

农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 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。本中期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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	39

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	农银睿选混合
基金主代码	005815
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 25 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	34,271,698.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握中国经济发展和行业转型过程中的投资机遇，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，分享中国经济快速增长的成果，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。具体投资策略分为三个层次：首先是“自上而下”的大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是资产的行业配置，即根据经济周期变动和驱动主题轮动的内在逻辑，在经济周期的不同阶段，配置不同的行业；最后是“自下而上”的个股选择策略和个券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	阮劲松
	联系电话	021-61095588	022-58316243
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95541/4008888811
传真		021-61095556	022-58314791
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	天津市河东区海河东路 218 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	天津市河东区海河东路 218 号
邮政编码		200120	300012
法定代表人		黄涛	李伏安

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,685,982.17
本期利润	104,809.34
加权平均基金份额本期利润	0.0028
本期加权平均净值利润率	0.12%
本期基金份额净值增长率	0.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	44,196,583.68
期末可供分配基金份额利润	1.2896
期末基金资产净值	78,468,282.26
期末基金份额净值	2.2896
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	128.96%

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

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

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

3.2 基金净值表现

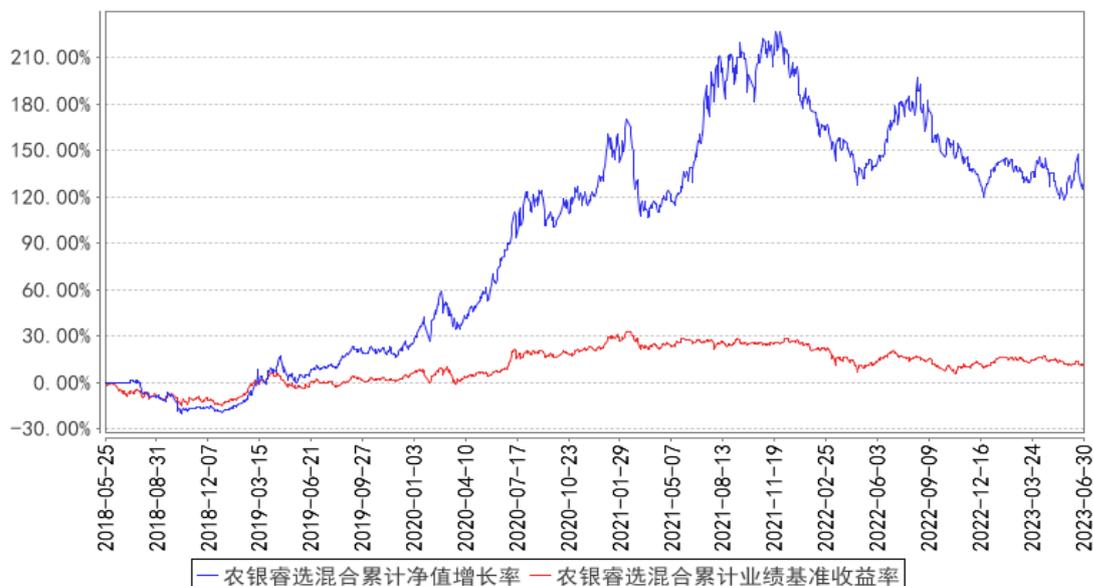
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.75%	1.81%	0.62%	0.55%	-1.37%	1.26%
过去三个月	-3.42%	1.64%	-2.71%	0.52%	-0.71%	1.12%

过去六个月	0.11%	1.31%	1.13%	0.52%	-1.02%	0.79%
过去一年	-14.42%	1.44%	-6.69%	0.61%	-7.73%	0.83%
过去三年	20.59%	1.68%	1.82%	0.75%	18.77%	0.93%
自基金合同生效起至今	128.96%	1.59%	11.78%	0.82%	117.18%	0.77%

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

农银睿选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于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。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成立日起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2023 年 6 月 30 日, 公司共管理 75 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、农

银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金。

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		
凌晨	本基金的基金经理	2021 年 5 月 11 日	-	16 年	历任国信证券股份有限公司研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、基金经理，财通证券资产管理有限公司权益研究部研究总监。现任农银汇理基金管理有限公司投资理财部总经理、投资经理、基金经理。
张燕	本基金的基金经理	2021 年 2 月 24 日	-	12 年	硕士。历任南京东大移动互联有限公司程序员、国金证券股份有限公司传媒研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

3、张燕女士于 2023 年 7 月 15 日离任本基金基金经理，廖凌先生于 2023 年 7 月 18 日起担任本基金基金经理，凌晨先生于 2023 年 7 月 24 日离任本基金基金经理，上述基金经理变更情况基金管理人已在指定媒体及公司网站进行了公告。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
凌晨	公募基金	1	78,468,282.26	2021 年 5 月 11 日
	私募资产管理计划	1	12,573,888,238.90	2019 年 11 月 8 日

	其他组合	-	-	-
	合计	2	12,652,356,521.16	-

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，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度 A 股市场最重要的变化是宏观经济预期“由强转弱”。年初至春节前，经济复苏体现为“强预期”，叠加北上资金大幅流入，市场整体上涨；春节后至 3 月末，经济复苏遭遇“强预期、弱现实”，增量资金流入放缓，存量博弈格局下指数震荡、轮动加速；但与此同时，海外人工智能产业趋势加速，主题行情活跃，市场活跃度增加。

进入二季度，经济和政策力度继续弱于预期，博弈顺周期的资金持续流出，A 股市场在低风险偏好下整体表现不佳。4 月中下旬至 2 季度末，信贷数据偏弱、通胀继续回落、库存周期加速去化，显示经济短期从低基数中爬出后内生动能不足，Q2 宏观和中观数据大多不及预期；而在逆周期政策刺激预期落空后，不乏有投资者担忧通缩、资产负债表衰退等中长期问题。此外，人民币汇率加速贬值、海外加息和银行危机等利空不断，对 A 股整体风险偏好亦有扰动，导致二季度海外资金阶段性流出中国市场。

在相对“混沌”的基本面及政策预期之下，二季度 A 股的市场风格关键词体现为“博弈”和“轮动”。A 股增量资金有限、资金存量博弈甚至是减量博弈，行业和主题轮动剧烈，机构“赚钱效应”较弱。从宽基指数来看，最为抗跌的是“中特估”相关的红利指数，领跌的是机构持仓比例较高的创业板指；从板块表现来看，AI 相关的算力（通信）和应用（传媒）、人形机器人相关的机械设备、煤价下跌受益的火电等行业领涨，而外资偏好的食品饮料、供需格局转弱的顺周期等行业领跌。整体来看，二季度 A 股仍体现为预期主导的估值波动和主题轮动行情，高波动、极致轮动和快速博弈是最主要的特征，对机构投资者并不友好。

上半年本基金行业配置适度均衡，风格更偏向科技成长。配置层面，板块重点布局了 AI 主线，基金走势整体震荡向上。在板块波动率加大的 6 月份，基金根据基本面的变化做了一些个股的调整。此外，围绕高质量发展主题，本基金布局了如“中国特色估值体系”、自主可控、数字经济等新投资方向中的强阿尔法品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.2896 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.11%，业绩比较基准收益率为 1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度末以来，A 股市场剧烈波动的背后，反映的是投资者对经济及政策预期、中美关系等利空担忧的延续，并且由于悲观预期的自我增强机制，不乏有投资者担忧通缩、资产负债表衰退等中长期问题。

我们认为，A 股投资者往往有将“短期担忧长期化”的倾向，短期经济增长和政策托底局势不明朗是造成所谓长期信心缺失的重要推手。随着二季度库存周期去化进入尾声，经济短周期的下行动力已经趋弱，而逆周期政策托底的效应开始逐渐体现，我们倾向于认为信心的重塑过程即将到来。

经济层面，在短期透支效应消退、去库周期加速的共同作用下，二季度为年内经济环比低点，年内经济下行斜率最大的阶段趋于结束。6 月 PMI 景气低位弱回升，从疫后复苏的季节性规律看，国内经济三季度环比企稳概率较大。中期维度展望来看，下半年库存周期有望触底回升，支撑经济开启新一轮复苏。

政策层面，稳增长意愿加强，信用扩张利好估值修复。6 月中旬央行先后下调 OMO 和 MLF 利率，重提“加大逆周期调节力度”，伴随货币和信用政策重新进入发力期，政策对经济的支撑力度增强。中期产业政策维度，随着机构改革落地，二十大新发展格局抓手更明确，政策红利将进一步向安全自主可控、数字经济、高端制造领域倾斜，产业转型沿着高质量发展的主线进一步深化

推进。

从市场展望来看，我们认为下半年股市剩余流动性依然维持充裕，经济和盈利周期或走出低谷，在当前高股债性价比和整体低估值水位的背景下，A 股具备中长期战略配置价值；此外，美联储加息结束带来海外流动性改善、人民币汇率贬值压力缓和，外资有望回流中国市场，从而支撑市场更加平稳地上行。风格层面，由于盈利改善的轮廓更加清晰，估值驱动的主题轮动效应减弱、景气驱动的基本面行情增强，市场更趋于理性和均衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《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）、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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遵规守信情况声明

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在对农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人对本报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,608,276.04	13,974,711.30
结算备付金		77,970.96	318,543.42

存出保证金		222,386.44	181,533.65
交易性金融资产	6.4.7.2	62,922,941.01	75,320,715.65
其中：股票投资		62,922,941.01	75,320,715.65
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,575.40	9,219.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		78,838,149.85	89,804,723.74
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		31,034.85	52,728.53
应付管理人报酬		99,814.50	122,543.64
应付托管费		16,635.76	20,423.92
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	222,382.48	384,944.78
负债合计		369,867.59	580,640.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	34,271,698.58	39,012,803.07
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	44,196,583.68	50,211,279.80

净资产合计		78,468,282.26	89,224,082.87
负债和净资产总计		78,838,149.85	89,804,723.74

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2896 元，基金份额总额 34,271,698.58 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		950,759.74	-16,167,795.03
1. 利息收入		61,066.02	123,620.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,066.02	123,620.93
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,923,245.52	-16,462,732.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,315,986.72	-16,762,749.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	392,741.20	300,016.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,790,791.51	92,335.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	22,147.73	78,980.69

减：二、营业总支出		845,950.40	1,001,704.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	660,004.86	778,630.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	110,000.88	129,771.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	75,944.66	93,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		104,809.34	-17,169,499.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		104,809.34	-17,169,499.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		104,809.34	-17,169,499.65

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	39,012,803.07	-	50,211,279.80	89,224,082.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	39,012,803.07	-	50,211,279.80	89,224,082.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,741,104.49	-	-6,014,696.12	-10,755,800.61
(一)、综合收益总额	-	-	104,809.34	104,809.34
(二)、本期基金份额交易产生的	-4,741,104.49	-	-6,119,505.46	-10,860,609.95

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	2,505,301.95	-	3,378,987.64	5,884,289.59
2. 基金赎 回款	-7,246,406.44	-	-9,498,493.10	-16,744,899.54
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	34,271,698.58	-	44,196,583.68	78,468,282.26
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	38,555,975.09	-	78,795,186.50	117,351,161.59
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净值)	38,555,975.09	-	78,795,186.50	117,351,161.59
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-1,732,769.85	-	-17,103,431.05	-18,836,200.90
(一)、综合收益 总额	-	-	-17,169,499.65	-17,169,499.65
(二)、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)	-1,732,769.85	-	66,068.60	-1,666,701.25
其中: 1. 基金申 购款	11,258,945.62	-	18,886,897.32	30,145,842.94
2. 基金赎 回款	-12,991,715.47	-	-18,820,828.72	-31,812,544.19

(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	36,823,205.24	-	61,691,755.45	98,514,960.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程昆</u>	<u>毕宏燕</u>	<u>丁煜琼</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 462 号《关于准予农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 376,525,315.32 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 0339 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 376,619,214.75 份基金份额,其中认购资金利息折合 93,899.43 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,基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、债券(国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离交易可转债、央票、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、债券回购、资产支持证券、定期存款、协议存款、同业存单、权证、股指期货等以及法律法规或

中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资范围为基金资产净值的 0%-3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	15,608,276.04

等于：本金	15,605,231.81
加：应计利息	3,044.23
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	15,608,276.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	61,169,331.03	-	62,922,941.01	1,753,609.98
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	61,169,331.03	-	62,922,941.01	1,753,609.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	100,394.50

其中：交易所市场	100,394.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	121,944.66
合计	222,382.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,012,803.07	39,012,803.07
本期申购	2,505,301.95	2,505,301.95
本期赎回（以“-”号填列）	-7,246,406.44	-7,246,406.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	34,271,698.58	34,271,698.58

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 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	62,898,458.49	-12,687,178.69	50,211,279.80
本期利润	-3,685,982.17	3,790,791.51	104,809.34
本期基金份额交易产生的变动数	-7,242,762.58	1,123,257.12	-6,119,505.46
其中：基金申购款	3,938,725.03	-559,737.39	3,378,987.64
基金赎回款	-11,181,487.61	1,682,994.51	-9,498,493.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,969,713.74	-7,773,130.06	44,196,583.68

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,469.98
其他	1,786.42

合计	61,066.02
----	-----------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	196,723,552.48
减：卖出股票成本总额	199,459,214.61
减：交易费用	580,324.59
买卖股票差价收入	-3,315,986.72

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	392,741.20
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	392,741.20

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	3,790,791.51
股票投资	3,790,791.51
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	3,790,791.51

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	21,313.06
基金转换费收入	834.67
合计	22,147.73

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. 本基金的转换费由转出基金的赎回费和申购费补差两部分组成，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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	75,944.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司（“渤海银行”）	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	660,004.86	778,630.32
其中：支付销售机构的客户维护 费	317,456.92	364,216.41

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	110,000.88	129,771.74

注：支付基金托管人渤海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期间及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	渤海银行	15,608,276.04	56,809.62	12,073,795.52

注：本基金的活期银行存款由基金托管人渤海银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,608,276.04	-	-	-	15,608,276.04
结算备付金	77,970.96	-	-	-	77,970.96
存出保证金	222,386.44	-	-	-	222,386.44
交易性金融资产	-	-	-	62,922,941.01	62,922,941.01
应收申购款	-	-	-	6,575.40	6,575.40
资产总计	15,908,633.44	-	-	62,929,516.41	78,838,149.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,034.85	31,034.85
应付管理人报酬	-	-	-	99,814.50	99,814.50
应付托管费	-	-	-	16,635.76	16,635.76
其他负债	-	-	-	222,382.48	222,382.48
负债总计	-	-	-	369,867.59	369,867.59
利率敏感度缺口	15,908,633.44	-	-	62,559,648.82	78,468,282.26
上年度末 2022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	13,974,711.30	-	-	-	13,974,711.30
结算备付金	318,543.42	-	-	-	318,543.42
存出保证金	181,533.65	-	-	-	181,533.65
交易性金融资产	-	-	-	75,320,715.65	75,320,715.65
应收申购款	-	-	-	9,219.72	9,219.72
资产总计	14,474,788.37	-	-	75,329,935.37	89,804,723.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	52,728.53	52,728.53
应付管理人报酬	-	-	-	122,543.64	122,543.64
应付托管费	-	-	-	20,423.92	20,423.92
其他负债	-	-	-	384,944.78	384,944.78
负债总计	-	-	-	580,640.87	580,640.87
利率敏感度缺口	14,474,788.37	-	-	74,749,294.50	89,224,082.87

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	62,922,941.01	80.19	75,320,715.65	84.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	62,922,941.01	80.19	75,320,715.65	84.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	4,400,486.87	4,772,605.50
	业绩比较基准下降5%	-4,400,486.87	-4,772,605.50

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	62,922,941.01	75,320,715.65
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	62,922,941.01	75,320,715.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,922,941.01	79.81
	其中：股票	62,922,941.01	79.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,686,247.00	19.90
8	其他各项资产	228,961.84	0.29
9	合计	78,838,149.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,108,500.00	1.41
B	采矿业	3,533,752.00	4.50
C	制造业	34,211,295.01	43.60
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	-	-
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	22,693,054.00	28.92

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	1,376,340.00	1.75
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	62,922,941.01	80.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002555	三七互娱	70,000	2,441,600.00	3.11
2	002463	沪电股份	111,000	2,324,340.00	2.96
3	002384	东山精密	87,300	2,261,070.00	2.88
4	300308	中际旭创	15,000	2,211,750.00	2.82
5	300418	昆仑万维	54,400	2,191,232.00	2.79
6	688012	中微公司	13,827	2,163,234.15	2.76
7	002517	恺英网络	129,400	2,036,756.00	2.60
8	000425	徐工机械	300,700	2,035,739.00	2.59
9	002436	兴森科技	127,300	1,973,150.00	2.51
10	002624	完美世界	115,400	1,949,106.00	2.48
11	002558	巨人网络	107,100	1,920,303.00	2.45
12	000651	格力电器	51,600	1,883,916.00	2.40
13	600547	山东黄金	80,000	1,878,400.00	2.39
14	002050	三花智控	60,000	1,815,600.00	2.31
15	300494	盛天网络	72,000	1,784,880.00	2.27
16	603444	吉比特	3,500	1,718,885.00	2.19
17	601857	中国石油	221,600	1,655,352.00	2.11
18	300394	天孚通信	15,000	1,602,450.00	2.04
19	300567	精测电子	16,500	1,569,975.00	2.00
20	300101	振芯科技	80,000	1,551,200.00	1.98
21	002602	世纪华通	200,000	1,518,000.00	1.93
22	603533	掌阅科技	54,600	1,513,512.00	1.93
23	000988	华工科技	37,800	1,436,778.00	1.83
24	688197	首药控股	30,000	1,429,800.00	1.82

25	002219	新里程	304,500	1,376,340.00	1.75
26	002230	科大讯飞	20,000	1,359,200.00	1.73
27	603027	千禾味业	60,000	1,267,200.00	1.61
28	300624	万兴科技	10,800	1,265,220.00	1.61
29	300750	宁德时代	5,400	1,235,466.00	1.57
30	688270	臻镭科技	18,396	1,194,452.28	1.52
31	600150	中国船舶	34,200	1,125,522.00	1.43
32	300972	万辰生物	25,000	1,108,500.00	1.41
33	300502	新易盛	15,820	1,075,285.40	1.37
34	601360	三六零	84,000	1,053,360.00	1.34
35	002174	游族网络	60,000	1,008,000.00	1.28
36	688617	惠泰医疗	2,626	981,467.50	1.25
37	600941	中国移动	10,000	933,000.00	1.19
38	002709	天赐材料	18,900	778,491.00	0.99
39	688337	普源精电	12,833	773,316.58	0.99
40	688385	复旦微电	15,421	772,592.10	0.98
41	002292	奥飞娱乐	75,000	748,500.00	0.95

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	5,141,222.68	5.76
2	300229	拓尔思	3,490,496.00	3.91
3	002174	游族网络	3,411,484.00	3.82
4	300418	昆仑万维	3,400,516.00	3.81
5	300394	天孚通信	3,283,881.00	3.68
6	300494	盛天网络	3,118,775.00	3.50
7	601360	三六零	2,980,279.00	3.34
8	001322	箭牌家居	2,872,244.00	3.22
9	603986	兆易创新	2,767,674.00	3.10
10	688012	中微公司	2,719,904.17	3.05
11	600050	中国联通	2,701,989.00	3.03
12	000998	隆平高科	2,630,600.00	2.95
13	000661	长春高新	2,630,147.00	2.95
14	002517	恺英网络	2,596,186.81	2.91
15	600547	山东黄金	2,553,388.00	2.86
16	002624	完美世界	2,527,382.00	2.83
17	002463	沪电股份	2,465,533.00	2.76
18	002384	东山精密	2,373,879.00	2.66
19	300624	万兴科技	2,347,609.12	2.63
20	002555	三七互娱	2,267,805.00	2.54
21	000063	中兴通讯	2,181,319.00	2.44

22	002050	三花智控	2,160,412.00	2.42
23	000425	徐工机械	2,130,170.00	2.39
24	300769	德方纳米	1,996,025.00	2.24
25	000977	浪潮信息	1,933,941.00	2.17
26	002368	太极股份	1,905,244.00	2.14
27	688197	首药控股	1,882,490.02	2.11
28	603477	巨星农牧	1,879,731.00	2.11
29	300059	东方财富	1,871,810.00	2.10
30	688223	晶科能源	1,860,715.33	2.09
31	600546	山煤国际	1,854,378.48	2.08
32	600256	广汇能源	1,853,457.00	2.08
33	688599	天合光能	1,853,346.86	2.08
34	000651	格力电器	1,852,457.00	2.08
35	300308	中际旭创	1,846,000.00	2.07
36	300896	爱美客	1,823,975.50	2.04
37	600559	老白干酒	1,819,205.00	2.04
38	600958	东方证券	1,808,843.00	2.03
39	002156	通富微电	1,805,683.00	2.02
40	300476	胜宏科技	1,797,902.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	4,043,310.00	4.53
2	300229	拓尔思	3,687,076.00	4.13
3	688197	首药控股	2,946,888.21	3.30
4	002142	宁波银行	2,946,587.00	3.30
5	000661	长春高新	2,828,896.00	3.17
6	002865	钧达股份	2,780,173.00	3.12
7	001322	箭牌家居	2,736,221.50	3.07
8	603606	东方电缆	2,645,739.00	2.97
9	000998	隆平高科	2,645,686.00	2.97
10	002422	科伦药业	2,618,559.00	2.93
11	600027	华电国际	2,617,689.00	2.93
12	600519	贵州茅台	2,551,636.00	2.86
13	600011	华能国际	2,486,113.00	2.79
14	300759	康龙化成	2,478,202.67	2.78
15	603986	兆易创新	2,425,970.21	2.72
16	300413	芒果超媒	2,405,097.38	2.70
17	601882	海天精工	2,395,231.00	2.68
18	002174	游族网络	2,382,145.00	2.67
19	600050	中国联通	2,336,147.00	2.62

20	300394	天孚通信	2,319,369.26	2.60
21	301073	君亭酒店	2,297,167.06	2.57
22	600859	王府井	2,285,648.00	2.56
23	000977	浪潮信息	2,226,841.00	2.50
24	002025	航天电器	2,225,411.00	2.49
25	000063	中兴通讯	2,208,069.28	2.47
26	002271	东方雨虹	2,161,741.00	2.42
27	603208	江山欧派	2,097,566.48	2.35
28	002368	太极股份	2,040,770.00	2.29
29	002011	盾安环境	2,036,343.17	2.28
30	600958	东方证券	2,024,347.96	2.27
31	300693	盛弘股份	1,973,073.00	2.21
32	688368	晶丰明源	1,967,069.03	2.20
33	300896	爱美客	1,957,003.00	2.19
34	600546	山煤国际	1,943,714.00	2.18
35	603212	赛伍技术	1,941,962.00	2.18
36	600004	白云机场	1,935,191.00	2.17
37	601111	中国国航	1,896,938.00	2.13
38	002335	科华数据	1,890,255.00	2.12
39	003029	吉大正元	1,844,481.00	2.07
40	601360	三六零	1,839,870.00	2.06
41	600256	广汇能源	1,835,560.00	2.06
42	000568	泸州老窖	1,831,758.00	2.05
43	605133	嵘泰股份	1,814,652.00	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	183,270,648.46
卖出股票收入（成交）总额	196,723,552.48

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

2023 年 3 月 26 日，昆仑万维科技股份有限公司因通过深圳证券交易所投资者关系互动平台回复投资者咨询时未能客观、完整地介绍和反映公司相关业务的实际情况、对公司业绩的影响及充分提示相关风险，被深圳证券交易所出具监管函（创业板监管函(2023)第 38 号）。

2023 年 6 月 27 日，因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对三七互娱网络科技集团股份有限公司、公司实际控制人兼董事长李卫伟和公司副董事长曾开天立案。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

其余证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	222,386.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	6,575.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,961.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
4,749	7,216.61	0.00	0.00	34,271,698.58	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	26,284.91	0.0767

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 5 月 25 日) 基金份额总额	376,619,214.75
本报告期期初基金份额总额	39,012,803.07
本报告期基金总申购份额	2,505,301.95
减：本报告期基金总赎回份额	7,246,406.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	34,271,698.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。本报告期内，无相关基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券	2	379,793,549.43	100.00	353,703.90	100.00	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2023 年 1 月 19 日
2	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证券日报、基金管理人网站	2023 年 3 月 29 日
3	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2023 年 4 月 20 日
4	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站	2023 年 6 月 29 日
5	农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金-招募说明书更新-2023 年第 1 次	证券日报、基金管理人网站	2023 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路9号50层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司

2023年8月25日