

# 农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证 券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：东方证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人东方证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>5</b>
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.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	51
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	51
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
13.1 备查文件目录 .....	56
13.2 存放地点 .....	56
13.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金
基金简称	农银瑞祥一年混合
基金主代码	010642
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 25 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	东方证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	245,431,435.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求将信用风险降到最低，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×20% + 中证全债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	东方证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	罗敏
	联系电话	021-61095588	021-63325888
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	dftg@orientsec.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95503
传真		021-61095556	021-63320039
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	上海市黄浦区中山南路 119 号 东方证券大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	上海市黄浦区中山南路 318 号 东方国际金融广场 2 号楼 3 楼
邮政编码		200120	200010
法定代表人		黄涛	金文忠

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com

基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层
------------	---------------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年 12 月 25 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-11,101,368.33	53,180,012.22	39,523.01
本期利润	-22,824,819.46	65,395,059.48	263,469.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0683	0.0580	0.0002
本期加权平均净值利润率	-6.68%	5.70%	0.02%
本期基金份额净值增长率	-4.81%	6.14%	0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	2,589,048.74	30,863,781.18	39,523.01
期末可供分配基金份额利润	0.0105	0.0488	0.0000
期末基金资产净值	248,020,484.68	671,975,192.84	1,124,198,789.97
期末基金份额净值	1.0105	1.0616	1.0002
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	1.05%	6.16%	0.02%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

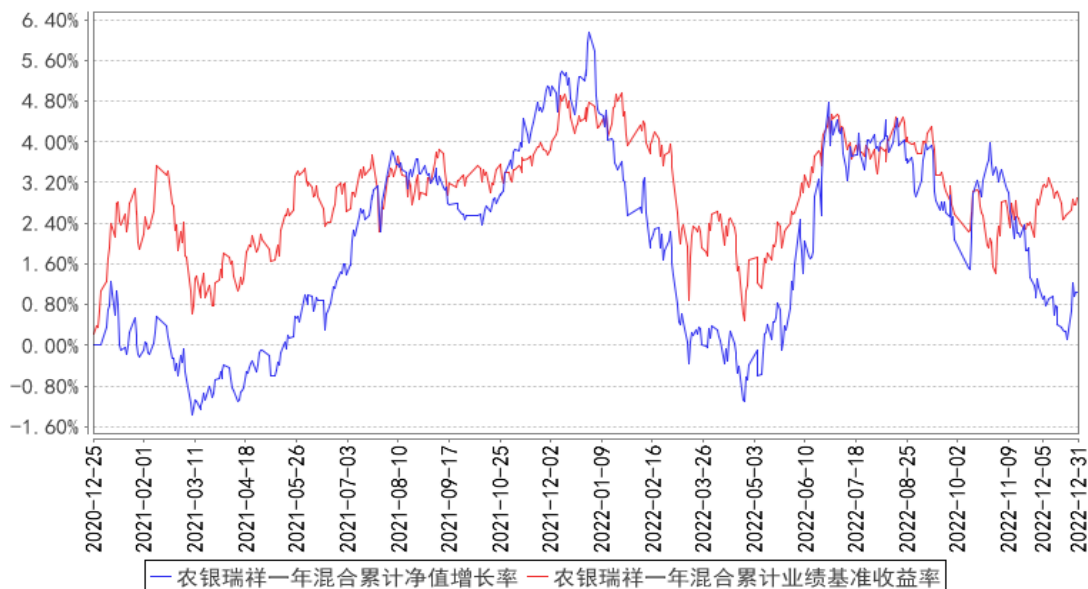
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.00%	0.27%	0.32%	0.25%	-1.32%	0.02%
过去六个月	-3.22%	0.26%	-1.56%	0.21%	-1.66%	0.05%
过去一年	-4.81%	0.31%	-1.79%	0.25%	-3.02%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.05%	0.26%	2.89%	0.25%	-1.84%	0.01%

#### 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

农银瑞祥一年混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

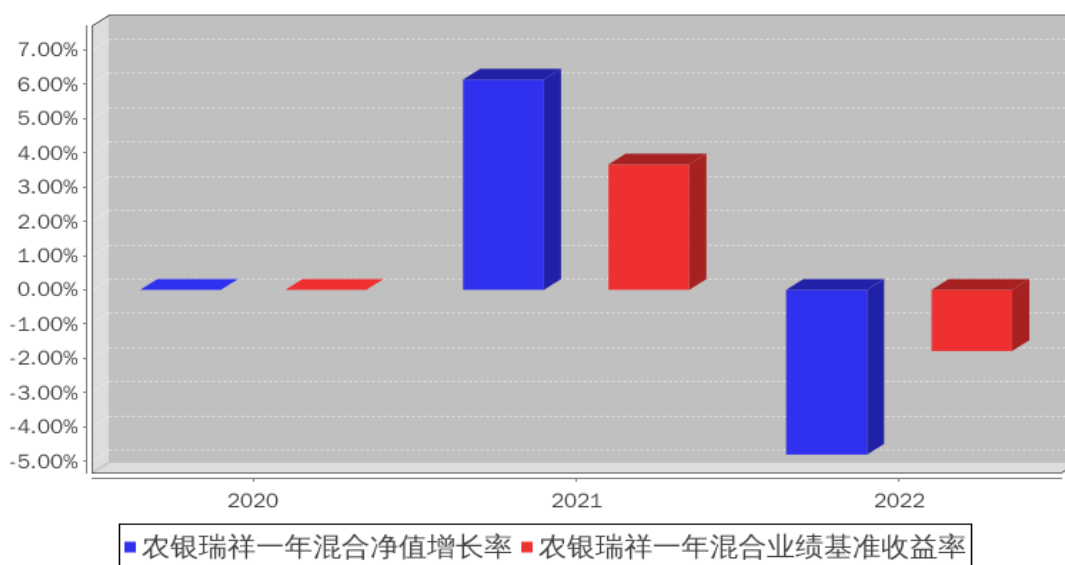


注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-40%，同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。本基金投资于主体评级在 AA 及以上级别的信用债，其中 AAA 级的信用债占总体信用债投资比例不低于总体信用债投资比例的 40%，AA+级的信用债占总体信用

债投资比例为 0-60%，AA 级的信用债占总体信用债投资比例为 0-20%。相关资信评级机构需取得相关监管机构评级业务的许可。本基金投资可交换债券和可转换债券合计比例不超过基金资产的 20%。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。本基金建仓期为成立日起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银瑞祥一年混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2022 年 12 月 31 日，公司共管理 72 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、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇

理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金。

#### 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		
周宇	本基金的基金经理	2020 年 12 月 25 日	-	12 年	历任中国民族证券有限责任公司固定收益部交易员及交易经理、民生加银基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、长城证券股份有限公司固定收益部投资助理及投资主办。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

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

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

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

### 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任

务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告风险管理委员会。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

疫情和房地产是 2022 年国内经济扰动的主线。在疫情爆发管控以及地产风险释放的压力下，全年经济一路下滑。直至四季度，政府对房地产政策和防疫政策进行了较大调整。防疫方面，逐步取消各地管控措施，恢复企业正常生产和居民正常生活；房地产方面，降低房贷利率和购房者门槛刺激购房需求，出台金融政策帮助房地产企业恢复融资，以及地方政府督促房地产企业保交楼；政策的出台极大提振了经济回升的信心。但是由于经济仍然存在向下的惯性，以及全国面临管控放开后的感染高峰，导致经济回升短期内仍然受到压制。PMI 数据持续探底，消费回升乏力，企业经营和利润仍然处于下滑阶段。但随着全国感染期的过去，相信居民消费会逐步恢复，成为支撑未来经济增长的强劲动力。

四季度成为资本市场的分水岭。年初至三季度，债券市场表现较好，收益率不断创出新低。而股票市场从年初一直下滑，反映了基本面的疲弱和投资者的悲观预期。房地产和防疫政策出现调整后，股债市场均出现剧烈的调整。债券市场收益率出现大幅上行，而股票市场中周期性行业在下跌近 2 年后出现大幅上涨，于此同时成长性板块出现一定程度的回调。

瑞祥基金上半年表现较差。权益方面，源于 2022 年年初没有预判到房地产行业的重大变化，在风险资产方面持仓比例偏高。同时，在市场大幅下跌的情况下没有快速进行有效止损。三季度

基金通过精选成长组合，获得了不错的超额收益。但是基金错过了四季度的周期性的上涨机会且成长性板块的回调给基金形成了拖累。债券方面，基金全年维持中高水平的配置，在四季度大幅降低了杠杆和久期水平，债券组合为基金提供了较为稳健的收益。整体而言，瑞祥 2022 年的表现并不理想，有很多值得总结的经验和教训。

#### 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 1.0105 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.81%，业绩比较基准收益率为-1.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，政策预期有望逐步转化为基本面的回升。权益类风险资产有望受益，而债券资产仍然处于逆风。瑞祥基金更看好风险资产的表现，预计未来将进一步提升权益资产的仓位，同时组合保持在成长和价值更加均衡的配置。债券方面保持相对谨慎的态度，维持较低的久期和杠杆运作，以持有较高收益率的信用债获取票息收益为主，期间去把握一些市场交易性的机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

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

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

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

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，东方证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P01747 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理

	<p>层对其他信息负责。其他信息包括农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性</p>

	和作出会计估计及相关披露的合理性。	
	<p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	叶王昊
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2023 年 03 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	258,799.51	115,640,704.77
结算备付金		2,866,846.88	5,352,774.71
存出保证金		323,320.18	513,698.84
交易性金融资产	7.4.7.2	244,278,351.21	646,602,586.28
其中：股票投资		52,848,160.00	199,856,199.28
基金投资		-	-
债券投资		191,430,191.21	446,746,387.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-



买入返售金融资产	7.4.7.4	-	47,000,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,069,985.39	5,022,157.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	59.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	6,560,450.37
资产总计		249,797,303.17	826,692,432.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-206.74	-
应付清算款		700,413.48	37,281,540.65
应付赎回款		454,507.21	115,954,976.55
应付管理人报酬		170,836.46	784,795.40
应付托管费		21,354.56	98,099.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,063.82	7,532.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	425,849.70	590,294.47
负债合计		1,776,818.49	154,717,239.27
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	245,431,435.94	632,965,183.37
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,589,048.74	39,010,009.47
净资产合计		248,020,484.68	671,975,192.84
负债和净资产总计		249,797,303.17	826,692,432.11

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0105 元，基金份额总额 245,431,435.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-19,197,343.37	83,060,305.97
1. 利息收入		586,358.36	36,272,211.99
其中：存款利息收入	7.4.7.13	202,678.50	694,268.15
债券利息收入		-	34,936,206.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		383,679.86	641,737.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,060,250.60	34,573,046.72
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-14,951,759.49	19,422,253.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	5,979,709.94	14,657,079.77
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	911,798.95	493,713.35
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）	7.4.7.20	-11,723,451.13	12,215,047.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,627,476.09	17,665,246.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,763,360.66	9,180,551.03
2. 托管费	7.4.10.2.2	345,420.12	1,147,568.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		268,777.77	3,660,399.91
其中：卖出回购金融资产支出		268,777.77	3,660,399.91

6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,729.56	20,700.41
8. 其他费用	7.4.7.23	242,187.98	3,656,026.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,824,819.46	65,395,059.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,824,819.46	65,395,059.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-22,824,819.46	65,395,059.48

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	632,965,183.37	-	39,010,009.47	671,975,192.84
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）	632,965,183.37	-	39,010,009.47	671,975,192.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-387,533,747.43	-	-36,420,960.73	-423,954,708.16
（一）、综合收益总额	-	-	-22,824,819.46	-22,824,819.46
（二）、本期基金份额交易产	-387,533,747.43	-	-13,596,141.27	-401,129,888.70

生的基金 净值变动 数 (净值减 少以“-” 号填列)				
其中：1. 基金申购 款	3,340,495.42	-	113,203.85	3,453,699.27
2. 基金赎回 款	-390,874,242.85	-	-13,709,345.12	-404,583,587.97
(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)	245,431,435.94	-	2,589,048.74	248,020,484.68
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	1,123,935,320.69	-	263,469.28	1,124,198,789.97
加：会计 政策变更	-	-	-	-
前期 差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净资	1,123,935,320.69	-	263,469.28	1,124,198,789.97

产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-490,970,137.32	-	38,746,540.19	-452,223,597.13
（一）、综合收益总额	-	-	65,395,059.48	65,395,059.48
（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）	-490,970,137.32	-	-26,648,519.29	-517,618,656.61
其中：1. 基金申购款	11,774,781.69	-	152,390.92	11,927,172.61
2. 基金赎回款	-502,744,919.01	-	-26,800,910.21	-529,545,829.22
（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）	632,965,183.37	-	39,010,009.47	671,975,192.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程昆</u>	<u>毕宏燕</u>	<u>丁煜琼</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金(原农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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]2852 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 1,123,935,320.69 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(20)第 00728 号验资报告。《农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 12 月 25 日正式生效。自 2021 年 3 月 4 日起,本基金由“农银汇理秀山一年持有期混合型发起式证券投资基金”变更为“农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金”。本次基金更名不改变基金投资范围。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为东方证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、最新适用的基金合同及《农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货,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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0-40%,同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于主体评级在 AA 及以上级别的信用债,其中 AAA 级的信用债占总体信用债投资比例不低于总体信用债投资比例的 40%,AA+级的信用债占总体信用债投资比例为 0-60%,AA 级的信用债占总体信用债投资比例为 0-20%。相关资信评级机构需取得相关监

管机构评级业务的许可。本基金投资可交换债券和可转换债券合计比例不超过基金资产的 20%。  
本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## 2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相

互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

#### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，在履行相关程序后，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《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”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22号)，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。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

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、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收申购款、应收利息，金额分别为人民币 115,640,704.77

元、人民币 5,352,774.71 元、人民币 513,698.84 元、人民币 47,000,000.00、人民币 5,022,157.19 元、人民币 59.95 元、人民币 6,560,450.37 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、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收申购款、其他资产-应收利息，金额分别为人民币 115,660,889.38 元、人民币 5,355,424.39 元、人民币 513,953.16 元、人民币 47,000,000.00 元、人民币 5,022,157.19 元、人民币 59.95 元、人民币 0.00 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，金额为人民币 646,602,586.28 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，金额为人民币 653,139,948.04 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为人民币 37,281,540.65 元、人民币 115,954,976.55 元、人民币 784,795.40 元、人民币 98,099.40 元、人民币 430,294.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为人民币 37,281,540.65 元、人民币 115,954,976.55 元、人民币 784,795.40 元、人民币 98,099.40 元、人民币 430,294.47 元。

本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。
- 2) 对证券投资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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- 4) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税。
- 5) 基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	258,799.51	115,640,704.77
等于：本金	257,451.79	115,640,704.77
加：应计利息	1,347.72	-
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	258,799.51	115,640,704.77

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	52,801,045.33	-	52,848,160.00	47,114.67	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	127,348,137.67	1,585,526.61	129,753,333.51	819,669.23
	银行间市场	60,959,241.50	868,857.70	61,676,857.70	-151,241.50
	合计	188,307,379.17	2,454,384.31	191,430,191.21	668,427.73
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	241,108,424.50	2,454,384.31	244,278,351.21	715,542.40	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	192,144,440.69	-	199,856,199.28	7,711,758.59	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	228,912,011.72	-	232,289,387.00	3,377,375.28
	银行间市场	213,107,140.34	-	214,457,000.00	1,349,859.66
	合计	442,019,152.06	-	446,746,387.00	4,727,234.94
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	634,163,592.75	-	646,602,586.28	12,438,993.53	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	47,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	47,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

### 7.4.7.5 债权投资

#### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 7.4.7.5.2 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。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。



**7.4.7.6.2 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。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 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。

**7.4.7.7.2 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。

**7.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	6,560,450.37
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	6,560,450.37

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31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	225,849.70	430,294.47
其中：交易所市场	222,774.70	421,744.47
银行间市场	3,075.00	8,550.00
应付利息	-	-
预提费用	200,000.00	160,000.00
合计	425,849.70	590,294.47

**7.4.7.10 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	632,965,183.37	632,965,183.37
本期申购	3,340,495.42	3,340,495.42
本期赎回（以“-”号填列）	-390,874,242.85	-390,874,242.85
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	245,431,435.94	245,431,435.94

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 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	30,863,781.18	8,146,228.29	39,010,009.47
本期利润	-11,101,368.33	-11,723,451.13	-22,824,819.46
本期基金份额交易产生的变动数	-14,249,814.31	653,673.04	-13,596,141.27
其中：基金申购款	121,418.15	-8,214.30	113,203.85
基金赎回款	-14,371,232.46	661,887.34	-13,709,345.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,512,598.54	-2,923,549.80	2,589,048.74

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	107,087.46	247,973.36
定期存款利息收入	-	158,888.88
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	84,493.91	279,317.50
其他	11,097.13	8,088.41
合计	202,678.50	694,268.15

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,214,649,252.61	1,242,298,547.45
减：卖出股票成本总额	1,226,512,052.72	1,222,876,293.85
减：交易费用	3,088,959.38	-
买卖股票差价收入	-14,951,759.49	19,422,253.60

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	7,790,531.13	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,810,821.19	14,657,079.77
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	5,979,709.94	14,657,079.77

##### 7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,062,031,442.57	2,658,369,817.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,051,849,185.63	2,603,287,995.11
减：应计利息总额	11,968,832.65	40,424,742.33
减：交易费用	24,245.48	-
买卖债券差价收入	-1,810,821.19	14,657,079.77

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	911,798.95	493,713.35
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	911,798.95	493,713.35

**7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日

1. 交易性金融资产	-11,723,451.13	12,215,047.26
股票投资	-7,664,643.92	7,004,301.12
债券投资	-4,058,807.21	5,210,746.14
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-11,723,451.13	12,215,047.26

#### 7.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	4,987.98	10,930.69
账户服务费	18,000.00	12,000.00
清算所账户服务费	19,200.00	12,800.00
交易费用	-	3,419,895.53
其他	-	400.00
合计	242,187.98	3,656,026.22

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司(以下简称	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

“农银汇理”)	
农银汇理资产管理有限公司	基金管理人的子公司
东方证券股份有限公司(以下简称“东方证券”)	基金托管人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
东方汇理资产管理公司(以下简称“东方汇理”)	基金管理人的股东
中铝资本控股有限公司(以下简称“中铝资本”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
东方证券	2,301,817,909.97	100.00	2,608,853,575.60	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
东方证券	524,650,765.28	100.00	1,276,762,367.83	100.00

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
东方证券	7,342,300,000.00	100.00	40,750,800,000.00	100.00

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东方证券	1,683,321.31	100.00	222,774.70	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东方证券	1,907,860.64	100.00	421,744.47	100.00

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,763,360.66	9,180,551.03
其中：支付销售机构的客户维护 费	1,329,492.68	4,528,307.61

注：支付基金管理人农银汇理的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算方法为：日基金管理人报酬前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	345,420.12	1,147,568.92

注：支付基金托管人东方证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：日基金托管费 前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付关联方的销售服务费。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金合同生效日（2020年12月25日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	10,000,450.04
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,450.04	10,000,450.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.0744%	1.5799%

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入



东方证券	258,799.51	107,087.46	115,640,704.77	247,973.36
------	------------	------------	----------------	------------

注：本基金的银行存款存放在托管人东方证券在农业银行开立的托管账户中，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币-206.74 元，于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,182,136.99	10,006,000.00
合计	20,182,136.99	10,006,000.00

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。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	131,880,889.86	212,959,200.00
AAA 以下	8,104,816.25	19,330,187.00
未评级	31,262,348.11	204,451,000.00
合计	171,248,054.22	436,740,387.00

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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	258,799.51	-	-	-	258,799.51
结算备付金	2,866,846.88	-	-	-	2,866,846.88
存出保证金	323,320.18	-	-	-	323,320.18
交易性金融资产	129,388,443.65	40,648,536.44	21,393,211.12	52,848,160.00	244,278,351.21
应收清算款	-	-	-	2,069,985.39	2,069,985.39
资产总计	132,837,410.22	40,648,536.44	21,393,211.12	54,918,145.39	249,797,303.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	454,507.21	454,507.21
应付管理人报酬	-	-	-	170,836.46	170,836.46
应付托管费	-	-	-	21,354.56	21,354.56

应付清算款	-	-	-	700,413.48	700,413.48
卖出回购金融资产款	-206.74	-	-	-	-206.74
应交税费	-	-	-	4,063.82	4,063.82
其他负债	-	-	-	425,849.70	425,849.70
负债总计	-206.74	-	-	1,777,025.23	1,776,818.49
利率敏感度缺口	132,837,616.96	40,648,536.44	21,393,211.12	53,141,120.16	248,020,484.68
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	115,640,704.77	-	-	-	115,640,704.77
结算备付金	5,352,774.71	-	-	-	5,352,774.71
存出保证金	513,698.84	-	-	-	513,698.84
交易性金融资产	101,319,387.00	201,000,000.00	144,427,000.00	199,856,199.28	646,602,586.28
买入返售金融资产	47,000,000.00	-	-	-	47,000,000.00
应收清算款	-	-	-	5,022,157.19	5,022,157.19
应收申购款	-	-	-	59.95	59.95
其他资产	-	-	-	6,560,450.37	6,560,450.37
资产总计	269,826,565.32	201,000,000.00	144,427,000.00	211,438,866.79	826,692,432.11
负债					
应付清算款	-	-	-	37,281,540.65	37,281,540.65
应付赎回款	-	-	-	115,954,976.55	115,954,976.55
应付管理人报酬	-	-	-	784,795.40	784,795.40
应付托管费	-	-	-	98,099.40	98,099.40
应交税费	-	-	-	7,532.80	7,532.80
其他负债	-	-	-	590,294.47	590,294.47
负债总计	-	-	-	154,717,239.27	154,717,239.27
利率敏感度缺口	269,826,565.32	201,000,000.00	144,427,000.00	56,721,627.52	671,975,192.84

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。		
	其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升	-850,481.97	-4,856,461.73

	25 个基点		
	市场利率平行下降 25 个基点	850,481.97	4,856,461.73

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	52,848,160.00	21.31	199,856,199.28	29.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,848,160.00	21.31	199,856,199.28	29.74

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）

		日)	31 日 )
	业绩比较基准上升 5%	9,622,187.15	21,144,615.66
	业绩比较基准下降 5%	-9,622,187.15	-21,144,615.66

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	80,948,208.58	231,145,586.28
第二层次	163,330,142.63	415,457,000.00
第三层次	-	-
合计	244,278,351.21	646,602,586.28

###### 7.4.14.2.2 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。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 8 投资组合报告****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	52,848,160.00	21.16
	其中：股票	52,848,160.00	21.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	191,430,191.21	76.63
	其中：债券	191,430,191.21	76.63
	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	3,125,646.39	1.25
8	其他各项资产	2,393,305.57	0.96
9	合计	249,797,303.17	100.00

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,205,260.00	18.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,541,500.00	1.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,101,400.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	52,848,160.00	21.31

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603198	迎驾贡酒	100,000	6,278,000.00	2.53
2	600809	山西汾酒	20,000	5,699,800.00	2.30
3	605123	派克新材	40,000	5,316,000.00	2.14
4	688112	鼎阳科技	50,000	4,662,500.00	1.88
5	688777	中控技术	50,000	4,541,500.00	1.83
6	688337	普源精电	45,000	4,396,050.00	1.77
7	688283	坤恒顺维	60,000	3,480,600.00	1.40
8	688700	东威科技	20,000	2,863,000.00	1.15
9	000858	五粮液	15,000	2,710,350.00	1.09
10	000887	中鼎股份	160,000	2,315,200.00	0.93
11	300413	芒果超媒	70,000	2,101,400.00	0.85
12	603690	至纯科技	50,000	1,892,000.00	0.76
13	600519	贵州茅台	1,000	1,727,000.00	0.70
14	688106	金宏气体	80,000	1,500,800.00	0.61
15	688628	优利德	50,000	1,437,500.00	0.58
16	300750	宁德时代	3,000	1,180,260.00	0.48
17	300957	贝泰妮	5,000	746,200.00	0.30



## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	55,358,214.54	8.24
2	000887	中鼎股份	48,241,830.16	7.18
3	600809	山西汾酒	39,737,974.40	5.91
4	300316	晶盛机电	38,395,531.20	5.71
5	600038	中直股份	26,829,786.00	3.99
6	300443	金雷股份	26,656,752.00	3.97
7	603259	药明康德	26,095,294.20	3.88
8	000738	航发控制	25,399,987.74	3.78
9	600919	江苏银行	24,034,977.10	3.58
10	300593	新雷能	20,032,304.40	2.98
11	002402	和而泰	18,729,351.09	2.79
12	601888	中国中免	18,581,848.81	2.77
13	300750	宁德时代	18,120,928.19	2.70
14	601021	春秋航空	17,699,951.00	2.63
15	300347	泰格医药	17,496,382.50	2.60
16	688112	鼎阳科技	17,455,298.23	2.60
17	603198	迎驾贡酒	15,975,174.27	2.38
18	603181	皇马科技	15,730,627.00	2.34
19	002460	赣锋锂业	15,622,931.23	2.32
20	600887	伊利股份	15,307,949.35	2.28
21	600346	恒力石化	14,130,765.00	2.10
22	600030	中信证券	13,623,743.90	2.03
23	688700	东威科技	13,471,580.90	2.00

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	63,153,396.70	9.40
2	000887	中鼎股份	54,056,279.89	8.04
3	300316	晶盛机电	39,683,550.91	5.91
4	600809	山西汾酒	34,728,565.20	5.17
5	300699	光威复材	28,923,683.00	4.30
6	300443	金雷股份	27,978,140.00	4.16
7	600038	中直股份	27,522,930.06	4.10
8	300012	华测检测	27,367,717.77	4.07
9	000738	航发控制	26,754,499.98	3.98

10	603259	药明康德	25,462,508.80	3.79
11	300593	新雷能	24,018,358.39	3.57
12	600919	江苏银行	22,704,912.40	3.38
13	300755	华致酒行	20,011,372.92	2.98
14	600036	招商银行	19,782,386.00	2.94
15	002402	和而泰	19,698,814.00	2.93
16	601888	中国中免	18,605,217.00	2.77
17	002179	中航光电	17,617,022.89	2.62
18	600030	中信证券	17,385,172.85	2.59
19	601021	春秋航空	17,360,469.28	2.58
20	600887	伊利股份	17,280,965.00	2.57
21	300750	宁德时代	17,028,713.00	2.53
22	300347	泰格医药	16,614,213.00	2.47
23	688066	航天宏图	16,238,128.33	2.42
24	002460	赣锋锂业	15,434,564.90	2.30
25	002430	杭氧股份	15,081,439.67	2.24
26	603855	华荣股份	15,077,933.00	2.24
27	603181	皇马科技	14,829,020.40	2.21
28	688122	西部超导	14,608,018.58	2.17
29	600346	恒力石化	14,131,347.06	2.10
30	002555	三七互娱	14,048,426.50	2.09
31	688112	鼎阳科技	13,783,983.93	2.05

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,087,168,657.36
卖出股票收入（成交）总额	1,214,649,252.61

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,006,353.59	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,801,367.12	16.85
	其中：政策性金融债	31,568,994.52	12.73
4	企业债券	101,653,284.93	40.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,869,136.99	3.98
7	可转债（可交换债）	28,100,048.58	11.33
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	191,430,191.21	77.18

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	163494	20 兵装 02	200,000	20,251,327.12	8.17
2	163500	20 中船 03	200,000	20,238,735.34	8.16
3	163513	20 中金 G3	200,000	20,235,336.99	8.16
4	220404	22 农发 04	200,000	20,182,136.99	8.14
5	180205	18 国开 05	100,000	11,386,857.53	4.59

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	323,320.18
2	应收清算款	2,069,985.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,393,305.57

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	7,423,022.47	2.99
2	110079	N 杭银转	6,972,223.56	2.81
3	127012	招路转债	5,599,986.30	2.26
4	110077	洪城转债	4,143,675.43	1.67
5	123114	三角转债	2,819,612.60	1.14
6	113045	环旭转债	1,141,528.22	0.46

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
7,810	31,425.28	10,999,084.03	4.48	234,432,351.91	95.52

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	68,549.33	0.0279

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.04	4.07	10,000,450.04	4.07	3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	22,104.46	0.01	-
基金经理等人员	0.00	0.00	-	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	-	0.00	-
其他	235,430,985.90	95.93	1,113,912,766.19	453.86	-
合计	245,431,435.94	100.00	1,123,935,320.69	457.94	-

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月25日)基金份额总额	1,123,935,320.69
本报告期期初基金份额总额	632,965,183.37
本报告期基金总申购份额	3,340,495.42
减：本报告期基金总赎回份额	390,874,242.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	245,431,435.94

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

#### § 11 重大事件揭示

##### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

##### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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”）第五届董事会第一次会议决议，原本公司董事长许金超先生自 2022 年 9 月 26 日离任本公司董事长职务；黄涛先生自 2022 年 9 月 26 日任职本公司董事长职位。

本公司已于 2022 年 9 月 28 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 8 万元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	2,301,817,909.97	100.00	1,683,321.31	100.00	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方证券	525,099,100.61	100.00	7,342,300,000.00	100.00	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人	2022 年 01 月 21 日
2	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	证券时报、基金管理人	2022 年 03 月 29 日
3	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人	2022 年 04 月 21 日
4	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人	2022 年 06 月 29 日
5	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金-招募说明书更新-2022 年第 1 次	证券时报、基金管理人	2022 年 06 月 29 日
6	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	证券时报、基金管理人	2022 年 07 月 20 日
7	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	证券时报、基金管理人	2022 年 08 月 30 日
8	农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	证券时报、基金管理人	2022 年 10 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司

2023 年 3 月 29 日