

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中 基金（FOF） 2022 年中期报告

2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 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 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告 (未经审计) | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产 (基金净值) 变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 42 |
| 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 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 43 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 43 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 43 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 43 |

| | |
|--|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 43 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 44 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 46 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |
| 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 | 47 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 47 |
| § 10 重大事件揭示 | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 48 |
| 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 | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 48 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 48 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 48 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 48 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 48 |
| 10.9 其他重大事件 | 49 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| § 12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录 | 50 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------|
| 基金名称 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) |
| 基金简称 | 农银永乐 3 月持有 (FOF) |
| 基金主代码 | 009185 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 6 月 24 日 |
| 基金管理人 | 农银汇理基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 30,397,745.17 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金是基金中基金，通过大类资产配置，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金，寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 资产配置策略：以宏观经济分析为重点，基于经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的估值及风险收益状况等，判断宏观经济发展趋势、政策导向和证券市场的未来发展趋势，确定和构造合适的资产配置比例。基金选择策略：采用定量分析和定性分析相结合的方法对基金进行选择。 |
| 业绩比较基准 | 25%×沪深 300 指数收益率+75%×中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 翟爱东 | 胡波 |
| | 联系电话 | 021-61095588 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | xuxin@abc-ca.com | hub5@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-61095599 | 95528 |
| 传真 | | 021-61095556 | 021-63602540 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层 | 上海市中山东一路 12 号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层 | 上海市北京东路 689 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200001 |
| 法定代表人 | | 许金超 | 郑杨 |

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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -480,216.72 |
| 本期利润 | -1,849,479.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0438 |
| 本期加权平均净值利润率 | -4.27% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.81% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,034,386.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0340 |
| 期末基金资产净值 | 31,432,131.90 |
| 期末基金份额净值 | 1.0340 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.40% |

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

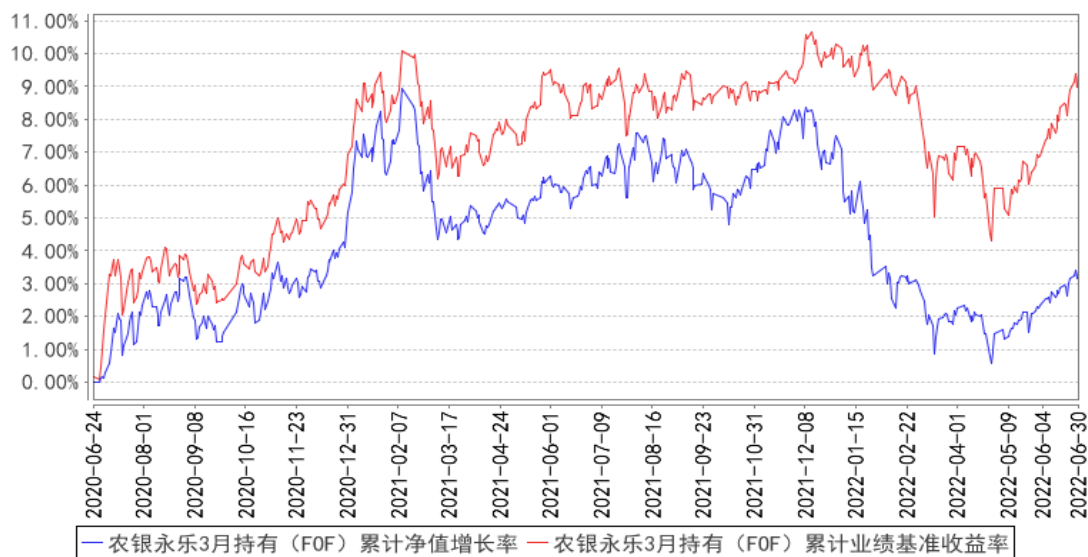
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 1.07% | 0.17% | 2.33% | 0.27% | -1.26% | -0.10% |
| 过去三个月 | 1.31% | 0.22% | 2.48% | 0.35% | -1.17% | -0.13% |
| 过去六个月 | -3.81% | 0.31% | -0.77% | 0.36% | -3.04% | -0.05% |
| 过去一年 | -2.94% | 0.32% | 0.36% | 0.31% | -3.30% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.40% | 0.32% | 9.42% | 0.32% | -6.02% | 0.00% |

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

农银永乐3月持有 (FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：投资于证券投资基金（含 QDII 基金，香港互认基金）的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于股票，股票型基金，混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）占基金资产的比例为 0%–40%。每个交易日日终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。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。

§ 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 2022 年 6 月 30 日,公司共管理 67 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、农银汇理金安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理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、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、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及农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 (助理) 期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|-------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 叶忻 | 本基金的基金经理 | 2020 年 6 月 24 日 | - | 12 年 | 历任泰信基金产品经理, 农银汇理基金产品经理、产品主管。现任农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末, 本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内, 本基金未违反法律法规及基金合同的规定, 也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年诸多“黑天鹅事件”让宏观经济雪上加霜: 俄乌冲突显著抬升了全球通胀压力, 并加剧了国家间的“对立”与“脱钩”; 海外经济体加息与缩表持续压制全球风险偏好, 抑制成长股估值; 进口原材料价格上升和产成品出口需求减弱, 汇率处于两难境地, 人民币汇率波动幅度加大; 疫情对居民生活和产业链的影响超过了 2020 年, 防疫效果和防控政策的变化, 影响着企业盈利预期和投资者的风险偏好。

上述因素进一步加剧了“需求紧缩、供给冲击、预期减弱”三重压力, A 股指数在 4 月末触及本轮下跌的最低点。为了应对冲击, 各类政策“应出尽出”, 着重强调“保市场主体保民生保就业”, 并主要通过保市场主体来实现保民生和保就业。全国各地在房地产、汽车、消费等领域出台了一系列的组合拳以刺激经济。随着本轮疫情逐渐得以控制, 一线城市复工复产, 企业盈利预期和风险偏好均有所修复。需求相对确定或业绩高增的汽车、光伏等高景气方向有较强的逻辑支撑, 带动市场反弹。

本基金在一季度根据市场情况和投资者反馈, 对基金的风险收益定位进行了调整, 在投资管理思路中更多的从绝对收益角度出发, 而减少相对收益的考虑, 降低了基金权益资产仓位中枢。在其后的投资管理中以稳健和均衡为配置取向。权益资产仓位总体保持在中性状态, 在疫情拐点后小幅增加了权益资产仓位, 在具体投资操作中尽量将底层资产的风格和行业维持在比较均衡的状态; 以纯债基金为固定收益资产底仓, 持仓基金以利率债基和高信用等级的信用债基为主。

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 1.0340 元; 本报告期基金份额净值增长率为-3.81%, 业绩比较基准收益率为-0.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，内外部的不确定性因素依然很多。国内经济修复在延续，虽然疫情仍会反复，但其冲击预计较上半年减弱；海外滞涨担忧仍存，美联储继续加息，中美基准利率正式倒挂，汇率和资本外流等压力加大；国内 CPI 预计将在三季度突破 3%，通胀担忧掣肘政策空间；居民的就业情况和收入预期制约了消费等行业的盈利前景；各类稳增长稳预期的举措落地效果仍待观察。

总体而言，在流动性宽裕、政策易松难紧的背景下，权益市场有望从估值修复和情绪修复转向基本面修复，形式上可能表现为结构性景气行业的快速轮动。但景气行业内部的分化程度可能更加极致，需要精挑细选寻找阿尔法，同时应谨慎对待拥挤度过高的领域。

在未来的投资管理中，我们将保持稳健均衡主基调的同时，给组合赋予一定的弹性和“反脆弱性”，以在复杂多变的市场中，增厚组合的收益。

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》、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)等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责：公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况、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

本基金从 2021 年 12 月 10 日至 2022 年 2 月 17 日、2022 年 3 月 24 日至 2022 年 5 月 12 日、2022 年 5 月 24 日至 2022 年 6 月 30 日, 分别连续 20 个工作日以上出现基金资产净值低于 5000 万的情形, 根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件, 予以披露。

§ 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, 上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)的托管过程中, 严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定, 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

本报告期内, 本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定, 对农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)的投资运作进行了监督, 对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核, 未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内, 由农银汇理基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注: 财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日: 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,525,765.44 | 744,173.53 |
| 结算备付金 | | - | 93,186.82 |
| 存出保证金 | | 6,343.46 | 3,963.52 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 30,256,026.23 | 47,932,799.85 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 28,233,579.65 | 43,731,539.85 |
| 债券投资 | | 2,022,446.58 | 4,201,260.00 |
| 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 | | - | 13,065.73 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,119.10 | 547.42 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 69,227.45 |
| 资产总计 | | 31,789,254.23 | 48,856,964.32 |
| 负债和净资产 | | | |
| 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 | | - | 1,200,000.00 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 272,243.57 | 399,801.80 |
| 应付管理人报酬 | | 28,799.01 | 44,759.06 |
| 应付托管费 | | 6,489.37 | 10,391.23 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 5,992.50 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 49,590.38 | 169,457.53 |
| 负债合计 | | 357,122.33 | 1,830,402.12 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 30,397,745.17 | 43,747,833.16 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 1,034,386.73 | 3,278,729.04 |
| 净资产合计 | | 31,432,131.90 | 47,026,562.20 |
| 负债和净资产总计 | | 31,789,254.23 | 48,856,964.32 |

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0340元，基金份额总额30,397,745.17份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理永乐3个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年1月1日至2022 年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日 |
|------------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -1,498,825.01 | 3,639,118.02 |
| 1. 利息收入 | | 6,174.65 | 131,364.69 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 6,174.65 | 20,352.08 |
| 债券利息收入 | | - | 111,012.61 |
| 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） | | -135,736.75 | 8,412,444.30 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -470,166.09 | 8,161,545.63 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 24,575.88 | -13,145.34 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 309,853.46 | 264,044.01 |
| 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） | 6.4.7.21 | -1,369,262.91 | -4,904,690.97 |

| | | | | |
|-----------------------------|------------|--|---------------|--------------|
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列) | | | - | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | 6.4.7.22 | | - | - |
| 减: 二、营业总支出 | | | 350,654.62 | 1,071,071.59 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | | 238,399.36 | 641,483.63 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | | 53,853.01 | 143,790.63 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | | - | - |
| 5. 利息支出 | | | 7,102.05 | 5,354.82 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | | 7,102.05 | 5,354.82 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.24 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.25 | | 51,300.20 | 280,442.51 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | | | -1,849,479.63 | 2,568,046.43 |
| 减: 所得税费用 | | | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | | | -1,849,479.63 | 2,568,046.43 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | | -1,849,479.63 | 2,568,046.43 |

6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|------------------|---------------------------------|--------|--------------|---------------|
| | 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) | 43,747,833.16 | - | 3,278,729.04 | 47,026,562.20 |
| 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) | 43,747,833.16 | - | 3,278,729.04 | 47,026,562.20 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|---------------|----------------|
| 净值) | | | | |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -13,350,087.99 | - | -2,244,342.31 | -15,594,430.30 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,849,479.63 | -1,849,479.63 |
| （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） | -13,350,087.99 | - | -394,862.68 | -13,744,950.67 |
| 其中：1. 基金申购款 | 21,467,431.10 | - | 647,907.58 | 22,115,338.68 |
| 2. 基金赎回款 | -34,817,519.09 | - | -1,042,770.26 | -35,860,289.35 |
| （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） | 30,397,745.17 | - | 1,034,386.73 | 31,432,131.90 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2021年1月1日至2021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) | 191,392,182.79 | - | 9,917,165.78 | 201,309,348.57 |
| 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) | 191,392,182.79 | - | 9,917,165.78 | 201,309,348.57 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -118,685,088.64 | - | -5,169,961.66 | -123,855,050.30 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 2,568,046.43 | 2,568,046.43 |
| (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) | -118,685,088.64 | - | -7,738,008.09 | -126,423,096.73 |
| 其中:1.基金申购款 | 10,521,404.06 | - | 705,883.73 | 11,227,287.79 |
| 2.基金赎回款 | -129,206,492.70 | - | -8,443,891.82 | -137,650,384.52 |
| (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) | 72,707,094.15 | - | 4,747,204.12 | 77,454,298.27 |

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：

程昆

毕宏燕

丁煜琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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[2020]285 号《关于准予农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 437,672,130.43 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(2020)第 0465 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》于 2020 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 437,872,936.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 200,805.67 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

对于每份基金份额,3 个月持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)或该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)。对于每份基金份额,3 个月持有期到期日指该基金份额 3 个月持有期起始日 3 个月后的年度对应日。年度对应日,指某一个特定日期在后续月度中的对应日期,如该月无此对应日期,则取该月对应月份的最后一日;如该日为非工作日,则顺延至下一工作日。在基金份额的 3 个月持有期到期日前(不含当日),基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请;基金份额的 3 个月持有期到期日起(含当日),基金份额持有

人可对该基金份额提出赎回申请。因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 3 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的, 该基金份额的 3 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金 (含 QDII、香港互认基金)、国内依法发行上市的股票 (包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券 (包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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)。本基金投资于证券投资基金 (含 QDII、香港互认基金) 的比例不低于基金资产的 80%, 投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金 (含商品期货基金和黄金 ETF) 占基金资产的比例为 0%-40%。每个交易日日终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 $25% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+75% \times$ 中证全债指数收益率。

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》、《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 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

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所列内容外, 本基金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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

新金融工具准则

1、金融资产和金融负债的分类:

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

2、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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认

后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具,按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具,按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项,无论是否存在重大融资成分,本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

3、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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税[适用于有应税金融商品转让项目的基金]后的净额确认为投资收益,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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

1、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、基金投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

2、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或资产支持证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。

[适用于本年度存在因持有违约债券或逆回购违约而计提减值的基金]除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产外,本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查,如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的,计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时,按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额,计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科

目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，结合现时情况确定应计提的坏账准备。

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。

3、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。[适用于可投资基金的基金]基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额[适用于有应税金融商品转让项目的基金]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。

金融工具分类和计量结果

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31

日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款, 金额分别为 744,173.53 元、93,186.82 元、3,963.52 元、69,227.45 元、13,065.73 元和 547.42 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款, 金额分别为 744,380.62 元、93,228.72 元、3,965.32 元、0.00 元、13,065.73 元和 547.42 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 47,932,799.85 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 48,001,776.51 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付利息, 金额分别为 1,200,000.00 元、399,801.80 元、44,759.06 元、10,391.23 元和-542.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付利息, 金额分别为 1,199,457.53 元、399,801.80 元、44,759.06 元、10,391.23 元和 0.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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费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 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,525,765.44 |
| 等于：本金 | 1,525,608.37 |
| 加：应计利息 | 157.07 |
| 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 | 1,525,765.44 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|------------------------|--------------|---------------|--------------|-----------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | - | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 2,004,800.00 | 19,446.58 | 2,022,446.58 | -1,800.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 2,004,800.00 | 19,446.58 | 2,022,446.58 | -1,800.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | 28,080,078.85 | - | 28,233,579.65 | 153,500.80 | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 30,084,878.85 | 19,446.58 | 30,256,026.23 | 151,700.80 | |

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额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 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 49,590.38 |
| 合计 | 49,590.38 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 43,747,833.16 | 43,747,833.16 |
| 本期申购 | 21,467,431.10 | 21,467,431.10 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -34,817,519.09 | -34,817,519.09 |
| 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 | 30,397,745.17 | 30,397,745.17 |

注：申购含红利再投、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 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初 | 6,800,083.95 | -3,521,354.91 | 3,278,729.04 |
| 本期利润 | -480,216.72 | -1,369,262.91 | -1,849,479.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,810,901.58 | 1,416,038.90 | -394,862.68 |
| 其中：基金申购款 | 3,165,470.62 | -2,517,563.04 | 647,907.58 |
| 基金赎回款 | -4,976,372.20 | 3,933,601.94 | -1,042,770.26 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,508,965.65 | -3,474,578.92 | 1,034,386.73 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
| | |

| | |
|-----------|----------|
| 活期存款利息收入 | 5,293.19 |
| 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 | 747.26 |
| 其他 | 134.20 |
| 合计 | 6,174.65 |

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

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 35,138,525.79 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 35,588,348.79 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额 | - |
| 减：交易费用 | 20,343.09 |
| 基金投资收益 | -470,166.09 |

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 41,880.33 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入 | -17,304.45 |
| 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 | 24,575.88 |

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总 额 | 6,519,821.73 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额 | 6,420,820.00 |
| 减：应计利息总额 | 116,299.73 |

| | |
|----------|------------|
| 减：交易费用 | 6.45 |
| 买卖债券差价收入 | -17,304.45 |

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 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。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | - |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 309,853.46 |
| 合计 | 309,853.46 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -1,369,262.91 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 12,480.00 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | -1,381,742.91 |
| 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 | -1,369,262.91 |

6.4.7.22 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 |
|----------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费(元) | 6,553.64 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费(元) | 104,392.10 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费(元) | 25,063.38 |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 24,795.19 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 1,709.82 |
| 合计 | 51,300.20 |

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，本基金并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(“农银汇理基金管理有限公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |

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

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、权证交易、债券交易和债券回购交易。本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

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 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 238,399.36 | 641,483.63 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 115,000.14 | 349,594.61 |

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的 1.20% 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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金公允价值后的余额 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 53,853.01 | 143,790.63 |

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后余额的 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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金公允价值后的余额 × 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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 |
| 浦发银行 | 1,525,765.44 | 5,293.19 | 1,047,869.61 | 19,993.99 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于2022年6月30日，本基金持有基金管理人农银汇理所管理的公开募集证券投资基金合计2,368,176.43元，占本基金资产净值的比例为7.53%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------|------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 2,898.50 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 17,066.12 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 6,553.64 | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理 | 104,392.10 | 5,000.97 |

| | | |
|---------------------|-----------|----------|
| 费 (元) | | |
| 当期持有基金产生的应支付托管费 (元) | 25,063.38 | 1,667.05 |

注：注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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(2022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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 2,022,446.58 | 4,201,260.00 |
| 合计 | 2,022,446.58 | 4,201,260.00 |

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

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。

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 2022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 | 1,525,765.44 | - | - | - | 1,525,765.44 |
| 存出保证金 | 6,343.46 | - | - | - | 6,343.46 |
| 交易性金融资产 | 2,022,446.58 | - | - | 28,233,579.65 | 30,256,026.23 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,119.10 | 1,119.10 |
| 资产总计 | 3,554,555.48 | - | - | 28,234,698.75 | 31,789,254.23 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | 272,243.57 | 272,243.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 28,799.01 | 28,799.01 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,489.37 | 6,489.37 |
| 其他负债 | - | - | - | 49,590.38 | 49,590.38 |
| 负债总计 | - | - | - | 357,122.33 | 357,122.33 |
| 利率敏感度缺口 | 3,554,555.48 | - | - | 27,877,576.42 | 31,432,131.90 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 744,173.53 | - | - | - | 744,173.53 |
| 结算备付金 | 93,186.82 | - | - | - | 93,186.82 |
| 存出保证金 | 3,963.52 | - | - | - | 3,963.52 |
| 交易性金融资产 | 4,201,260.00 | - | - | 43,731,539.85 | 47,932,799.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 13,065.73 | 13,065.73 |
| 应收利息 | - | - | - | 69,227.45 | 69,227.45 |
| 应收申购款 | - | - | - | 547.42 | 547.42 |
| 资产总计 | 5,042,583.87 | - | - | 43,814,380.45 | 48,856,964.32 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 1,200,000.00 | - | - | - | 1,200,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 399,801.80 | 399,801.80 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 44,759.06 | 44,759.06 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,391.23 | 10,391.23 |
| 应付利息 | - | - | - | -542.47 | -542.47 |
| 应交税费 | - | - | - | 5,992.50 | 5,992.50 |
| 其他负债 | - | - | - | 170,000.00 | 170,000.00 |
| 负债总计 | 1,200,000.00 | - | - | 630,402.12 | 1,830,402.12 |
| 利率敏感度缺口 | 3,842,583.87 | - | - | 43,183,978.33 | 47,026,562.20 |

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

| | | | |
|----|-----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 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（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 市场利率平行上升 25 个基点 | -2,703.00 | -3,256.06 |
| | 市场利率平行下降 | 2,703.00 | 3,256.06 |

| | | | |
|--|--------|--|--|
| | 25 个基点 | | |
|--|--------|--|--|

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2021 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 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | 28,233,579.65 | 89.82 | 43,731,539.85 | 92.99 |
| 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 | 28,233,579.65 | 89.82 | 43,731,539.85 | 92.99 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | — | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|----|-------------|-----------------------------|------------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 本期末（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5% | 1,230,052.51 | 2,167,591.23 |

| | | | |
|--|----------------|------------------|------------------|
| | 业绩比较基准下降 5% | -1, 230, 052. 51 | -2, 167, 591. 23 |
|--|----------------|------------------|------------------|

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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 28, 233, 579. 65 | 43, 731, 539. 85 |
| 第二层次 | 2, 022, 446. 58 | 4, 201, 260. 00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 30, 256, 026. 23 | 47, 932, 799. 85 |

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 2022 年 6 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(2021 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

无。

§ 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 28,233,579.65 | 88.81 |
| 3 | 固定收益投资 | 2,022,446.58 | 6.36 |
| | 其中：债券 | 2,022,446.58 | 6.36 |
| | 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 | 1,525,765.44 | 4.80 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,462.56 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 31,789,254.23 | 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**

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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**

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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 | 2,022,446.58 | 6.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,022,446.58 | 6.43 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 019666 | 22 国债 01 | 20,000 | 2,022,446.58 | 6.43 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金将自上而下的资产配置策略与自下而上的基金优选策略相结合，力争实现基金资产的长期稳健增值。资产配置方面，本基金根据产品定位确定本基金各类资产的中长期中枢比例，在此基础上，根据市场情况确定细分资产类别的战术资产配置比例，灵活运用多种投资策略，构建和动态维护投资组合。基金优选方面，本基金将定量评价与定性评价相结合，筛选优秀的基金经理和基金品种。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|------------|--------|--------------|--------------|---------------|------------------------|
| 1 | 002169 | 永赢稳益债券 | 契约型开放式 | 2,846,582.84 | 3,093,950.89 | 9.84 | 否 |
| 2 | 003327 | 万家鑫璟纯债债券 A | 契约型开放式 | 2,565,392.58 | 3,086,423.81 | 9.82 | 否 |
| 3 | 006758 | 农银汇理金禄债券 | 契约型开放式 | 2,303,897.68 | 2,368,176.43 | 7.53 | 是 |
| 4 | 000015 | 华夏纯债债券 A | 契约型开放式 | 1,679,200.00 | 2,130,904.80 | 6.78 | 否 |
| 5 | 519782 | 交银裕隆纯债债券 A | 契约型开放式 | 1,384,820.29 | 1,778,801.66 | 5.66 | 否 |
| 6 | 003978 | 中信建投稳祥债券 A | 契约型开放式 | 1,711,447.00 | 1,767,411.32 | 5.62 | 否 |
| 7 | 100066 | 富国纯债债券发起 A | 契约型开放式 | 1,601,170.57 | 1,758,245.40 | 5.59 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|--------------|----------|--------------|--------------|------|---|
| 8 | 004585 | 鹏扬汇利债券 A | 契约型开放式 | 1,550,349.14 | 1,679,028.12 | 5.34 | 否 |
| 9 | 001299 | 兴业添利债券 | 契约型开放式 | 1,390,118.89 | 1,418,477.32 | 4.51 | 否 |
| 10 | 004705 | 南方祥元债券 A | 契约型开放式 | 1,016,068.83 | 1,132,510.32 | 3.60 | 否 |
| 11 | 040041 | 华安纯债债券 C | 契约型开放式 | 935,628.74 | 1,008,139.97 | 3.21 | 否 |
| 12 | 007617 | 富国投资级信用债债券 C | 契约型开放式 | 956,022.94 | 983,078.39 | 3.13 | 否 |
| 13 | 519918 | 华夏兴和混合 | 契约型开放式 | 183,909.71 | 849,295.04 | 2.70 | 否 |
| 14 | 012940 | 中泰星元灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 339,584.32 | 841,252.24 | 2.68 | 否 |
| 15 | 519002 | 华安安信消费混合 A | 契约型开放式 | 167,580.16 | 808,071.53 | 2.57 | 否 |
| 16 | 002943 | 广发多因子混合 | 契约型开放式 | 225,778.91 | 771,373.65 | 2.45 | 否 |
| 17 | 008246 | 圆信永丰致优混合 C | 契约型开放式 | 393,650.29 | 758,249.19 | 2.41 | 否 |
| 18 | 161834 | 银华鑫锐灵活配置混合 | 上市契约型开放式 | 418,539.96 | 743,326.97 | 2.36 | 否 |

| | | (LOF)A | (LOF) | | | | |
|----|--------|--------------------------------|-------------------------|------------|------------|------|---|
| 19 | 550015 | 中信保 诚至远 动力混 合 A | 契约 型开 放式 | 183,931.77 | 482,820.90 | 1.54 | 否 |
| 20 | 090018 | 大成新 锐产业 混合 | 契约 型开 放式 | 77,833.57 | 474,084.27 | 1.51 | 否 |
| 21 | 001445 | 华安国 企改革 主题灵 活配置 混合 | 契约 型开 放式 | 76,689.88 | 299,857.43 | 0.95 | 否 |
| 22 | 511990 | 华宝添 益货币 A | 交易 型开 放式 (ETF) | 1.00 | 100.00 | 0.00 | 否 |

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.3 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 | 6,343.46 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,119.10 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,462.56 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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 (%) |
| 1,557 | 19,523.28 | 0.00 | 0.00 | 30,397,745.17 | 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 | 187,303.36 | 0.6162 |

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 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2020 年 6 月 24 日) 基金份额总额 | 437,872,936.10 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 43,747,833.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 21,467,431.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 34,817,519.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 30,397,745.17 |

注：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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内未发生涉及公募基金托管业务的诉讼。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%) | |
| 西藏东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：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。

10.8.2 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 | | 基金交易 | |
|----------|--------------|------------------|---------------|--------------------|------|------------------|---------------|------------------|
| | 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 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 西藏东方财富证券 | 6,413,602.00 | 100.00 | 59,800,000.00 | 100.00 | - | - | 19,894,060.41 | 100.00 |

10.9 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 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2021 年第 4 季度报告 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 2 | 关于农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 可能触发基金合同终止情形的提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 1 月 26 日 |
| 3 | 关于农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 2 月 17 日 |
| 4 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2021 年年度报告 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 3 月 29 日 |
| 5 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2022 年第 1 季度报告 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 4 月 21 日 |
| 6 | 关于农银汇理永乐 3 个月持有期混 | 证券日报、基金管理人 | 2022 年 5 月 14 日 |

| | | | |
|---|--|--------------|-----------------|
| | 合型基金中基金 (FOF) 可能触发基金合同终止情形的提示性公告 | 网站 | |
| 7 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 年 6 月 29 日 |
| 8 | 农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) - 招募说明书更新-2022 年第 1 次 | 证券日报、基金管理人网站 | 2022 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、《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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

2022 年 8 月 30 日