

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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.....	63

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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金
基金简称	农银大盘蓝筹混合
基金主代码	660006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 1 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,137,403.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票，通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期取得基金资产的长期理性增值。
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。首先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析，对未来股票市场和债券市场的走势进行科学的分析，并以此为基础对大类资产配置进行确定。在“自下而上”的层面，本基金将严格执行备选股票库制度，在建立大盘蓝筹股票库的基础上，综合运用定性和定量的手段，筛选出具有良好基本面和发展前景的蓝筹股票进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	李申
	联系电话	021-61095588	021-60637102
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61095599	021-60637111
传真		021-61095556	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区闹市口大街 1 号

	区银城路 9 号 50 层	院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	许金超	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	49,508,966.26	37,995,334.74	-8,076,508.75
本期利润	70,874,531.05	68,429,121.89	-53,056,529.09
加权平均基金份额本期利润	0.4597	0.3205	-0.2266
本期加权平均净值利润率	33.63%	29.66%	-21.93%
本期基金份额净值增长率	39.58%	34.53%	-20.36%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	86,138,636.58	39,324,676.43	-24,034,922.97
期末可供分配基金份额利润	0.6829	0.2057	-0.1038
期末基金资产净值	212,276,039.79	230,501,212.50	207,607,845.35
期末基金份额净值	1.6829	1.2057	0.8962
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	68.29%	20.57%	-10.38%

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

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

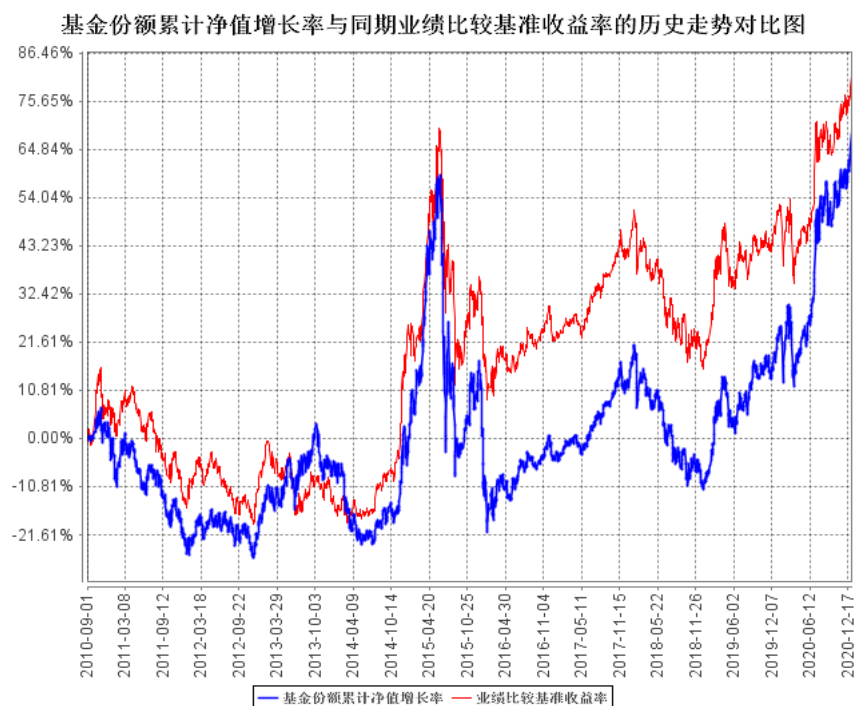
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

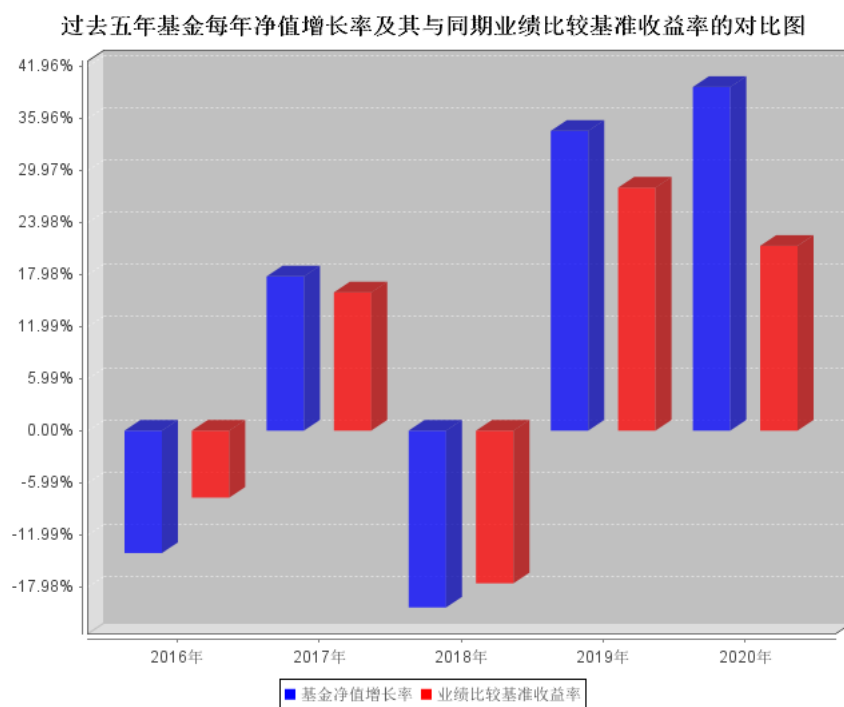
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.51%	0.99%	10.46%	0.74%	2.05%	0.25%
过去六个月	26.61%	1.25%	18.74%	1.01%	7.87%	0.24%
过去一年	39.58%	1.33%	21.29%	1.07%	18.29%	0.26%
过去三年	49.55%	1.15%	27.94%	1.00%	21.61%	0.15%
过去五年	51.30%	1.12%	36.88%	0.93%	14.42%	0.19%
自基金合同生效起至今	68.29%	1.31%	81.37%	1.08%	-13.08%	0.23%

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



注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2010 年 9 月 1 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例

3.2.3 过去五年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



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

§ 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 2020 年 12 月 31 日，公司共管理 60 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基

金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金基金经理	2015 年 12 月 2 日	-	13	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。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

-

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年市场是上涨的一年，由于新冠疫情的原因世界各国加大对经济的刺激，从而导致流动性比较充裕；利率下行，流动性充足，使得成长性较好的行业迎来了估值和利润的双增长，市场也长开了一年的结构性牛市；在报告期内本基金根据市场业绩和主题行情的展开，在新能源、白酒、医药等增长前较好和增长稳定的行业上加大了配置，而地产、金融等行业未来增长乏力等行业低配；整体看全年取得了较好的超额收益。

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 1.6829 元；本报告期基金份额净值增长率为 39.58%，业绩比较基准收益率为 21.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

21 年对宏观经济增长的预期还是比较一致的，在低基数下我经济将取得比较高的增长；随着疫苗的推进，世界各国都将取得较快的恢复时机；我国在去年的杠杆率增加的较快，央行将会适当收紧流动性，对高估值的行业会产生一定的估值压制，对上市公司的业绩增长需求就比较严格；虽然去年 12 月份中央经济工作会议定调是不急转弯，各项因疫情的刺激政策将会缓慢退出，但 21 年一季度会比较好，随后将会迎来流动性的调整，对市场还是偏谨慎。A 股市场整体上看还是以结构性行情为主，一季度市场上涨的概率较大；后续市场可能因流动性原因产生调整震荡，期间市场会以业绩为主线来挑选投资标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

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

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会

关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金基金合同约定“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%。”即本基金本年无应分配利润。

2. 报告期内没有实施过利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 25026 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	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“农银大盘蓝筹混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了农银大盘蓝筹混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于农银大盘蓝筹混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>农银大盘蓝筹混合基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银大盘蓝筹混合</p>

	<p>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大盘蓝筹混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督农银大盘蓝筹混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对农银大盘蓝筹混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致农</p>

	<p>银大盘蓝筹混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 赵钰
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	7,168,245.55	17,923,286.68
结算备付金		466,172.56	613,779.46
存出保证金		55,428.17	106,783.89
交易性金融资产	7.4.7.2	205,306,294.48	211,467,076.44
其中：股票投资		198,181,204.48	199,058,600.04
基金投资		-	-
债券投资		7,125,090.00	12,408,476.40
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		24,861.84	1,909,697.27
应收利息	7.4.7.5	122,962.07	118,167.86
应收股利		-	-
应收申购款		547,865.87	5,482.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		213,691,830.54	232,144,273.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		674,182.20	741,863.47
应付管理人报酬		260,165.74	288,574.46
应付托管费		43,360.95	48,095.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	257,580.80	382,888.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,501.06	181,639.26
负债合计		1,415,790.75	1,643,061.17
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	126,137,403.21	191,176,536.07
未分配利润	7.4.7.10	86,138,636.58	39,324,676.43
所有者权益合计		212,276,039.79	230,501,212.50
负债和所有者权益总计		213,691,830.54	232,144,273.67

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6829 元，基金份额总额 126,137,403.21 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		76,750,100.94	75,328,965.42
1. 利息收入		326,755.04	731,867.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	103,382.75	271,240.56
债券利息收入		223,372.29	460,626.97
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）		55,006,851.71	44,094,756.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	52,086,672.54	40,257,913.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	39,128.20	58,467.14
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	2,881,050.97	3,778,376.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	21,365,564.79	30,433,787.15
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	50,929.40	68,554.05
减：二、费用		5,875,569.89	6,899,843.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,161,347.65	3,456,628.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	526,891.24	576,104.64

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,999,502.76	2,677,148.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.02
7. 其他费用	7.4.7.20	187,828.24	189,962.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,874,531.05	68,429,121.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,874,531.05	68,429,121.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	191,176,536.07	39,324,676.43	230,501,212.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,874,531.05	70,874,531.05
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）	-65,039,132.86	-24,060,570.90	-89,099,703.76
其中：1. 基金申购款	21,501,372.62	8,141,344.39	29,642,717.01
2. 基金赎回款	-86,540,505.48	-32,201,915.29	-118,742,420.77
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）	126,137,403.21	86,138,636.58	212,276,039.79
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	231,642,768.32	-24,034,922.97	207,607,845.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,429,121.89	68,429,121.89
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）	-40,466,232.25	-5,069,522.49	-45,535,754.74
其中：1. 基金申购款	30,206,307.93	2,002,663.43	32,208,971.36
2. 基金赎回款	-70,672,540.18	-7,072,185.92	-77,744,726.10
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）	191,176,536.07	39,324,676.43	230,501,212.50

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>施卫</u>	<u>Celine Zhang</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金(原名为“农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金”，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[2010]第807号《关于同意农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金募集的批复》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《农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,916,524,336.73元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第230号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于2010年9月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,917,182,128.64份基金份额，其中认购资金利息折合657,791.91份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日更名为农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理大盘蓝筹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，包括国内依法上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 80%，除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	活期存款	7,168,245.55		17,923,286.68
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：	7,168,245.55		17,923,286.68	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	161,317,162.32	198,181,204.48	36,864,042.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,144,656.13	7,125,090.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,144,656.13	7,125,090.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	168,461,818.45	205,306,294.48	36,844,476.03
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,664,214.97	199,058,600.04	15,394,385.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,323,950.23	12,408,476.40
	银行间市场	-	-
	合计	12,323,950.23	12,408,476.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	195,988,165.20	211,467,076.44	15,478,911.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	687.94	5,178.35
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	209.70	276.20
应收债券利息	122,039.43	112,665.21
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	25.00	48.10
合计	122,962.07	118,167.86

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	257,580.80	382,888.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	257,580.80	382,888.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	501.06	1,639.26
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,501.06	181,639.26

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,176,536.07	191,176,536.07
本期申购	21,501,372.62	21,501,372.62
本期赎回（以“-”号填列）	-86,540,505.48	-86,540,505.48
- 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	126,137,403.21	126,137,403.21

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,430,388.38	-41,105,711.95	39,324,676.43
本期利润	49,508,966.26	21,365,564.79	70,874,531.05
本期基金份额交易产生的变动数	-35,667,660.12	11,607,089.22	-24,060,570.90
其中：基金申购款	12,108,523.96	-3,967,179.57	8,141,344.39
基金赎回款	-47,776,184.08	15,574,268.79	-32,201,915.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,271,694.52	-8,133,057.94	86,138,636.58

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	94,065.48	256,850.99
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	8,032.11	12,111.33
其他	1,285.16	2,278.24
合计	103,382.75	271,240.56

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	52,086,672.54	-
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	52,086,672.54	-

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	676,727,909.09	873,182,753.25
减：卖出股票成本总额	624,641,236.55	832,924,839.92
买卖股票差价收入	52,086,672.54	40,257,913.33

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	39,128.20	58,467.14
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	39,128.20	58,467.14

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,602,107.36	44,377,935.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,002,986.00	43,578,002.47
减：应收利息总额	559,993.16	741,465.83
买卖债券差价收入	39,128.20	58,467.14

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,881,050.97	3,778,376.22
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	2,881,050.97	3,778,376.22

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	21,365,564.79	30,433,787.15
——股票投资	21,469,657.09	30,420,857.92
——债券投资	-104,092.30	12,929.23
——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	21,365,564.79	30,433,787.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	44,452.78	55,696.61
转换费收入	6,476.62	12,857.44
合计	50,929.40	68,554.05

注：

1. 本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,999,502.76	2,677,148.12
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,999,502.76	2,677,148.12

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	7,828.24	9,962.10
账户服务费	-	-
其他	-	-
合计	187,828.24	189,962.10

7.4.7.21 分部报告

-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,161,347.65	3,456,628.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,117,653.15	1,220,689.65

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	526,891.24	576,104.64

注：支付基金托管人中国建设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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,168,245.55	94,065.48	17,923,286.68	256,850.99

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 8 日	科创板锁定	16.21	43.90	7,231	117,214.51	317,440.90	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2021 年 1 月 4 日	科创板锁定	11.33	16.34	7,868	89,144.44	128,563.12	-
300869	康泰医学	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	创业板锁定	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
688069	德林海	2020 年 7 月 15 日	2021 年 1 月 22 日	科创板锁定	67.20	62.45	1,306	87,763.20	81,559.70	-
300877	金春股份	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	创业板锁定	30.54	50.85	381	11,635.74	19,373.85	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	创业板锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300872	天阳科技	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	创业板锁定	21.34	37.84	465	9,923.10	17,595.60	-
300913	兆龙互连	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	创业板锁定	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300861	美畅股份	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月	创业板锁定	43.76	51.10	281	12,296.56	14,359.10	-

			24 日								
300878	维康药业	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	创业板锁定	41.34	48.72	281	11,616.54	13,690.32	-	
300907	康平科技	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	创业板锁定	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-	
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	创业板锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-	
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	创业板锁定	44.47	74.52	169	7,515.43	12,593.88	-	
300873	海晨股份	2020 年 8 月 14 日	2021 年 3 月 2 日	创业板锁定	30.72	41.32	295	9,062.40	12,189.40	-	
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	创业板锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300860	锋尚文化	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	创业板锁定	138.02	126.67	89	12,283.78	11,273.63	-	
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股流通受限	4.59	5.46	20,370	93,498.30	111,220.20	-	

注：

1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,497,750.00	-
合计	4,497,750.00	-

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	2,627,340.00	12,408,476.40
合计	2,627,340.00	12,408,476.40

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,168,245.55	-	-	-	7,168,245.55
结算备付	466,172.56	-	-	-	466,172.56

金					
存出保证金	55,428.17		-	-	55,428.17
交易性金融资产	7,125,090.00		-	-198,181,204.48	205,306,294.48
应收证券清算款			-	24,861.84	24,861.84
应收利息			-	122,962.07	122,962.07
应收申购款			-	547,865.87	547,865.87
资产总计	14,814,936.28		-	-198,876,894.26	213,691,830.54
负债					
应付赎回款			-	674,182.20	674,182.20
应付管理人报酬			-	260,165.74	260,165.74
应付托管费			-	43,360.95	43,360.95
应付交易费用			-	257,580.80	257,580.80
其他负债			-	180,501.06	180,501.06
负债总计			-	1,415,790.75	1,415,790.75
利率敏感度缺口	14,814,936.28		-	-197,461,103.51	212,276,039.79
上年度末 2019	1 年以内	1-5 年	5 年以	不计息	合计

年 12 月 31 日			上		
资产					
银行存款	17,923,286.68		-	-	17,923,286.68
结算备付金	613,779.46		-	-	613,779.46
存出保证金	106,783.89		-	-	106,783.89
交易性金融资产		-12,408,476.40	-	-199,058,600.04	211,467,076.44
应收证券清算款			-	1,909,697.27	1,909,697.27
应收利息			-	118,167.86	118,167.86
应收申购款			-	5,482.07	5,482.07
其他资产			-		
资产总计	18,643,850.03	-12,408,476.40	-	-201,091,947.24	232,144,273.67
负债					
应付赎回款			-	741,863.47	741,863.47
应付管理人报酬			-	288,574.46	288,574.46
应付托管费			-	48,095.75	48,095.75
应付交易费用			-	382,888.23	382,888.23
其他			-	181,639.26	181,639.26

负债					
负债总计	-	-	-	1,643,061.17	1,643,061.17
利率敏感度缺口	18,643,850.03	12,408,476.40	-	-199,448,886.07	230,501,212.50

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-6,236.83	-77,254.35
市场利率平行下降25个基点	6,236.83	77,254.35	

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	198,181,204.48	93.36	199,058,600.04	86.36
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	198,181,204.48	93.36	199,058,600.04	86.36

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2020 年 12 月 31 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	12,845,520.06	12,051,146.91
	业绩比较基准下降 5%	-12,845,520.06	-12,051,146.91

注: 本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层次的余额为 197,253,463.71 元，属于第二层次的余额为 8,052,830.77 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 197,765,237.74 元，第二层次 13,701,838.70 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	198,181,204.48	92.74
	其中：股票	198,181,204.48	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,125,090.00	3.33
	其中：债券	7,125,090.00	3.33
	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	7,634,418.11	3.57
8	其他各项资产	751,117.95	0.35
9	合计	213,691,830.54	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,816,616.80	0.86
B	采矿业	3,014,278.62	1.42
C	制造业	124,523,856.95	58.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,017,526.00	0.95
E	建筑业	2,065,698.00	0.97
F	批发和零售业	870,939.52	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	3,343,700.29	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,048,096.74	2.85
J	金融业	36,903,109.44	17.38
K	房地产业	5,445,079.20	2.57
L	租赁和商务服务业	3,713,874.60	1.75
M	科学研究和技术服务业	2,589,142.68	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	95,568.56	0.05

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	161,598.00	0.08
Q	卫生和社会工作	4,907,524.05	2.31
R	文化、体育和娱乐业	664,595.03	0.31
S	综合	-	-
	合计	198,181,204.48	93.36

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,400	8,791,200.00	4.14
2	601318	中国平安	76,800	6,680,064.00	3.15
3	000858	五粮液	21,346	6,229,830.10	2.93
4	600882	妙可蓝多	78,000	4,453,800.00	2.10
5	000333	美的集团	43,700	4,301,828.00	2.03
6	600276	恒瑞医药	37,566	4,187,106.36	1.97
7	300750	宁德时代	11,000	3,862,210.00	1.82
8	600036	招商银行	84,800	3,726,960.00	1.76
9	601100	恒立液压	32,656	3,690,128.00	1.74
10	300274	阳光电源	49,900	3,606,772.00	1.70
11	300015	爱尔眼科	37,301	2,793,471.89	1.32
12	601012	隆基股份	30,142	2,779,092.40	1.31
13	002475	立讯精密	48,668	2,731,248.16	1.29
14	002850	科达利	28,400	2,669,316.00	1.26
15	600048	保利地产	149,200	2,360,344.00	1.11
16	000568	泸州老窖	10,000	2,261,600.00	1.07
17	002709	天赐材料	21,200	2,200,560.00	1.04
18	601888	中国中免	7,700	2,174,865.00	1.02
19	601336	新华保险	37,100	2,150,687.00	1.01
20	601166	兴业银行	99,600	2,078,652.00	0.98
21	000651	格力电器	32,986	2,043,152.84	0.96
22	603659	璞泰来	18,000	2,023,020.00	0.95
23	603259	药明康德	14,840	1,999,244.80	0.94
24	600887	伊利股份	43,879	1,946,911.23	0.92
25	002179	中航光电	23,870	1,868,782.30	0.88

26	600438	通威股份	48,500	1,864,340.00	0.88
27	600030	中信证券	58,300	1,714,020.00	0.81
28	600309	万华化学	18,820	1,713,372.80	0.81
29	601398	工商银行	332,600	1,659,674.00	0.78
30	600346	恒力石化	54,500	1,524,365.00	0.72
31	300347	泰格医药	9,200	1,486,812.00	0.70
32	300059	东方财富	47,239	1,464,409.00	0.69
33	300014	亿纬锂能	17,814	1,451,841.00	0.68
34	603678	火炬电子	20,000	1,446,000.00	0.68
35	603658	安图生物	9,900	1,437,282.00	0.68
36	600031	三一重工	40,600	1,420,188.00	0.67
37	603369	今世缘	24,400	1,400,072.00	0.66
38	002027	分众传媒	139,680	1,378,641.60	0.65
39	000002	万科 A	46,600	1,337,420.00	0.63
40	603288	海天味业	6,660	1,335,596.40	0.63
41	000001	平安银行	66,520	1,286,496.80	0.61
42	300677	英科医疗	7,500	1,261,125.00	0.59
43	002415	海康威视	25,650	1,244,281.50	0.59
44	002594	比亚迪	6,250	1,214,375.00	0.57
45	600900	长江电力	62,400	1,195,584.00	0.56
46	002714	牧原股份	14,528	1,120,108.80	0.53
47	000725	京东方 A	185,500	1,113,000.00	0.52
48	002352	顺丰控股	12,500	1,102,875.00	0.52
49	600779	水井坊	12,000	996,240.00	0.47
50	600372	中航电子	50,000	982,500.00	0.46
51	002304	洋河股份	4,133	975,346.67	0.46
52	000799	酒鬼酒	6,000	939,000.00	0.44
53	603899	晨光文具	10,500	929,880.00	0.44
54	600588	用友网络	21,152	927,938.24	0.44
55	601988	中国银行	290,300	923,154.00	0.43
56	600809	山西汾酒	2,400	900,696.00	0.42
57	601601	中国太保	23,400	898,560.00	0.42
58	601899	紫金矿业	94,200	875,118.00	0.41
59	000661	长春高新	1,900	852,929.00	0.40
60	600585	海螺水泥	16,400	846,568.00	0.40
61	601328	交通银行	188,200	843,136.00	0.40
62	300124	汇川技术	8,397	783,440.10	0.37
63	600690	海尔智家	26,800	782,828.00	0.37
64	600000	浦发银行	80,356	777,846.08	0.37

65	600016	民生银行	145,700	757,640.00	0.36
66	002460	赣锋锂业	7,400	748,880.00	0.35
67	002142	宁波银行	20,630	729,064.20	0.34
68	601688	华泰证券	40,300	725,803.00	0.34
69	601668	中国建筑	143,700	714,189.00	0.34
70	603501	韦尔股份	3,000	693,300.00	0.33
71	600837	海通证券	52,900	680,294.00	0.32
72	000100	TCL 科技	95,900	678,972.00	0.32
73	300751	迈为股份	1,000	677,010.00	0.32
74	300122	智飞生物	4,500	665,595.00	0.31
75	000063	中兴通讯	18,500	622,525.00	0.29
76	600570	恒生电子	5,922	621,217.80	0.29
77	601633	长城汽车	15,800	597,398.00	0.28
78	600600	青岛啤酒	6,000	596,400.00	0.28
79	600999	招商证券	25,360	591,902.40	0.28
80	002049	紫光国微	4,400	588,764.00	0.28
81	600104	上汽集团	24,000	586,560.00	0.28
82	002241	歌尔股份	15,600	582,192.00	0.27
83	300408	三环集团	15,600	581,100.00	0.27
84	600436	片仔癀	2,100	561,771.00	0.26
85	300498	温氏股份	30,600	557,838.00	0.26
86	601211	国泰君安	30,900	541,677.00	0.26
87	601229	上海银行	68,078	533,731.52	0.25
88	688388	嘉元科技	6,000	528,840.00	0.25
89	000338	潍柴动力	32,800	517,912.00	0.24
90	002410	广联达	6,500	511,810.00	0.24
91	600009	上海机场	6,600	499,356.00	0.24
92	601169	北京银行	101,440	490,969.60	0.23
93	002230	科大讯飞	11,953	488,519.11	0.23
94	600919	江苏银行	88,270	481,954.20	0.23
95	300136	信维通信	13,300	477,204.00	0.22
96	600660	福耀玻璃	9,600	461,280.00	0.22
97	603986	兆易创新	2,280	450,300.00	0.21
98	600196	复星医药	8,300	448,117.00	0.21
99	002555	三七互娱	14,200	443,466.00	0.21
100	601766	中国中车	83,300	442,323.00	0.21
101	002812	恩捷股份	3,100	439,518.00	0.21
102	601628	中国人寿	11,396	437,492.44	0.21
103	002271	东方雨虹	11,250	436,500.00	0.21

104	601818	光大银行	109,100	435,309.00	0.21
105	600893	航发动力	7,300	433,255.00	0.20
106	600383	金地集团	31,500	425,250.00	0.20
107	600765	中航重机	17,000	425,000.00	0.20
108	600406	国电南瑞	15,800	419,806.00	0.20
109	600763	通策医疗	1,500	414,780.00	0.20
110	600703	三安光电	15,264	412,280.64	0.19
111	300142	沃森生物	10,600	408,736.00	0.19
112	601088	中国神华	22,600	407,026.00	0.19
113	601919	中远海控	33,100	404,151.00	0.19
114	300601	康泰生物	2,300	401,350.00	0.19
115	000538	云南白药	3,500	397,600.00	0.19
116	300759	康龙化成	3,300	397,320.00	0.19
117	600111	北方稀土	29,900	391,391.00	0.18
118	002493	荣盛石化	13,900	383,779.00	0.18
119	603799	华友钴业	4,696	372,392.80	0.18
120	600028	中国石化	91,600	369,148.00	0.17
121	601390	中国中铁	69,700	367,319.00	0.17
122	600019	宝钢股份	60,968	362,759.60	0.17
123	002311	海大集团	5,500	360,250.00	0.17
124	600547	山东黄金	15,204	359,118.48	0.17
125	603486	科沃斯	4,000	353,960.00	0.17
126	300413	芒果超媒	4,870	353,075.00	0.17
127	000768	中航西飞	9,506	348,680.08	0.16
128	600872	中炬高新	5,200	346,580.00	0.16
129	000876	新希望	15,400	344,960.00	0.16
130	600745	闻泰科技	3,400	336,600.00	0.16
131	002007	华兰生物	7,967	336,526.08	0.16
132	000625	长安汽车	15,300	334,764.00	0.16
133	000895	双汇发展	7,100	333,274.00	0.16
134	600958	东方证券	28,600	332,618.00	0.16
135	601009	南京银行	41,056	331,732.48	0.16
136	000776	广发证券	20,300	330,484.00	0.16
137	600584	长电科技	7,700	327,789.00	0.15
138	000166	申万宏源	61,695	325,749.60	0.15
139	002236	大华股份	16,200	322,218.00	0.15
140	603613	国联股份	2,500	320,200.00	0.15
141	002129	中环股份	12,500	318,750.00	0.15
142	601377	兴业证券	36,700	318,556.00	0.15

143	688568	中科星图	7,231	317,440.90	0.15
144	600741	华域汽车	10,800	311,256.00	0.15
145	000157	中联重科	31,300	309,870.00	0.15
146	600176	中国巨石	15,500	309,380.00	0.15
147	002371	北方华创	1,700	307,258.00	0.14
148	600926	杭州银行	20,340	303,472.80	0.14
149	002050	三花智控	12,285	302,825.25	0.14
150	603993	洛阳钼业	48,400	302,500.00	0.14
151	002821	凯莱英	1,000	299,140.00	0.14
152	002001	新和成	8,800	296,384.00	0.14
153	601901	方正证券	28,200	292,434.00	0.14
154	601877	正泰电器	7,400	289,784.00	0.14
155	001979	招商蛇口	21,700	288,393.00	0.14
156	600050	中国联通	63,700	284,102.00	0.13
157	601066	中信建投	6,600	277,200.00	0.13
158	300433	蓝思科技	9,049	276,989.89	0.13
159	000786	北新建材	6,900	276,345.00	0.13
160	601857	中国石油	66,500	275,975.00	0.13
161	600109	国金证券	16,600	270,082.00	0.13
162	002736	国信证券	19,800	270,072.00	0.13
163	002202	金风科技	18,864	268,812.00	0.13
164	002841	视源股份	2,300	264,569.00	0.12
165	600015	华夏银行	42,180	263,625.00	0.12
166	601006	大秦铁路	40,700	262,922.00	0.12
167	601989	中国重工	62,500	261,875.00	0.12
168	000860	顺鑫农业	3,600	261,144.00	0.12
169	688008	澜起科技	3,108	257,591.04	0.12
170	601225	陕西煤业	27,400	255,916.00	0.12
171	603160	汇顶科技	1,600	248,880.00	0.12
172	601186	中国铁建	31,500	248,850.00	0.12
173	601788	光大证券	13,400	248,168.00	0.12
174	002008	大族激光	5,800	247,950.00	0.12
175	000066	中国长城	12,900	244,971.00	0.12
176	600352	浙江龙盛	17,800	242,436.00	0.11
177	600760	中航沈飞	3,100	242,358.00	0.11
178	603019	中科曙光	6,980	238,925.40	0.11
179	000902	新洋丰	14,900	238,400.00	0.11
180	002624	完美世界	8,050	237,475.00	0.11
181	300003	乐普医疗	8,700	236,466.00	0.11

182	688012	中微公司	1,500	236,385.00	0.11
183	002701	奥瑞金	47,700	235,638.00	0.11
184	002601	龙麟佰利	7,600	233,852.00	0.11
185	002938	鹏鼎控股	4,700	233,449.00	0.11
186	002157	正邦科技	13,600	231,744.00	0.11
187	002600	领益智造	19,300	231,407.00	0.11
188	600362	江西铜业	11,300	225,435.00	0.11
189	000783	长江证券	26,500	222,600.00	0.10
190	600183	生益科技	7,800	219,648.00	0.10
191	601360	三六零	13,900	218,369.00	0.10
192	000596	古井贡酒	800	217,600.00	0.10
193	601108	财通证券	17,200	217,580.00	0.10
194	002444	巨星科技	6,900	214,659.00	0.10
195	600845	宝信软件	3,100	213,838.00	0.10
196	002384	东山精密	8,200	213,200.00	0.10
197	002044	美年健康	18,752	212,460.16	0.10
198	601555	东吴证券	21,280	209,820.80	0.10
199	601985	中国核电	42,600	209,592.00	0.10
200	600637	东方明珠	23,300	208,302.00	0.10
201	601669	中国电建	52,400	203,312.00	0.10
202	000938	紫光股份	9,820	200,819.00	0.09
203	000069	华侨城 A	28,100	199,229.00	0.09
204	002024	苏宁易购	25,500	196,605.00	0.09
205	002456	欧菲光	14,755	194,470.90	0.09
206	300144	宋城演艺	10,720	189,958.40	0.09
207	601878	浙商证券	12,400	189,720.00	0.09
208	000977	浪潮信息	7,045	189,369.60	0.09
209	601933	永辉超市	26,100	187,398.00	0.09
210	601138	工业富联	13,600	186,184.00	0.09
211	300033	同花顺	1,500	185,970.00	0.09
212	300529	健帆生物	2,700	183,114.00	0.09
213	600010	包钢股份	156,060	182,590.20	0.09
214	600522	中天科技	16,800	182,112.00	0.09
215	600795	国电电力	80,800	181,800.00	0.09
216	002602	世纪华通	25,535	181,553.85	0.09
217	600029	南方航空	30,300	180,588.00	0.09
218	300676	华大基因	1,400	179,984.00	0.08
219	600161	天坛生物	4,300	179,310.00	0.08
220	601800	中国交建	24,100	174,966.00	0.08

221	000425	徐工机械	32,200	172,914.00	0.08
222	002139	拓邦股份	21,100	171,121.00	0.08
223	000733	振华科技	2,900	170,665.00	0.08
224	688036	传音控股	1,108	168,571.12	0.08
225	600886	国投电力	19,100	165,024.00	0.08
226	300595	欧普康视	2,000	163,840.00	0.08
227	300496	中科创达	1,400	163,800.00	0.08
228	002607	中公教育	4,600	161,598.00	0.08
229	603833	欧派家居	1,200	161,400.00	0.08
230	000703	恒逸石化	12,560	160,768.00	0.08
231	600705	中航资本	36,700	160,746.00	0.08
232	600061	国投资本	11,600	160,428.00	0.08
233	000963	华东医药	6,040	160,422.40	0.08
234	002878	元隆雅图	7,800	160,368.00	0.08
235	000728	国元证券	17,884	160,240.64	0.08
236	601838	成都银行	14,800	157,916.00	0.07
237	002463	沪电股份	8,300	155,957.00	0.07
238	600066	宇通客车	9,100	153,972.00	0.07
239	601111	中国国航	20,500	153,545.00	0.07
240	601607	上海医药	7,900	151,680.00	0.07
241	000708	中信特钢	6,900	150,351.00	0.07
242	600606	绿地控股	25,000	145,750.00	0.07
243	600115	东方航空	30,700	143,676.00	0.07
244	000739	普洛药业	6,000	139,680.00	0.07
245	601162	天风证券	22,810	139,141.00	0.07
246	300628	亿联网络	1,900	138,928.00	0.07
247	600340	华夏幸福	10,740	138,868.20	0.07
248	000998	隆平高科	7,000	138,670.00	0.07
249	603877	太平鸟	4,600	138,000.00	0.07
250	601021	春秋航空	2,483	137,632.69	0.06
251	002252	上海莱士	18,540	137,196.00	0.06
252	600177	雅戈尔	18,964	136,351.16	0.06
253	002916	深南电路	1,260	136,155.60	0.06
254	601727	上海电气	25,000	135,000.00	0.06
255	600011	华能国际	30,100	134,848.00	0.06
256	002508	老板电器	3,300	134,574.00	0.06
257	002422	科伦药业	6,900	134,136.00	0.06
258	601618	中国中冶	48,900	133,497.00	0.06
259	600487	亨通光电	9,360	130,946.40	0.06

260	600118	中国卫星	4,000	128,720.00	0.06
261	688528	秦川物联	7,868	128,563.12	0.06
262	601198	东兴证券	9,400	125,208.00	0.06
263	600068	葛洲坝	18,900	124,362.00	0.06
264	002120	韵达股份	7,866	123,496.20	0.06
265	600369	西南证券	22,846	122,911.48	0.06
266	002773	康弘药业	2,530	121,819.50	0.06
267	002673	西部证券	11,980	121,477.20	0.06
268	600489	中金黄金	13,294	117,120.14	0.06
269	002985	北摩高科	600	115,980.00	0.05
270	600498	烽火通信	4,800	115,584.00	0.05
271	600004	白云机场	8,100	114,453.00	0.05
272	601216	君正集团	23,100	114,345.00	0.05
273	600332	白云山	3,900	114,075.00	0.05
274	000961	中南建设	12,900	113,907.00	0.05
275	000656	金科股份	15,700	111,313.00	0.05
276	002739	万达电影	6,100	110,288.00	0.05
277	601881	中国银河	8,800	110,088.00	0.05
278	600018	上港集团	23,800	108,766.00	0.05
279	600390	五矿资本	15,440	107,771.20	0.05
280	603317	天味食品	1,300	106,912.00	0.05
281	688009	中国通号	17,700	103,722.00	0.05
282	002791	坚朗五金	700	100,800.00	0.05
283	600233	圆通速递	8,700	100,050.00	0.05
284	002675	东诚药业	5,000	99,550.00	0.05
285	601117	中国化学	16,900	99,203.00	0.05
286	601319	中国人保	14,600	95,922.00	0.05
287	002558	巨人网络	5,500	95,865.00	0.05
288	600271	航天信息	7,600	95,760.00	0.05
289	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.05
290	000723	美锦能源	14,000	93,520.00	0.04
291	603456	九洲药业	2,600	93,080.00	0.04
292	600998	九州通	5,100	92,616.00	0.04
293	002891	中宠股份	1,600	91,984.00	0.04
294	603156	养元饮品	3,536	91,370.24	0.04
295	600208	新潮中宝	29,400	91,140.00	0.04
296	600085	同仁堂	3,765	89,983.50	0.04
297	002258	利尔化学	4,300	89,870.00	0.04
298	600100	同方股份	14,400	89,280.00	0.04

299	000400	许继电气	6,100	88,206.00	0.04
300	002430	杭氧股份	3,000	87,270.00	0.04
301	601231	环旭电子	4,500	87,030.00	0.04
302	002032	苏泊尔	1,100	85,789.00	0.04
303	601238	广汽集团	6,380	84,790.20	0.04
304	300725	药石科技	600	82,800.00	0.04
305	002939	长城证券	6,400	82,368.00	0.04
306	603027	千禾味业	2,200	82,236.00	0.04
307	603195	公牛集团	400	82,116.00	0.04
308	600848	上海临港	4,100	82,082.00	0.04
309	300188	美亚柏科	3,800	81,852.00	0.04
310	600298	安琪酵母	1,600	81,712.00	0.04
311	688069	德林海	1,306	81,559.70	0.04
312	002959	小熊电器	700	79,345.00	0.04
313	002030	达安基因	2,300	78,890.00	0.04
314	600482	中国动力	4,400	78,848.00	0.04
315	002146	荣盛发展	11,900	77,707.00	0.04
316	300031	宝通科技	4,000	77,680.00	0.04
317	300624	万兴科技	1,400	77,546.00	0.04
318	600027	华电国际	22,300	75,820.00	0.04
319	688208	道通科技	1,100	75,361.00	0.04
320	300394	天孚通信	1,400	74,662.00	0.04
321	000671	阳光城	11,300	73,676.00	0.03
322	300088	长信科技	8,000	71,120.00	0.03
323	600729	重庆百货	2,400	69,360.00	0.03
324	002153	石基信息	2,200	68,398.00	0.03
325	603378	亚士创能	1,600	68,336.00	0.03
326	601577	长沙银行	7,000	66,640.00	0.03
327	000627	天茂集团	13,500	65,745.00	0.03
328	603392	万泰生物	300	60,459.00	0.03
329	600989	宝丰能源	5,000	58,500.00	0.03
330	600025	华能水电	12,300	54,858.00	0.03
331	601698	中国卫通	2,900	52,606.00	0.02
332	601808	中海油服	4,100	52,357.00	0.02
333	002945	华林证券	1,800	27,126.00	0.01
334	600299	安迪苏	2,200	25,322.00	0.01
335	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
336	300877	金春股份	381	19,373.85	0.01
337	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01

338	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
339	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
340	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.01
341	300872	天阳科技	465	17,595.60	0.01
342	300913	兆龙互连	700	17,277.40	0.01
343	600060	海信视像	1,500	17,220.00	0.01
344	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
345	605151	西上海	723	15,219.15	0.01
346	605500	森林包装	762	14,980.92	0.01
347	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
348	300861	美畅股份	281	14,359.10	0.01
349	003027	同兴环保	349	14,008.86	0.01
350	300878	维康药业	281	13,690.32	0.01
351	003020	立方制药	374	12,858.12	0.01
352	300907	康平科技	473	12,700.05	0.01
353	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
354	300887	谱尼测试	169	12,593.88	0.01
355	300873	海晨股份	295	12,189.40	0.01
356	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
357	300860	锋尚文化	89	11,273.63	0.01
358	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
359	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.00
360	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
361	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
362	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600882	妙可蓝多	13,630,715.00	5.91
2	600048	保利地产	11,651,070.13	5.05
3	601336	新华保险	11,288,258.35	4.90
4	600809	山西汾酒	10,305,749.97	4.47
5	002241	歌尔股份	8,784,705.41	3.81
6	603019	中科曙光	8,508,503.00	3.69

7	300015	爱尔眼科	8,066,414.09	3.50
8	603369	今世缘	6,771,777.00	2.94
9	002146	荣盛发展	6,600,487.00	2.86
10	300661	圣邦股份	6,273,188.00	2.72
11	300413	芒果超媒	6,122,108.87	2.66
12	000858	五粮液	5,926,593.88	2.57
13	600036	招商银行	5,815,686.10	2.52
14	600383	金地集团	5,786,730.06	2.51
15	002714	牧原股份	5,745,925.97	2.49
16	600745	闻泰科技	5,642,984.00	2.45
17	300760	迈瑞医疗	5,492,864.00	2.38
18	300792	壹网壹创	5,241,287.40	2.27
19	600763	通策医疗	5,234,480.00	2.27
20	002624	完美世界	5,231,163.00	2.27
21	600536	中国软件	5,171,047.00	2.24
22	300274	阳光电源	5,156,105.56	2.24
23	300750	宁德时代	5,114,052.00	2.22
24	601601	中国太保	5,100,823.74	2.21
25	601988	中国银行	4,989,244.00	2.16
26	000895	双汇发展	4,870,104.38	2.11
27	002475	立讯精密	4,741,766.61	2.06
28	600438	通威股份	4,732,868.00	2.05
29	601100	恒立液压	4,700,019.43	2.04
30	600588	用友网络	4,645,449.62	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600809	山西汾酒	11,060,691.51	4.80
2	600882	妙可蓝多	10,482,421.52	4.55
3	600048	保利地产	10,348,210.00	4.49
4	601336	新华保险	9,592,655.68	4.16
5	002241	歌尔股份	9,504,666.56	4.12
6	300015	爱尔眼科	9,278,060.54	4.03
7	300413	芒果超媒	9,247,155.79	4.01

8	603019	中科曙光	8,859,415.87	3.84
9	002146	荣盛发展	7,699,486.00	3.34
10	000858	五粮液	7,617,071.71	3.30
11	002624	完美世界	7,406,320.40	3.21
12	002714	牧原股份	6,551,483.68	2.84
13	002555	三七互娱	6,543,274.00	2.84
14	300750	宁德时代	6,499,927.00	2.82
15	300661	圣邦股份	6,416,946.48	2.78
16	600036	招商银行	6,309,151.95	2.74
17	002475	立讯精密	6,005,792.52	2.61
18	600745	闻泰科技	5,946,332.40	2.58
19	300433	蓝思科技	5,887,319.60	2.55
20	600383	金地集团	5,775,792.02	2.51
21	300760	迈瑞医疗	5,545,245.68	2.41
22	601166	兴业银行	5,520,866.00	2.40
23	603369	今世缘	5,458,711.00	2.37
24	601988	中国银行	5,418,007.00	2.35
25	300792	壹网壹创	5,391,303.26	2.34
26	002607	中公教育	5,224,334.52	2.27
27	601601	中国太保	5,187,073.08	2.25
28	000895	双汇发展	5,158,940.72	2.24
29	601012	隆基股份	5,090,465.00	2.21
30	600519	贵州茅台	5,065,150.55	2.20
31	600536	中国软件	5,053,079.68	2.19
32	603259	药明康德	4,935,805.40	2.14
33	601808	中海油服	4,886,538.37	2.12
34	002127	南极电商	4,812,785.30	2.09
35	600438	通威股份	4,715,397.74	2.05
36	600763	通策医疗	4,654,588.00	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	602,294,183.90
卖出股票收入（成交）总额	676,727,909.09

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。

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	6,116,790.00	2.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,008,300.00	0.47
	其中：政策性金融债	1,008,300.00	0.47
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	7,125,090.00	3.36

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019627	20 国债 01	30,000	2,999,700.00	1.41
2	010107	21 国债(7)	16,000	1,619,040.00	0.76
3	019640	20 国债 10	15,000	1,498,050.00	0.71
4	108604	国开 1805	10,000	1,008,300.00	0.47

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

2020年3月25日，上海妙可蓝多食品科技股份有限公司因未及时将控股股东及其关联方资金占用及关联交易情况予以披露，亦未在上述占用期间内的定期报告中就该事项进行披露，违反了《上市公司信息披露管理办法》的相关规定，被中国证券监督管理委员会上海监管局采取了出具警示函的行政监管措施。

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,428.17
2	应收证券清算款	24,861.84
3	应收股利	-
4	应收利息	122,962.07
5	应收申购款	547,865.87

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	751,117.95

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
9,180	13,740.46	1,041,882.71	0.83%	125,095,520.50	99.17%

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	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月1日）基金份额总额	3,917,182,128.64
本报告期期初基金份额总额	191,176,536.07
本报告期基金总申购份额	21,501,372.62
减:本报告期基金总赎回份额	86,540,505.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	126,137,403.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

国金证券	2	376,537,946.35	29.66%	350,666.19	29.66%	-
海通证券	2	314,741,690.44	24.79%	293,117.72	24.79%	-
广发证券	2	280,667,619.97	22.11%	261,388.03	22.11%	-
中金公司	2	66,541,257.59	5.24%	61,970.32	5.24%	-
东方证券	2	61,920,858.23	4.88%	57,667.45	4.88%	-
国信证券	2	50,826,222.55	4.00%	47,334.39	4.00%	-
国泰君安	2	43,131,456.11	3.40%	40,167.88	3.40%	-
申万宏源	2	37,799,999.26	2.98%	35,203.30	2.98%	-
中信证券	2	28,972,018.45	2.28%	26,981.64	2.28%	-
安信证券	2	8,264,061.03	0.65%	7,696.13	0.65%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。
- (3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

国金证券	14,607,054.80	29.89%	-	-	-	-
海通证券	17,222,576.90	35.24%	-	-	-	-
广发证券	6,600,614.40	13.51%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	2,015,400.00	4.12%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	8,420,160.00	17.23%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理基金 2019 年第四季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 1 月 21 日
2	农银汇理基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 3 月 13 日
3	农银汇理基金 2019 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 4 月 14 日
4	农银汇理基金 2020 年一季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
5	关于农银汇理基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 5 月 29 日
6	农银汇理基金二季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 7 月 20 日

		人网站	
7	农银汇理旗下基金 2020 年中期报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
8	农银汇理旗下 60 只基金产品资料概要	证券时报、基金管理人网站	2020 年 8 月 31 日
9	农银汇理基金 2020 年第三季度报告	证券时报、基金管理人网站	2020 年 10 月 27 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理大盘蓝筹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。

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

13.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2021 年 3 月 29 日