农银汇理金禄债券型证券投资基金
2021 年年度报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
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
§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遵规守信情况的说明.....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.....14
§5 托管人报告.....15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....15
§6 审计报告.....16
6.1 审计报告基本信息.....16
6.2 审计报告的基本内容.....16
§7 年度财务报表.....19
7.1 资产负债表.....19
7.2 利润表.....20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....21
7.4 报表附注.....22
§8 投资组合报告.....47
8.1 期末基金资产组合情况.....47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....47
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.....47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....48
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.....48
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.....48

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 48
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 48
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
8.11 投资组合报告附注 49
§9 基金份额持有人信息 50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
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 50
§10 开放式基金份额变动 51
§11 重大事件揭示 52
11.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
11.4 基金投资策略的改变 52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
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 52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
11.8 其他重大事件 53
§12 影响投资者决策的其他重要信息 56
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 56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 56
§13 备查文件目录 57
13.1 备查文件目录 57
13.2 存放地点 57
13.3 查阅方式 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理金禄债券型证券投资基金
基金简称	农银金禄债券
基金主代码	006758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 21 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	7,635,117,142.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于债券品种，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略、信用策略、跨市场投资策略及资产支持证券投资策略等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债国债及政策性银行债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于股票型、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	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	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	229,121,057.47	100,693,668.81	54,941,419.63
本期利润	288,243,507.23	96,059,865.03	63,643,136.09
加权平均基金份额本期利润	0.0480	0.0186	0.0460
本期加权平均净值利润率	4.66%	1.83%	4.57%
本期基金份额净值增长率	4.74%	4.05%	4.56%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	25,643,228.03	6,753,823.45	13,104,015.01
期末可供分配基金份额利润	0.0034	0.0012	0.0057
期末基金资产净值	7,898,251,976.60	5,703,394,233.39	2,313,934,234.89
期末基金份额净值	1.0345	1.0228	1.0113
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	14.02%	8.86%	4.62%

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。

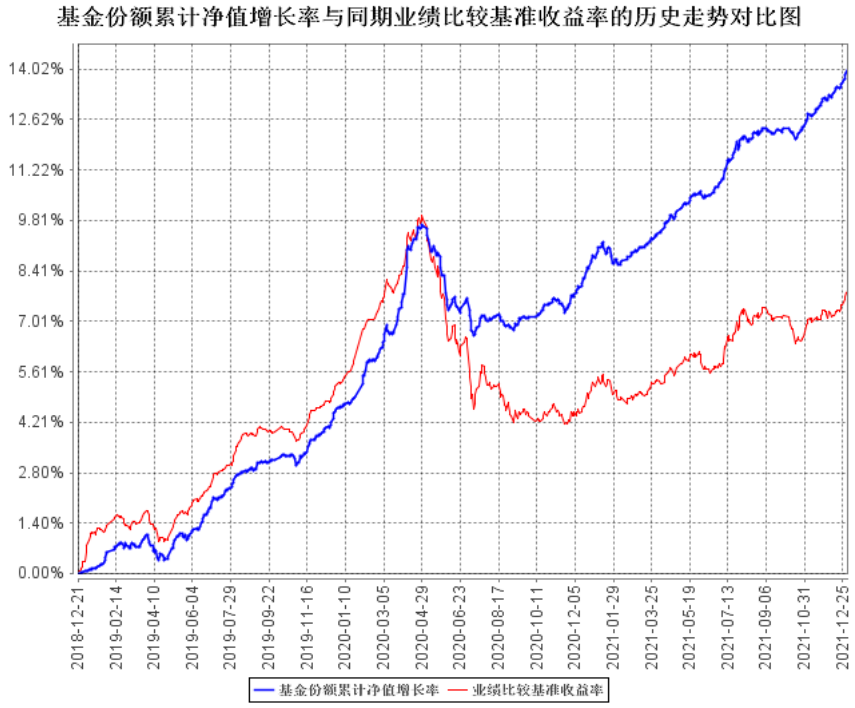
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

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
过去三个月	1.45%	0.05%	0.62%	0.09%	0.83%	-0.04%
过去六个月	2.87%	0.06%	1.92%	0.09%	0.95%	-0.03%
过去一年	4.74%	0.05%	2.40%	0.08%	2.34%	-0.03%
过去三年	13.95%	0.07%	7.49%	0.10%	6.46%	-0.03%
自基金合同生效起至今	14.02%	0.07%	7.85%	0.10%	6.17%	-0.03%

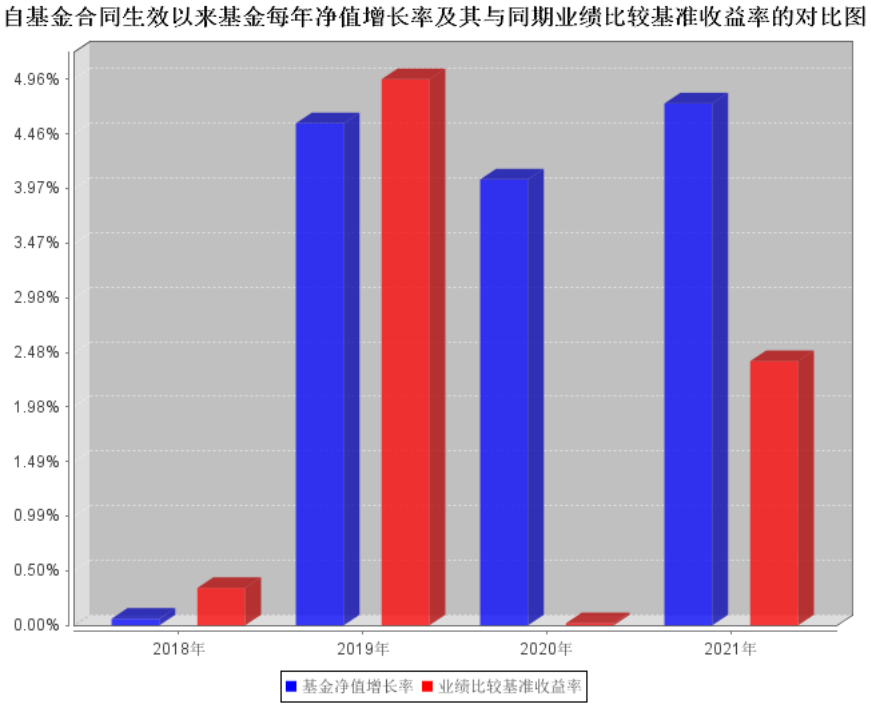
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金持有现金或者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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

本基金建仓期为基金合同生效日（2018 年 12 月 21 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



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
2021	0.3600	205,462,663.52	23,566,089.51	229,028,753.03	
2020	0.2920	148,856,254.99	12,509,819.74	161,366,074.73	
2019	0.3420	49,608,623.82	484.63	49,609,108.45	
合计	0.9940	403,927,542.33	36,076,393.88	440,003,936.21	

§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 12 月 31 日，公司共管理 66 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、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金。

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		
周宇	本基金基金经理	2018 年 12 月 21 日	-	11	历任中国民族证券有限责任公司固定收益部交易员及交易经理、民生加银基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、长城证券股份有限公司固定收益部投资助理及投资主办。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
郭振宇	本基金基金经理、固定收益部副总经理	2019 年 2 月 2 日	-	7	历任中国农业银行股份有限公司金融市场部风险管理、研究及高级交易员岗位，现任农银汇理基金管理有限公司固定收益部副总经理及基金经理。

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

组合主要配置 2-3 年利率债作为底仓，并采用一定程度杠杆运作；同时通过 5-10 年活跃利率债作为组合久期调整的工具，获取资本利得。2021 年，对货币政策变化及宏观经济走势的前瞻性把握，是把握债券市场机会的关键。年初，央行表示资产价格存在局部泡沫，暗示货币政策可能边际收紧，叠加 1 月底资金面异常紧张，债市出现明显调整，组合尽管意识到货币政策有所变化，做了一定程度减仓操作，但对于快速变化的市场仍然应对有限，组合仍遭受了一定程度的回撤；进入二季度，市场对于经济延续增长的预期仍然高涨，但组合认为经济并未有市场预期的好，信

贷需求也开始出现放缓迹象，组合果断增持中长期债券，把握了 7 月份央行降准以来的一波收益率下行行情；下半年组合对债市总体乐观，整体操作变化不大，受益于市场上涨获得净值增长。

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 1.0345 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.74%，业绩比较基准收益率为 2.40%。

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 2022 年，货币政策大概率延续合理充裕的态势，但是否存在进一步宽松机会，需要观察实体经济的恢复情况；同时美联储加息进程的变化也将开始对国内货币政策形成一定制约；通胀是否卷土重来仍有一定概率，也将限制货币政策的宽松程度及债券市场表现。相比于 2021 年，债市的行情预期可能有所降低，预计十年国债收益率波动区间在 2.7%-2.9%；但大级别的调整需要货币政策转向才可能出现，短期概率也不大。

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检查，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

报告期内已实施过四次利润分配，第一次分配方案为每 10 份基金份额派发红利 0.06 元，第二次分配方案为每 10 份基金份额派发红利 0.10 元，第三次分配方案为每 10 份基金份额派发红利 0.10 元，第四次分配方案为每 10 份基金份额派发红利 0.10 元；权益登记日分别为 2021 年 3 月 17 日、2021 年 6 月 22 日、2021 年 9 月 9 日、2021 年 12 月 15 日，共计分配利润 229,028,753.03 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

2021 年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理金禄债券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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 4 次收益分配，分配金额总共为 229,028,753.03 元，符合基金合同的规定。

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

2021 年度，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金禄债券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 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(2022)第 23145 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	农银汇理金禄债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了农银汇理金禄债券型证券投资基金(以下简称“农银金禄债券基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 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。 (二)我们的意见 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,公允反映了农银金禄债券基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于农银金禄债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	农银金禄债券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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银金禄债券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金禄债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督农银金禄债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对农银金禄债券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金禄债券基金不能持续经营。 （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。 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。	
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	2022 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理金禄债券型证券投资基金

报告截止日： 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	4,976,382.43	11,271,132.89
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,739,471,600.00	7,196,225,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,739,471,600.00	7,196,225,000.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	225,205,184.59	121,325,190.07
应收股利		-	-
应收申购款		156,209.24	63,774.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,969,809,376.26	7,328,885,097.07
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,066,896,446.05	1,623,497,867.75
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		32,491.26	34,286.01
应付管理人报酬		1,958,863.58	1,088,118.58
应付托管费		652,954.53	362,706.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	106,216.72	103,152.26
应交税费		-	-
应付利息		1,675,227.52	174,732.89

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	235,200.00	230,000.00
负债合计		2,071,557,399.66	1,625,490,863.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,635,117,142.95	5,576,470,035.57
未分配利润	7.4.7.10	263,134,833.65	126,924,197.82
所有者权益合计		7,898,251,976.60	5,703,394,233.39
负债和所有者权益总计		9,969,809,376.26	7,328,885,097.07

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0345 元，基金份额总额 7,635,117,142.95 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理金禄债券型证券投资基金

本报告期： 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		350,427,857.00	137,491,593.66
1.利息收入		250,721,918.39	212,839,829.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	211,906.73	287,012.36
债券利息收入		250,409,865.23	211,921,206.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		100,146.43	631,610.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,581,404.24	-70,716,730.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	40,581,404.24	-70,716,730.22
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	59,122,449.76	-4,633,803.78
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	2,084.61	2,298.01
减：二、费用		62,184,349.77	41,431,728.63
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	18,450,398.15	15,666,535.77
2．托管费	7.4.10.2.2	6,150,132.71	5,222,178.64

3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	7.4.7.19	207,480.00	306,353.16
5．利息支出		37,077,511.50	19,888,819.13
其中：卖出回购金融资产支出		37,077,511.50	19,888,819.13
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	7.4.7.20	298,827.41	347,841.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		288,243,507.23	96,059,865.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		288,243,507.23	96,059,865.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理金禄债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	5,576,470,035.57	126,924,197.82	5,703,394,233.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	288,243,507.23	288,243,507.23
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）	2,058,647,107.38	76,995,881.63	2,135,642,989.01
其中：1.基金申购款	6,711,940,895.10	204,143,597.89	6,916,084,492.99
2.基金赎回款	-4,653,293,787.72	-127,147,716.26	-4,780,441,503.98
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）	-	-229,028,753.03	-229,028,753.03
五、期末所有者权益（基金净值）	7,635,117,142.95	263,134,833.65	7,898,251,976.60
项目	上年度可比期间 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）	2,288,107,932.80	25,826,302.09	2,313,934,234.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	96,059,865.03	96,059,865.03
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）	3,288,362,102.77	166,404,105.43	3,454,766,208.20
其中：1.基金申购款	7,246,471,468.36	198,172,887.28	7,444,644,355.64
2.基金赎回款	-3,958,109,365.59	-31,768,781.85	-3,989,878,147.44
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）	-	-161,366,074.73	-161,366,074.73
五、期末所有者权益（基金净值）	5,576,470,035.57	126,924,197.82	5,703,394,233.39

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：

程昆	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理金禄债券型证券投资基金(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[2018]第 1565 号《关于准予农银汇理金禄债券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《农银汇理金禄债券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人民币 217,991,773.71 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(2018)第 0789 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理金禄债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 12 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,996,897.45 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,123.74 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》和《农银汇理金禄债券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国债、政策性金融债、地方政府债、中央银行票据、债券回购、定期存款、协议存款、同业存单(主体评级 AAA 级)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规定。本基金不投资于股票等权益类资产。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债国债及政策性银行债指数收益率。

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》、《农银汇理金禄债券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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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。

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卖出回购金融资产款和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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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[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,包括买卖债券的差价收入,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。

(4) 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	4,976,382.43	11,271,132.89
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：	4,976,382.43	11,271,132.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	9,676,281,237.56	9,739,471,600.00	63,190,362.44
	合计	9,676,281,237.56	9,739,471,600.00	63,190,362.44
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,676,281,237.56	9,739,471,600.00	63,190,362.44
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	7,192,157,087.32	7,196,225,000.00	4,067,912.68
	合计	7,192,157,087.32	7,196,225,000.00	4,067,912.68
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,192,157,087.32	7,196,225,000.00	4,067,912.68

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从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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,147.96	14,219.91
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	-	-
应收债券利息	225,198,036.67	121,286,970.18
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	5,999.96	23,999.98
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	225,205,184.59	121,325,190.07

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	106,216.72	103,152.26
合计	106,216.72	103,152.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	235,200.00	230,000.00

合计	235,200.00	230,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,576,470,035.57	5,576,470,035.57
本期申购	6,711,940,895.10	6,711,940,895.10
本期赎回（以“-”号填列）	-4,653,293,787.72	-4,653,293,787.72
- 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	7,635,117,142.95	7,635,117,142.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	6,753,823.45	120,170,374.37	126,924,197.82
本期利润	229,121,057.47	59,122,449.76	288,243,507.23
本期基金份额交易产生的变动数	18,797,100.14	58,198,781.49	76,995,881.63
其中：基金申购款	38,033,015.90	166,110,581.99	204,143,597.89
基金赎回款	-19,235,915.76	-107,911,800.50	-127,147,716.26
本期已分配利润	-229,028,753.03	-	-229,028,753.03
本期末	25,643,228.03	237,491,605.62	263,134,833.65

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	105,977.09	87,440.65
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	-	462.22
其他	105,929.64	199,109.49
合计	211,906.73	287,012.36

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

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖股票差价收入。

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	40,581,404.24	-70,716,730.22
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	40,581,404.24	-70,716,730.22

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	19,790,789,569.21	29,907,853,208.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,508,354,495.76	29,660,992,911.22
减：应收利息总额	241,853,669.21	317,577,027.77
买卖债券差价收入	40,581,404.24	-70,716,730.22

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

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	59,122,449.76	-4,633,803.78

——股票投资	-	-
——债券投资	59,122,449.76	-4,633,803.78
——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	59,122,449.76	-4,633,803.78

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,170.54	2,298.01
转换费收入	914.07	-
合计	2,084.61	2,298.01

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，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	88.16
银行间市场交易费用	207,480.00	306,265.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	207,480.00	306,353.16

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	115,200.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
清算所账户服务费	19,200.00	19,200.00
账户服务费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费	26,327.41	30,641.93
其他	100.00	50,000.00
合计	298,827.41	347,841.93

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

本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 1 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 3 月 2 日止在本基金注册登记人农银汇理基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1100 元。

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金管理人的股东
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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,450,398.15	15,666,535.77
其中：支付销售机构的客户维护费	1,449,384.14	750,510.75

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,150,132.71	5,222,178.64

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	416,900,000.00	25,966.40

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转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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。

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之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
交通银行	4,976,382.43	105,977.09	11,271,132.89	87,440.65

注：本基金的活期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。

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	2021 年 12 月 15 日	-	2021 年 12 月 15 日	0.1000	61,371,246.09	12,548,785.10	73,920,031.19	
2	2021 年 9 月 9 日	-	2021 年 9 月 9 日	0.1000	68,717,780.27	9,526,782.59	78,244,562.86	
3	2021 年 6 月 22 日	-	2021 年 6 月 22 日	0.1000	43,678,218.10	1,485,418.67	45,163,636.77	
4	2021 年 3 月 17 日	-	2021 年 3 月 17 日	0.0600	31,695,419.06	5,103.15	31,700,522.21	
合计	-	-		0.3600	205,462,663.52	23,566,089.51	229,028,753.03	

7.4.12 期末（ 2021 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,066,896,446.05 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180309	18进出09	2022 年 1 月 6 日	102.64	3,160,000	324,342,400.00
180408	18农发08	2022 年 1 月 4 日	102.45	2,500,000	256,125,000.00
200203	20国开03	2022 年 1 月 4 日	101.77	5,260,000	535,310,200.00
210407	21农发07	2022 年 1 月 4 日	99.84	2,960,000	295,526,400.00
210212	21国开12	2022 年 1 月 7 日	100.71	3,160,000	318,243,600.00
210202	21国开02	2022 年 1 月 4 日	100.90	5,560,000	561,004,000.00
合计				22,600,000	2,290,551,600.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末及上年度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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	339,484,000.00	99,850,000.00
合计	339,484,000.00	99,850,000.00

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	9,399,987,600.00	7,096,375,000.00

合计	9,399,987,600.00	7,096,375,000.00

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债。

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2021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	4,976,382.43	-	-	-	4,976,382.43
交易性金融资产	500,035,000.00	6,806,874,000.00	2,432,562,600.00	-	9,739,471,600.00
应收利息	-	-	-	225,205,184.59	225,205,184.59
应收申购款	-	-	-	156,209.24	156,209.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	505,011,382.43	6,806,874,000.00	2,432,562,600.00	225,361,393.83	9,969,809,376.26
负债					
卖出回购金融资产款	2,066,896,446.05	-	-	-	2,066,896,446.05
应付赎回款	-	-	-	32,491.26	32,491.26
应付管理人报酬	-	-	-	1,958,863.58	1,958,863.58
应付托管费	-	-	-	652,954.53	652,954.53
应付交易	-	-	-	106,216.72	106,216.72

费用					
应付利息	-	-	-	1,675,227.52	1,675,227.52
其他负债	-	-	-	235,200.00	235,200.00
负债总计	2,066,896,446.05	-	-	4,660,953.61	2,071,557,399.66
利率敏感度缺口	-1,561,885,063.62	6,806,874,000.00	2,432,562,600.00	220,700,440.22	7,898,251,976.60
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	11,271,132.89	-	-	-	11,271,132.89
交易性金融资产	379,224,000.00	6,152,565,000.00	664,436,000.00	-	7,196,225,000.00
应收利息	-	-	-	121,325,190.07	121,325,190.07
应收申购款	-	-	-	63,774.11	63,774.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	390,495,132.89	6,152,565,000.00	664,436,000.00	121,388,964.18	7,328,885,097.07
负债					
卖出回购金融资产款	1,623,497,867.75	-	-	-	1,623,497,867.75
应付赎回款	-	-	-	34,286.01	34,286.01

应付管理人报酬	-	-	-	1,088,118.58	1,088,118.58
应付托管费	-	-	-	362,706.19	362,706.19
应付交易费用	-	-	-	103,152.26	103,152.26
应付利息	-	-	-	174,732.89	174,732.89
其他负债	-	-	-	230,000.00	230,000.00
负债总计	1,623,497,867.75	-	-	1,992,995.93	1,625,490,863.68
利率敏感度缺口	-1,233,002,734.86	6,152,565,000.00	664,436,000.00	119,395,968.25	5,703,394,233.39

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	收益率曲线平行变化。		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。		
	其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2021 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2020 年 12 月 31 日 ）
	市场利率平行上升 25 个基点	-75,893,127.18	-39,170,889.22
	市场利率平行下降 25 个基点	75,893,127.18	39,170,889.22

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。本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要市场风险为利率风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有股票和权证等权益类资产，因此，本基金本期末及上年度末面临的其他价格风险不重大。

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 2021 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二层次的余额为 9,739,471,600.00 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 7,196,225,000.00 元，无第一或第三层次)。

(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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2021 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(2020 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号－金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号－金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,739,471,600.00	97.69
	其中：债券	9,739,471,600.00	97.69
	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	4,976,382.43	0.05
8	其他各项资产	225,361,393.83	2.26
9	合计	9,969,809,376.26	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	567,863,000.00	7.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,171,608,600.00	116.12
	其中：政策性金融债	9,171,608,600.00	116.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,739,471,600.00	123.31

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200203	20 国开 03	8,400,000	854,868,000.00	10.82
2	210202	21 国开 02	5,900,000	595,310,000.00	7.54
3	190305	19 进出 05	5,500,000	557,810,000.00	7.06
4	200212	20 国开 12	4,300,000	439,116,000.00	5.56
5	210007	21 附息国债 07	4,200,000	426,216,000.00	5.40

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国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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

本基金不投资于股票等权益类资产。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	225,205,184.59
5	应收申购款	156,209.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	225,361,393.83

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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
618	12,354,558.48	7,630,526,392.74	99.94%	4,590,750.21	0.06%

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	54,934.69	0.0007%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2018 年 12 月 21 日 ）基金份额总额	217,996,897.45
本报告期期初基金份额总额	5,576,470,035.57
本报告期基金总申购份额	6,711,940,895.10
减:本报告期基金总赎回份额	4,653,293,787.72
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	7,635,117,142.95

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

本报告期内,根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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。另根据本公司董事会有关决议，原本公司总经理施卫先生自 2021 年 7 月 14 日离任本公司总经理职务，本公司董事长许金超先生代为履行总经理职务；程昆先生自 2021 年 9 月 6 日任职本公司总经理职位，本公司董事长许金超先生不再代为履行总经理职务。

本公司已分别于 2021 年 4 月 30 日、2021 年 6 月 18 日、2021 年 7 月 15 日、2021 年 9 月 7 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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 11.52 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

(1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。

(2)、市场形象及财务状况良好。

(3)、经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

(4)、内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请，集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后，研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价，做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

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例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理金禄债券型证券投资基	上海证券报、管理人	2021 年 12 月 14 日

	金 2021 年分红公告	网站	
2	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 10 月 26 日
3	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2021 年分红公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 9 月 8 日
4	关于农银汇理金禄债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 9 月 6 日
5	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2021 年中期报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 8 月 30 日
6	农银金禄债基-招募说明书更新-2021 年 2 号	上海证券报、管理人网站	2021 年 7 月 23 日
7	农银金禄债基-托管协议-侧袋	上海证券报、管理人网站	2021 年 7 月 23 日
8	农银金禄债基-基金合同-侧袋	上海证券报、管理人网站	2021 年 7 月 23 日
9	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 7 月 20 日
10	农银汇理金禄债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上海证券报、管理人网站	2021 年 6 月 29 日
11	农银金禄债基-招募说明书更新-2021 年 1 号	上海证券报、管理人网站	2021 年 6 月 29 日
12	农银汇理金禄债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 6 月 19 日
13	关于农银金禄债券基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 6 月 17 日
14	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 4 月 21 日

15	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2020 年年度报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 3 月 29 日
16	农银汇理金禄债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 3 月 16 日
17	关于农银金禄债券基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2021 年 3 月 12 日
18	农银汇理金禄债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、管理人网站	2021 年 1 月 21 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、《农银汇理金禄债券型证券投资基金基金合同》；

3、《农银汇理金禄债券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

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。

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

2022 年 3 月 29 日