

# 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证 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：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 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             | 12        |
| 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                | 13        |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>19</b> |
| 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        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>47</b> |
| 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       | 49        |
| 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                    | 53        |
| 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      | 54        |
| 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   | 54        |
| 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   | 54        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 54        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....          | 54        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 54        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                      | 55        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                | <b>56</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 56        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 56        |
| 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 .....  | 56        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>57</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>58</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 58        |
| 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 .....   | 58        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 58        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 58        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 58        |
| 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 .....      | 58        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 58        |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 59        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>61</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 ..... | 61        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 61        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                  | <b>62</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                        | 62        |
| 13.2 存放地点 .....                          | 62        |
| 13.3 查阅方式 .....                          | 62        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金 |
| 基金简称       | 农银中证新华社民族品牌指数           |
| 基金主代码      | 012394                  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                  |
| 基金合同生效日    | 2021 年 10 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      | 浙商银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 432,752,731.22 份        |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。                                                                                                                                                                                                     |
| 投资策略   | <p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证新华社民族品牌工程指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                           |

## 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          | 浙商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 翟爱东                   | 朱巍                |
|         | 联系电话 | 021-61095588          | 0571-87659806     |
|         | 电子邮箱 | lijianfeng@abc-ca.com | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话  |      | 021-61095599          | 95527             |
| 传真      |      | 021-61095556          | 0571-88268688     |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城路9号50层 | 杭州市萧山区鸿宁路1788号    |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城路9号50层 | 杭州市拱墅区延安路368号     |
| 邮政编码    |      | 200120                | 310006            |
| 法定代表人   |      | 许金超                   | 张荣森（代为履行法定代表人职责）  |

因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于2022年1月14日以书面传签方式召开第六届董事会2022年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

## 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 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市延安东路222号外滩中心30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 10 月 8 日<br>(基金合同生效<br>日)-2021 年 12 月<br>31 日 | 2020 年  | 2019 年  |
|---------------|------------------------------------------------------|---------|---------|
| 本期已实现收益       | 3,463,111.41                                         | -       | -       |
| 本期利润          | 8,487,699.93                                         | -       | -       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0169                                               | -       | -       |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.68%                                                | -       | -       |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.32%                                                | -       | -       |
| 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      | 3,244,399.42                                         | -       | -       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0075                                               | -       | -       |
| 期末基金资产净值      | 438,445,642.42                                       | -       | -       |
| 期末基金份额净值      | 1.0132                                               | -       | -       |
| 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   | 1.32%                                                | -       | -       |

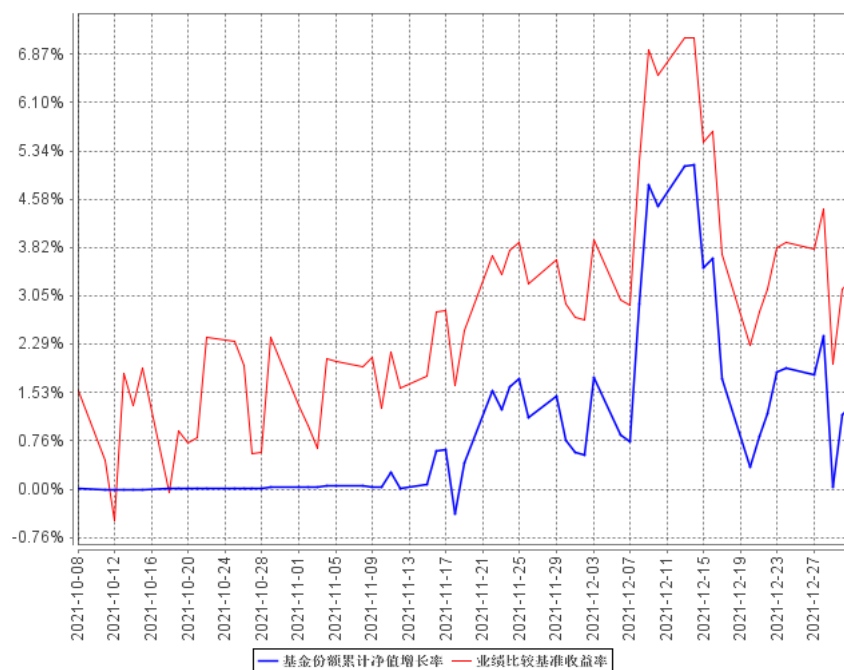
#### 3.2 基金净值表现

##### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.32%        | 0.72%               | 3.30%              | 1.00%                 | -1.98% | -0.28% |

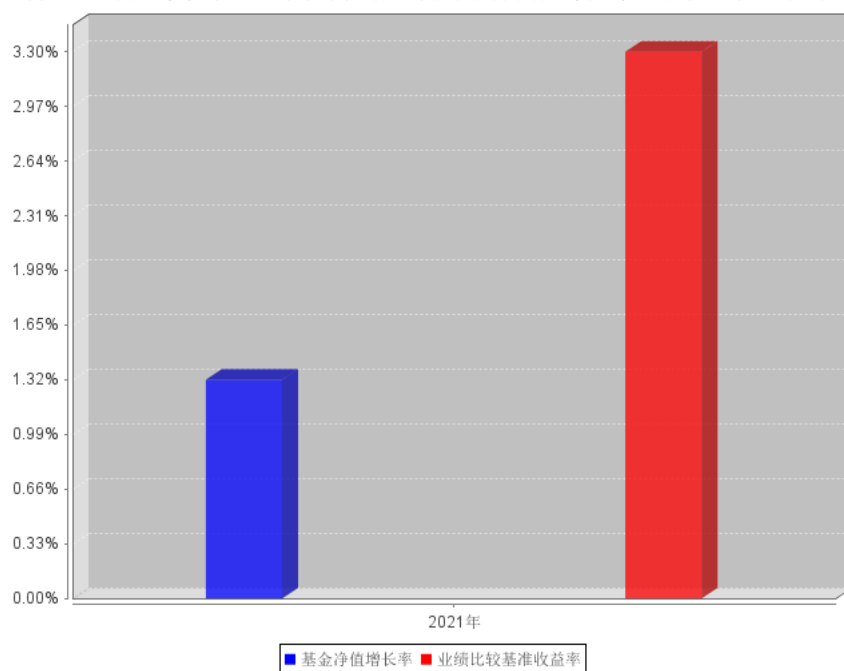
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 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

本基金过去三年无利润分配。

## § 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 |        |                                                                                |
| 宋永安 | 本基金基金经理 | 2021 年 10 月 8 日 | —    | 14     | 硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。 |

#### 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

本报告期内基金处于建仓期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.6778%，日均偏离度为 0.3560%，报告期内跟踪误差和日均偏离度较大是因为本基金尚处于建仓期。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1）标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2）申购赎回的影响；3）成份股票的停牌；4）指数中成份股票的调整；5）基金建仓的影响。

#### 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 1.0132 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.32%，业绩比较基准收益率为 3.30%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证新华社民族品牌工程指数的被动化指数产品，我们将坚持指数被动化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

## 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。

#### **4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金 2021 年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复核，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     | 德师报(审)字(22)第 P00148 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   | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金全体持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计意见      | <p>我们审计了农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。                                                                                                                                                                |
| 其他信息      | <p>农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>                  |



|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资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汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、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汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                    |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <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>(1) 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>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |     |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 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>(4) 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,就可能导致对农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资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汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |     |
| 注册会计师的姓名  | 汪芳                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 叶王昊 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市延安东路 222 号外滩中心 30 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：农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金

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<br>2021 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 9,304,488.23                    |
| 结算备付金           |            | 8,130,320.93                    |
| 存出保证金           |            | 244,495.24                      |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 429,176,289.92                  |
| 其中：股票投资         |            | 416,390,389.92                  |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 12,785,900.00                   |
| 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         |            | 272,885.64                      |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 161,316.08                      |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | 284,333.59                      |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 447,574,129.63                  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 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       |            | 6,600,000.00                    |
| 应付证券清算款         |            | -                               |
| 应付赎回款           |            | 1,475,135.84                    |
| 应付管理人报酬         |            | 396,692.53                      |
| 应付托管费           |            | 39,669.25                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 549,356.74                      |
| 应交税费            |            | -                               |
| 应付利息            |            | 3,957.36                        |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 63,675.49      |
| 负债合计          |          | 9,128,487.21   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 432,752,731.22 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 5,692,911.20   |
| 所有者权益合计       |          | 438,445,642.42 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 447,574,129.63 |

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金份额净值 1.0132 元，基金份额总额 432,752,731.22 份；

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金

本报告期：2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号        | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金<br>合同生效日)至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|------------|---------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      |            | 10,584,821.00                                           |
| 1.利息收入           |            | 874,793.94                                              |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.11   | 113,301.86                                              |
| 债券利息收入           |            | 85,549.51                                               |
| 资产支持证券利息收入       |            | -                                                       |
| 买入返售金融资产收入       |            | 675,942.57                                              |
| 证券出借利息收入         |            | -                                                       |
| 其他利息收入           |            | -                                                       |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |            | 4,166,767.77                                            |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.12   | 4,141,601.73                                            |
| 基金投资收益           |            | -                                                       |
| 债券投资收益           | 7.4.7.13   | 17,297.04                                               |
| 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   | 7,869.00                                                |
| 3.公允价值变动收益（损失以   | 7.4.7.17   | 5,024,588.52                                            |

|                            |            |              |
|----------------------------|------------|--------------|
| “-”号填列)                    |            |              |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |            | -            |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)          | 7.4.7.18   | 518,670.77   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,097,121.07 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,165,746.07 |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 116,574.63   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -            |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 705,847.20   |
| 5. 利息支出                    |            | 18,553.17    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 18,553.17    |
| 6. 税金及附加                   |            | -            |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 90,400.00    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |            | 8,487,699.93 |
| 减：所得税费用                    |            | -            |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |            | 8,487,699.93 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金

本报告期：2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)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)                   | 540,437,937.85                                   | 0.00          | 540,437,937.85  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -                                                | 8,487,699.93  | 8,487,699.93    |
| 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) | -107,685,206.63                                  | -2,794,788.73 | -110,479,995.36 |
| 其中：1. 基金申购款                       | 17,752,464.88                                    | 323,549.54    | 18,076,014.42   |
| 2. 基金赎回款                          | -125,437,671.51                                  | -3,118,338.27 | -128,556,009.78 |
| 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) | 432,752,731.22 | 5,692,911.20 | 438,445,642.42 |

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：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>程昆</u> | <u>毕宏燕</u> | <u>丁煜琮</u> |
| 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

农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金(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》、《农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2021]1527 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 540,437,937.85 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(21)第 00500 号验资报告。基金合同于 2021 年 10 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、最新适用的基金合同及《农银汇理中证新华社民族品牌工程指数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,以中证新华社民族品牌工程指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:投资于中证新华社民族品牌工程指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证新华社民族品牌工程指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

## 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。

## 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

—

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款和应收款项。

## 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或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。贷款和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。

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，贷款和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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体



具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票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，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 0%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去

每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- 4) 每一基金份额享有同等分配权；
- 5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

## 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 9,304,488.23            | —                        |
| 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：            | 9,304,488.23            | —                        |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |               |
|---------------|-------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 411,363,476.16          | 416,390,389.92 | 5,026,913.76  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                       | —              | —             |
| 债券            | 交易所市场                   | 12,788,225.24  | 12,785,900.00 |
|               | 银行间市场                   | —              | —             |
|               | 合计                      | 12,788,225.24  | 12,785,900.00 |
|               |                         |                | -2,325.24     |
|               |                         |                | —             |
|               |                         |                | -2,325.24     |

|               |                          |                |              |
|---------------|--------------------------|----------------|--------------|
| 资产支持证券        | -                        | -              | -            |
| 基金            | -                        | -              | -            |
| 其他            | -                        | -              | -            |
| 合计            | 424,151,701.40           | 429,176,289.92 | 5,024,588.52 |
| 项目            | 上年度末<br>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                    | -              | -            |
|               | 合计                       | -              | -            |
| 资产支持证券        | -                        | -              | -            |
| 基金            | -                        | -              | -            |
| 其他            | -                        | -              | -            |
| 合计            | -                        | -              | -            |

#### 7.4.7.3 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。

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,113.23                | -                        |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 3,658.60                | -                        |
| 应收债券利息     | 156,434.25              | -                        |
| 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       | 110.00     | - |
| 合计       | 161,316.08 | - |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 549,356.74              | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 549,356.74              | -                        |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 3,675.49                | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 60,000.00               | -                        |
| 合计          | 63,675.49               | -                        |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|--------------------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                          | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 540,437,937.85                                   | 540,437,937.85  |
| 本期申购          | 17,752,464.88                                    | 17,752,464.88   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -125,437,671.51                                  | -125,437,671.51 |
| - 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           | 432,752,731.22                                   | 432,752,731.22  |



注：1、本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

2、本基金基金合同于 2021 年 10 月 8 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 540,267,431.73 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 170,506.12 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 540,437,937.85 元，折合 540,437,937.85 份基金份额。

#### 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       |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -            | -             | -             |
| 本期利润           | 3,463,111.41 | 5,024,588.52  | 8,487,699.93  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -218,711.99  | -2,576,076.74 | -2,794,788.73 |
| 其中：基金申购款       | 91,247.27    | 232,302.27    | 323,549.54    |
| 基金赎回款          | -309,959.26  | -2,808,379.01 | -3,118,338.27 |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 3,244,399.42 | 2,448,511.78  | 5,692,911.20  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 90,835.57                                        | -                                           |
| 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 | 22,136.32                                        | -                                           |
| 其他        | 329.97                                           | -                                           |
| 合计        | 113,301.86                                       | -                                           |

#### 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<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|----------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 101,356,605.38                                   | -                                           |

|            |               |   |
|------------|---------------|---|
| 减：卖出股票成本总额 | 97,215,003.65 | - |
| 买卖股票差价收入   | 4,141,601.73  | - |

### 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<br>2021年10月8日(基金合<br>同生效日)至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>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 | 17,297.04                                 | -                                    |
| 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                            | 17,297.04                                 | -                                    |

#### 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<br>2021年10月8日(基金合<br>同生效日)至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|-------------------------|-------------------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 27,414,669.78                             | -                                    |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 27,180,907.86                             | -                                    |
| 减：应收利息总额                | 216,464.88                                | -                                    |
| 买卖债券差价收入                | 17,297.04                                 | -                                    |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期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<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 7,869.00                                         | -                                           |
| 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            | 7,869.00                                         | -                                           |

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------|----|---------|
|------|----|---------|

|                        | 2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--------------------------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 5,024,588.52                               | -                                |
| ——股票投资                 | 5,026,913.76                               | -                                |
| ——债券投资                 | -2,325.24                                  | -                                |
| ——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                     | 5,024,588.52                               | -                                |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 476,646.45                                       | -                                           |
| 其他      | 42,024.32                                        | -                                           |
| 合计      | 518,670.77                                       | -                                           |

注：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。其中对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 25% 归入基金财产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 705,847.20                                       | -                                           |
| 银行间市场交易费用 | -                                                | -                                           |

|    |            |   |
|----|------------|---|
| 合计 | 705,847.20 | - |
|----|------------|---|

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效<br>日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12<br>月 31 日 |
|---------|------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 审计费用    | 60,000.00                                            | -                                              |
| 信息披露费   | 30,000.00                                            | -                                              |
| 证券出借违约金 | -                                                    | -                                              |
| 其他      | 400.00                                               | -                                              |
| 合计      | 90,400.00                                            | -                                              |

#### 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(以下简称“农银汇理”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| 东方汇理资产管理公司(以下简称“东方汇理”)   | 基金管理人的股东            |
| 中铝资本控股有限公司(以下简称“中铝”)     | 基金管理人的股东            |

|              |           |
|--------------|-----------|
| 资本” )        |           |
| 农银汇理资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

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<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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  | 1,165,746.07                                     | —                                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 571,351.19                                       | —                                           |

注：支付基金管理人农银汇理的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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 | 116,574.63                                       | -                                           |

注：支付基金托管人浙商银行的基金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：日基金托管费=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**

本基金本报告期内未发生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**

本基金本报告期内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。

**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**

本基金本报告期内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。

**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**

本报告期内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<br>2021 年 10 月 8 日(基金合同生效日)至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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 |
|------|--------------|-----------|------|--------|
| 浙商银行 | 9,304,488.23 | 90,835.57 | -    | -      |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

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 |
| 688176               | 亚虹医药 | 2021 年 12 月 29 日 | 2022 年 1 月 7 日  | 新股流通受限 | 22.98 | 22.98  | 8,593    | 197,467.14 | 197,467.14 | -  |
| 001234               | 泰慕士  | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53 | 16.53  | 333      | 5,504.49   | 5,504.49   | -  |

##### 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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购



证券款余额 6,600,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

|        |               |   |
|--------|---------------|---|
| A-1    | —             | — |
| A-1 以下 | —             | — |
| 未评级    | 12,785,900.00 | — |
| 合计     | 12,785,900.00 | — |

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

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

#### 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<br>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                     | 9,304,488.23  | -     | -     | -              | 9,304,488.23   |
| 结算备付金                    | 8,130,320.93  | -     | -     | -              | 8,130,320.93   |
| 存出保证金                    | 244,495.24    | -     | -     | -              | 244,495.24     |
| 交易性金融资产                  | 12,785,900.00 | -     | -     | 416,390,389.92 | 429,176,289.92 |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -     | 272,885.64     | 272,885.64     |
| 应收利息                     | -             | -     | -     | 161,316.08     | 161,316.08     |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 284,333.59     | 284,333.59     |
| 资产总计                     | 30,465,204.40 | -     | -     | 417,108,925.23 | 447,574,129.63 |
| 负债                       |               |       |       |                |                |
| 卖出回购金融资产款                | 6,600,000.00  | -     | -     | -              | 6,600,000.00   |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 1,475,135.84   | 1,475,135.84   |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 396,692.53     | 396,692.53     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 39,669.25      | 39,669.25      |
| 应付交易费用                   | -             | -     | -     | 549,356.74     | 549,356.74     |
| 应付利息                     | -             | -     | -     | 3,957.36       | 3,957.36       |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 63,675.49      | 63,675.49      |
| 负债总计                     | 6,600,000.00  | -     | -     | 2,528,487.21   | 9,128,487.21   |
| 利率敏感度缺口                  | 23,865,204.40 | -     | -     | 414,580,438.02 | 438,445,642.42 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                       |               |       |       |                |                |
| 资产总计                     | -             | -     | -     | -              | -              |
| 负债                       |               |       |       |                |                |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | -              | -              |
| 利率敏感度缺                   | -             | -     | -     | -              | -              |

|   |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|
| □ |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|

注：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。

#### 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<br>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       | -14,006.51                      | -                      |
|    | 市场利率平行下降 25 个基点       | 14,006.51                       |                        |

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 |              | 上年度末<br>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 | 416,390,389.92          | 94.97        | -                        | -            |
| 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            | 416,390,389.92 | 94.97 | — | — |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至本期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本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) 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银行存款、应收账款和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 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的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 416,187,418.29 元，第二层次的余额为人民币 12,988,871.63 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金分别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或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会[2017]7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会[2017]8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会[2017]9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会[2017]14 号)(以下简称“新金融工具准则”)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号)等新金融工具相关会计准则及规定,本基金自 2022 年 1 月 1 日起开始执行新金融工具准则。

经评估,新金融工具准则预期不会对本基金财务报表产生重大影响。

(3) 除公允价值和新金融工具准则外,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              | 416,390,389.92 | 93.03         |
|    | 其中：股票             | 416,390,389.92 | 93.03         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 12,785,900.00  | 2.86          |
|    | 其中：债券             | 12,785,900.00  | 2.86          |
|    | 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      | 17,434,809.16  | 3.90          |
| 8  | 其他各项资产            | 963,030.55     | 0.22          |
| 9  | 合计                | 447,574,129.63 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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              | 340,592,883.19 | 77.68         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -             |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 4,783,947.00   | 1.09          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | 1,441,560.00   | 0.33          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,999,891.00  | 3.42          |
| J  | 金融业              | 16,495,395.00  | 3.76          |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 11,519,025.00  | 2.63          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 14,244,036.00  | 3.25          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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       | 8,537,925.40   | 1.95  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 3,507,420.00   | 0.80  |
| S | 综合            | —              | —     |
|   | 合计            | 416,122,082.59 | 94.91 |

### 8.2.2 期末积极投资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              | 222,495.51 | 0.05         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —          | —            |
| E  | 建筑业              | 4,713.80   | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 41,098.02  | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —          | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —          | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —          | —            |
| 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       | —          | —            |
| 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               | 268,307.33 | 0.06         |

### 8.2.3 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****8.3.1 期末指数投资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  | 600519 | 贵州茅台  | 21,104    | 43,263,200.00 | 9.87         |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 63,200    | 37,161,600.00 | 8.48         |
| 3  | 000858 | 五粮液   | 104,300   | 23,223,438.00 | 5.30         |
| 4  | 300059 | 东方财富  | 444,500   | 16,495,395.00 | 3.76         |
| 5  | 002415 | 海康威视  | 250,900   | 13,127,088.00 | 2.99         |
| 6  | 603259 | 药明康德  | 110,200   | 13,067,516.00 | 2.98         |
| 7  | 002475 | 立讯精密  | 265,200   | 13,047,840.00 | 2.98         |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药  | 240,700   | 12,205,897.00 | 2.78         |
| 9  | 601888 | 中国中免  | 52,500    | 11,519,025.00 | 2.63         |
| 10 | 600887 | 伊利股份  | 275,200   | 11,409,792.00 | 2.60         |
| 11 | 000568 | 泸州老窖  | 39,400    | 10,002,478.00 | 2.28         |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗  | 26,100    | 9,938,880.00  | 2.27         |
| 13 | 000651 | 格力电器  | 254,400   | 9,420,432.00  | 2.15         |
| 14 | 603501 | 韦尔股份  | 28,000    | 8,701,560.00  | 1.98         |
| 15 | 600809 | 山西汾酒  | 26,200    | 8,273,436.00  | 1.89         |
| 16 | 000725 | 京东方 A | 1,613,100 | 8,146,155.00  | 1.86         |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能  | 60,900    | 7,197,162.00  | 1.64         |
| 18 | 603288 | 海天味业  | 67,900    | 7,136,969.00  | 1.63         |
| 19 | 600436 | 片仔癀   | 16,200    | 7,081,830.00  | 1.62         |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科  | 145,330   | 6,144,552.40  | 1.40         |
| 21 | 600690 | 海尔智家  | 203,500   | 6,082,615.00  | 1.39         |
| 22 | 688981 | 中芯国际  | 104,300   | 5,526,857.00  | 1.26         |
| 23 | 300122 | 智飞生物  | 43,000    | 5,357,800.00  | 1.22         |
| 24 | 002230 | 科大讯飞  | 98,900    | 5,193,239.00  | 1.18         |
| 25 | 002129 | 中环股份  | 121,600   | 5,076,800.00  | 1.16         |
| 26 | 603986 | 兆易创新  | 28,700    | 5,046,895.00  | 1.15         |
| 27 | 002371 | 北方华创  | 14,100    | 4,892,982.00  | 1.12         |
| 28 | 000661 | 长春高新  | 17,400    | 4,722,360.00  | 1.08         |
| 29 | 300782 | 卓胜微   | 12,600    | 4,117,680.00  | 0.94         |
| 30 | 600570 | 恒生电子  | 62,820    | 3,904,263.00  | 0.89         |
| 31 | 002311 | 海大集团  | 44,600    | 3,269,180.00  | 0.75         |
| 32 | 600196 | 复星医药  | 64,900    | 3,176,206.00  | 0.72         |
| 33 | 000895 | 双汇发展  | 93,100    | 2,937,305.00  | 0.67         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 34 | 000538 | 云南白药 | 27,500  | 2,877,875.00 | 0.66 |
| 35 | 688111 | 金山办公 | 10,000  | 2,650,000.00 | 0.60 |
| 36 | 300896 | 爱美客  | 4,700   | 2,519,717.00 | 0.57 |
| 37 | 600763 | 通策医疗 | 12,027  | 2,393,373.00 | 0.55 |
| 38 | 300413 | 芒果超媒 | 40,200  | 2,300,244.00 | 0.52 |
| 39 | 300601 | 康泰生物 | 22,200  | 2,187,588.00 | 0.50 |
| 40 | 600760 | 中航沈飞 | 31,600  | 2,150,064.00 | 0.49 |
| 41 | 300454 | 深信服  | 11,200  | 2,139,200.00 | 0.49 |
| 42 | 600584 | 长电科技 | 67,000  | 2,078,340.00 | 0.47 |
| 43 | 688008 | 澜起科技 | 24,400  | 2,046,428.00 | 0.47 |
| 44 | 600600 | 青岛啤酒 | 19,100  | 1,890,900.00 | 0.43 |
| 45 | 603486 | 科沃斯  | 12,300  | 1,856,685.00 | 0.42 |
| 46 | 000876 | 新希望  | 121,100 | 1,841,931.00 | 0.42 |
| 47 | 300285 | 国瓷材料 | 43,200  | 1,839,024.00 | 0.42 |
| 48 | 603369 | 今世缘  | 33,700  | 1,833,280.00 | 0.42 |
| 49 | 000938 | 紫光股份 | 76,900  | 1,757,165.00 | 0.40 |
| 50 | 688012 | 中微公司 | 13,300  | 1,683,780.00 | 0.38 |
| 51 | 600085 | 同仁堂  | 36,900  | 1,659,762.00 | 0.38 |
| 52 | 600298 | 安琪酵母 | 26,900  | 1,623,684.00 | 0.37 |
| 53 | 600862 | 中航高科 | 44,900  | 1,605,624.00 | 0.37 |
| 54 | 002841 | 视源股份 | 17,900  | 1,457,060.00 | 0.33 |
| 55 | 603833 | 欧派家居 | 9,800   | 1,445,500.00 | 0.33 |
| 56 | 600754 | 锦江酒店 | 24,600  | 1,441,560.00 | 0.33 |
| 57 | 300529 | 健帆生物 | 26,000  | 1,385,800.00 | 0.32 |
| 58 | 603517 | 绝味食品 | 19,855  | 1,356,692.15 | 0.31 |
| 59 | 600332 | 白云山  | 37,800  | 1,292,760.00 | 0.29 |
| 60 | 300308 | 中际旭创 | 30,100  | 1,279,250.00 | 0.29 |
| 61 | 601607 | 上海医药 | 62,000  | 1,231,940.00 | 0.28 |
| 62 | 300144 | 宋城演艺 | 84,300  | 1,207,176.00 | 0.28 |
| 63 | 000423 | 东阿阿胶 | 24,600  | 1,199,250.00 | 0.27 |
| 64 | 300676 | 华大基因 | 13,400  | 1,176,520.00 | 0.27 |
| 65 | 600872 | 中炬高新 | 30,000  | 1,139,100.00 | 0.26 |
| 66 | 600771 | 广誉远  | 26,400  | 1,136,784.00 | 0.26 |
| 67 | 603605 | 珀莱雅  | 5,400   | 1,124,874.00 | 0.26 |
| 68 | 600845 | 宝信软件 | 18,300  | 1,113,189.00 | 0.25 |
| 69 | 002507 | 涪陵榨菜 | 28,600  | 1,081,080.00 | 0.25 |
| 70 | 300558 | 贝达药业 | 13,400  | 1,069,722.00 | 0.24 |
| 71 | 600521 | 华海药业 | 48,100  | 1,041,846.00 | 0.24 |
| 72 | 688126 | 沪硅产业 | 40,000  | 1,032,800.00 | 0.24 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 73  | 002557 | 洽洽食品 | 16,400  | 1,006,304.00 | 0.23 |
| 74  | 688396 | 华润微  | 14,300  | 923,780.00   | 0.21 |
| 75  | 002508 | 老板电器 | 25,500  | 918,510.00   | 0.21 |
| 76  | 600655 | 豫园股份 | 83,600  | 861,080.00   | 0.20 |
| 77  | 002024 | 苏宁易购 | 200,300 | 825,236.00   | 0.19 |
| 78  | 600859 | 王府井  | 30,453  | 822,231.00   | 0.19 |
| 79  | 688363 | 华熙生物 | 5,200   | 807,560.00   | 0.18 |
| 80  | 601933 | 永辉超市 | 195,100 | 790,155.00   | 0.18 |
| 81  | 600535 | 天士力  | 48,800  | 773,480.00   | 0.18 |
| 82  | 600315 | 上海家化 | 18,300  | 739,503.00   | 0.17 |
| 83  | 603195 | 公牛集团 | 4,200   | 702,660.00   | 0.16 |
| 84  | 603858 | 步长制药 | 30,700  | 647,463.00   | 0.15 |
| 85  | 603866 | 桃李面包 | 20,500  | 582,200.00   | 0.13 |
| 86  | 002032 | 苏泊尔  | 8,700   | 541,488.00   | 0.12 |
| 87  | 600597 | 光明乳业 | 37,100  | 538,692.00   | 0.12 |
| 88  | 600305 | 恒顺醋业 | 32,300  | 515,185.00   | 0.12 |
| 89  | 600329 | 中新药业 | 15,400  | 483,714.00   | 0.11 |
| 90  | 002216 | 三全食品 | 23,600  | 476,956.00   | 0.11 |
| 91  | 600398 | 海澜之家 | 69,800  | 447,418.00   | 0.10 |
| 92  | 002867 | 周大生  | 23,600  | 419,608.00   | 0.10 |
| 93  | 002242 | 九阳股份 | 16,500  | 382,800.00   | 0.09 |
| 94  | 688019 | 安集科技 | 1,400   | 382,480.00   | 0.09 |
| 95  | 002563 | 森马服饰 | 43,500  | 336,255.00   | 0.08 |
| 96  | 600612 | 老凤祥  | 6,800   | 311,780.00   | 0.07 |
| 97  | 600623 | 华谊集团 | 30,400  | 276,640.00   | 0.06 |
| 98  | 300783 | 三只松鼠 | 6,500   | 253,305.00   | 0.06 |
| 99  | 000869 | 张裕 A | 7,264   | 231,431.04   | 0.05 |
| 100 | 300894 | 火星人  | 2,200   | 108,174.00   | 0.02 |

### 8.3.2 期末积极投资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  | 688176 | 亚虹医药 | 8,593 | 197,467.14 | 0.05         |
| 2  | 603071 | 物产环能 | 1,627 | 41,098.02  | 0.01         |
| 3  | 603216 | 梦天家居 | 772   | 19,523.88  | 0.00         |
| 4  | 001234 | 泰慕士  | 333   | 5,504.49   | 0.00         |
| 5  | 603176 | 汇通集团 | 1,924 | 4,713.80   | 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代  | 54,971,060.13 | 12.54          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 49,582,259.86 | 11.31          |
| 3  | 000858 | 五粮液   | 25,125,254.00 | 5.73           |
| 4  | 300059 | 东方财富  | 17,889,681.16 | 4.08           |
| 5  | 603259 | 药明康德  | 16,680,609.00 | 3.80           |
| 6  | 600887 | 伊利股份  | 15,744,925.25 | 3.59           |
| 7  | 002415 | 海康威视  | 15,029,792.12 | 3.43           |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药  | 14,740,086.85 | 3.36           |
| 9  | 300760 | 迈瑞医疗  | 14,109,006.34 | 3.22           |
| 10 | 601888 | 中国中免  | 13,902,572.00 | 3.17           |
| 11 | 002475 | 立讯精密  | 12,715,864.33 | 2.90           |
| 12 | 000651 | 格力电器  | 10,720,710.00 | 2.45           |
| 13 | 000568 | 泸州老窖  | 10,063,566.00 | 2.30           |
| 14 | 603288 | 海天味业  | 9,339,514.10  | 2.13           |
| 15 | 000725 | 京东方 A | 9,319,761.00  | 2.13           |
| 16 | 600809 | 山西汾酒  | 9,181,054.00  | 2.09           |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能  | 9,080,986.00  | 2.07           |
| 18 | 603501 | 韦尔股份  | 8,776,449.00  | 2.00           |
| 19 | 600436 | 片仔癀   | 8,249,817.00  | 1.88           |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科  | 8,115,358.20  | 1.85           |

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 15,030,451.00 | 3.43           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 14,131,346.00 | 3.22           |
| 3  | 600406 | 国电南瑞 | 7,085,198.00  | 1.62           |
| 4  | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,378,673.00  | 1.00           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 5  | 600887 | 伊利股份  | 4,211,076.00 | 0.96 |
| 6  | 000858 | 五粮液   | 3,926,437.00 | 0.90 |
| 7  | 300059 | 东方财富  | 2,582,857.59 | 0.59 |
| 8  | 603259 | 药明康德  | 2,165,055.36 | 0.49 |
| 9  | 002415 | 海康威视  | 2,058,579.00 | 0.47 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药  | 1,929,513.20 | 0.44 |
| 11 | 002475 | 立讯精密  | 1,905,216.00 | 0.43 |
| 12 | 601888 | 中国中免  | 1,820,438.21 | 0.42 |
| 13 | 300003 | 乐普医疗  | 1,695,740.00 | 0.39 |
| 14 | 000651 | 格力电器  | 1,626,658.00 | 0.37 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖  | 1,547,562.00 | 0.35 |
| 16 | 603160 | 汇顶科技  | 1,507,101.00 | 0.34 |
| 17 | 600809 | 山西汾酒  | 1,374,527.00 | 0.31 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能  | 1,310,358.00 | 0.30 |
| 19 | 603501 | 韦尔股份  | 1,307,244.00 | 0.30 |
| 20 | 000725 | 京东方 A | 1,278,664.00 | 0.29 |

#### 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 | 508,578,479.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 101,356,605.38 |

#### 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      | 12,785,900.00 | 2.92         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | —             | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —             | —            |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 12,785,900.00 | 2.92         |

**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  | 019658 | 21 国债 10 | 98,000 | 9,785,300.00 | 2.23         |
| 2  | 019649 | 21 国债 01 | 30,000 | 3,000,600.00 | 0.68         |

**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**

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -    |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | 0.00 |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | 0.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | 0.00 |

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

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。

### 8.12.2 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   | 244,495.24 |
| 2  | 应收证券清算款 | 272,885.64 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 161,316.08 |
| 5  | 应收申购款   | 284,333.59 |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 963,030.55 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 688176 | 亚虹医药 | 197,467.14  | 0.05          | 新股流通受限   |
| 2  | 001234 | 泰慕士  | 5,504.49    | 0.00          | 新股流通受限   |

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 21,728       | 19,916.82     | 5,365,133.18 | 1.24%      | 427,387,598.04 | 98.76%     |

### 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 | 65,349.80 | 0.0151%  |

### 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（2021 年 10 月 8 日）基金份额总额     | 540,437,937.85 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 17,752,464.88  |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 125,437,671.51 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 432,752,731.22 |

## § 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 3 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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |   |
|------|----|----------------|----------------------|------------|----------------|---|
| 广发证券 | 2  | 517,444,459.29 | 84.87%               | 481,896.95 | 87.72%         | - |
| 东方证券 | 2  | 92,246,279.21  | 15.13%               | 67,459.79  | 12.28%         | - |
| 国盛证券 | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 华鑫证券 | 1  | -              | -                    | -          | -              | - |
| 西南证券 | 2  | -              | -                    | -          | -              | - |

### 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额             | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证<br>成交总额<br>的比例 |
| 广发证券 | 62,371,178.00 | 92.86%               | 2,250,700,000.00 | 99.14%                     | -    | -                        |
| 东方证券 | 4,796,160.00  | 7.14%                | 19,600,000.00    | 0.86%                      | -    | -                        |
| 国盛证券 | -             | -                    | -                | -                          | -    | -                        |
| 华鑫证券 | -             | -                    | -                | -                          | -    | -                        |
| 西南证券 | -             | -                    | -                | -                          | -    | -                        |

### 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  | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告   | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 11 月 5 日 |
| 2  | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金基金合同生效公告               | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 10 月 9 日 |
| 3  | 农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金延长募集期的公告 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 9 月 18 日 |
| 4  | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金-基金产品资料概要              | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 8 月 20 日 |
| 5  | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金-发售公告                  | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 8 月 20 日 |
| 6  | 农银汇理中证新华社民族品牌工                                | 中国证券报、基金管     | 2021 年 8 月 20 日 |

|   |                          |               |                 |
|---|--------------------------|---------------|-----------------|
|   | 程指数基金-招募说明书              | 理人网站          |                 |
| 7 | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数基金-托管协议 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 8 月 20 日 |
| 8 | 农银汇理中证新华社民族品牌工程指数基金-基金合同 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2021 年 8 月 20 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、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证新华社民族品牌工程指数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

2022 年 3 月 29 日