

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）  
2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 农银养老 2035  |
| 基金主代码      | 007407   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019 年 8 月 28 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 86,089,346.86 份  |
| 投资目标       | 本基金是采用目标日期策略的基金中基金，目标日期为 2035 年 12 月 31 日。本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       | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的投资理念属于生命周期基金中的“目标时间型”基金。在基金实际管理过程中，基金管理人将随着本基金目标日期的临近并根据中国证券市场的阶段性变化，对本基金的资产配置策略涉及权益类资产和非权益类资产在投资组合中的比例适时进行调整。随着投资人生命周期的延续和投资目标日期的临近，权益类资产比例逐步下降，而非权益类资产比例逐步上升。</p> <p>2、基金投资选择策略</p> <p>（1）主动股票型和混合型基金的优选策略</p> <p>本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法对主动股票型和混合型基金进行选择。</p> <p>（2）债券型基金的优选策略</p> <p>债券型基金的选择方面，将首先根据投资范围、期限结构、信用等级等信息，对债券型基金进行分类。再综合基金的运作时间、资产规模、风险收益指标、历史信用风险事件、费率水平、申购赎回限制、运作周期等因素优选基金，进行配置。</p> |

|                      | <p>(3) 指数基金和商品基金的配置策略<br/>本基金将基于资产配置的结果，综合基金规模、流动性、跟踪误差、费率水平等因素，优选指数基金或商品基金进行配置。</p> <p>(4) 货币市场基金配置策略<br/>本基金投资货币市场基金主要以流动性管理以及降低投资组合整体波动率水平为目标。基金管理人将综合考虑货币基金的规模、流动性、费率、交易方式等因素，优选货币基金进行配置。</p> <p>(5) 基金套利策略<br/>对于在交易所上市的 ETF、LOF 等基金，基金管理人将在基金和基金公司量化研究的基础上，综合运用申赎套利、事件套利等策略，进行套利投资，以期增厚基金资产的收益。</p> <p>3、股票投资策略<br/>本基金通过定量和定性相结合的方法精选个股。主要需要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等，并对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司构建股票组合。</p> <p>4、债券投资策略<br/>首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合结构；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合影响确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，我们采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。</p> <p>5、资产支持证券投资策略<br/>本基金将通过资产支持证券的利率风险、提前偿还率、资产池结构、资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，对收益率走势及其收益和风险进行判断。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资。<br/>(详见基金合同)</p> |                      |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
|----------------------|---|----------------------|-------------|----------------------|----------------------|----------------------|-----|---------------------|----------------------|-----|---------------------|----------------------|-----|---------------------|---------------------|-----|------------|---------------------|-----|
| <p>业绩比较基准</p>        | <p>本基金的业绩比较基准为 <math>I \times \text{沪深 300 指数收益率} + (100\% - I) \times \text{中证全债指数收益率}</math>，其中 I 值见下表：</p> <table border="1" data-bbox="560 1624 1361 1910"> <thead> <tr> <th>时间段</th> <th>权益类资产比例 (H)</th> <th>业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>基金合同生效之日至 2020/12/31</td> <td><math>35\% \leq H &lt; 60\%</math></td> <td>50%</td> </tr> <tr> <td>2021/1/1-2025/12/31</td> <td><math>25\% \leq H &lt; 50\%</math></td> <td>40%</td> </tr> <tr> <td>2026/1/1-2030/12/31</td> <td><math>15\% \leq H &lt; 40\%</math></td> <td>30%</td> </tr> <tr> <td>2031/1/1-2035/12/31</td> <td><math>5\% \leq H &lt; 30\%</math></td> <td>20%</td> </tr> <tr> <td>2036/1/1 起</td> <td><math>0\% \leq H &lt; 20\%</math></td> <td>10%</td> </tr> </tbody> </table> <p>(详见基金合同)</p>  | 时间段                  | 权益类资产比例 (H) | 业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I) | 基金合同生效之日至 2020/12/31 | $35\% \leq H < 60\%$ | 50% | 2021/1/1-2025/12/31 | $25\% \leq H < 50\%$ | 40% | 2026/1/1-2030/12/31 | $15\% \leq H < 40\%$ | 30% | 2031/1/1-2035/12/31 | $5\% \leq H < 30\%$ | 20% | 2036/1/1 起 | $0\% \leq H < 20\%$ | 10% |
| 时间段                  | 权益类资产比例 (H)   | 业绩比较基准股票类资产比例参考值 (I) |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| 基金合同生效之日至 2020/12/31 | $35\% \leq H < 60\%$  | 50%                  |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| 2021/1/1-2025/12/31  | $25\% \leq H < 50\%$  | 40%                  |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| 2026/1/1-2030/12/31  | $15\% \leq H < 40\%$  | 30%                  |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| 2031/1/1-2035/12/31  | $5\% \leq H < 30\%$   | 20%                  |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| 2036/1/1 起           | $0\% \leq H < 20\%$   | 10%                  |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |
| <p>风险收益特征</p>        | <p>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。</p>  |                      |             |                      |                      |                      |     |                     |                      |     |                     |                      |     |                     |                     |     |            |                     |     |

|       |                |
|-------|----------------|
| 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 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022年7月1日-2022年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 7,865,401.07              |
| 2. 本期利润         | -11,563,669.92            |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0803                   |
| 4. 期末基金资产净值     | 104,425,354.37            |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2130                    |

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。

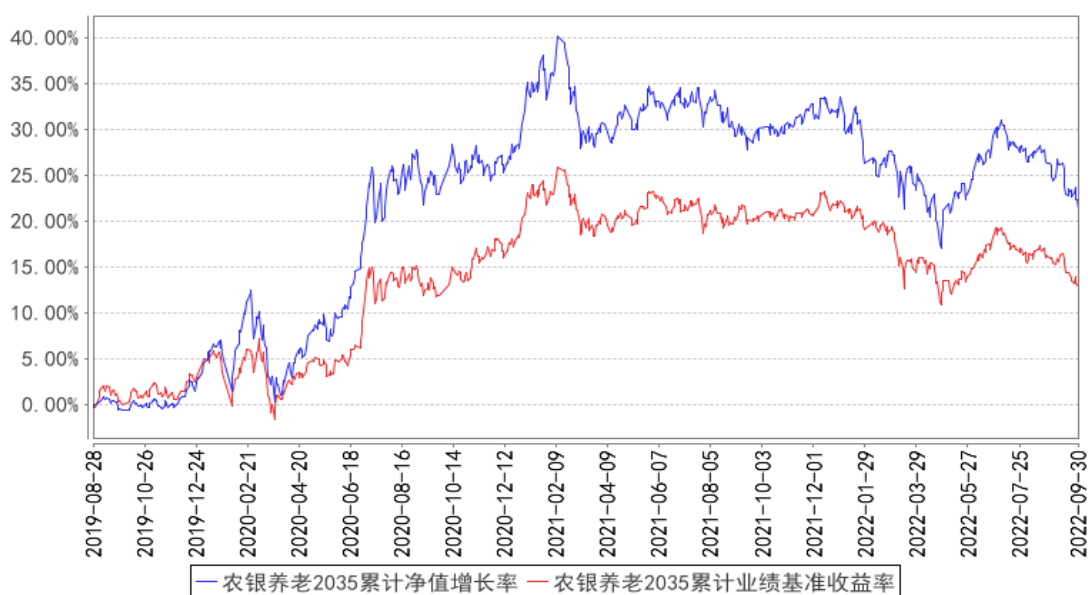
#### 3.2 基金净值表现

##### 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             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -6.94%     | 0.49%         | -5.35%         | 0.35%                 | -1.59% | 0.14% |
| 过去六个月          | -2.53%     | 0.60%         | -2.25%         | 0.47%                 | -0.28% | 0.13% |
| 过去一年           | -6.83%     | 0.62%         | -6.27%         | 0.47%                 | -0.56% | 0.15% |
| 过去三年           | 22.07%     | 0.73%         | 12.83%         | 0.56%                 | 9.24%  | 0.17% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 21.30%     | 0.72%         | 12.85%         | 0.56%                 | 8.45%  | 0.16% |

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

农银养老2035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、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）的比例不高于基金资产净值的 60%。在基金实际管理过程中，基金管理人应当随着目标日期的临近，逐步降低权益类资产的配置比例，增加非权益类资产的配置比例。权益类资产包括股票、股票型基金、混合型基金，此处权益类资产中的混合型基金是指根据定期报告披露情况，最近连续四个季度股票资产占基金资产的比例均在 50% 以上的混合型基金。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。

本基金建仓期为基金合同生效日（2019 年 8 月 28 日）起 6 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------|-----------------|------|--------|---|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 周永冠 | 本基金的基金经理 | 2022 年 7 月 13 日 | -    | 12 年   | 历任国金证券股份有限公司机械行业研究院，平安资产管理有限责任公司股票投资经理，百年保险资产管理有限责任公司高级投资经理，平安基金管理有限公司拟任 MOM 基金经理，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。 |

|    |          |                 |                 |      |  |
|----|----------|-----------------|-----------------|------|--|
| 杨鹏 | 本基金的基金经理 | 2019 年 8 月 28 日 | 2022 年 7 月 19 日 | 10 年 | 历任申银万国证券研究所宏观分析师、中国人保资产管理有限公司 FOF 投资经理、太平洋资产管理有限责任公司股票高级投资经理；现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。 |
|----|----------|-----------------|-----------------|------|--|

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，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，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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。

报告期内，所有投资组合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未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度全球资本市场仍然笼罩在美国加息的阴影之中。随着美国抑制通胀的决心愈加明确，美联储坚决加息的表态愈加鹰派。目前国际资本市场仍怀有两大担忧：一是美国加息仍无放缓迹象，美国经济衰退的预期在逐步加强；二是俄乌冲突逐步升温，随着冬天的临近，欧洲能源供应问题仍将重挫欧洲经济。在外部条件不佳的背景下，国内也面临较多的发展掣肘，主要体现在防疫、地产、未来预期三大问题。

本基金在三季度进行了基金结构调整，主要体现在以下方面。一是基于上述分析，资产配置角度下调了权益比例，对净值进行保护。二是结构上降低高弹性板块比例，整体更注重平衡。三季度权益市场持续下跌，以上操作对组合收益具有一定的正贡献。

从资产估值角度，我国权益资产估值处于低位。今年以来的下跌已经大幅度释放了核心资产

的估值风险，进一步下跌的空间有限。我们认为四季度权益市场预计将逐步进入筑底的过程中。未来是否能够进入上升通道主要取决于四季度政策面的调整。如果二十大之后政府对于市场关心的问题能够提供针对性调整政策，则四季度权益市场将明显好转。十月份将是重要的观察窗口。结构上我们仍然看好新能源、疫情修复板块和稳增长板块。

#### 4.5 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 1.2130 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.94%，业绩比较基准收益率为-5.35%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | 95,065,580.05  | 88.07        |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 12,809,128.75  | 11.87        |
| 8  | 其他资产              | 67,467.35      | 0.06         |
| 9  | 合计                | 107,942,176.15 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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。

##### 5.2.2 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 57,441.32 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 10,026.03 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 67,467.35 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

## §6 基金中基金

### 6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称         | 运作方式       | 持有份额<br>(份)   | 公允价值<br>(元)   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 是否属于<br>基金管理人及管理人<br>关联方所管理的<br>基金 |
|----|--------|--------------|------------|---------------|---------------|----------------------|------------------------------------|
| 1  | 006758 | 农银汇理<br>金禄债券 | 契约型开放<br>式 | 13,644,042.65 | 14,072,465.59 | 13.48                | 是                                  |

|    |        |                              |            |              |               |      |   |
|----|--------|------------------------------|------------|--------------|---------------|------|---|
| 2  | 003847 | 华安鼎丰<br>债券                   | 契约型开放<br>式 | 8,914,942.94 | 10,009,697.93 | 9.59 | 否 |
| 3  | 004127 | 鹏华丰康<br>债券                   | 契约型开放<br>式 | 8,494,837.62 | 9,656,931.41  | 9.25 | 否 |
| 4  | 519782 | 交银裕隆<br>纯债债券 A               | 契约型开放<br>式 | 7,389,856.82 | 9,602,379.95  | 9.20 | 否 |
| 5  | 005730 | 国泰江源<br>优势精选<br>灵活配置<br>混合 A | 契约型开放<br>式 | 3,281,606.37 | 6,647,221.86  | 6.37 | 否 |
| 6  | 005937 | 工银精选<br>金融地产<br>混合 A         | 契约型开放<br>式 | 4,085,438.34 | 5,245,294.28  | 5.02 | 否 |
| 7  | 450011 | 国富研究<br>精选混合                 | 契约型开放<br>式 | 1,864,315.76 | 5,162,290.34  | 4.94 | 否 |
| 8  | 519089 | 新华优选<br>成长混合                 | 契约型开放<br>式 | 2,672,279.39 | 5,157,499.22  | 4.94 | 否 |
| 9  | 000828 | 泰达转型<br>机遇股票 A               | 契约型开放<br>式 | 1,722,365.78 | 5,111,981.64  | 4.90 | 否 |
| 10 | 050027 | 博时信用<br>债纯债债<br>券 A          | 契约型开放<br>式 | 4,460,622.81 | 5,046,302.58  | 4.83 | 否 |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 | 其中：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 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | 11,500.00                            | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | 176,729.23                           | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 4,817.63                             | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 314,660.31                           | 20,722.22                       |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 64,710.59                            | 5,889.52                        |
| 当期交易基金产生的交易费（元）      | 5,156.17                             | -                               |

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，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。

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）、销售服务费等销售费用，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。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 168,488,717.69 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 685,025.33     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 83,084,396.16  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 86,089,346.86  |

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。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| —管理人持有的本基金份额             | 10,000,000.00 |
| —买入/申购总份额                | -             |
| —卖出/赎回总份额                | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 11.62         |

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

## § 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额总数         | 发起份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|---------------|---------------------|----------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人<br>固有资金   | 10,000,000.00 | 11.62               | 10,000,000.00  | 11.62               | 3 年            |
| 基金管理人<br>高级管理人员 | 0.00          | 0.00                | 20,006.01      | 0.02                | -              |
| 基金经理等<br>人员     | 0.00          | 0.00                |                | 0.00                | -              |
| 基金管理人<br>股东     | 0.00          | 0.00                |                | 0.00                | -              |
| 其他              | 76,089,346.86 | 88.38               | 141,724,044.59 | 164.62              | -              |
| 合计              | 86,089,346.86 | 100.00              | 151,744,050.60 | 176.26              | -              |

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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。

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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、《农银养老目标日期 2035 混合基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《农银养老目标日期 2035 混合基金 (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、营业执照；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址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 10 月 26 日