

# 农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 市场中性策略执行情况.....	43
7.13 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	农银海棠定开混合
基金主代码	006977
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 16 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	251,647,246.26 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制投资组合风险的前提下，追求资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、权证投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% + 中证全债指数收益率×35%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105798
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105799
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		许金超	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	71,134,219.36
本期利润	103,611,258.11
加权平均基金份额本期利润	0.4191
本期加权平均净值利润率	32.14%
本期基金份额净值增长率	37.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	8,061,076.24
期末可供分配基金份额利润	0.0320
期末基金资产净值	324,832,092.26
期末基金份额净值	1.2908
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	61.10%

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

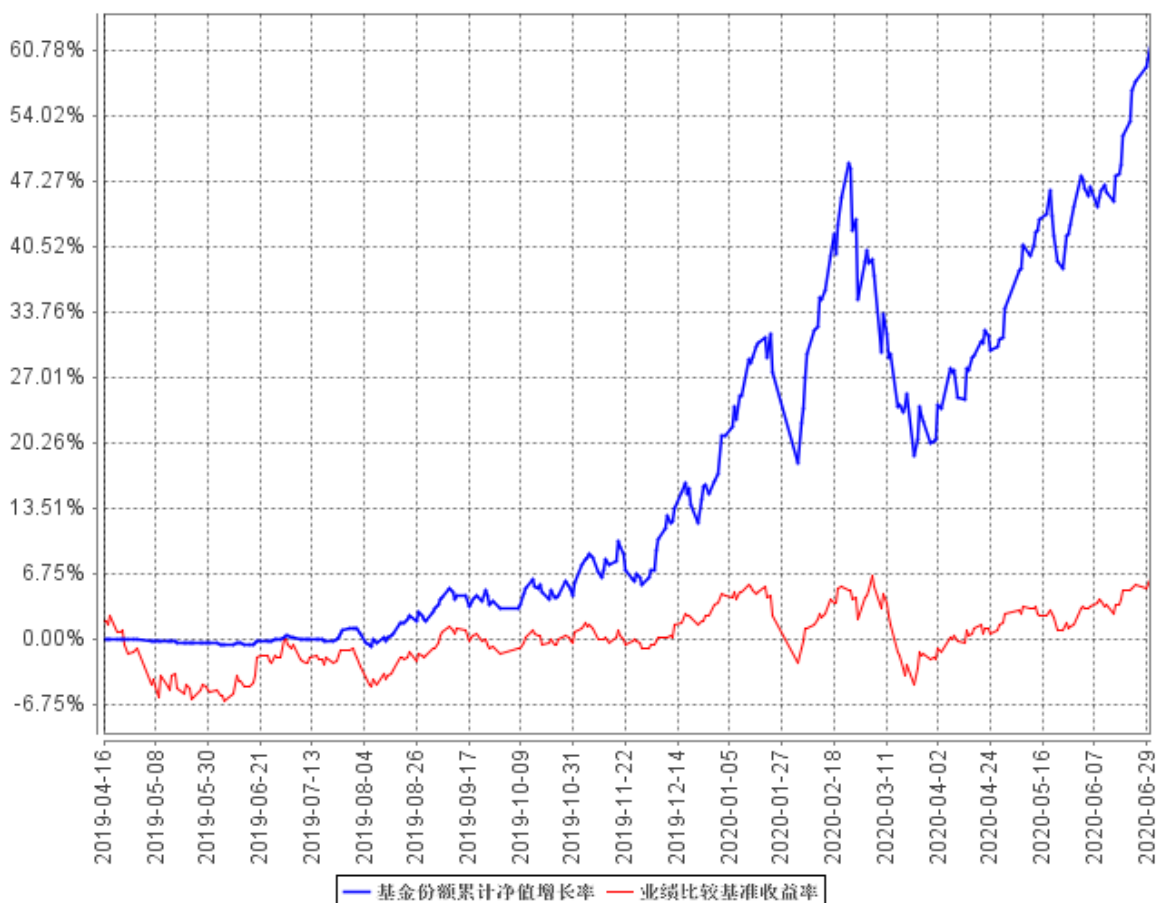
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.37%	0.99%	4.63%	0.58%	6.74%	0.41%
过去三个月	33.80%	1.22%	8.16%	0.59%	25.64%	0.63%
过去六个月	37.66%	1.91%	2.29%	0.97%	35.37%	0.94%
过去一年	61.26%	1.42%	8.11%	0.78%	53.15%	0.64%
自基金合同生效起至今	61.10%	1.30%	6.07%	0.83%	55.03%	0.47%



### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产净值的比例为 50%-95%，但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内，本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金建仓期为 2019 年 4 月 16 日起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 62 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、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、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、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、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理永安

混合型证券投资基金、农银汇理稳进多因子股票型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理可转债债券型证券投资基金、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、农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金及农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

#### 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		
付娟	本基金基金经理、公司投资总监	2019 年 4 月 16 日	2020 年 6 月 16 日	14	会计学博士，具有基金从业资格。历任申银万国证券研究所分析师、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理、研究部副总经理、投资部总经理、投资部副总监。现任农银汇理基金管理有限公司投资总监、基金经理。
赵诣	本基金基金经理	2019 年 6 月 1 日	-	8	硕士。历任申银万国证券研究所机械行业分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

#### 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规

及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度受疫情的影响，市场出现了较大的波动。进入二季度，随着国内和海外国家逐步进入复工复产阶段，疫情对市场影响最大的阶段已经过去，同时由于疫情对全球经济产生了较大的影响，各国均出台了较强的经济刺激政策，全球进入放水阶段，随着美股在宽松的货币环境下创出新高，国内市场也在二季度出现震荡上行的局面，经过跌宕起伏的上半年之后，上证综指下跌 2.12%，深证成指上涨 14.97%，创业板指上涨 35.60%。

在操作上，由于刚接手新产品，整体和之前一样，保持中性仓位，结构上进行了一定的调整。在一季度经历了疫情冲击导致的大幅波动后，二季度取得了较好的收益，主要原因在于由于市场对于海外疫情短期影响过于担忧，而忽视了优质公司的长期成长价值，因此在因外需而导致的下跌中，加仓了以新能源行业为主的龙头企业。目前组合持仓主要集中在计算机、电子、机械、新能源、医药和食品饮料等行业。

#### 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 1.2908 元；本报告期基金份额净值增长率为 37.66%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

### 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，我们认为，一方面随着欧美国家在 5 月份逐步开始复工之后，各国相应的经济刺激政策开始陆续出台，市场将进入一个从政策到落地到政策兑现的一个观察期，考虑到市场已经由于宽松已经回到疫情前的水平，因此更需要观察政策的执行效果；另一方面，随着疫情的逐

步控制，美国大选的临近，整个的外部环境又将变的复杂，也会对市场情绪产生一定的扰动。因此，在对外部环境我们无法预测和定价的情况下，我们仍将立足于产业趋势和公司发展，选择具有竞争力的优质龙头企业，尤其是对于那些在疫情后，能回到甚至超过疫情前的领域和公司，将是我们需要重点配置的方向。组合配置上仍然围绕科技+消费的方式，科技股方面，主要以 5G 产业链、新能源、高端制造为主；在消费股方面，主要以医疗器械及耗材、大众消费品为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内已实施过一次利润分配，每 10 份基金份额派发红利 2.60 元，权益登记日为 2020 年 6 月 23 日，总计分配利润 73,692,008.88 元。

#### **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，本基金托管人在对农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	61,716,078.72	44,302,795.98
结算备付金		311,478.73	631,719.20
存出保证金		82,808.96	84,420.50
交易性金融资产	6.4.7.2	263,792,735.60	244,866,663.14
其中：股票投资		263,792,735.60	244,866,663.14
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	32,500,000.00	-
应收证券清算款		77,199.43	-
应收利息	6.4.7.5	10,223.68	6,925.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		358,490,525.12	289,892,524.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		32,566,653.41	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		424,447.71	353,373.70
应付托管费		70,741.29	58,895.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	507,082.85	389,581.90
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	140,000.00
负债合计		33,658,432.86	941,851.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	251,647,246.26	246,897,819.20
未分配利润	6.4.7.10	73,184,846.00	42,052,853.66
所有者权益合计		324,832,092.26	288,950,672.86
负债和所有者权益总计		358,490,525.12	289,892,524.08

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2908 元，基金份额总额 251,647,246.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 4 月 16 日(基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		107,895,282.28	698,634.86
1.利息收入		186,853.54	617,565.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	170,004.60	263,002.04
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		16,848.94	354,563.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		75,231,389.99	45,295.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	74,475,551.64	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	755,838.35	45,295.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	32,477,038.75	35,773.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		4,284,024.17	947,117.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,396,910.24	758,862.48

2. 托管费	6.4.10.2.2	399,485.05	126,477.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,388,277.28	20,368.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	99,351.60	41,408.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		103,611,258.11	-248,482.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		103,611,258.11	-248,482.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	246,897,819.20	42,052,853.66	288,950,672.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	103,611,258.11	103,611,258.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,749,427.06	1,212,743.11	5,962,170.17
其中：1.基金申购款	4,749,427.06	1,212,743.11	5,962,170.17
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-73,692,008.88	-73,692,008.88
五、期末所有者权益（基金净值）	251,647,246.26	73,184,846.00	324,832,092.26

项目	上年度可比期间 2019 年 4 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	246,897,819.20	-	246,897,819.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-248,482.55	-248,482.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	246,897,819.20	-248,482.55	246,649,336.65

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：

_____ 施卫	_____ Celine Zhang	_____ 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

农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 117 号《关于准予农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 246,711,110.45 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0222 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 4 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 246,897,819.20

份基金份额，其中认购资金利息折合 186,708.75 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作，即采取封闭期和开放期相结合的方式运作。自基金合同生效日(含该日)起或者自每一开放期结束之日次日(含该日)起至三年后的对应日的前一日的期间，为本基金的一个封闭期。本基金的第一个封闭期自基金合同生效之日(含该日)起至三年后的对应日的前一日止。下一个封闭期自第一个开放期结束之日次日(含该日)起至三年后的对应日的前一日止，以此类推。如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务(红利再投资除外)，也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、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)、衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货等)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的相关规定。本基金投资于股票的比例范围为基金资产的 50%-95%，但应开放期流动性需要，每个开放期开始前 3 个月至开放期结束后 3 个月内不受前述比例限制。开放期内，本基金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，保持现金或者到期日在一年内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资范围为基金资产净值的 0%-3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中证全债指数收益率×35%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理

海棠三年定期开放混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	61,716,078.72
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	61,716,078.72

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	199,727,936.73	263,792,735.60	64,064,798.87
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	199,727,936.73	263,792,735.60	64,064,798.87

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	32,500,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	10,064.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	126.18
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.48
合计	10,223.68

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	507,082.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	507,082.85

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	246,897,819.20	246,897,819.20
本期申购	4,749,427.06	4,749,427.06
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-



基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	251,647,246.26	251,647,246.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,465,093.54	31,587,760.12	42,052,853.66
本期利润	71,134,219.36	32,477,038.75	103,611,258.11
本期基金份额交易产生的变动数	153,772.22	1,058,970.89	1,212,743.11
其中：基金申购款	153,772.22	1,058,970.89	1,212,743.11
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-73,692,008.88	-	-73,692,008.88
本期末	8,061,076.24	65,123,769.76	73,184,846.00

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	165,417.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,798.63
其他	788.55
合计	170,004.60

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	482,838,595.16
减：卖出股票成本总额	408,363,043.52

买卖股票差价收入	74,475,551.64
----------	---------------

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.13.4 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。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	755,838.35
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	755,838.35

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	32,477,038.75
——股票投资	32,477,038.75
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	32,477,038.75

**6.4.7.18 其他收入**

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，赎回费总额归入基金资产的比例随着持有期限而变化。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,388,277.28
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,388,277.28

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	844.00
其他	-
合计	99,351.60

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司(“农银汇理”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易、权证交易、债券交易和债券回购交易。本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无应付关联方佣金。

**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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,396,910.24	758,862.48
其中：支付销售机构的客	1,282,657.62	406,687.70

户维护费		
------	--	--

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：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年4月16日(基金合同生效 日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	399,485.05	126,477.09

#### 6.4.10.2.3 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

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 4 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	61,716,078.72	165,417.42	227,380,241.16	259,414.95

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 6 月 23 日	-	2020 年 6 月 23 日	2.6000	58,626,433.51	5,634,074.35	64,260,507.86	
2	2020 年 1 月 20 日	-	2020 年 1 月 20 日	0.3820	9,103,405.20	328,095.82	9,431,501.02	
合计	-	-	-	2.9820	67,729,838.71	5,962,170.17	73,692,008.88	

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流 通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-

688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688159	有方科技	2020年1月16日	2020年7月23日	科创板锁定	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。



## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

### 6.4.13.3 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 2020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	61,716,078.72	-	-	-	61,716,078.72
结算备付金	311,478.73	-	-	-	311,478.73
存出保证金	82,808.96	-	-	-	82,808.96
交易性金融资产	-	-	-	-263,792,735.60	263,792,735.60

买入返售金融资产	32,500,000.00	-	-	-	32,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	77,199.43	77,199.43
应收利息	-	-	-	10,223.68	10,223.68
资产总计	94,610,366.41	-	-	-263,880,158.71	358,490,525.12
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	32,566,653.41	32,566,653.41
应付管理人报酬	-	-	-	424,447.71	424,447.71
应付托管费	-	-	-	70,741.29	70,741.29
应付交易费用	-	-	-	507,082.85	507,082.85
其他负债	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	-	-	-	-33,658,432.86	33,658,432.86
利率敏感度缺口	94,610,366.41	-	-	-230,221,725.85	324,832,092.26
上年度末 2019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	44,302,795.98	-	-	-	44,302,795.98
结算备付金	631,719.20	-	-	-	631,719.20
存出保证金	84,420.50	-	-	-	84,420.50
交易性金融资产	-	-	-	-244,866,663.14	244,866,663.14
应收利息	-	-	-	6,925.26	6,925.26
资产总计	45,018,935.68	-	-	-244,873,588.40	289,892,524.08
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	353,373.70	353,373.70
应付托管费	-	-	-	58,895.62	58,895.62
应付交易费用	-	-	-	389,581.90	389,581.90
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	941,851.22	941,851.22
利率敏感度缺口	45,018,935.68	-	-	-243,931,737.18	288,950,672.86

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-	-
	市场利率平行下降 25 个基点	-	-

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	263,792,735.60	81.21	244,866,663.14	84.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	263,792,735.60	81.21	244,866,663.14	84.74

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	-		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准变动	-	-

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1) 增值税**

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	263,792,735.60	73.58
	其中：股票	263,792,735.60	73.58
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	32,500,000.00	9.07
	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	62,027,557.45	17.30
8	其他各项资产	170,232.07	0.05
9	合计	358,490,525.12	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	250,936,766.81	77.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	306,544.97	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,052,535.00	2.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,292,720.00	0.71
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	3,191,402.50	0.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	263,792,735.60	81.21

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	603308	应流股份	1,300,166	26,523,386.40	8.17
2	601012	隆基股份	585,200	23,835,196.00	7.34
3	600438	通威股份	1,180,400	20,515,352.00	6.32
4	300750	宁德时代	117,600	20,504,736.00	6.31
5	002460	赣锋锂业	308,523	16,527,577.11	5.09
6	002475	立讯精密	310,823	15,960,761.05	4.91
7	300037	新宙邦	248,600	13,687,916.00	4.21
8	002791	坚朗五金	124,943	11,755,886.87	3.62
9	603659	璞泰来	113,000	11,641,260.00	3.58
10	002850	科达利	156,900	10,857,480.00	3.34
11	000733	振华科技	482,000	10,840,180.00	3.34
12	601865	福莱特	557,167	10,474,739.60	3.22
13	600984	建设机械	419,600	10,406,080.00	3.20
14	300073	当升科技	297,600	9,841,632.00	3.03
15	600305	恒顺醋业	480,512	8,913,497.60	2.74
16	002709	天赐材料	250,200	8,454,258.00	2.60
17	001914	招商积余	229,500	7,052,535.00	2.17
18	603019	中科曙光	169,260	6,499,584.00	2.00
19	603179	新泉股份	285,400	6,461,456.00	1.99
20	600276	恒瑞医药	38,640	3,566,472.00	1.10
21	300015	爱尔眼科	73,450	3,191,402.50	0.98
22	002507	涪陵榨菜	84,800	3,053,648.00	0.94
23	300759	康龙化成	23,300	2,292,720.00	0.71
24	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
25	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.05

26	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
27	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.04
28	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
29	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
30	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
31	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
32	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
33	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
34	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
35	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
36	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
37	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
38	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
39	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	603019	中科曙光	32,552,114.23	11.27
2	603308	应流股份	22,728,689.82	7.87
3	601012	隆基股份	18,789,301.00	6.50
4	688066	航天宏图	17,767,847.94	6.15
5	002460	赣锋锂业	17,466,924.06	6.04
6	600438	通威股份	17,457,191.32	6.04
7	300750	宁德时代	17,326,699.08	6.00
8	603359	东珠生态	12,214,890.19	4.23
9	300037	新宙邦	10,820,046.48	3.74
10	000733	振华科技	10,461,633.24	3.62
11	603659	璞泰来	10,420,844.65	3.61
12	000876	新希望	10,126,249.00	3.50
13	300073	当升科技	8,724,987.00	3.02
14	002299	圣农发展	8,518,619.14	2.95
15	300763	锦浪科技	8,486,844.00	2.94
16	300017	网宿科技	8,174,070.11	2.83



17	601865	福莱特	8,062,388.43	2.79
18	002709	天赐材料	7,498,353.19	2.60
19	002415	海康威视	7,137,859.00	2.47
20	002507	涪陵榨菜	7,036,493.00	2.44
21	300709	精研科技	6,931,307.00	2.40
22	002600	领益智造	6,431,262.00	2.23
23	603179	新泉股份	6,203,107.77	2.15
24	300724	捷佳伟创	6,191,055.00	2.14
25	000156	华数传媒	6,097,725.66	2.11
26	600305	恒顺醋业	6,092,839.00	2.11
27	002798	帝欧家居	6,077,606.55	2.10
28	300088	长信科技	5,989,738.00	2.07
29	300465	高伟达	5,911,839.00	2.05

注：买入金额按买入成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603019	中科曙光	33,123,595.38	11.46
2	300348	长亮科技	25,642,106.41	8.87
3	002791	坚朗五金	21,340,464.50	7.39
4	600984	建设机械	20,901,457.09	7.23
5	600584	长电科技	19,214,909.05	6.65
6	688066	航天宏图	16,526,390.94	5.72
7	603496	恒为科技	15,858,418.85	5.49
8	300709	精研科技	14,254,165.12	4.93
9	002507	涪陵榨菜	14,034,160.88	4.86
10	603359	东珠生态	12,131,292.94	4.20
11	000876	新希望	11,684,855.44	4.04
12	600060	海信视像	11,510,884.50	3.98
13	002555	三七互娱	10,969,000.92	3.80
14	000002	万科 A	9,609,534.00	3.33
15	000977	浪潮信息	9,196,188.00	3.18
16	002624	完美世界	9,132,462.96	3.16
17	002299	圣农发展	8,957,490.03	3.10
18	603308	应流股份	8,636,174.00	2.99

19	300017	网宿科技	8,569,773.97	2.97
20	300747	锐科激光	8,392,821.50	2.90
21	600426	华鲁恒升	7,960,877.55	2.76
22	300572	安车检测	7,666,202.68	2.65
23	002212	南洋股份	7,595,465.00	2.63
24	300763	锦浪科技	7,080,636.00	2.45
25	002415	海康威视	6,894,509.00	2.39
26	300088	长信科技	6,661,093.00	2.31
27	300465	高伟达	6,596,793.00	2.28
28	300783	三只松鼠	6,415,746.00	2.22
29	002027	分众传媒	6,373,905.00	2.21
30	002600	领益智造	6,371,651.00	2.21
31	002798	帝欧家居	5,903,383.52	2.04

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	394,812,077.23
卖出股票收入（成交）总额	482,838,595.16

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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 市场中性策略执行情况

## 7.13 投资组合报告附注

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

2020 年 4 月 13 日，江西赣锋锂业股份有限公司因内幕信息知情人登记管理不规范问题（一是未对重大投资进行内幕信息知情人登记，二是内幕信息知情人登记不完整），违反了中国证监会《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，被中国证券监督管理委员会江西监管局采取了出具警示函的行政监管措施。

2020 年 2 月 5 日，深圳新宙邦科技股份有限公司因股权激励方案不合规以及股权激励相关信息披露不真实、不准确违反了《上市公司股权激励管理办法》，被深圳证券交易所采取了监管关注的行政监管措施（创业板监管函〔2020〕第 13 号）。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

其余八名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.13.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	82,808.96
2	应收证券清算款	77,199.43
3	应收股利	-
4	应收利息	10,223.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,232.07

**7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,647	21,606.19	518,989.36	0.21%	251,128,256.90	99.79%

### 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	41,074.52	0.0200%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年4月16日）基金份额总额	246,897,819.20
本报告期期初基金份额总额	246,897,819.20
本报告期基金总申购份额	4,749,427.06
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	251,647,246.26

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	293,890,602.17	33.64%	273,702.16	33.64%	-
中泰证券	2	136,375,274.49	15.61%	127,006.62	15.61%	-
东方证券	2	126,374,467.49	14.46%	117,692.30	14.46%	-
西藏东方财富证券	2	111,575,202.37	12.77%	103,909.51	12.77%	-
安信证券	2	105,572,186.90	12.08%	98,320.30	12.08%	-
银河证券	2	66,942,346.69	7.66%	62,343.35	7.66%	-
中信证券	2	25,187,135.29	2.88%	23,456.64	2.88%	-
国泰君安	2	7,191,380.10	0.82%	6,697.25	0.82%	-
西南证券	2	576,861.00	0.07%	537.24	0.07%	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	35,200,000.00	14.72%	-	-
东方证券	-	-	103,800,000.00	43.41%	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	100,100,000.00	41.87%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

### 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	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告	证券时报	2020年1月17日
2	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告的补充公告	证券时报	2020年1月18日



3	农银汇理海棠定开混合基金 2019 年第四季度报告	证券时报	2020 年 1 月 21 日
4	农银汇理基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证券时报	2020 年 3 月 13 日
5	农银汇理海棠定开混合基金 2019 年年度报告	证券时报	2020 年 4 月 14 日
6	农银汇理海棠定开混合基金 2020 年一季度报告	证券时报	2020 年 4 月 22 日
7	关于农银汇理基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	证券时报	2020 年 5 月 29 日
8	农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2020 年 6 月 1 日
9	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书-2020 年第 2 次	证券时报	2020 年 6 月 4 日
10	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书摘要-2020 年第 2 次	证券时报	2020 年 6 月 4 日
11	农银汇理海棠定开混合基金-招募说明书摘要-2020 年第 3 次	证券时报	2020 年 6 月 22 日
12	农银汇理海棠混合型证券投资基金分红公告	证券时报	2020 年 6 月 22 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、《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日