

农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资
基金
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	农银瑞丰 6 个月持有混合
基金主代码	014576
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 22 日
报告期末基金份额总额	106,937,034.55 份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，力争控制基金的回撤水平，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票。本基金旨在追求绝对回报，注重风险控制，通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险，运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20% + 中证全债指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	595,151.67

2. 本期利润	-1,178,804.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0107
4. 期末基金资产净值	102,959,698.04
5. 期末基金份额净值	0.9628

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

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

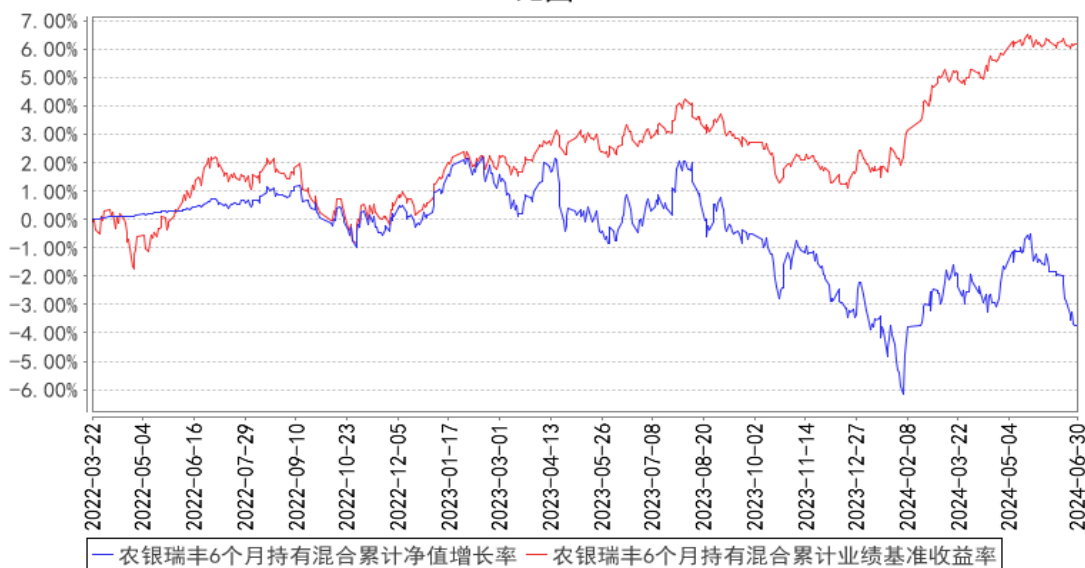
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.18%	0.30%	1.13%	0.14%	-2.31%	0.16%
过去六个月	-1.54%	0.36%	3.70%	0.17%	-5.24%	0.19%
过去一年	-3.80%	0.33%	3.22%	0.17%	-7.02%	0.16%
自基金合同 生效起至今	-3.72%	0.26%	6.21%	0.19%	-9.93%	0.07%

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

农银瑞丰6个月持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-30%，同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约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不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为合同生效日（2022 年 3 月 22 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
史向明	本基金的基金经理、公司投资副总监	2022 年 3 月 22 日	-	23 年	理学硕士，具有基金从业资格。历任中国银河证券公司上海总部债券研究员、天治基金管理公司债券研究员及基金经理、上投摩根基金管理公司固定收益部投资经理。现任农银汇理基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额

持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度在经济基本面趋势未改、债券供给放量未有冲击，流动性维持均衡宽松的延续下，债券市场整体走强。4 月上旬债市维持窄幅震荡格局，下旬围绕政府债供给、货币政策预期、欠配压力、以及央行对长债收益率表态等因素，10Y 国债利率在突破 2.3% 后迎来急跌，月末回暖。5 月债市多空交织，市场担忧的利空因素在五月逐步落地，地产方面集中出台了一系列地产新政，包括取消全国层面房贷利率政策下限、下调房贷首付款比例和公积金贷款利率、拟设立保障性住房再贷款等，一线城市楼市政策持续松绑，供给方面财政部明确特别国债发行计划，资金面宽松，长端利率窄幅震荡，收益率曲线有所陡峭化。6 月受非银资金持续充裕，宏观数据有所回落以及股债跷跷板效应下，债市再度走强。相较一季度末，1 年期国债、国开债收益率二季度分别下行 18bp 和 15bp，10 年期国债、国开债分别下行 8bp 和 12bp，1 年、3 年和 5 年 AAA 信用债利率分别下行 31bp、37bp 和 36bp。二季度中债总指数上涨 1.77%，中债企业债总指数上涨 1.82%，中债综合指数上涨 1.76%，中证转债指数上涨 0.75%，申万 A 股指数下跌 6.63%。

本基金债券持仓以中高评级信用债为主，二季度主要操作主要集中在可转债，可转债方面适度止盈一季度增持的可转债资产，权益方面不断调整持仓结构以期更加均衡。本基金可转债投资及股票投资均以绝对收益为目标，力图做好均衡配置和控制好回撤，注重收益与风险的平衡。

经济基本面和资金欠配压力对债市的支撑逻辑依旧延续，货币政策保持支持性，债市利率上行动力不足，非银资金充裕，利率下行仍然有诉求，整体看目前有利债市的大环境仍在，但随着利率逐步创出新低，资本利得的博弈空间愈加有限，供给预计将逐步放量，叠加央行面向一级交易商开展国债借入的操作，谨慎情绪也随之积累。当前市场处于资产荒与周期底修复的博弈状态，

三季度随着稳增长措施逐步落地以及债券供给增加，预计后市可能出现收益下行空间有限而震荡加剧的格局，且不排除收益率负向波动的可能。基金现阶段债券投资拟保持较低久期，持续关注地产数据变化、政策的持续和延展对于推动经济的实际效果，并根据市场变化调整组合久期和杠杆。权益方面，市场下跌空间有限，不应忽视决策层稳增长的决心和力度，基金将继续坚持绝对收益为目标，把握好权益资产和可转债资产的投资机会，努力为投资者提供稳定的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9628 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.18%，业绩比较基准收益率为 1.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	29,016,956.76	24.41
	其中：股票	29,016,956.76	24.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	88,165,405.48	74.17
	其中：债券	88,165,405.48	74.17
	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	1,653,236.13	1.39
8	其他资产	29,304.49	0.02
9	合计	118,864,902.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	293,220.00	0.28
C	制造业	17,371,978.76	16.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	124,820.00	0.12
E	建筑业	17,140.00	0.02
F	批发和零售业	248,140.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	3,715,310.00	3.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	154,595.00	0.15
J	金融业	4,428,115.00	4.30
K	房地产业	1,807,950.00	1.76
L	租赁和商务服务业	12,498.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	813,170.00	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	13,960.00	0.01
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	16,060.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	29,016,956.76	28.18

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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	000776	广发证券	98,000	1,192,660.00	1.16
2	002594	比亚迪	4,000	1,001,000.00	0.97
3	601166	兴业银行	54,000	951,480.00	0.92
4	002850	科达利	11,500	878,370.00	0.85
5	601628	中国人寿	26,500	822,825.00	0.80
6	600030	中信证券	41,000	747,430.00	0.73
7	601021	春秋航空	13,000	732,290.00	0.71
8	002415	海康威视	23,000	710,930.00	0.69
9	600426	华鲁恒升	26,500	705,960.00	0.69
10	600048	保利发展	80,000	700,800.00	0.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,281,198.36	5.13

2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,582,885.24	19.99
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,932,974.52	48.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,368,347.36	12.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	88,165,405.48	85.63

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1928025	19 交通银行永续债	100,000	10,375,639.34	10.08
2	2120116	21 南京银行 01	100,000	10,207,245.90	9.91
3	185010	21 海通 11	100,000	10,193,674.52	9.90
4	149849	22 国信 04	100,000	10,153,089.86	9.86
5	185269	22 兴业 01	100,000	10,128,232.88	9.84

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2023 年 8 月 22 日，广发证券股份有限公司因未按照规定履行客户身份识别义务；未按规定报送可疑交易报告，被中国人民银行广东省分行罚款人民币 486 万元。

2023 年 9 月 7 日，广发证券股份有限公司因对美尚生态景观股份有限公司出具的保荐书等文件存在虚假记载，在担任保荐(主承销)机构期间未勤勉尽责，被中国证监会责令改正，给予警告，没收保荐业务收入 943,396.23 元，并处以 943,396.23 元罚款；没收承销股票违法所得 7,830,188.52 元，并处以 50 万元罚款。

2024 年 3 月 22 日，广发证券股份有限公司因内部研究报告撰写不规范，未体现出在充分研究基础上理性报价；询价流程不规范，相关内部控制存在缺失，被上海证券交易所予以监管警示。

2023 年 8 月 8 日，交通银行股份有限公司因贷后管理不到位严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会商丘监管分局处以罚款 25 万元。

2024 年 6 月 3 日，交通银行股份有限公司因安全测试存在薄弱环节，运行管理存在漏洞，数据安全不足，灾备管理不足，被国家金融监督管理总局罚款 160 万元。

2023 年 8 月 25 日，南京银行股份有限公司因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇登记管理规定，被国家外汇管理局江苏分局给予警告并罚款人民币 60 万元。

2023 年 11 月 7 日，海通证券股份有限公司因在保荐江苏沃得农业机械股份有限公司（以下简称发行人）首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责履行相关职责，未及时向深圳证券交易所报告和披露发行人实际控制人股份冻结情况，未发现发行人会计基础薄弱、内部控制不完善、资金拆借信息披露不完整等情况，未经中国证监会或者深圳证券交易所同意改动招股说明书，被中国证监会采取出具警示函监管措施。

2023 年 11 月 17 日，海通证券因作为湖北超卓航空科技股份有限公司（以下简称超卓航科）保

荐机构之一,在开展募集资金核查时,发现超卓航科全资子公司上海超卓金属材料有限公司存放于招商银行股份有限公司南京城北支行账户中的资金使用情况披露不真实、银行存款处于冻结状态,未及时开展有效的调查和监督;2023 年 8 月 31 日,公司出具《2023 年度持续督导半年度跟踪报告》,称超卓航科持续督导期间信息披露和募集资金管理使用均不存在违规事项,未能真实、准确反映超卓航科募集资金管理使用情况,被湖北证监局采取出具警示函措施。2023 年 11 月 17 日,上海证券交易所就前述事项对海通证券股份有限公司予以书面警示。

2024 年 1 月 5 日,海通证券股份有限公司因在担任项目保荐人过程中,一、未就实际控制人所持股权冻结情况持续履行尽职调查职责并及时向本所报告,二、对关联方资金拆借披露的准确性未予充分核实,三、未对发行人会计基础不完善、内部控制不规范的情况予以充分关注,四、未经同意改动招股说明书,被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024 年 1 月 22 日,海通证券股份有限公司因:1.对境外子公司合规管理和风险管理不到位,未健全覆盖境外子公司的风险指标体系;未督促境外子公司有效处置风险指标超限额的情形;未按规定就境外子公司相关议案进行集体讨论;未对境外子公司部分董事、高级管理人员开展离任审计或离任审查。2.场外期权业务相关内部控制不健全,未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度;未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法。场外衍生品业务相关风险指标体系不健全。3.未清晰划分另类投资子公司业务范围;未及时处理另类投资子公司有关人员兼任利益冲突职务的行为,被中国证券监督管理委员会上海监管局采取责令改正的监督管理措施。

2024 年 1 月 29 日,海通证券股份有限公司(以下简称海通证券或公司)存在首发保荐业务履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查把关不审慎等缺陷,被上海证券交易所采取监管措施。

2024 年 2 月 1 日,海通证券股份有限公司因场外期权业务相关内部控制不健全,未建立健全覆盖场外期权业务各环节的内部管理制度;未明确部门层级风险指标超限额的报告路径和处理办法。场外衍生品业务相关风险指标体系不健全,被中国证券监督管理委员会上海监管局责令处分有关人员。

2024 年 4 月 24 日,海通证券股份有限公司作为格力地产股份有限公司债券“21 格地 02”“22 格地 02”的主承销商和受托管理人,未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查;在“22 格地 02”期后事项核查中,未对存货可变现净值的评估进行持续关注和尽职调查;未制作咨询审计机构工作底稿;未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告;对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时,被广东证监局采取责令改正的行政监管措

施。2024 年 5 月 28 日，上海证券交易所就前述事项对海通证券股份有限公司予以书面警示。

2024 年 4 月 29 日，海通证券股份有限公司因：1. 未审慎评估个别股票质押合约标的证券的风险，股票质押业务风险管理不审慎，未审慎评估个别股票质押合约融资资金用途，2. 未审慎开展收益互换业务，3. 个别风险债券投资内部控制程序不健全，4. 另类投资子公司投资的个别私募基金实际投资标的超出另类投资子公司业务范围，被中国证券监督管理委员会上海监管局采取责令改正的监督管理措施。

2024 年 4 月 30 日，海通证券股份有限公司因以自己名义按照中信中证的报价指令认购中核钛白非公开发行股票，客观上帮助中信中证及其客户取得股票收益，使得定增套利行为得以实现，中国证监会对海通证券股份有限公司合计没收违法所得 789,445.21 元，并处 6,975,000 元罚款。

2024 年 5 月 6 日，海通证券股份有限公司因：（一）保荐核查工作履职尽责不到位，（二）保荐业务内部质量控制存在薄弱环节，被上海证券交易所予以通报批评。

2023 年 9 月 1 日，国信证券股份有限公司存在薪酬考核不合理，未严格落实收入递延支付要求、部分债券承揽人员薪酬收入与项目直接挂钩，内部问责机制不健全，个别项目内控跟踪落实不到位，部分内核员工独立性不足，部分岗位人员出现廉洁从业风险，廉洁从业检查流于形式等问题，被证监会采取责令改正的行政监督管理措施。

2024 年 1 月 4 日，国信证券股份有限公司因未充分关注并督促发行人整改规范推广费用内部控制缺失的情形，对发行人经销收入相关事项核查不到位，被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024 年 4 月 17 日，国信证券股份有限公司存在以下问题：一是股票质押式回购业务个别标的黑名单管理不到位、个别标的尽职调查不充分、在业务融入方出现风险后仍多次有条件延期造成大额损失；二是纾困产品管理不足，部分纾困资管产品投向纾困用途的资金未达到规定比例；三是私募子公司管理不到位，个别产品未经备案开展业务、个别基金部分投资款被合作方挪用；四是存在为金融机构及其管理产品规避监管提供便利、为未备案的私募产品提供外包服务、信息隔离墙制度执行不到位等问题，被深圳证监局采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 4 月 18 日，国信证券股份有限公司作为广东奥普特科技股份有限公司（以下简称奥普特）首发上市保荐机构，在持续督导过程中存在以下违规情形：一是未及时督促奥普特履行募投计划变更审议及披露程序。在持续督导期间，未能勤勉尽责，未及时发现奥普特存在超募设计计划发放员工薪酬的情况，也未按要求督促奥普特履行审议和披露程序。二是未纠正奥普特使用其他募集专户发放薪酬问题。未能持续关注奥普特募集资金的存储使用情况，未及时发现奥普特使

用营销中心募投资金向其他项目支付员工薪酬的问题，在发现该问题后也未要求奥普特及时整改。被广东证监局采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 5 月 7 日，国信证券股份有限公司保荐的利尔达科技集团股份有限公司（以下简称利尔达）于 2023 年 2 月 17 日在北交所上市，根据利尔达 2024 年 4 月 26 日披露的《2023 年年度报告》，利尔达 2023 年归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润为-1,831.71 万元，上市当年即亏损，且该项目选取的上市标准含净利润标准，被浙江证监局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。

2024 年 7 月 5 日，国信证券股份有限公司因在私募资产管理业务开展中存在以下问题：一是部分产品具有通道业务特征，主动管理不足；二是资管新规整改不实，存在规模较大的资产管理计划实质仍为非净值化通道类产品；三是个别产品为其他金融机构违规运作资金池类理财业务提供便利；四是存在产品投资限额授权不审慎、债券评级方法客观性不足、投资者适当性管理不足等问题，被深圳证监局采取责令改正并暂停新增私募资产管理产品备案 3 个月（为接续存量产品所投资的未到期资产而新发行的产品除外，但不得新增投资）的行政监管措施，暂停期间自 2024 年 7 月 6 日至 10 月 5 日。

2023 年 8 月 3 日，兴业证券股份有限公司因发布证券研究报告业务客户服务行为内部控制和合规管理不到位，个别分析师的发言内容不够审慎，被福建证监局采取出具警示函的措施。

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。

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,045.57
2	应收证券清算款	24,258.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,304.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	5,624,043.86	5.46
2	110073	国投转债	1,840,074.41	1.79
3	113052	兴业转债	1,731,482.74	1.68
4	113044	大秦转债	481,060.38	0.47
5	113033	利群转债	304,977.04	0.30
6	118034	晶能转债	292,869.37	0.28
7	118008	海优转债	244,842.08	0.24
8	127018	本钢转债	236,153.32	0.23
9	113053	隆 22 转债	203,500.71	0.20
10	127089	晶澳转债	203,070.42	0.20
11	113641	华友转债	202,934.03	0.20
12	118031	天 23 转债	185,702.47	0.18
13	118023	广大转债	141,812.05	0.14
14	113049	长汽转债	111,806.82	0.11
15	123210	信服转债	103,602.90	0.10
16	118022	锂科转债	99,208.22	0.10
17	110081	闻泰转债	99,102.25	0.10
18	123144	裕兴转债	92,407.53	0.09
19	110086	精工转债	89,133.42	0.09
20	110095	双良转债	80,563.34	0.08

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	113,197,558.06
报告期期间基金总申购份额	7,616.28
减：报告期期间基金总赎回份额	6,268,139.79
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	106,937,034.55

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理瑞丰 6 个月持有期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。

9.2 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。

9.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日