期初基金份额总额	174,737,947.87
本报告期基金总申购份额	30,463,430.66
减：本报告期基金总赎回份额	29,779,594.10
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	175,421,784.43

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

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，原本公司副总经理 Céline Zhang（张晴）女士自 2021 年 4 月 29 日离任本公司副总经理职务；毕宏燕女士自 2021 年 6 月 17 日任职本公司副总经理职位。本公司已分别于 2021 年 4 月 30 日、2021 年 6 月 18 日在指定媒体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。

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	
海通证券	2	614,995,571.50	66.02%	572,744.21	66.02%	-
中信建投	1	218,730,436.29	23.48%	203,709.74	23.48%	-
中金公司	2	56,566,697.69	6.07%	52,686.61	6.07%	-
中信证券	2	41,229,120.50	4.43%	38,397.20	4.43%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：

- (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、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站	2021 年 1 月 15 日
2	农银汇理平衡双利混合型基金	中国证券报、基金管	2021 年 1 月 21 日

	2020 年四季度报告	理人网站	
3	农银汇理平衡双利混合型基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管 理人网站	2021 年 3 月 29 日
4	农银汇理平衡双利混合型基金 2021 年一季度报告	中国证券报、基金管 理人网站	2021 年 4 月 21 日
5	农银汇理平衡双利混合型基金招 募说明书更新	中国证券报、基金管 理人网站	2021 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理平衡双利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

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 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

2021 年 8 月 30 日