

农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38

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	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金
基金简称	农银平衡双利混合
基金主代码	660003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 8 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	193,308,364.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在红利股票和高息债券等不同类型资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
投资策略	本基金将在对宏观经济走势和证券市场科学预期的基础上，采取灵活的资产配置策略，构建具有弹性的股票债券平衡组合，寻求经风险调整后的收益水平最大化。在股票投资中以分红类型的股票为投资重点，以获取上市公司分红和股票增值的收益；在债券投资中重点关注高票息券种，通过多样化的投资手段达到提高债券组合收益水平并规避市场风险的目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中证全债指数×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东
	联系电话	021-61095588
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com
客户服务电话	021-61095599	95559
传真	021-61095556	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	黄涛	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
----------------	-------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-22,046,356.87
本期利润	-12,790,417.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0631
本期加权平均净值利润率	-3.51%
本期基金份额净值增长率	-3.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	142,706,162.31
期末可供分配基金份额利润	0.7382
期末基金资产净值	336,014,527.16
期末基金份额净值	1.7382
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	299.42%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

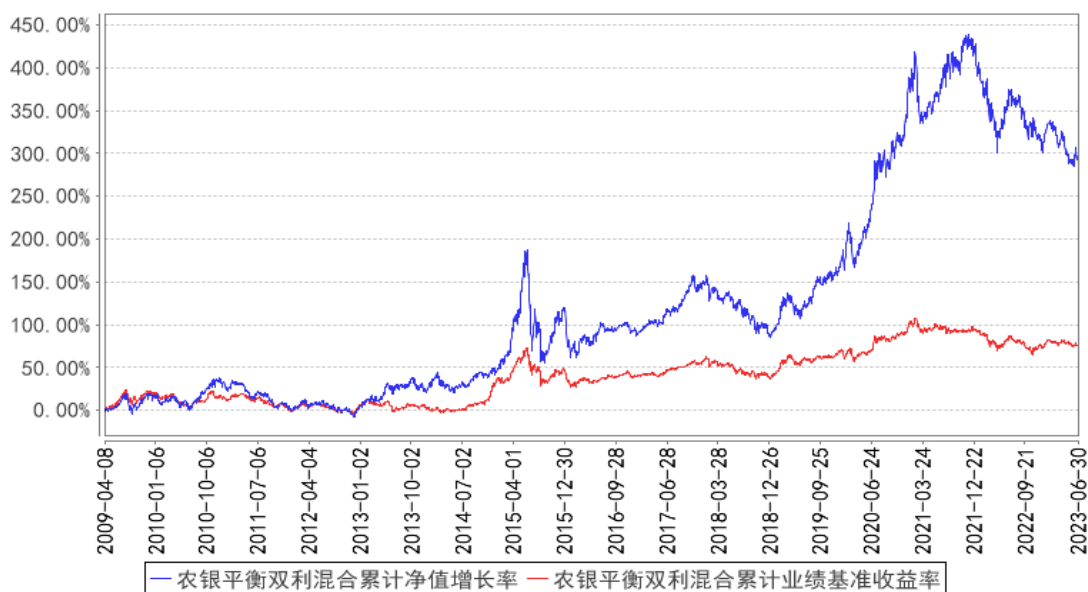
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.92%	0.82%	0.90%	0.47%	1.02%	0.35%
过去三个月	-4.32%	0.75%	-1.95%	0.45%	-2.37%	0.30%
过去六个月	-3.50%	0.73%	1.01%	0.46%	-4.51%	0.27%

过去一年	-15.34%	0.86%	-6.00%	0.54%	-9.34%	0.32%
过去三年	14.85%	1.17%	2.50%	0.66%	12.35%	0.51%
自基金合同生效起至今	299.42%	1.31%	75.94%	0.79%	223.48%	0.52%

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

农银平衡双利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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 30%-80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%（其中，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（2009 年 4 月 8 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。公司法定代表人为黄涛先生。

截止 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 75 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、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金。

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		
陈富权	本基金的基金经理	2014 年 4 月 15 日	-	15 年	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理，农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员，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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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。

4.3.2 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

1 月市场普涨特征明显，风格上成长相较价值有更好的表现。大体来看，上涨下跌和行业 beta 的关系更显著。2 月市场分化较大，创业板指则大幅下行。TMT 板块在人工智能主题的带动下大幅上涨，通信和计算机涨幅居前，电新及金融地产等机构持仓较重或流动性较好的板块则显著回调。3 月市场延续 2 月行情，板块间继续大分化，由于人工智能热点事件不断，催化 TMT 板块全面上涨。其他的一些机构重仓板块，包括电新、医药、食品、金融等都出现资金流出现象，整体表现为小幅上涨或小幅下跌，经济刺激政策相关度高的地产链和汽车链则出现大幅下跌。本基金在一季度初以景气为抓手，主要配置高景气以及景气趋强的板块，包括食品饮、军工以及新能源，以及景气边际趋强的计算机和医药。在春节前，考虑到节后复苏链条的传动以及政策预期，增加了一些复苏链条的配置，如汽车链、地产链、出行链等，减配了一些边际走弱、筹码拥挤度较高的军工和新能源汽车。两会后考虑到国内增长目标，减配了消费，增配了成长，特别是数字经济相关的大盘成长，同时结合一季度的季报展望，对组合个股进行了调优。

4 月市场整体大幅震荡，行业亦大幅分化。在经济预期不明朗的情况下，消费及大盘成长的资金转移到有限的科技热点以及一些有资金容纳能力强的低估低位的板块之上。5 月市场普跌，市场上防御类的板块出现较为显著的相对收益，其中电力股领涨，银行也录得正收益。6 月市场大幅震荡，在 5 月经济数据及 6 月高频继续走弱的情况下，市场开始交易政策发力预期，家电及汽车为代表的潜在政策受益板块表现较佳。本基金在二季度逐渐切换至杠铃配置策略，增配受益 AI 科技浪潮的 TMT 以及增长相对稳健的央国企，减配了一些消费和新能源。增配方向主要集中在算力方向的光模块、服务器以及应用方向的传媒，低估值板块上则重点加配了基本面稳健的电信以及景气趋强的电力和保险。

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 1.7382 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.50%，业绩比较基准收益率为 1.01%。

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，经济有望逐渐复苏。在经历了二季度的加速去库存后，企业的库存压力得到较

大的缓解，库存对经济增长的拖累大幅降低。从库存周期的角度看，下半年经济有望逐渐企稳。同时，考虑到政策上的边际加码，需求端的刺激有望加强，有助于经济的进一步修复。在当前的经济环境之下，国内的流动性有望保持宽松。前期汇率的波动实际上提供了一次压力测试，即宽松的流动性叠加较弱的经济预期下，人民币汇率仍能有较强的支撑。因此后续国内流动性边际加码这一点在意愿和能力上都具备条件，可以预期，后续国内的流动性将保持充裕。

政策方面，根据 7 月中央政治局会议的部署，预计下半年会有较多总量及结构上的刺激政策会出台，包括房地产、地方债、资本市场，以及汽车、电子产品、家居等细分产业领域的政策。我们认为政策出台的影响是积极正面的，但是我们认为对政策力度预期不宜过高。中期维度高质量发展目标并没有变化，目前出台系列政策的初衷更多是为了平衡经济的短期增长，会更多体现为一种温和的托底。

对于资本市场，我们认为由于经济逐步企稳、流动性充裕、政策偏暖，市场元气也会逐渐恢复。宏观基本面的回暖会带动行业景气度的回升，具备业绩支撑的结构性行业机会会更频繁地出现，从而为基本面投资带来更多机会。我们认为在高质量发展的方针指导下，具备稳健增长预期、估值偏低的低波红利股有较好的配置价值。此外，在人工智能、人形机器人等新一轮科技浪潮下，那些能够参与到其中供应链的制造业，也会在业绩层面表现出较强的景气度，值得持续关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会于 2012 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

本报告期内，基金托管人在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	72,630,256.00	89,248,432.38
结算备付金		552,326.62	447,264.44
存出保证金		76,865.85	78,100.52
交易性金融资产	6.4.7.2	272,112,325.06	282,798,045.96
其中：股票投资		272,112,325.06	282,798,045.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,175,979.07	12,161.70
应收股利		-	-
应收申购款		13,545.86	20,005.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		348,561,298.46	372,604,010.81
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		11,491,182.06	181,278.90

应付管理人报酬		426,083.30	470,242.01
应付托管费		71,013.88	78,373.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	558,492.06	457,749.13
负债合计		12,546,771.30	1,187,643.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	193,308,364.85	206,190,338.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	142,706,162.31	165,226,028.65
净资产合计		336,014,527.16	371,416,367.08
负债和净资产总计		348,561,298.46	372,604,010.81

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7382 元，基金份额总额 193,308,364.85 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,522,894.02	-44,260,775.24
1. 利息收入		297,117.67	356,836.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	297,117.67	320,896.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	35,939.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,110,679.08	-19,020,078.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-21,044,148.70	-20,532,069.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	256,317.12

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,933,469.62	1,255,674.38
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.20	9,255,939.51	-25,625,127.81
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	34,727.88	27,594.70
减：二、营业总支出		3,267,523.34	3,454,501.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,712,874.98	2,873,056.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	452,145.80	478,842.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	102,502.56	102,602.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-12,790,417.36	-47,715,276.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-12,790,417.36	-47,715,276.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,790,417.36	-47,715,276.92

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	206,190,338.43	-	165,226,028.65	371,416,367.08
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)	206,190,338.43	-	165,226,028.65	371,416,367.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,881,973.58	-	-22,519,866.34	-35,401,839.92
(一)、综合收益总额	-	-	-12,790,417.36	-12,790,417.36
(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)	-12,881,973.58	-	-9,729,448.98	-22,611,422.56
其中：1. 基金申购款	9,798,767.20	-	7,914,030.36	17,712,797.56
2. 基金赎回款	-22,680,740.78	-	-17,643,479.34	-40,324,220.12
(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)	193,308,364.85	-	142,706,162.31	336,014,527.16
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	174,615,914.82	-	296,771,775.17	471,387,689.99
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)	174,615,914.82	-	296,771,775.17	471,387,689.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,500,970.72	-	-90,235,276.77	-68,734,306.05
(一)、综合收益总额	-	-	-47,715,276.92	-47,715,276.92
(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)	21,500,970.72	-	24,300,426.05	45,801,396.77
其中：1. 基金申购款	34,644,453.99	-	37,665,738.45	72,310,192.44
2. 基金赎回款	-13,143,483.27	-	-13,365,312.40	-26,508,795.67
(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)	-	-	-66,820,425.90	-66,820,425.90
(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)	196,116,885.54	-	206,536,498.40	402,653,383.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

程昆

毕宏燕

丁煜琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理平衡双利混合型证券投资基金(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》、《农银汇理平衡双利混合型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[2009]74 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 6,465,518,027.79 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(09)第 0008 号验资报告。《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2009 年 4 月 8 日正式生效。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新适用的《农银汇理平衡双利混合型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，包括国内依法上市的股票、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。基金的投资组合为：股票投资比例范围为基金资产的 30%-80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%（其中，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）。本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数×55%+中证全债指数×45%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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) 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
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
活期存款	72,630,256.00
等于：本金	72,616,693.18
加：应计利息	13,562.82
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	72,630,256.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	272,132,020.93	-	272,112,325.06	-19,695.87
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	272,132,020.93	-	272,112,325.06	-19,695.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	38,767.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	435,421.73

其中：交易所市场	435,421.73
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	558,492.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,190,338.43	206,190,338.43
本期申购	9,798,767.20	9,798,767.20
本期赎回（以“-”号填列）	-22,680,740.78	-22,680,740.78
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	193,308,364.85	193,308,364.85

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	292,674,311.74	-127,448,283.09	165,226,028.65
本期利润	-22,046,356.87	9,255,939.51	-12,790,417.36
本期基金份额交易产生的变动数	-17,270,872.20	7,541,423.22	-9,729,448.98
其中：基金申购款	13,504,674.33	-5,590,643.97	7,914,030.36
基金赎回款	-30,775,546.53	13,132,067.19	-17,643,479.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	253,357,082.67	-110,650,920.36	142,706,162.31

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	活期存款利息收入	290,674.30
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	5,838.14	
其他	605.23	

合计	297,117.67
----	------------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	523,309,911.00
减：卖出股票成本总额	542,774,720.77
减：交易费用	1,579,338.93
买卖股票差价收入	-21,044,148.70

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,933,469.62
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	1,933,469.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	9,255,939.51
股票投资	9,255,939.51
债券投资	-
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	9,255,939.51

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	34,450.55
基金转换费收入	277.33
合计	34,727.88

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、本基金的转换费由转出基金的赎回费和申购费补差两部分组成，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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	200.00
账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
合计	102,502.56

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(以下简称“农银汇理”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,712,874.98	2,873,056.37
其中：支付销售机构的客户维护费	1,298,279.72	1,390,055.07

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	452,145.80	478,842.75

注：支付基金托管人交通银行的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期间及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
交通银行	72,630,256.00	290,674.30	81,706,744.25	316,141.75

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2023 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	受限期	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
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	创业板锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	创业板锁定	26.80	22.32	677	18,143.60	15,110.64	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	创业板锁定	23.77	42.89	504	11,980.08	21,616.56	-

注：1、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中需要限售的部分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。

2、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

“本基金管理人的风险政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。通过事前制定科学合理的

制度和业务流程、事中有有效的执行和管控、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

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

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注 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。

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 2023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	72,630,256.00	-	-	-	72,630,256.00
结算备付金	552,326.62	-	-	-	552,326.62
存出保证金	76,865.85	-	-	-	76,865.85
交易性金融资产	-	-	-	-272,112,325.06	272,112,325.06
应收申购款	0.05	-	-	13,545.81	13,545.86
应收清算款	-	-	-	3,175,979.07	3,175,979.07
资产总计	73,259,448.52	-	-	-275,301,849.94	348,561,298.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,491,182.06	11,491,182.06
应付管理人报酬	-	-	-	426,083.30	426,083.30
应付托管费	-	-	-	71,013.88	71,013.88
其他负债	-	-	-	558,492.06	558,492.06
负债总计	-	-	-	12,546,771.30	12,546,771.30
利率敏感度缺口	73,259,448.52	-	-	-262,755,078.64	336,014,527.16
上年度末 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	89,248,432.38	-	-	-	89,248,432.38

结算备付金	447,264.44	-	-	-	447,264.44
存出保证金	78,100.52	-	-	-	78,100.52
交易性金融资产	-	-	-	-282,798,045.96	282,798,045.96
应收申购款	-	-	-	20,005.81	20,005.81
应收清算款	-	-	-	12,161.70	12,161.70
资产总计	89,773,797.34	-	-	-282,830,213.47	372,604,010.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	181,278.90	181,278.90
应付管理人报酬	-	-	-	470,242.01	470,242.01
应付托管费	-	-	-	78,373.69	78,373.69
其他负债	-	-	-	457,749.13	457,749.13
负债总计	-	-	-	1,187,643.73	1,187,643.73
利率敏感度缺口	89,773,797.34	-	-	-281,642,569.74	371,416,367.08

注：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

本基金本报告期末及上年度末无债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动对基金资产净值的影响不重大。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	272,112,325.06	80.98	282,798,045.96	76.14
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	272,112,325.06	80.98	282,798,045.96	76.14

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	18,549,383.46	23,868,533.73
	业绩比较基准下降5%	-18,549,383.46	-23,868,533.73

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	272,067,658.36	282,125,383.23
第二层次	-	-

第三层次	44,666.70	672,662.73
合计	272,112,325.06	282,798,045.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	272,112,325.06	78.07
	其中：股票	272,112,325.06	78.07
2	基金投资	-	-
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	73,182,582.62	21.00
8	其他各项资产	3,266,390.78	0.94
9	合计	348,561,298.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,715,850.00	0.51
C	制造业	193,717,865.98	57.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,333,938.00	3.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,412,585.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	7,651,093.12	2.28
H	住宿和餐饮业	956,884.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,311,300.04	8.43
J	金融业	14,961,555.00	4.45
K	房地产业	3,905,083.00	1.16
L	租赁和商务服务业	1,063,605.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	157,388.00	0.05
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	5,925,177.92	1.76
S	综合	-	-
	合计	272,112,325.06	80.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300750	宁德时代	48,600	11,119,194.00	3.31
2	601882	海天精工	321,000	10,689,300.00	3.18
3	600150	中国船舶	301,100	9,909,201.00	2.95

4	688234	天岳先进	129,271	9,558,297.74	2.84
5	600941	中国移动	97,900	9,134,070.00	2.72
6	600276	恒瑞医药	188,000	9,005,200.00	2.68
7	688596	正帆科技	205,772	8,909,927.60	2.65
8	601318	中国平安	184,600	8,565,440.00	2.55
9	300274	阳光电源	56,400	6,577,932.00	1.96
10	600519	贵州茅台	3,800	6,425,800.00	1.91
11	600079	人福医药	238,500	6,425,190.00	1.91
12	000858	五粮液	36,500	5,970,305.00	1.78
13	000568	泸州老窖	25,400	5,323,078.00	1.58
14	600570	恒生电子	114,000	5,049,060.00	1.50
15	300896	爱美客	11,160	4,965,642.00	1.48
16	600023	浙能电力	946,400	4,798,248.00	1.43
17	300502	新易盛	69,580	4,729,352.60	1.41
18	002430	杭氧股份	136,000	4,672,960.00	1.39
19	600197	伊力特	163,100	4,431,427.00	1.32
20	601928	凤凰传媒	382,200	4,357,080.00	1.30
21	600026	中远海能	343,600	4,343,104.00	1.29
22	300308	中际旭创	28,500	4,202,325.00	1.25
23	002156	通富微电	181,700	4,106,420.00	1.22
24	002384	东山精密	150,100	3,887,590.00	1.16
25	002609	捷顺科技	333,000	3,882,780.00	1.16
26	688111	金山办公	7,870	3,716,371.40	1.11
27	002371	北方华创	11,600	3,684,740.00	1.10
28	000063	中兴通讯	79,700	3,629,538.00	1.08
29	300567	精测电子	37,500	3,568,125.00	1.06
30	601336	新华保险	92,600	3,404,902.00	1.01
31	002422	科伦药业	114,500	3,398,360.00	1.01
32	688518	联赢激光	118,111	3,290,572.46	0.98
33	600933	爱柯迪	140,100	3,262,929.00	0.97
34	301391	卡莱特	26,700	3,128,439.00	0.93
35	603345	安井食品	21,100	3,097,480.00	0.92
36	601728	中国电信	539,200	3,035,696.00	0.90
37	601658	邮储银行	611,700	2,991,213.00	0.89
38	688498	源杰科技	10,431	2,972,835.00	0.88
39	002415	海康威视	85,300	2,824,283.00	0.84
40	002709	天赐材料	68,300	2,813,277.00	0.84
41	000543	皖能电力	419,000	2,765,400.00	0.82
42	688239	航宇科技	39,114	2,736,024.30	0.81
43	688981	中芯国际	52,954	2,675,236.08	0.80
44	603605	珀莱雅	23,604	2,653,089.60	0.79
45	600325	华发股份	264,700	2,607,295.00	0.78
46	600529	山东药玻	94,300	2,566,846.00	0.76

47	600989	宝丰能源	193,100	2,434,991.00	0.72
48	600511	国药股份	62,100	2,412,585.00	0.72
49	000977	浪潮信息	48,100	2,332,850.00	0.69
50	002078	太阳纸业	195,500	2,089,895.00	0.62
51	002850	科达利	15,500	2,049,875.00	0.61
52	601985	中国核电	276,200	1,947,210.00	0.58
53	002461	珠江啤酒	217,200	1,913,532.00	0.57
54	000862	银星能源	238,000	1,823,080.00	0.54
55	002275	桂林三金	100,600	1,811,806.00	0.54
56	600426	华鲁恒升	59,100	1,810,233.00	0.54
57	601088	中国神华	55,800	1,715,850.00	0.51
58	601111	中国国航	204,208	1,682,673.92	0.50
59	603306	华懋科技	57,000	1,654,140.00	0.49
60	605377	华旺科技	88,900	1,604,645.00	0.48
61	002555	三七互娱	42,900	1,496,352.00	0.45
62	002345	潮宏基	189,000	1,485,540.00	0.44
63	300570	太辰光	25,100	1,373,221.00	0.41
64	001979	招商蛇口	99,600	1,297,788.00	0.39
65	603129	春风动力	7,400	1,198,060.00	0.36
66	603444	吉比特	2,400	1,178,664.00	0.35
67	002050	三花智控	35,400	1,071,204.00	0.32
68	601900	南方传媒	52,000	1,066,520.00	0.32
69	300795	米奥会展	25,500	1,063,605.00	0.32
70	688012	中微公司	6,284	983,131.80	0.29
71	600754	锦江酒店	22,600	956,884.00	0.28
72	603209	兴通股份	43,820	929,422.20	0.28
73	688072	拓荆科技	1,802	767,597.94	0.23
74	688337	普源精电	12,066	727,097.16	0.22
75	603885	吉祥航空	45,100	695,893.00	0.21
76	688099	晶晨股份	7,902	666,296.64	0.20
77	605300	佳禾食品	26,800	582,632.00	0.17
78	600373	中文传媒	37,656	501,577.92	0.15
79	003000	劲仔食品	27,800	350,002.00	0.10
80	300416	苏试试验	7,300	157,388.00	0.05
81	002624	完美世界	9,000	152,010.00	0.05
82	605499	东鹏饮料	700	121,030.00	0.04
83	601138	工业富联	4,000	100,800.00	0.03
84	301358	湖南裕能	504	21,616.56	0.01
85	301303	真兰仪表	677	15,110.64	0.00
86	301157	华塑科技	150	7,939.50	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	601318	中国平安	12,537,492.34	3.38
2	601882	海天精工	9,634,820.00	2.59
3	000858	五粮液	9,130,804.00	2.46
4	600941	中国移动	9,058,290.00	2.44
5	600150	中国船舶	8,586,791.50	2.31
6	688596	正帆科技	7,757,696.62	2.09
7	600036	招商银行	7,209,416.00	1.94
8	688981	中芯国际	6,999,087.50	1.88
9	601633	长城汽车	6,978,097.81	1.88
10	000568	泸州老窖	6,819,435.00	1.84
11	002415	海康威视	6,119,251.00	1.65
12	601928	凤凰传媒	5,906,619.00	1.59
13	688518	联赢激光	5,746,775.95	1.55
14	688697	纽威数控	5,618,883.06	1.51
15	601111	中国国航	5,612,041.56	1.51
16	603039	泛微网络	5,561,608.00	1.50
17	002555	三七互娱	5,449,301.18	1.47
18	000063	中兴通讯	5,273,094.00	1.42
19	002078	太阳纸业	5,103,819.08	1.37
20	603833	欧派家居	5,074,037.00	1.37

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	002049	紫光国微	8,631,649.35	2.32
2	688369	致远互联	8,100,964.47	2.18
3	600905	三峡能源	7,495,626.00	2.02
4	000963	华东医药	7,472,746.74	2.01
5	002025	航天电器	7,276,529.00	1.96
6	600036	招商银行	7,126,293.00	1.92
7	601633	长城汽车	6,472,066.00	1.74
8	688197	首药控股	6,459,694.52	1.74
9	002594	比亚迪	6,263,497.27	1.69
10	605499	东鹏饮料	5,943,547.00	1.60
11	000568	泸州老窖	5,822,040.00	1.57
12	002459	晶澳科技	5,800,563.80	1.56
13	600011	华能国际	5,614,113.00	1.51
14	688697	纽威数控	5,554,125.30	1.50
15	601012	隆基绿能	5,526,100.00	1.49
16	300014	亿纬锂能	5,516,239.26	1.49

17	603833	欧派家居	5,504,379.00	1.48
18	002352	顺丰控股	5,020,889.76	1.35
19	603885	吉祥航空	4,753,611.00	1.28
20	600487	亨通光电	4,611,170.00	1.24

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	522,833,060.36
卖出股票收入（成交）总额	523,309,911.00

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

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	76,865.85
2	应收清算款	3,175,979.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,545.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,266,390.78

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 (%)
52,309	3,695.51	3,682,343.93	1.90	189,626,020.92	98.10

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	5,615.93	0.0029

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 4 月 8 日） 基金份额总额	6,465,518,027.79
本报告期期初基金份额总额	206,190,338.43
本报告期基金总申购份额	9,798,767.20
减：本报告期基金总赎回份额	22,680,740.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	193,308,364.85

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

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

10.6.2 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 (%)	
国泰君安证券	2	349,383,725.16	33.42	325,369.58	33.42	-
海通证券	2	324,825,939.57	31.07	302,510.07	31.07	-
中信证券	2	228,735,650.88	21.88	213,022.64	21.88	-
长江证券	2	103,115,953.81	9.86	96,027.63	9.86	-
中金公司	2	39,474,452.34	3.78	36,763.45	3.78	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
2	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站	2023 年 03 月 29 日
3	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2023 年 04 月 20 日
4	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金-招募说明书更新-2023 年第 1 次	中国证券报、基金管理人网站	2023 年 06 月 29 日
5	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站	2023 年 06 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、《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理平衡双利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

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。

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

2023 年 8 月 25 日