

# 农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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的情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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	114,074,072.33 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	北京市西城区金融大街 25 号

	区银城路 9 号 50 层	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金中期报告备置地点	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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	20,460,760.65
本期利润	10,179,462.95
加权平均基金份额本期利润	0.0860
本期加权平均净值利润率	5.10%
本期基金份额净值增长率	5.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	87,670,114.07
期末可供分配基金份额利润	0.7685
期末基金资产净值	201,744,186.40
期末基金份额净值	1.7685
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	76.85%

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

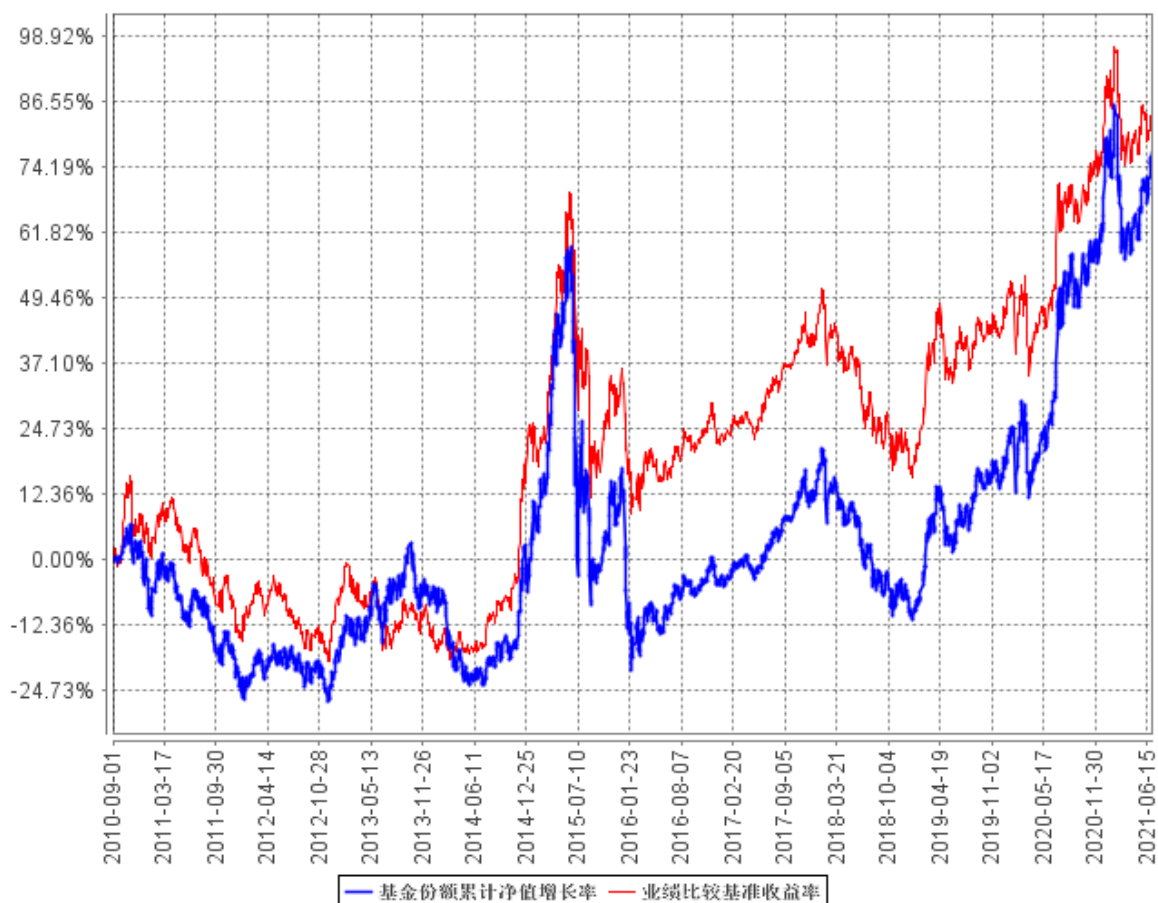
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.07%	0.84%	-1.46%	0.60%	4.53%	0.24%
过去三个月	10.23%	0.86%	2.99%	0.73%	7.24%	0.13%
过去六个月	5.09%	1.24%	0.95%	0.99%	4.14%	0.25%
过去一年	33.05%	1.25%	19.87%	1.00%	13.18%	0.25%
过去三年	73.86%	1.18%	41.50%	1.02%	32.36%	0.16%
自基金合同生效起至今	76.85%	1.31%	83.09%	1.08%	-6.24%	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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 62 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农

银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金及农银汇理金盛债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金基金经理	2015 年 12 月 2 日	-	14	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

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。

#### 4.2 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

上半年市场震荡为主，年初经过大幅震荡后，后续大盘基本处于窄幅震荡，市场结构分化比较严重。整体上，经济一季度数据上是顶点，二季度数据比预期要好。但基本上符合市场的预期；流动性上，央行保持了适度的宽松，为调结构、控风险提供合适环境。在报告期内本基金配置了部分增长较高的股票，取得了较好的超额收益，整体上以公司业绩为主，去寻找抓住超预期机会。

#### 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 1.7685 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.09%，业绩比较基准收益率为 0.95%。

### 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，经济上看，经济弱于上半年。房地产投资上将继续受到严格控制，出口方面下半年还是较难创新高，基建投资基本商业偏弱；而消费受疫情影响，恢复的程度也是较弱。二季度宏观经济基本见顶，市场已经预期到了。关键在于后续市场是否可能超预期下滑；从流动性上看，政府和央行已经预期到经济的状况，进行了货币和财政上的调整，央行的降准，政府也将采取适当的措施。下半年市场震荡的可能性更大一些，市场还是会以结构性机会为主。在估值较高的情况下，选择公司的标准还是业绩为王，加大上市公司的业绩要求才能取得更好的超额收益。

### 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）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关

于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同的要求, 报告期内本基金不需分配利润。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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《中华人民共和国证券投资基金法》、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,727,255.99	7,168,245.55
结算备付金		261,300.94	466,172.56
存出保证金		56,937.47	55,428.17
交易性金融资产	6.4.7.2	186,502,788.32	205,306,294.48
其中：股票投资		179,385,618.32	198,181,204.48
基金投资		-	-
债券投资		7,117,170.00	7,125,090.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	24,861.84
应收利息	6.4.7.5	147,592.41	122,962.07
应收股利		-	-
应收申购款		229,790.80	547,865.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		202,925,665.93	213,691,830.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,591.18	-
应付赎回款		643,088.49	674,182.20
应付管理人报酬		243,144.04	260,165.74
应付托管费		40,524.00	43,360.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	161,033.46	257,580.80
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,098.36	180,501.06
负债合计		1,181,479.53	1,415,790.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	114,074,072.33	126,137,403.21
未分配利润	6.4.7.10	87,670,114.07	86,138,636.58
所有者权益合计		201,744,186.40	212,276,039.79
负债和所有者权益总计		202,925,665.93	213,691,830.54

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7685 元，基金份额总额 114,074,072.33 份。

## 6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		12,878,170.09	23,474,212.09
1.利息收入		152,458.87	192,140.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	40,533.73	74,195.24
债券利息收入		111,925.14	117,944.91
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）		22,991,158.80	21,137,019.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,943,939.44	19,485,968.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-36,055.53	103,913.43
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,083,274.89	1,547,138.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,281,297.70	2,125,441.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,850.12	19,609.99
<b>减：二、费用</b>		2,698,707.14	3,025,071.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,490,251.73	1,578,837.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	248,375.30	263,139.52



3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	867,903.30	1,089,618.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	92,176.81	93,476.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,179,462.95	20,449,140.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,179,462.95	20,449,140.99

### 6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	126,137,403.21	86,138,636.58	212,276,039.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,179,462.95	10,179,462.95
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）	-12,063,330.88	-8,647,985.46	-20,711,316.34
其中：1. 基金申购款	7,893,243.54	5,604,898.11	13,498,141.65
2. 基金赎回款	-19,956,574.42	-14,252,883.57	-34,209,457.99
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）	114,074,072.33	87,670,114.07	201,744,186.40
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		



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%。

#### 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 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 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,727,255.99
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：	15,727,255.99

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	152,813,651.09	179,385,618.32	26,571,967.23

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,125,958.90	7,117,170.00
	银行间市场	-	-
	合计	7,125,958.90	7,117,170.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	159,939,609.99	186,502,788.32	26,563,178.33

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,654.00
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	105.84
应收债券利息	145,809.53
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	23.04
合计	147,592.41

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	161,033.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	161,033.46

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	838.21
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	90,098.36

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,137,403.21	126,137,403.21
本期申购	7,893,243.54	7,893,243.54
本期赎回(以“-”号填列)	-19,956,574.42	-19,956,574.42
- 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	114,074,072.33	114,074,072.33

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	94,271,694.52	-8,133,057.94	86,138,636.58
本期利润	20,460,760.65	-10,281,297.70	10,179,462.95
本期基金份额交易产生的变动数	-10,010,828.12	1,362,842.66	-8,647,985.46
其中：基金申购款	6,619,103.49	-1,014,205.38	5,604,898.11
基金赎回款	-16,629,931.61	2,377,048.04	-14,252,883.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,721,627.05	-17,051,512.98	87,670,114.07

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	36,444.61
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	3,599.14
其他	489.98
合计	40,533.73

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	295,064,456.79
减：卖出股票成本总额	273,120,517.35
买卖股票差价收入	21,943,939.44

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	-36,055.53
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	-36,055.53

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	19,043,710.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,848,979.43
减：应收利息总额	230,786.11
买卖债券差价收入	-36,055.53

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,083,274.89
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	1,083,274.89

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,281,297.70
——股票投资	-10,292,074.93
——债券投资	10,777.23
——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	-10,281,297.70

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,637.93
转换费	1,212.19
合计	15,850.12

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。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	867,903.30
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	867,903.30

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,916.66
合计	92,176.81

## 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”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,490,251.73	1,578,837.20
其中：支付销售机构的客户维护费	525,935.47	558,473.68

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 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	248,375.30	263,139.52

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 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 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。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国建设银行	15,727,255.99	36,444.61	14,472,141.17	68,936.39

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-

301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	科创板锁定	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	科创板锁定	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301010	晶雪	2021年	2021	创业板	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

	节能	6月9日	年12月20日	锁定						
--	----	------	---------	----	--	--	--	--	--	--

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。

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	公告重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	21,700	205,864.51	121,303.00	-



### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,610,420.00	4,497,750.00
合计	4,610,420.00	4,497,750.00

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	2,506,750.00	2,627,340.00
合计	2,506,750.00	2,627,340.00

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。

**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 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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指

标、流通受限制的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短期内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,727,255.99	-	-	-	15,727,255.99
结算备付金	261,300.94	-	-	-	261,300.94
存出保证金	56,937.47	-	-	-	56,937.47
交易性金融资产	7,117,170.00	-	-	-179,385,618.32	186,502,788.32
应收利息	-	-	-	147,592.41	147,592.41
应收申购款	-	-	-	229,790.80	229,790.80
资产总计	23,162,664.40	-	-	-179,763,001.53	202,925,665.93
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,591.18	3,591.18
应付赎回款	-	-	-	643,088.49	643,088.49
应付管理人报酬	-	-	-	243,144.04	243,144.04
应付托管费	-	-	-	40,524.00	40,524.00
应付交易费用	-	-	-	161,033.46	161,033.46
其他负债	-	-	-	90,098.36	90,098.36

负债总计	-	-	-	1,181,479.53	1,181,479.53
利率敏感度缺口	23,162,664.40	-	-	-178,581,522.00	201,744,186.40
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,168,245.55	-	-	-	7,168,245.55
结算备付金	466,172.56	-	-	-	466,172.56
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

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-6,274.54	-6,236.83
	市场利率平行下降25个基点	6,274.54	6,236.83

本基金本报告期末和上年度末未持有利率敏感性资产，因此，市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	179,385,618.32	88.92	198,181,204.48	93.36
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	179,385,618.32	88.92	198,181,204.48	93.36

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	12,217,534.85	12,845,520.06

	业绩比较基准下降 5%	-12,217,534.85	-12,845,520.06
--	-------------	----------------	----------------

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 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	179,385,618.32	88.40
	其中：股票	179,385,618.32	88.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,117,170.00	3.51
	其中：债券	7,117,170.00	3.51
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,988,556.93	7.88
8	其他各项资产	434,320.68	0.21
9	合计	202,925,665.93	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,150,143.00	0.57
B	采矿业	3,304,552.96	1.64
C	制造业	116,828,004.98	57.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,947,059.39	0.97
E	建筑业	1,338,290.44	0.66
F	批发和零售业	1,134,955.40	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	5,809,479.68	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,396,888.97	2.68
J	金融业	27,284,907.75	13.52
K	房地产业	2,012,489.00	1.00
L	租赁和商务服务业	2,356,338.80	1.17
M	科学研究和技术服务业	5,204,447.71	2.58
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	198,455.00	0.10
Q	卫生和社会工作	4,960,473.24	2.46
R	文化、体育和娱乐业	459,132.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	179,385,618.32	88.92

### 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沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,200	6,581,440.00	3.26
2	601012	隆基股份	54,719	4,861,235.96	2.41
3	601919	中远海控	132,100	4,034,334.00	2.00
4	600036	招商银行	73,500	3,982,965.00	1.97
5	601318	中国平安	55,600	3,573,968.00	1.77
6	603259	药明康德	21,908	3,430,573.72	1.70
7	002594	比亚迪	13,250	3,325,750.00	1.65
8	000858	五粮液	10,046	2,992,602.94	1.48
9	300274	阳光电源	23,200	2,669,392.00	1.32
10	000725	京东方 A	383,700	2,394,288.00	1.19
11	600809	山西汾酒	5,300	2,374,400.00	1.18
12	600438	通威股份	53,900	2,332,253.00	1.16
13	300015	爱尔眼科	29,174	2,070,770.52	1.03
14	603659	璞泰来	14,800	2,021,680.00	1.00
15	002812	恩捷股份	8,600	2,013,260.00	1.00
16	603260	合盛硅业	24,200	1,861,222.00	0.92
17	601888	中国中免	6,200	1,860,620.00	0.92
18	000830	鲁西化工	96,900	1,814,937.00	0.90
19	600763	通策医疗	4,400	1,808,400.00	0.90
20	002179	中航光电	22,870	1,807,187.40	0.90
21	000333	美的集团	25,300	1,805,661.00	0.90
22	603486	科沃斯	7,400	1,687,792.00	0.84
23	600426	华鲁恒升	53,370	1,651,801.50	0.82
24	600436	片仔癀	3,500	1,569,050.00	0.78
25	600276	恒瑞医药	22,999	1,563,242.03	0.77



26	002415	海康威视	23,950	1,544,775.00	0.77
27	600096	云天化	109,500	1,537,380.00	0.76
28	601166	兴业银行	74,600	1,533,030.00	0.76
29	300671	富满电子	11,570	1,523,074.80	0.75
30	600887	伊利股份	40,679	1,498,207.57	0.74
31	002139	拓邦股份	82,300	1,480,577.00	0.73
32	601398	工商银行	281,400	1,454,838.00	0.72
33	300059	东方财富	42,367	1,389,213.93	0.69
34	300782	卓胜微	2,580	1,386,750.00	0.69
35	603799	华友钴业	11,996	1,369,943.20	0.68
36	300595	欧普康视	13,100	1,356,505.00	0.67
37	601633	长城汽车	31,000	1,351,290.00	0.67
38	601636	旗滨集团	72,500	1,345,600.00	0.67
39	002821	凯莱英	3,600	1,341,360.00	0.66
40	300750	宁德时代	2,500	1,337,000.00	0.66
41	000651	格力电器	24,686	1,286,140.60	0.64
42	300363	博腾股份	14,900	1,253,388.00	0.62
43	600900	长江电力	58,300	1,203,312.00	0.60
44	600196	复星医药	16,000	1,154,080.00	0.57
45	002475	立讯精密	25,068	1,153,128.00	0.57
46	000799	酒鬼酒	4,500	1,150,200.00	0.57
47	000001	平安银行	49,820	1,126,928.40	0.56
48	600030	中信证券	43,700	1,089,878.00	0.54
49	000568	泸州老窖	4,300	1,014,542.00	0.50
50	603026	石大胜华	6,200	1,004,710.00	0.50
51	000100	TCL 科技	131,300	1,004,445.00	0.50
52	002916	深南电路	8,960	995,724.80	0.49
53	603517	绝味食品	11,600	977,764.00	0.48
54	000063	中兴通讯	29,200	970,316.00	0.48
55	000661	长春高新	2,500	967,500.00	0.48
56	603806	福斯特	8,860	931,451.80	0.46
57	600031	三一重工	31,500	915,705.00	0.45
58	601988	中国银行	294,800	907,984.00	0.45
59	002142	宁波银行	23,130	901,376.10	0.45
60	600309	万华化学	8,120	883,618.40	0.44
61	603501	韦尔股份	2,700	869,400.00	0.43
62	300124	汇川技术	11,545	857,331.70	0.42
63	600919	江苏银行	120,570	856,047.00	0.42
64	603288	海天味业	6,458	832,759.10	0.41

65	000002	万科 A	34,900	830,969.00	0.41
66	002714	牧原股份	13,500	821,070.00	0.41
67	600132	重庆啤酒	4,100	811,595.00	0.40
68	300593	新雷能	18,240	792,528.00	0.39
69	300122	智飞生物	4,100	765,593.00	0.38
70	002920	德赛西威	6,800	748,544.00	0.37
71	300146	汤臣倍健	22,400	736,960.00	0.37
72	002304	洋河股份	3,533	732,037.60	0.36
73	600176	中国巨石	46,177	716,205.27	0.36
74	300759	康龙化成	3,300	716,067.00	0.35
75	603993	洛阳钼业	136,200	702,792.00	0.35
76	002709	天赐材料	6,500	692,770.00	0.34
77	601328	交通银行	140,900	690,410.00	0.34
78	601899	紫金矿业	70,800	686,052.00	0.34
79	300014	亿纬锂能	6,600	685,938.00	0.34
80	688396	华润微	7,400	673,548.00	0.33
81	603127	昭衍新药	3,500	643,125.00	0.32
82	603678	火炬电子	9,500	641,250.00	0.32
83	002352	顺丰控股	9,300	629,610.00	0.31
84	002230	科大讯飞	9,053	611,801.74	0.30
85	002876	三利谱	9,320	603,004.00	0.30
86	600000	浦发银行	60,156	601,560.00	0.30
87	688111	金山办公	1,500	592,200.00	0.29
88	002049	紫光国微	3,700	570,503.00	0.28
89	600837	海通证券	49,500	569,250.00	0.28
90	603833	欧派家居	3,900	553,644.00	0.27
91	601838	成都银行	43,600	551,104.00	0.27
92	000932	华菱钢铁	81,900	540,540.00	0.27
93	603877	太平鸟	10,100	539,138.00	0.27
94	300755	华致酒行	13,200	538,692.00	0.27
95	002241	歌尔股份	12,300	525,702.00	0.26
96	300347	泰格医药	2,700	521,910.00	0.26
97	603986	兆易创新	2,732	513,342.80	0.25
98	601601	中国太保	17,600	509,872.00	0.25
99	600585	海螺水泥	12,300	504,915.00	0.25
100	600690	海尔智家	19,400	502,654.00	0.25
101	002271	东方雨虹	9,050	500,646.00	0.25
102	601668	中国建筑	107,600	500,340.00	0.25
103	002460	赣锋锂业	4,100	496,469.00	0.25

104	002027	分众传媒	52,680	495,718.80	0.25
105	300142	沃森生物	8,000	493,600.00	0.24
106	600016	民生银行	109,100	481,131.00	0.24
107	601699	潞安环能	40,000	472,400.00	0.23
108	300737	科顺股份	14,500	455,880.00	0.23
109	600745	闻泰科技	4,700	455,430.00	0.23
110	600050	中国联通	105,400	455,328.00	0.23
111	601882	海天精工	29,000	450,950.00	0.22
112	600048	保利地产	36,800	443,072.00	0.22
113	600703	三安光电	13,764	441,136.20	0.22
114	000338	潍柴动力	24,400	436,028.00	0.22
115	600409	三友化工	43,100	435,741.00	0.22
116	603882	金域医学	2,700	431,379.00	0.21
117	002129	中环股份	10,900	420,740.00	0.21
118	601229	上海银行	50,978	418,019.60	0.21
119	601688	华泰证券	26,400	417,120.00	0.21
120	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.20
121	600570	恒生电子	4,322	403,026.50	0.20
122	600660	福耀玻璃	7,200	402,120.00	0.20
123	600966	博汇纸业	30,700	400,635.00	0.20
124	601211	国泰君安	23,100	395,934.00	0.20
125	600104	上汽集团	18,000	395,460.00	0.20
126	300529	健帆生物	4,500	388,620.00	0.19
127	002371	北方华创	1,400	388,332.00	0.19
128	601766	中国中车	62,400	379,392.00	0.19
129	601169	北京银行	75,940	369,827.80	0.18
130	600999	招商证券	18,960	360,619.20	0.18
131	002311	海大集团	4,300	350,880.00	0.17
132	600019	宝钢股份	45,668	348,903.52	0.17
133	002410	广联达	4,900	334,180.00	0.17
134	300327	中颖电子	3,900	332,397.00	0.16
135	601658	邮储银行	65,800	330,316.00	0.16
136	601088	中国神华	16,900	329,888.00	0.16
137	600406	国电南瑞	14,160	329,078.40	0.16
138	300498	温氏股份	22,900	329,073.00	0.16
139	601818	光大银行	84,800	320,544.00	0.16
140	600111	北方稀土	15,400	318,780.00	0.16
141	300601	康泰生物	2,100	312,900.00	0.16
142	000625	长安汽车	11,600	304,848.00	0.15

143	000538	云南白药	2,600	300,872.00	0.15
144	600028	中国石化	68,600	299,096.00	0.15
145	600893	航发动力	5,500	292,545.00	0.15
146	300450	先导智能	4,800	288,672.00	0.14
147	601628	中国人寿	8,496	287,929.44	0.14
148	600143	金发科技	13,700	285,782.00	0.14
149	688131	皓元医药	821	284,221.99	0.14
150	600346	恒力石化	10,800	283,392.00	0.14
151	600588	用友网络	8,352	277,787.52	0.14
152	601390	中国中铁	52,200	273,528.00	0.14
153	601009	南京银行	25,656	269,901.12	0.13
154	002493	荣盛石化	15,600	269,412.00	0.13
155	601377	兴业证券	27,500	265,650.00	0.13
156	601857	中国石油	49,800	263,442.00	0.13
157	002648	卫星石化	6,600	258,654.00	0.13
158	688036	传音控股	1,208	253,076.00	0.13
159	603456	九洲药业	5,200	252,616.00	0.13
160	688169	石头科技	200	252,200.00	0.13
161	300413	芒果超媒	3,670	251,762.00	0.12
162	601225	陕西煤业	20,500	242,925.00	0.12
163	600741	华域汽车	9,200	241,684.00	0.12
164	600584	长电科技	6,400	241,152.00	0.12
165	002601	龙蟠佰利	6,900	238,602.00	0.12
166	300408	三环集团	5,600	237,552.00	0.12
167	600009	上海机场	4,900	235,837.00	0.12
168	688012	中微公司	1,400	232,288.00	0.12
169	000776	广发证券	15,200	230,128.00	0.11
170	601100	恒立液压	2,656	228,203.52	0.11
171	300433	蓝思科技	7,749	227,898.09	0.11
172	002001	新和成	7,900	226,572.00	0.11
173	000895	双汇发展	7,100	225,780.00	0.11
174	600926	杭州银行	15,240	224,790.00	0.11
175	002050	三花智控	9,185	220,256.30	0.11
176	000166	申万宏源	46,195	216,192.60	0.11
177	600958	东方证券	21,400	213,786.00	0.11
178	002841	视源股份	1,700	211,293.00	0.10
179	000963	华东医药	4,540	208,885.40	0.10
180	300003	乐普医疗	6,500	208,780.00	0.10
181	600600	青岛啤酒	1,800	208,170.00	0.10

182	002007	华兰生物	5,567	204,197.56	0.10
183	000786	北新建材	5,200	204,100.00	0.10
184	002677	浙江美大	11,100	202,908.00	0.10
185	000157	中联重科	21,800	201,432.00	0.10
186	601006	大秦铁路	30,500	200,690.00	0.10
187	600362	江西铜业	8,900	199,182.00	0.10
188	002607	中公教育	9,500	198,455.00	0.10
189	601901	方正证券	21,100	197,496.00	0.10
190	601336	新华保险	4,300	197,413.00	0.10
191	600015	华夏银行	31,580	195,480.20	0.10
192	002236	大华股份	9,200	194,120.00	0.10
193	601989	中国重工	46,800	192,816.00	0.10
194	002850	科达利	2,200	192,280.00	0.10
195	603267	鸿远电子	1,500	191,880.00	0.10
196	601138	工业富联	15,300	189,873.00	0.09
197	000768	中航西飞	7,106	186,745.68	0.09
198	601877	正泰电器	5,500	183,590.00	0.09
199	600352	浙江龙盛	13,300	182,742.00	0.09
200	600010	包钢股份	116,860	181,133.00	0.09
201	600760	中航沈飞	2,980	179,694.00	0.09
202	600547	山东黄金	9,344	179,591.68	0.09
203	601788	光大证券	10,000	178,900.00	0.09
204	001979	招商蛇口	16,300	178,485.00	0.09
205	002008	大族激光	4,400	177,716.00	0.09
206	601186	中国铁建	23,600	175,348.00	0.09
207	603369	今世缘	3,200	173,312.00	0.09
208	002202	金风科技	14,164	172,234.24	0.09
209	000876	新希望	11,600	170,172.00	0.08
210	002555	三七互娱	6,800	163,336.00	0.08
211	003816	中国广核	60,500	161,535.00	0.08
212	603899	晨光文具	1,900	160,664.00	0.08
213	000938	紫光股份	7,320	160,161.60	0.08
214	002736	国信证券	14,800	159,100.00	0.08
215	601799	星宇股份	700	158,004.00	0.08
216	600109	国金证券	12,400	157,356.00	0.08
217	601066	中信建投	5,000	157,150.00	0.08
218	000069	华侨城 A	21,000	156,240.00	0.08
219	603160	汇顶科技	1,200	155,556.00	0.08
220	600989	宝丰能源	11,300	154,584.00	0.08

221	300136	信维通信	5,000	154,400.00	0.08
222	000425	徐工机械	24,100	153,517.00	0.08
223	601669	中国电建	39,200	151,704.00	0.08
224	000977	浪潮信息	5,245	147,541.85	0.07
225	600795	国电电力	60,500	147,015.00	0.07
226	002384	东山精密	7,000	145,880.00	0.07
227	000783	长江证券	19,900	145,668.00	0.07
228	601238	广汽集团	11,180	144,781.00	0.07
229	688008	澜起科技	2,308	143,973.04	0.07
230	000596	古井贡酒	600	143,700.00	0.07
231	603019	中科曙光	5,180	143,019.80	0.07
232	002624	完美世界	5,950	142,264.50	0.07
233	600085	同仁堂	3,465	141,545.25	0.07
234	600079	人福医药	5,000	141,350.00	0.07
235	688161	威高骨科	1,311	139,031.55	0.07
236	600183	生益科技	5,900	138,119.00	0.07
237	600886	国投电力	14,300	137,423.00	0.07
238	300677	英科医疗	1,100	137,280.00	0.07
239	600029	南方航空	22,700	136,654.00	0.07
240	601985	中国核电	26,900	136,114.00	0.07
241	601108	财通证券	12,900	135,321.00	0.07
242	300144	宋城演艺	8,020	134,736.00	0.07
243	000703	恒逸石化	11,260	134,557.00	0.07
244	601360	三六零	11,000	134,310.00	0.07
245	002600	领益智造	14,500	133,255.00	0.07
246	601555	东吴证券	15,880	132,439.20	0.07
247	000066	中国长城	9,000	131,400.00	0.07
248	300676	华大基因	1,100	130,460.00	0.06
249	002252	上海莱士	17,340	129,876.60	0.06
250	002938	鹏鼎控股	3,600	129,168.00	0.06
251	002044	美年健康	14,052	128,013.72	0.06
252	600522	中天科技	12,600	126,000.00	0.06
253	000728	国元证券	15,684	125,001.48	0.06
254	601607	上海医药	5,900	124,667.00	0.06
255	300033	同花顺	1,100	124,058.00	0.06
256	002602	世纪华通	19,135	122,846.70	0.06
257	600332	白云山	3,600	121,860.00	0.06
258	600872	中炬高新	2,900	121,858.00	0.06
259	002024	苏宁易购	21,700	121,303.00	0.06

260	600161	天坛生物	3,500	119,875.00	0.06
261	601111	中国国航	15,300	119,034.00	0.06
262	600383	金地集团	11,600	118,784.00	0.06
263	300628	亿联网络	1,400	117,320.00	0.06
264	601800	中国交建	18,100	117,288.00	0.06
265	600115	中国东航	23,000	116,840.00	0.06
266	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.06
267	688276	百克生物	1,099	114,933.42	0.06
268	600845	宝信软件	2,250	114,525.00	0.06
269	000860	顺鑫农业	2,700	113,886.00	0.06
270	600061	国投资本	13,224	112,271.76	0.06
271	002508	老板电器	2,400	111,600.00	0.06
272	688363	华熙生物	400	111,144.00	0.06
273	601727	上海电气	26,200	111,088.00	0.06
274	601618	中国中冶	36,600	109,068.00	0.05
275	000708	中信特钢	5,200	108,368.00	0.05
276	601162	天风证券	22,210	107,940.60	0.05
277	601021	春秋航空	1,883	107,142.70	0.05
278	600705	中航资本	27,400	106,038.00	0.05
279	601878	浙商证券	8,000	104,640.00	0.05
280	600606	绿地控股	18,700	101,915.00	0.05
281	002456	欧菲光	11,055	98,168.40	0.05
282	002157	正邦科技	8,100	96,795.00	0.05
283	002463	沪电股份	6,200	95,914.00	0.05
284	600011	华能国际	22,600	95,372.00	0.05
285	000656	金科股份	16,400	94,956.00	0.05
286	600521	华海药业	4,500	93,960.00	0.05
287	601933	永辉超市	19,500	92,235.00	0.05
288	600848	上海临港	4,920	88,068.00	0.04
289	601216	君正集团	17,300	88,057.00	0.04
290	600118	中国卫星	3,000	87,780.00	0.04
291	600489	中金黄金	9,894	85,286.28	0.04
292	600018	上港集团	17,800	84,906.00	0.04
293	603392	万泰生物	320	82,937.60	0.04
294	002558	巨人网络	6,200	82,460.00	0.04
295	603195	公牛集团	400	80,800.00	0.04
296	601995	中金公司	1,300	79,950.00	0.04
297	002120	韵达股份	5,866	79,366.98	0.04
298	002673	西部证券	9,180	75,735.00	0.04

299	688009	中国通号	13,300	75,677.00	0.04
300	601319	中国人保	12,400	73,532.00	0.04
301	688126	沪硅产业	2,500	72,950.00	0.04
302	002739	万达电影	4,600	72,634.00	0.04
303	603658	安图生物	940	71,223.80	0.04
304	601881	中国银河	6,600	71,148.00	0.04
305	603338	浙江鼎力	1,200	70,428.00	0.03
306	600233	圆通速递	6,500	65,065.00	0.03
307	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.03
308	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.03
309	600482	中国动力	3,300	57,486.00	0.03
310	601231	环旭电子	3,400	57,154.00	0.03
311	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
312	002939	长城证券	4,800	53,424.00	0.03
313	600025	华能水电	9,200	53,268.00	0.03
314	002153	石基信息	2,260	53,132.60	0.03
315	002032	苏泊尔	800	51,032.00	0.03
316	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
317	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
318	002773	康弘药业	1,930	44,640.90	0.02
319	601808	中海油服	3,000	43,080.00	0.02
320	601698	中国卫通	2,300	37,237.00	0.02
321	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
322	000807	云铝股份	2,600	30,940.00	0.02
323	600299	安迪苏	2,100	25,116.00	0.01
324	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
325	002945	华林证券	1,400	19,348.00	0.01
326	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
327	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
328	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
329	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
330	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
331	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
332	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
333	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
334	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
335	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
336	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
337	603156	养元饮品	36	1,028.88	0.00



338	600487	亨通光电	60	684.00	0.00
339	600177	雅戈尔	64	421.76	0.00
340	600390	五矿资本	40	239.20	0.00
341	600369	西南证券	46	224.02	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	7,063,106.00	3.33
2	300677	英科医疗	6,689,233.00	3.15
3	600809	山西汾酒	5,827,285.00	2.75
4	601988	中国银行	5,197,080.00	2.45
5	601328	交通银行	4,840,844.00	2.28
6	603659	璞泰来	4,741,866.00	2.23
7	600763	通策医疗	4,664,173.02	2.20
8	601336	新华保险	4,568,238.00	2.15
9	600036	招商银行	4,394,245.00	2.07
10	601166	兴业银行	4,250,592.00	2.00
11	601398	工商银行	4,102,899.00	1.93
12	000725	京东方 A	3,911,462.00	1.84
13	600019	宝钢股份	3,834,810.00	1.81
14	002850	科达利	3,143,816.68	1.48
15	601012	隆基股份	3,054,043.00	1.44
16	600048	保利地产	2,893,724.00	1.36
17	600438	通威股份	2,852,929.00	1.34
18	600900	长江电力	2,758,671.00	1.30
19	002241	歌尔股份	2,644,488.00	1.25
20	002739	万达电影	2,644,022.46	1.25

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

### 7.4.2 累计卖出金额超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	300274	阳光电源	9,029,154.63	4.25
2	300677	英科医疗	7,786,684.00	3.67
3	601336	新华保险	6,163,229.00	2.90
4	300750	宁德时代	5,462,380.00	2.57
5	601988	中国银行	5,182,537.00	2.44
6	600036	招商银行	5,099,136.00	2.40
7	603659	璞泰来	5,091,209.54	2.40
8	601328	交通银行	5,051,796.00	2.38
9	600519	贵州茅台	5,006,692.98	2.36
10	002850	科达利	4,887,812.50	2.30
11	601166	兴业银行	4,885,924.00	2.30
12	600048	保利地产	4,675,601.94	2.20
13	600882	妙可蓝多	4,417,533.00	2.08
14	600809	山西汾酒	4,394,386.00	2.07
15	601398	工商银行	4,346,766.37	2.05
16	002709	天赐材料	3,983,709.10	1.88
17	000858	五粮液	3,949,358.00	1.86
18	601100	恒立液压	3,856,248.00	1.82
19	600019	宝钢股份	3,757,177.00	1.77
20	600763	通策医疗	3,724,383.00	1.75

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	264,617,006.12
卖出股票收入（成交）总额	295,064,456.79

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	4,610,420.00	2.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,506,750.00	1.24
	其中：政策性金融债	2,506,750.00	1.24
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	7,117,170.00	3.53

## 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	019645	20 国债 15	30,000	3,009,300.00	1.49
2	108604	国开 1805	25,000	2,506,750.00	1.24
3	019649	21 国债 01	16,000	1,601,120.00	0.79

## 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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 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。

## 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 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	56,937.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	147,592.41
5	应收申购款	229,790.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	434,320.68

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,705	13,104.43	972,710.65	0.85%	113,101,361.68	99.15%

### 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	0.00	0.0000%

### 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

## § 9 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	126,137,403.21
本报告期基金总申购份额	7,893,243.54
减：本报告期基金总赎回份额	19,956,574.42
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	114,074,072.33

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,根据农银汇理基金管理有限公司(以下简称“本公司”)董事会有关决议,原本公司副总经理 Céline Zhang (张晴)女士自 2021 年 4 月 29 日离任本公司副总经理职务;毕宏燕女士自 2021 年 6 月 17 日任职本公司副总经理职位。本公司已分别于 2021 年 4 月 30 日、2021 年 6 月 18 日在指定媒体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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	282,048,800.51	50.58%	262,673.75	50.58%	-
国金证券	2	223,250,638.45	40.04%	207,913.34	40.04%	-
国信证券	2	44,994,585.56	8.07%	41,904.39	8.07%	-
海通证券	2	5,339,302.72	0.96%	4,972.85	0.96%	-
中金公司	2	2,000,335.52	0.36%	1,862.57	0.36%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	27,629,206.10	76.44%	-	-	-	-
国金证券	7,014,450.00	19.41%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,499,550.00	4.15%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-



**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2020 年四季度报告	证券时报、基金管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2021 年 3 月 29 日
3	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金招募说明书更新	证券时报、基金管理人网站	2021 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。

### 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

2021 年 8 月 30 日