

# 农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
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.....	11
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金
基金简称	农银信息传媒股票
基金主代码	001319
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 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	370,942,896.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信息传媒主题相关的优质上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>信息传媒产业根据所提供的产品与服务类别不同，可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素，进行股票资产在信息传媒产业各细分子行业间的动态配置。</p> <p>（2）个股精选策略</p> <p>在细分子行业配置的基础上，本基金将定性研究方法和定量研究方法相结合，对信息传媒相关上市公司的投资价值进行综合评估，精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析，以有利于资产增值为原则，加强风险控制，谨慎参与投资。</p>

业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数×80%+中证全债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

### 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	010-66105799
	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	010-66105798
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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	83,180,967.61
本期利润	30,352,524.74
加权平均基金份额本期利润	0.0733
本期加权平均净值利润率	5.95%
本期基金份额净值增长率	4.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	128,715,978.33
期末可供分配基金份额利润	0.3470
期末基金资产净值	499,658,874.33
期末基金份额净值	1.3470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	34.70%

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

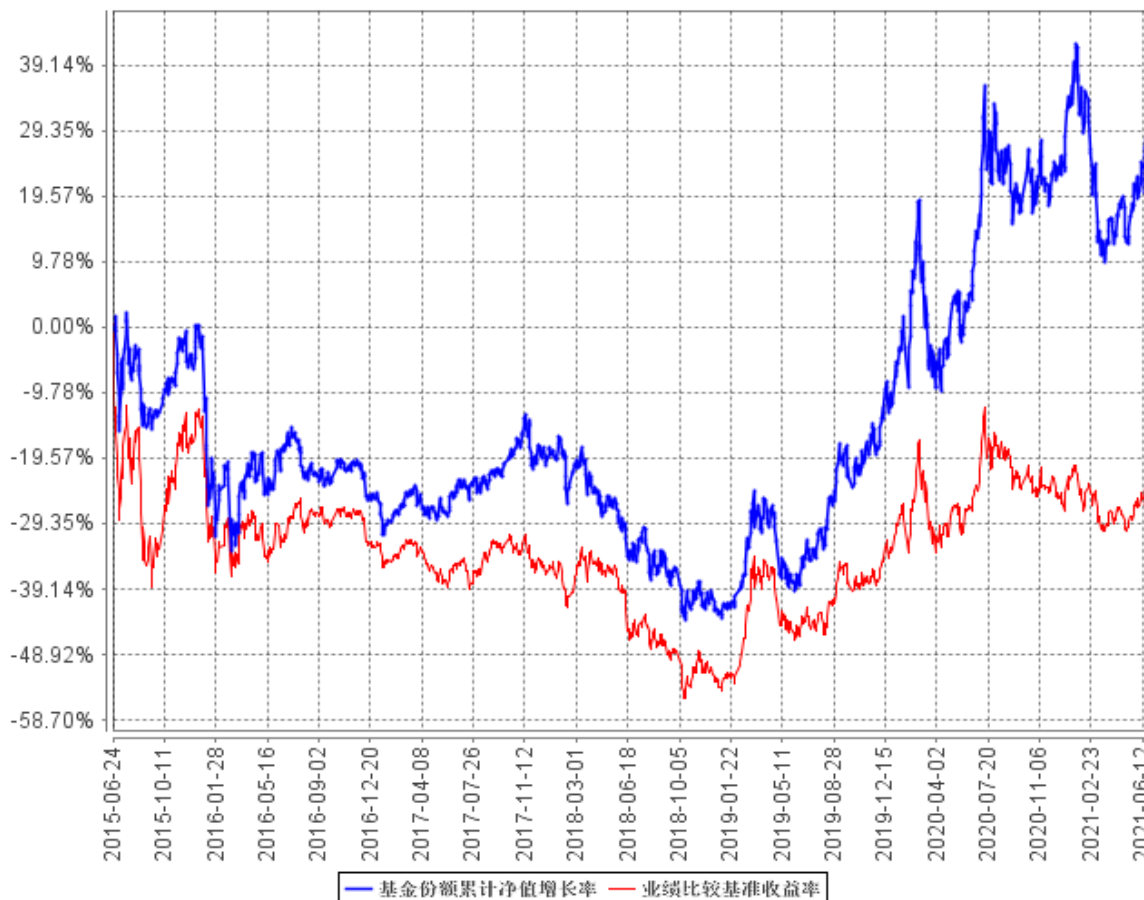
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.96%	1.84%	4.67%	1.07%	5.29%	0.77%
过去三个月	19.63%	1.47%	9.59%	0.93%	10.04%	0.54%
过去六个月	4.88%	1.70%	3.02%	1.06%	1.86%	0.64%
过去一年	15.22%	1.73%	0.78%	1.21%	14.44%	0.52%
过去三年	98.88%	1.81%	39.47%	1.49%	59.41%	0.32%
自基金合同生效起至今	34.70%	1.67%	-22.34%	1.59%	57.04%	0.08%



### 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



本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的信息传媒产业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金建仓期为基金合同生效日（2015 年 6 月 24 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩林	本基金基金经理	2017 年 3 月 21 日	-	11	理学硕士，具有基金从业资格。历任兴业证券研究所电子行业研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员及基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

注：谷超先生于 2021 年 7 月 15 日起担任本基金基金经理，韩林先生于 2021 年 7 月 21 日离任本基金基金经理，上述基金经理变更情况基金管理人已在指定媒体及公司网站进行了公告。

#### 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。

#### 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 季度之初，疫苗落地预期之下全球经济或继续修复，国内实体企业盈利预计持续改善，基数影响下 21 年全 A 非金融盈利修复，增速前高后低，1 季度或为全年盈利增速高峰值。在盈利高增预期且流动性尚未见到进一步收紧前提下，具备了春季躁动可能性，1 月中上旬市场快速上涨。行业方面，化工、银行、电气设备、有色金属、轻工等大幅上涨，而军工、商业贸易、纺织服装、通信、非银等有所下跌。新能源车行业景气度仍在高位维持，产业链企业开工率饱满、多环节产品出现涨价现象，使得板块在 1 月上旬表现突出，但高估值制约了板块后续表现，类似的阶段性景气较高的军工板块也在中下旬表现不佳。有关机构抱团的话题被市场广泛讨论，行业景气改善且估值、前期涨幅仍在较低位置的化工、银行、有色等顺周期行业关注度逐级提升。这一过程中，货币政策与市场流动性的变化也对市场的风险偏好及行业偏好起到了重要作用，临近月末，央行为防止房地产行业风险等采取的流动性收紧动作带来了市场的大幅波动。我们判断国内及海外经济或继续修复，国内实体企业盈利预计持续改善，业绩层面无须悲观。我们在操作上小幅降低了整体仓位，减持了部分绝对估值水平较高的云计算板块个股，但持仓中白马成长股回撤仍较为明显。

2 月市场波动急剧放大，地产、钢铁、农业、休闲服务、有色、采掘等大幅上涨，而电气设备、汽车、食品饮料、传媒、电子、计算机等有所下跌。宏观预期和大宗商品走势对 2 月市场的结构性变化产生了较大的影响，美债利率飙升、周期品价格大涨、国内央行在春节前后低于预期的流动性释放等因素，阶段性地冲击了市场的风险偏好及交易结构。从结果上看，通胀交易占据主流，核心资产（或被认为机构抱团的品种）出现较大幅度下跌。我们判断，国际定价的大宗商品受益于海外疫情好转与需求复苏预期，供给端的修复尚未匹配，价格预期维持在较高水平，相关周期板块龙头前期涨幅较大后波动或加剧；国内定价的周期品行业，在碳中和政策延伸至供给侧改革影响预期放大，相关周期板块有望补涨，但实际需求仍需要观察。我们前期配置的新能源、TMT 等行业景气程度未见显著下滑，但其前期积累的估值溢价还需要一个消化的过程，需要等待其进入合理估值区间。我们在操作上维持了现有整体仓位，但降低了部分估值偏高的白马股配置

比例，调降了组合整体估值水平。

3 月中上旬市场结构上延续了上月以来的通胀交易占据主流、核心资产出现较大幅度下跌的状况，而下旬市场稍有企稳。增量逻辑主要为 3 月适逢两会期间，政策预期升温，碳中和碳达峰成为重要主题线索，电力、环保等与降排直接相关板块及部分或在供给端受益的钢铁等行业大幅上涨，主题较快扩散。我们判断更类似借碳中和之名，进行高低估值板块切换，证据为更直接受益的新能源行业并未有正向表现，更多的低估、滞涨板块表现更优。我们认为在前期核心资产下跌过程中，相对悲观的逻辑的得到了充分演绎。宏观经济层面，市场对中美经济预期悲观，如担忧美债利率快速上行，担心国内经济增长 Q1 见顶，我们认为本轮中国经济的主要动能来自出口和制造业投资，在全球疫情恢复的地区之间速度差异，中国经济增速或具备较强韧性。流动性层面，虽然“不急转弯”的提法不再，但考虑内外部环境较为复杂等因素，货币政策或定调温和，我们将持续观察。在前期市场估值压力部分释放后，短期具备了借助年报、季报乐观数据出现市场企稳反弹的基础。

2 季度之初市场迎来明显反弹。医药、有色、钢铁、电气设备、电子、食品饮料等大幅上涨，而公用事业、建筑、军工、通信、非银等有所下跌。在 4 月下旬以来，以黑色系为代表的工业品价格再次拉升，通胀预期“二次发酵”。5 月初公布 4 月的中美通胀超预期后，全球投资者对通胀的一致预期基本达到顶峰，通胀问题已经成为“众人皆知”的风险。我们认为商品价格或继续强势，但通胀担忧已阶段性见顶。在国内政策密集出台约束商品价格快速上行的背景下，商品价格阶段性走弱的信号有所显现。在严峻的疫情形势背景下，及经济达到更高均衡的要求下，货币政策或将边际放松。430 政治局会议政策基调要“稳中求进”，货币政策端预期温和，护航经济修复。我们基于对通胀预期和流动性的判断，逐步增加了总体仓位。半导体等子版块景气上行趋势明确，我们增加了相关板块的配置水平。

5 月市场延续反弹。行业方面，军工、食品饮料、有色金属、计算机、电气设备等大幅上涨，而农林牧渔、家电、钢铁有所下跌。结构上符合我们此前关于通胀担忧已阶段性见顶的预期，市场呈现明显的“逆通胀交易”。过去一个月，高估值资产经历了基本面、政策、海外流动性环境上的顺风，值得注意的是，部分资产估值和盈利间的矛盾已经重回 2 月初时的水平。但需要观察这一有利组合边际上是否在发生变化，外部核心矛盾来美联储的流动性预期；内部矛盾来自流动性的变化方向，4、5 月银行间流动性超预期宽松，6 月面临季节性紧张和重要事件前维稳需求的组合，我们将重点关注其变化方向。在流动性维持相对宽松的环境下，我们维持了此前对于市场和板块结构的判断，并赋予业绩成长性更高权重进行个股选择，加大了半导体设计、半导体设备、智能驾驶与人工智能等部分高景气板块中高成长性个股的配置，降低了电子板块中部分偏周期性

个股的配置。

2 季度末市场指数层面产生分化，结构上延续了“逆通胀交易”的特征。行业方面，电气设备、电子、汽车、化工等大幅上涨，而休闲服务、房地产、建筑材料、家电、银行等有所下跌。6 月全球资产表现，也出现了通胀预期下行、成长大幅跑赢的特征，原油以外的大宗商品普遍回落，长端美债下行，美元有所走强，期间纳斯达克指数再创新高。我们预期美国经济增长继续修复、通胀预期边际缓解、政策持续宽松的组合或能延续一段时间。国内方面，我们对中期宏观环境的预期从乐观转向中性。6 月 PMI、发电耗煤、5 月工业企业利润数据等显示中国经济动能减弱但韧性尚存。流动性前期的超预期宽松是否延续存在不确定性。伴随 2 季度市场的大幅反弹，结构性行情中部分板块积累涨幅较高、性价比有所下降，资金博弈有所加剧。在宏观层面未发生显著变化前，我们维持结构性行情的判断，但市场波动或将放大。

#### 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 1.3470 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.88%，业绩比较基准收益率为 3.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，随着国内疫苗逐渐开始接种，虽然有偶发的新冠肺炎感染病例，但国内的经济发展基本恢复正常。全球来看，主要发达国家的疫苗接种率也在提升，经济活动也开始缓慢恢复。预计未来全球疫情将逐渐进入常态化阶段，疫情带来的边际影响有望逐渐减弱。由于国内疫情控制相对较好，中国企业的生产经营活动受到影响相对较小，在全球竞争中拥有的优势越来越明显。

科技创新是社会生产力提升的核心驱动力，参考美股经验，过去十年美国大牛市中，科技公司贡献巨大，纳斯达克指数涨幅远超标普 500，这主要是因为科技创新带来社会生产力的巨大提升。过去十年中，美国五家科技巨头 Facebook、Apple、Amazon、Microsoft、Google 超额收益显著，其合计市值占标普 500 的比重持续提升，贡献了纳斯达克 100 指数超过一半的涨幅。但这五家公司估值扩张并不明显，大部分涨幅来自于盈利贡献，说明投资者的回报主要来自企业内生价值的成长。

随着近年来中国科技产业的快速发展，国内科技企业在全球市场面临的竞争压力也越来越大，甚至在很多领域会遇到非市场竞争因素带来的困难。虽然在某些关键的技术领域，我们在技术上距离国际先进水平还有不少差距；但在很多领域如人工智能、信息科技、高端装备制造、新能源等行业，我们在迅速追赶甚至在部分领域已经实现了反超。

长期来看，因为我国一方面有社会主义制度优势和工程师红利，另一方面还拥有一个巨大的

内需市场，完全有条件构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新格局。在这种格局中，其他国家在技术和市场方面对我们的封锁终将失败；未来中国必将涌现出一批在全球都具备核心竞争力的优质科技企业，它们会通过持续创新与强大品牌来构建深深的护城河，它们的内生价值会持续增加。

市场短期是投票器，长期是称重机。即便是优质企业，其股价也会因为宏观经济、行业政策、货币流动性等因素而产生短期波动，但只要企业的内在价值在持续提升，我们相信其股价终将回归。未来我们将竭尽全力去挖掘这些优质企业的投资机会，力争为持有人创造最大的价值回报。

#### 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**

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，本基金托管人在对农银汇理信息传媒主题股票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，农银汇理信息传媒主题股票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信息传媒主题股票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信息传媒主题股票型证券投资基金 2021 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：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	36,163,997.32	63,830,862.43
结算备付金		3,345,041.92	2,080,650.91
存出保证金		183,882.35	327,444.82
交易性金融资产	6.4.7.2	460,400,769.73	663,201,759.58
其中：股票投资		460,400,769.73	663,201,759.58
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	-	-
应收证券清算款		6,051,486.68	1,977,107.70
应收利息	6.4.7.5	4,612.88	7,559.05
应收股利		-	-
应收申购款		122,759.12	111,243.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		506,272,550.00	731,536,627.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,426,780.86
应付赎回款		5,180,662.17	7,360,874.95
应付管理人报酬		588,482.40	921,596.49
应付托管费		98,080.36	153,599.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	648,027.26	1,182,555.32
应交税费		-	0.10

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,423.48	224,759.00
负债合计		6,613,675.67	15,270,166.13
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	370,942,896.00	557,717,253.58
未分配利润	6.4.7.10	128,715,978.33	158,549,207.98
所有者权益合计		499,658,874.33	716,266,461.56
负债和所有者权益总计		506,272,550.00	731,536,627.69

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3470 元，基金份额总额 370,942,896.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		37,369,790.66	439,720,373.82
1.利息收入		214,957.17	499,554.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	97,644.45	489,141.90
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		117,312.72	10,412.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		89,757,232.40	389,074,539.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	88,361,878.47	385,256,520.85
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	1,395,353.93	3,818,018.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-52,828,442.87	49,357,206.43
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	226,043.96	789,074.00
<b>减：二、费用</b>		7,017,265.92	20,863,323.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,811,812.48	10,516,599.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	635,302.03	1,752,766.51

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,450,949.92	8,453,188.62
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	119,201.49	140,768.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,352,524.74	418,857,050.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,352,524.74	418,857,050.82

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	557,717,253.58	158,549,207.98	716,266,461.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,352,524.74	30,352,524.74
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）	-186,774,357.58	-60,185,754.39	-246,960,111.97
其中：1.基金申购款	33,982,864.20	8,936,304.52	42,919,168.72
2.基金赎回款	-220,757,221.78	-69,122,058.91	-289,879,280.69
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）	370,942,896.00	128,715,978.33	499,658,874.33
项目	上年度可比期间 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)	1,859,659,923.18	-207,103,874.14	1,652,556,049.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	418,857,050.82	418,857,050.82
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)	-837,239,884.04	-38,811,720.66	-876,051,604.70
其中：1.基金申购款	199,413,769.51	9,100,282.04	208,514,051.55
2.基金赎回款	-1,036,653,653.55	-47,912,002.70	-1,084,565,656.25
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)	1,022,420,039.14	172,941,456.02	1,195,361,495.16

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：

\_\_\_\_\_  
许金超  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
毕宏燕  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
丁煜琼  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金(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[2015]第 785 号《关于准予农银汇理信息传媒主题股票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《农银汇理信息传媒主题股票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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,568,289,201.53 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(2015)第 514 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,569,455,478.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,166,276.92 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理信息传媒主题股票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，包括国内依法发行或上市的股票(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、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、资产支持证券等)、货币市场工具(包括短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等)、权证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。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的信息传媒产业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数×80%+中证全债指数×20%。

#### 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》、《农银汇理信息传媒股票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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 2021年6月30日
活期存款	36,163,997.32
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：	36,163,997.32

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	346,376,465.95	460,400,769.73	114,024,303.78
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	346,376,465.95	460,400,769.73	114,024,303.78

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。



#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,183.77
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	1,354.68
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	74.43
合计	4,612.88

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	648,027.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	648,027.26

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,212.05
应付证券出借违约金	-
预提费用	95,211.43
合计	98,423.48

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	557,717,253.58	557,717,253.58
本期申购	33,982,864.20	33,982,864.20
本期赎回(以“-”号填列)	-220,757,221.78	-220,757,221.78
- 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	370,942,896.00	370,942,896.00

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	239,535,148.66	-80,985,940.68	158,549,207.98
本期利润	83,180,967.61	-52,828,442.87	30,352,524.74
本期基金份额交易产生的变动数	-94,097,182.74	33,911,428.35	-60,185,754.39
其中：基金申购款	18,407,558.56	-9,471,254.04	8,936,304.52
基金赎回款	-112,504,741.30	43,382,682.39	-69,122,058.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	228,618,933.53	-99,902,955.20	128,715,978.33

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	79,458.15
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	16,219.53
其他	1,966.77
合计	97,644.45

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	900,615,618.71
减：卖出股票成本总额	812,253,740.24
买卖股票差价收入	88,361,878.47

#### 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

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,395,353.93
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	1,395,353.93

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-52,828,442.87
——股票投资	-52,828,442.87
——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	-52,828,442.87

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	207,109.99
转换费	18,933.97
合计	226,043.96

注：1. 本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,450,949.92
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	2,450,949.92

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	35,704.06
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户服务费	9,084.42
清算所账户服务费	9,000.00
银行汇划费	5,905.64
合计	119,201.49

## 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

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,811,812.48	10,516,599.37
其中：支付销售机构的客户维护费	1,882,870.19	5,751,334.23

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：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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	635,302.03	1,752,766.51

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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

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

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	36,163,997.32	79,458.15	91,761,931.69	452,836.49

注：本基金的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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票
----------------------



证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	科创板锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	科创板锁定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	创业板锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

			日							
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	公告重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	235,600	7,672,392.04	13,276,060.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放于本基金的托管银行—工商银行，本基金认为与工商银行相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，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

本基金本报告期末及上年度未持有长期信用评级债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此均能及时变现。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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，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模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

“本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注“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、以及组合在短期内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。”

### 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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,163,997.32	-	-	-	36,163,997.32
结算备付金	3,345,041.92	-	-	-	3,345,041.92
存出保证金	183,882.35	-	-	-	183,882.35
交易性金融资产	-	-	-	460,400,769.73	460,400,769.73
应收证券清算款	-	-	-	6,051,486.68	6,051,486.68
应收利息	-	-	-	4,612.88	4,612.88
应收申购款	-	-	-	122,759.12	122,759.12
资产总计	39,692,921.59	-	-	466,579,628.41	506,272,550.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,180,662.17	5,180,662.17
应付管理人报酬	-	-	-	588,482.40	588,482.40
应付托管费	-	-	-	98,080.36	98,080.36
应付交易费用	-	-	-	648,027.26	648,027.26
其他负债	-	-	-	98,423.48	98,423.48
负债总计	-	-	-	6,613,675.67	6,613,675.67
利率敏感度缺口	39,692,921.59	-	-	459,965,952.74	499,658,874.33
上年度末 2020年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	63,830,862.43	-	-	-	63,830,862.43
结算备付金	2,080,650.91	-	-	-	2,080,650.91
存出保证金	327,444.82	-	-	-	327,444.82
交易性金融资产	-	-	-	663,201,759.58	663,201,759.58
应收证券清算款	-	-	-	1,977,107.70	1,977,107.70
应收利息	-	-	-	7,559.05	7,559.05

应收申购款	-	-	-	111,243.20	111,243.20
资产总计	66,238,958.16	-	-	665,297,669.53	731,536,627.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,426,780.86	5,426,780.86
应付赎回款	-	-	-	7,360,874.95	7,360,874.95
应付管理人报酬	-	-	-	921,596.49	921,596.49
应付托管费	-	-	-	153,599.41	153,599.41
应付交易费用	-	-	-	1,182,555.32	1,182,555.32
应交税费	-	-	-	0.10	0.10
其他负债	-	-	-	224,759.00	224,759.00
负债总计	-	-	-	15,270,166.13	15,270,166.13
利率敏感度缺口	66,238,958.16	-	-	-650,027,503.40	716,266,461.56

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

假设	收益率曲线平行变化		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-	-
	市场利率平行下降25个基点	-	-

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，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

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场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交易的股票，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，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	460,400,769.73	92.14	663,201,759.58	92.59
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	460,400,769.73	92.14	663,201,759.58	92.59

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 5%	31,945,901.10
	业绩比较基准下降 5%	-31,945,901.10	-43,462,518.54

本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	460,400,769.73	90.94
	其中：股票	460,400,769.73	90.94
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	39,509,039.24	7.80
8	其他各项资产	6,362,741.03	1.26
9	合计	506,272,550.00	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	342,021,028.84	68.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	49,173.00	0.01
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	107,945,528.59	21.60
J	金融业	7,886,614.50	1.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,473,107.97	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,282.00	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	460,400,769.73	92.14

### 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	300782	卓胜微	51,380	27,616,750.00	5.53
2	603986	兆易创新	138,380	26,001,602.00	5.20
3	300496	中科创达	158,000	24,815,480.00	4.97
4	002371	北方华创	88,200	24,464,916.00	4.90
5	603501	韦尔股份	62,400	20,092,800.00	4.02
6	002230	科大讯飞	273,300	18,469,614.00	3.70
7	002049	紫光国微	115,300	17,778,107.00	3.56
8	300327	中颖电子	194,600	16,585,758.00	3.32
9	688111	金山办公	38,180	15,073,464.00	3.02
10	300014	亿纬锂能	140,376	14,589,277.68	2.92
11	600460	士兰微	235,600	13,276,060.00	2.66
12	002475	立讯精密	252,721	11,625,166.00	2.33
13	600563	法拉电子	67,400	10,673,464.00	2.14
14	300638	广和通	226,230	10,564,941.00	2.11
15	002241	歌尔股份	241,900	10,338,806.00	2.07
16	688037	芯源微	68,249	10,169,101.00	2.04
17	603444	吉比特	18,500	9,805,000.00	1.96
18	688036	传音控股	46,510	9,743,845.00	1.95
19	688200	华峰测控	16,950	8,022,943.50	1.61
20	002415	海康威视	122,380	7,893,510.00	1.58
21	300059	东方财富	239,460	7,851,893.40	1.57
22	600570	恒生电子	82,886	7,729,119.50	1.55
23	600703	三安光电	235,600	7,550,980.00	1.51
24	002402	和而泰	311,400	7,464,258.00	1.49
25	688099	晶晨股份	52,589	5,900,485.80	1.18

26	603290	斯达半导	18,000	5,760,000.00	1.15
27	603738	泰晶科技	157,600	5,440,352.00	1.09
28	600884	杉杉股份	222,800	5,195,696.00	1.04
29	688007	光峰科技	123,730	5,181,812.40	1.04
30	688018	乐鑫科技	22,114	5,161,849.88	1.03
31	300628	亿联网络	60,150	5,040,570.00	1.01
32	600845	宝信软件	98,420	5,009,578.00	1.00
33	300207	欣旺达	152,900	4,978,424.00	1.00
34	002409	雅克科技	60,961	4,937,841.00	0.99
35	002185	华天科技	320,700	4,935,573.00	0.99
36	600745	闻泰科技	50,600	4,903,140.00	0.98
37	603893	瑞芯微	34,300	4,783,478.00	0.96
38	688208	道通科技	52,624	4,577,761.76	0.92
39	300682	朗新科技	252,200	4,242,004.00	0.85
40	002152	广电运通	292,000	3,804,760.00	0.76
41	003021	兆威机电	54,440	3,325,195.20	0.67
42	688608	恒玄科技	8,831	2,798,632.21	0.56
43	002027	分众传媒	262,817	2,473,107.97	0.49
44	603068	博通集成	29,900	2,460,770.00	0.49
45	300624	万兴科技	41,800	2,448,644.00	0.49
46	603613	国联股份	24,080	2,407,277.60	0.48
47	300223	北京君正	23,800	2,401,896.00	0.48
48	000988	华工科技	101,900	2,396,688.00	0.48
49	300582	英飞特	102,200	2,385,348.00	0.48
50	300433	蓝思科技	80,000	2,352,800.00	0.47
51	688288	鸿泉物联	49,263	2,344,426.17	0.47
52	300115	长盈精密	112,700	2,321,620.00	0.46
53	300378	鼎捷软件	107,100	2,299,437.00	0.46
54	000997	新大陆	138,300	2,294,397.00	0.46
55	002410	广联达	33,268	2,268,877.60	0.45
56	002129	中环股份	41,000	1,582,600.00	0.32
57	600171	上海贝岭	42,700	1,299,361.00	0.26
58	688383	新益昌	8,848	1,247,656.48	0.25
59	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.06
60	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.05
61	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.04
62	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
63	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
64	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01

65	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
66	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
67	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
68	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
69	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
70	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
71	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
74	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
75	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
76	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
77	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
78	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
79	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
80	000888	峨眉山 A	200	1,282.00	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	002371	北方华创	31,004,931.82	4.33
2	603986	兆易创新	19,761,542.59	2.76
3	002049	紫光国微	19,553,977.62	2.73
4	002241	歌尔股份	16,922,067.18	2.36
5	002230	科大讯飞	14,939,164.12	2.09
6	688036	传音控股	14,309,252.68	2.00
7	002415	海康威视	14,053,719.00	1.96
8	300253	卫宁健康	10,759,200.00	1.50
9	600460	士兰微	10,522,487.00	1.47
10	002409	雅克科技	9,618,722.98	1.34
11	688200	华峰测控	9,342,204.81	1.30
12	000636	风华高科	9,267,213.00	1.29
13	603444	吉比特	9,244,558.00	1.29
14	300059	东方财富	9,166,122.08	1.28

15	603186	华正新材	9,138,188.33	1.28
16	600745	闻泰科技	8,966,853.87	1.25
17	600703	三安光电	8,919,260.60	1.25
18	600563	法拉电子	8,857,038.00	1.24
19	300408	三环集团	8,775,689.03	1.23
20	002402	和而泰	8,751,994.97	1.22

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002027	分众传媒	41,552,804.80	5.80
2	000725	京东方 A	33,312,660.00	4.65
3	002475	立讯精密	31,550,665.14	4.40
4	300014	亿纬锂能	30,521,157.13	4.26
5	002410	广联达	26,484,337.57	3.70
6	600570	恒生电子	23,958,888.73	3.34
7	000066	中国长城	20,668,253.50	2.89
8	688002	睿创微纳	20,144,069.47	2.81
9	600588	用友网络	20,112,671.67	2.81
10	300059	东方财富	19,033,940.51	2.66
11	688111	金山办公	18,804,726.09	2.63
12	688396	华润微	18,354,658.51	2.56
13	300408	三环集团	18,116,688.89	2.53
14	688036	传音控股	18,060,493.81	2.52
15	002409	雅克科技	15,921,922.24	2.22
16	300413	芒果超媒	15,431,107.72	2.15
17	603501	韦尔股份	15,236,736.65	2.13
18	600703	三安光电	14,360,847.26	2.00
19	300454	深信服	13,589,457.98	1.90
20	002241	歌尔股份	13,017,741.23	1.82

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	662,281,193.26
卖出股票收入（成交）总额	900,615,618.71

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 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	183,882.35
2	应收证券清算款	6,051,486.68
3	应收股利	-
4	应收利息	4,612.88
5	应收申购款	122,759.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,362,741.03

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
17,497	21,200.37	592,921.38	0.16%	370,349,974.62	99.84%

### 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	116.31	-

### 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（2015年6月24日）基金份额总额	4,569,455,478.45
本报告期期初基金份额总额	557,717,253.58
本报告期基金总申购份额	33,982,864.20
减：本报告期基金总赎回份额	220,757,221.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	370,942,896.00

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

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）董事会有关决议，原本公司副总经理 Céline Zhang（张晴）女士自 2021 年 4 月 29 日离任本公司副总经理职务；毕宏燕女士自 2021 年 6 月 17 日任职本公司副总经理职位。本公司已分别于 2021 年 4 月 30 日、2021 年 6 月 18 日在指定媒体以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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	
西藏东方财富证券	2	331,123,296.45	21.22%	308,375.61	21.95%	-
安信证券	2	301,429,121.87	19.32%	280,719.42	19.98%	-
银河证券	2	221,690,404.02	14.21%	206,460.79	14.69%	-
长江证券	2	170,375,032.53	10.92%	158,668.33	11.29%	-
兴业证券	2	133,121,901.33	8.53%	123,978.81	8.82%	-

东吴证券	2	106,480,957.08	6.83%	77,869.91	5.54%	-
海通证券	2	74,554,292.92	4.78%	54,521.23	3.88%	-
国泰君安	2	49,203,670.96	3.15%	45,822.22	3.26%	-
东方证券	2	44,659,408.57	2.86%	41,590.48	2.96%	-
中信证券	2	32,837,493.47	2.10%	30,581.48	2.18%	-
中信建投	2	29,034,343.98	1.86%	21,232.16	1.51%	-
天风证券	2	28,924,010.40	1.85%	21,152.17	1.51%	-
中泰证券	2	20,302,333.10	1.30%	18,907.64	1.35%	-
申万宏源	2	16,416,208.00	1.05%	15,288.05	1.09%	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元,与同一托管行托管的基金公用原有交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	66,100,000.00	5.42%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	542,000,000.00	44.41%	-	-
兴业证券	-	-	13,800,000.00	1.13%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	45,600,000.00	3.74%	-	-
国泰君安	-	-	68,100,000.00	5.58%	-	-
东方证券	-	-	92,100,000.00	7.55%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	323,600,000.00	26.51%	-	-
中泰证券	-	-	46,100,000.00	3.78%	-	-
申万宏源	-	-	23,100,000.00	1.89%	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	农银汇理信息传媒股票基金 2020 年四季度报告	证券日报、基金管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	农银汇理信息传媒股票基金 2020 年年度报告	证券日报、基金管理人网站	2021 年 3 月 29 日
3	农银汇理信息传媒股票基金 2021 年一季度报告	证券日报、基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
4	农银汇理信息传媒股票基金招募说明书更新	证券日报、基金管理人网站	2021 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

### 12.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日