

农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资
基金
2024 年中期报告

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

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 22 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 2024 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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41

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	41
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	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
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情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
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	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
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	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	106,937,034.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，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。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	张立学
	联系电话	021-61095588	010-68858113
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95580
传真		021-61095556	-
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		黄涛	刘建军

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	http://www.abc-ca.com

址	
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,111,650.50
本期利润	-1,710,893.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0151
本期加权平均净值利润率	-1.55%
本期基金份额净值增长率	-1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-3,977,336.51
期末可供分配基金份额利润	-0.0372
期末基金资产净值	102,959,698.04
期末基金份额净值	0.9628
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-3.72%

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

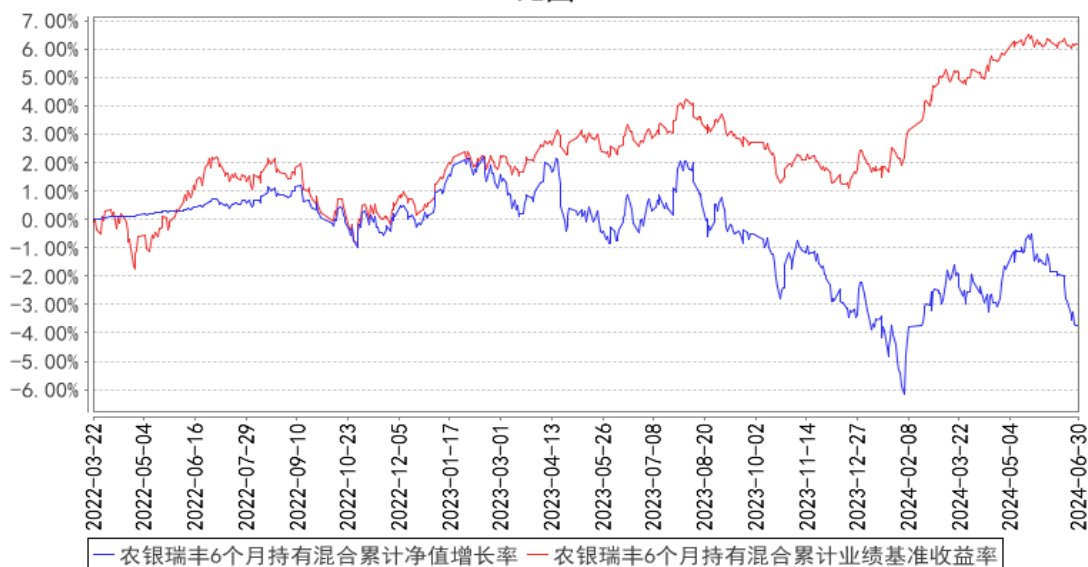
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.21%	0.23%	0.12%	0.09%	-2.33%	0.14%
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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

农银瑞丰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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 83 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）、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银

汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、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、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理国企优选混合型证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债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		
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。

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

上半年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。具体来看，年初至两会前经济基本面修复缓慢，2 月降准降息落地，叠加股市下探低点，资本市场避险情绪浓厚，10Y 国债收益率快速下行。3 月至 4 月中旬债市多空交织，两会政策目标未超预期，1-2 月经济数据好于预期，监管关注长端利率风险，10Y 国债收益率下行速度放缓，在 4 月中下旬达到 2.23% 低点。4 月下旬至 6 月中旬，供给方面财政部明确特别国债发行计划，地产政策工具频出，政策力度超出市场预期，叠加央行多次提示长短利率风险，10Y 国债收益率小幅回升后围绕在 2.3% 窄幅波动。6 月下旬公布的经济数据再度走弱，在“金融挤水分”的背景下，信贷数据连续两个月偏弱，加之半年末资金面平稳，债市再度回暖，10Y 国债收益率创新低回落至 2.21%。相较于去年四季度末，1 年期国债、国开债收益率上半年分别下行 54bp 和 51bp，10 年期国债、国开债分别下行 35bp 和 39bp，1 年、3 年和 5 年 AAA 信用债利率分别下行 51bp、58bp 和 67bp。上半年中债总指数上涨 3.83%，中债企业债总指数上涨 3.71%，中债综合指数上涨 3.76%，中证转债指数下跌 0.07%，申万 A 股指数下跌 9.43%。

本基金债券持仓以中高评级信用债为主，上半年主要操作主要集中在可转债和权益，可转债方面在一季度适度增持，二季度适度减持，6 月又适度减持，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。

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 0.9628 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.54%，业绩比较基准收益率为 3.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，但随着利率绝对水平和各种利差水平逐步创出新低，资本利得的博弈空间愈加有限，供给预计将逐步放量，叠加央行的一系列操作（包括逐渐通过买卖债券引导市场利率向他认为的合理区间移动，同时增设隔夜正逆回购交易形成利率走廊，防止市场出现流动性冲击以及防止流动性过度宽松影响利率引导效果），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，市场估值已较具备吸引力，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。

4.6 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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	143,043.87	145,737.81
结算备付金		1,510,192.26	3,118,201.01
存出保证金		5,045.57	9,028.91
交易性金融资产	6.4.7.2	117,182,362.24	147,142,032.15
其中：股票投资		29,016,956.76	34,275,923.50
基金投资		-	-
债券投资		88,165,405.48	112,866,108.65
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		24,258.92	111,303.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		118,864,902.86	150,526,303.27
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		15,680,000.00	31,778,347.92
应付清算款		23,125.47	-

应付赎回款		31,763.82	101,242.04
应付管理人报酬		69,078.15	80,643.01
应付托管费		17,269.56	20,160.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		98.41	153.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	83,869.41	167,808.65
负债合计		15,905,204.82	32,148,355.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	106,937,034.55	121,051,023.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,977,336.51	-2,673,076.07
净资产合计		102,959,698.04	118,377,947.80
负债和净资产总计		118,864,902.86	150,526,303.27

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9628 元，基金份额总额 106,937,034.55 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-748,791.64	3,715,004.09
1. 利息收入		23,150.14	70,453.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,294.84	69,750.04
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		855.30	703.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,050,602.63	3,482,844.52
其中：股票投资收益	6.4.7.14	89,704.78	133,509.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,678,634.35	2,767,540.88
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			

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	282,263.50	581,794.49
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	-2,822,544.41	161,706.16
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	-	-
减：二、营业总支出		962,102.27	1,989,972.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	439,024.11	826,412.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	109,755.96	206,603.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		312,618.95	855,971.83
其中：卖出回购金融资产支出		312,618.95	855,971.83
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		54.01	162.82
8. 其他费用	6.4.7.23	100,649.24	100,822.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,710,893.91	1,725,031.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,710,893.91	1,725,031.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,710,893.91	1,725,031.26

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	121,051,023.87	-	-2,673,076.07	118,377,947.80

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	121,051,023.87	-	-2,673,076.07	118,377,947.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-14,113,989.32	-	-1,304,260.44	-15,418,249.76
(一)、综合收益总额	-	-	-1,710,893.91	-1,710,893.91
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-14,113,989.32	-	406,633.47	-13,707,355.85
其中：1. 基金申购款	79,320.72	-	-3,299.53	76,021.19
2. 基金赎回款	-14,193,310.04	-	409,933.00	-13,783,377.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	106,937,034.55	-	-3,977,336.51	102,959,698.04
项目	上年度可比期间			
	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	327,970,756.69	-	574,770.38	328,545,527.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	327,970,756.69	-	574,770.38	328,545,527.07

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-172,576,715.99	-	-443,674.68	-173,020,390.67
(一)、综合收益总额	-	-	1,725,031.26	1,725,031.26
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-172,576,715.99	-	-2,168,705.94	-174,745,421.93
其中：1. 基金申购款	383,081.80	-	4,683.99	387,765.79
2. 基金赎回款	-172,959,797.79	-	-2,173,389.93	-175,133,187.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	155,394,040.70	-	131,095.70	155,525,136.40

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

农银汇理瑞丰 6 个月持有期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》、《农银汇理瑞丰 6 个月持有期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[2021]3866 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 562,139,017.94 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(22)第 00146 号验资报告。《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》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 3 月 22 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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《农银汇理瑞丰 6 个月持有期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，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票)、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、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合为：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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于主体评级在 AA 及以上级别的信用债，其中 AAA 级(包括 AAA-、AAA、AAA+)的信用债占总体信用债投资比例不低于总体信用债投资比例的 50%，AA+级的信用债占总体信用债投资比例为 0-50%，AA 级的信用债占总体信用债投资比例为 0-20%。相关资信评级机构需取得相关监管机构评级业务的许可。本基金投资可交换债券和可转换债券合计比例不超过基金资产的 20%。本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%”。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产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重大会计估计变更。

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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	143,043.87
等于：本金	142,694.85
加：应计利息	349.02
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	143,043.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	40,248,277.06	-	29,016,956.76	-11,231,320.30	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	66,707,713.82	547,218.19	67,582,520.24	327,588.23
	银行间市场	20,237,841.64	386,885.24	20,582,885.24	-41,841.64
	合计	86,945,555.46	934,103.43	88,165,405.48	285,746.59

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	127,193,832.52	934,103.43	117,182,362.24	-10,945,573.71

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各项资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	1,820.17
其中：交易所市场	1,820.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
合计	83,869.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	121,051,023.87	121,051,023.87
本期申购	79,320.72	79,320.72
本期赎回（以“-”号填列）	-14,193,310.04	-14,193,310.04
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	106,937,034.55	106,937,034.55

注：红利再投、转换入及级别调整入份额计入申购，转换出及级别调整出份额计入赎回。

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	2,621,149.58	-5,294,225.65	-2,673,076.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,621,149.58	-5,294,225.65	-2,673,076.07
本期利润	1,111,650.50	-2,822,544.41	-1,710,893.91
本期基金份额交易产生的变动数	-360,496.31	767,129.78	406,633.47
其中：基金申购款	1,886.71	-5,186.24	-3,299.53
基金赎回款	-362,383.02	772,316.02	409,933.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,372,303.77	-7,349,640.28	-3,977,336.51

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	2,673.17
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	19,573.25
其他	48.42
合计	22,294.84

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	4,076,426.38
减：卖出股票成本总额	3,979,509.05
减：交易费用	7,212.55
买卖股票差价收入	89,704.78

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,513,635.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	164,999.21
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,678,634.35

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,343,821.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,376,449.63
减：应计利息总额	802,206.54
减：交易费用	166.03
买卖债券差价收入	164,999.21

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	282,263.50
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	282,263.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,822,544.41
股票投资	-3,010,360.69
债券投资	187,816.28
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	-2,822,544.41

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	100,649.24

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（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	基金托管人、基金代销机构

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的佣金。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	439,024.11	826,412.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	218,729.18	411,940.38
应支付基金管理人的净管理费	220,294.93	414,471.92

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	109,755.96	206,603.02

注：支付基金托管人邮储银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期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固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
邮储银行	143,043.87	2,673.17	140,709.84	11,929.60

注：本基金的活期银行存款由基金托管人邮储银行保管，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（2024 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,680,000.00 元，于 2024 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,281,198.36	6,014,631.34
合计	5,281,198.36	6,014,631.34

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	80,743,982.00	95,200,368.68
AAA 以下	2,140,225.12	11,651,108.63
未评级	-	-
合计	82,884,207.12	106,851,477.31

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	143,043.87	-	-	-	143,043.87
结算备付金	1,510,192.26	-	-	-	1,510,192.26
存出保证金	5,045.57	-	-	-	5,045.57
交易性金融资产	76,817,484.11	11,347,921.37	-	29,016,956.76	117,182,362.24
应收清算款	-	-	-	24,258.92	24,258.92

资产总计	78,475,765.81	11,347,921.37	-	29,041,215.68	118,864,902.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,763.82	31,763.82
应付管理人报酬	-	-	-	69,078.15	69,078.15
应付托管费	-	-	-	17,269.56	17,269.56
应付清算款	-	-	-	23,125.47	23,125.47
卖出回购金融资产款	15,680,000.00	-	-	-	15,680,000.00
应交税费	-	-	-	98.41	98.41
其他负债	-	-	-	83,869.41	83,869.41
负债总计	15,680,000.00	-	-	225,204.82	15,905,204.82
利率敏感度缺口	62,795,765.81	11,347,921.37	-	28,816,010.86	102,959,698.04
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	145,737.81	-	-	-	145,737.81
结算备付金	3,118,201.01	-	-	-	3,118,201.01
存出保证金	9,028.91	-	-	-	9,028.91
交易性金融资产	60,607,122.79	52,258,985.86	-	34,275,923.50	147,142,032.15
应收清算款	-	-	-	111,303.39	111,303.39
资产总计	63,880,090.52	52,258,985.86	-	34,387,226.89	150,526,303.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	101,242.04	101,242.04
应付管理人报酬	-	-	-	80,643.01	80,643.01
应付托管费	-	-	-	20,160.75	20,160.75
卖出回购金融资产款	31,778,347.92	-	-	-	31,778,347.92
应交税费	-	-	-	153.10	153.10
其他负债	-	-	-	167,808.65	167,808.65
负债总计	31,778,347.92	-	-	370,007.55	32,148,355.47
利率敏感度缺口	32,101,742.60	52,258,985.86	-	34,017,219.34	118,377,947.80

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个	-205,691.42	-368,754.71

	基点		
	市场利率下降 25 个基点	205,691.42	368,754.71

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	29,016,956.76	28.18	34,275,923.50	28.95
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	29,016,956.76	28.18	34,275,923.50	28.95

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月）

			31 日)
业绩比较基准上升 5%		8,414,123.35	9,112,569.01
业绩比较基准下降 5%		-8,414,123.35	-9,112,569.01

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	41,385,304.12	46,365,742.24
第二层次	75,797,058.12	100,776,289.91
第三层次	-	-
合计	117,182,362.24	147,142,032.15

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、债券和基金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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

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	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	其他各项资产	29,304.49	0.02
9	合计	118,864,902.86	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	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	124,820.00	0.12

	应业		
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

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	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
11	000002	万科 A	95,000	658,350.00	0.64
12	002241	歌尔股份	33,000	643,830.00	0.63
13	000858	五粮液	5,000	640,200.00	0.62
14	600233	圆通速递	40,000	626,000.00	0.61
15	002648	卫星化学	34,000	611,320.00	0.59
16	601111	中国国航	80,000	590,400.00	0.57
17	000333	美的集团	9,000	580,500.00	0.56

18	603055	台华新材	57,000	577,410.00	0.56
19	603501	韦尔股份	5,700	566,409.00	0.55
20	601058	赛轮轮胎	40,000	560,000.00	0.54
21	300979	华利集团	9,000	547,650.00	0.53
22	601012	隆基绿能	39,000	546,780.00	0.53
23	002345	潮宏基	115,000	542,800.00	0.53
24	002156	通富微电	22,000	492,580.00	0.48
25	000651	格力电器	12,500	490,250.00	0.48
26	601689	拓普集团	9,000	482,490.00	0.47
27	300059	东方财富	45,000	475,200.00	0.46
28	600315	上海家化	26,000	462,280.00	0.45
29	600004	白云机场	48,000	455,040.00	0.44
30	600383	金地集团	132,000	448,800.00	0.44
31	600026	中远海能	28,000	437,080.00	0.42
32	300750	宁德时代	2,340	421,270.20	0.41
33	603885	吉祥航空	38,000	417,620.00	0.41
34	000725	京东方 A	100,000	409,000.00	0.40
35	688234	天岳先进	8,400	394,128.00	0.38
36	300873	海晨股份	24,000	349,920.00	0.34
37	300759	康龙化成	18,000	334,440.00	0.32
38	600612	老凤祥	5,700	331,683.00	0.32
39	603259	药明康德	8,000	313,520.00	0.30
40	000975	银泰黄金	18,000	293,220.00	0.28
41	002001	新 和 成	15,000	288,000.00	0.28
42	600438	通威股份	15,000	286,650.00	0.28
43	002050	三花智控	15,000	286,200.00	0.28
44	002867	周大生	19,000	248,140.00	0.24
45	603218	日月股份	20,000	205,400.00	0.20
46	300782	卓胜微	2,600	202,124.00	0.20
47	688696	极米科技	2,500	193,100.00	0.19
48	002709	天赐材料	10,000	175,600.00	0.17
49	600036	招商银行	5,000	170,950.00	0.17
50	000625	长安汽车	11,000	147,730.00	0.14
51	002920	德赛西威	1,600	139,344.00	0.14
52	300725	药石科技	5,000	133,850.00	0.13
53	002475	立讯精密	3,300	129,723.00	0.13
54	300037	新宙邦	4,500	128,520.00	0.12
55	603606	东方电缆	2,500	122,025.00	0.12
56	002422	科伦药业	4,000	121,320.00	0.12
57	600079	人福医药	7,000	120,190.00	0.12
58	600129	太极集团	4,000	115,680.00	0.11
59	688981	中芯国际	2,500	115,250.00	0.11
60	688375	国博电子	1,500	105,960.00	0.10

61	600803	新奥股份	5,000	104,000.00	0.10
62	601633	长城汽车	4,000	101,200.00	0.10
63	002049	紫光国微	1,700	89,420.00	0.09
64	300677	英科医疗	3,000	80,430.00	0.08
65	300274	阳光电源	1,120	69,473.60	0.07
66	688390	固德威	1,120	62,854.40	0.06
67	688472	阿特斯	6,000	61,080.00	0.06
68	600276	恒瑞医药	1,500	57,690.00	0.06
69	600050	中国联通	12,000	56,400.00	0.05
70	002705	新宝股份	4,000	56,280.00	0.05
71	601816	京沪高铁	10,000	53,700.00	0.05
72	600989	宝丰能源	3,000	51,990.00	0.05
73	688385	复旦微电	1,600	50,208.00	0.05
74	000893	亚钾国际	3,000	48,480.00	0.05
75	002959	小熊电器	1,000	48,110.00	0.05
76	002737	葵花药业	2,000	46,760.00	0.05
77	603799	华友钴业	2,000	44,260.00	0.04
78	000729	燕京啤酒	5,000	44,150.00	0.04
79	002747	埃斯顿	3,000	42,660.00	0.04
80	002468	申通快递	5,000	42,000.00	0.04
81	300633	开立医疗	1,000	39,580.00	0.04
82	601688	华泰证券	3,000	37,170.00	0.04
83	002459	晶澳科技	3,220	36,064.00	0.04
84	603444	吉比特	200	35,602.00	0.03
85	688008	澜起科技	600	34,296.00	0.03
86	002332	仙琚制药	3,000	34,230.00	0.03
87	603486	科沃斯	700	33,026.00	0.03
88	688035	德邦科技	1,000	32,220.00	0.03
89	600584	长电科技	1,000	31,710.00	0.03
90	603600	永艺股份	3,000	31,320.00	0.03
91	600958	东方证券	4,000	30,400.00	0.03
92	601766	中国中车	4,000	30,040.00	0.03
93	000977	浪潮信息	800	29,096.00	0.03
94	688223	晶科能源	4,000	28,400.00	0.03
95	002557	洽洽食品	1,000	28,190.00	0.03
96	301035	润丰股份	600	26,724.00	0.03
97	603518	锦泓集团	3,000	26,400.00	0.03
98	603801	志邦家居	2,000	26,160.00	0.03
99	688269	凯立新材	1,000	25,550.00	0.02
100	600406	国电南瑞	1,000	24,960.00	0.02
101	300957	贝泰妮	500	24,160.00	0.02
102	300896	爱美客	140	24,094.00	0.02
103	600522	中天科技	1,500	23,775.00	0.02

104	002129	TCL 中环	2,500	21,625.00	0.02
105	600027	华电国际	3,000	20,820.00	0.02
106	300569	天能重工	5,000	20,800.00	0.02
107	002008	大族激光	1,000	20,800.00	0.02
108	002225	濮耐股份	5,000	20,450.00	0.02
109	300014	亿纬锂能	500	19,960.00	0.02
110	002410	广联达	2,000	19,160.00	0.02
111	603208	江山欧派	1,000	19,140.00	0.02
112	002615	哈尔斯	3,000	18,600.00	0.02
113	300887	谱尼测试	2,500	18,500.00	0.02
114	688777	中控技术	490	18,473.00	0.02
115	600875	东方电气	1,000	18,450.00	0.02
116	300628	亿联网络	500	18,385.00	0.02
117	688200	华峰测控	200	18,350.00	0.02
118	002387	维信诺	3,000	18,240.00	0.02
119	002472	双环传动	800	17,616.00	0.02
120	603733	仙鹤股份	1,000	17,580.00	0.02
121	603303	得邦照明	1,500	17,220.00	0.02
122	301039	中集车辆	2,000	17,200.00	0.02
123	601186	中国铁建	2,000	17,140.00	0.02
124	688409	富创精密	444	16,401.36	0.02
125	000338	潍柴动力	1,000	16,240.00	0.02
126	300144	宋城演艺	2,000	16,060.00	0.02
127	000568	泸州老窖	100	14,349.00	0.01
128	000803	山高环能	4,000	13,960.00	0.01
129	002545	东方铁塔	2,000	13,620.00	0.01
130	300416	苏试试验	1,000	12,860.00	0.01
131	601888	中国中免	200	12,498.00	0.01
132	688478	晶升股份	400	11,648.00	0.01
133	601598	中国外运	2,000	11,260.00	0.01
134	688778	厦钨新能	280	8,747.20	0.01
135	300129	泰胜风能	1,000	6,820.00	0.01

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	600036	招商银行	138,473.00	0.12
2	000625	长安汽车	120,280.00	0.10
3	600129	太极集团	103,646.00	0.09
4	688472	阿特斯	83,611.00	0.07
5	600079	人福医药	82,200.00	0.07

6	688390	固德威	80,852.00	0.07
7	601689	拓普集团	76,335.00	0.06
8	603128	华贸物流	59,630.00	0.05
9	300037	新宙邦	56,355.00	0.05
10	601688	华泰证券	40,890.00	0.03
11	688035	德邦科技	39,156.00	0.03
12	000977	浪潮信息	38,594.00	0.03
13	300782	卓胜微	37,872.00	0.03
14	300633	开立医疗	36,950.00	0.03
15	688223	晶科能源	33,910.00	0.03
16	603600	永艺股份	33,670.00	0.03
17	603518	锦泓集团	31,438.00	0.03
18	002557	洽洽食品	30,925.00	0.03
19	002468	申通快递	27,750.00	0.02
20	603801	志邦家居	27,650.00	0.02

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	600030	中信证券	581,241.00	0.49
2	603225	新凤鸣	288,000.00	0.24
3	601021	春秋航空	254,185.00	0.21
4	000651	格力电器	250,944.00	0.21
5	601166	兴业银行	247,485.00	0.21
6	600612	老凤祥	243,419.00	0.21
7	000333	美的集团	232,617.00	0.20
8	002648	卫星化学	230,280.00	0.19
9	002594	比亚迪	202,469.00	0.17
10	002241	歌尔股份	180,651.00	0.15
11	600233	圆通速递	153,780.00	0.13
12	300979	华利集团	137,636.00	0.12
13	600026	中远海能	115,856.00	0.10
14	002345	潮宏基	91,420.00	0.08
15	603871	嘉友国际	89,930.00	0.08
16	603501	韦尔股份	82,481.00	0.07
17	601628	中国人寿	79,805.00	0.07
18	002850	科达利	70,610.00	0.06
19	603128	华贸物流	59,670.00	0.05
20	601058	赛轮轮胎	58,750.00	0.05

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

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	1,730,903.00
卖出股票收入（成交）总额	4,076,426.38

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	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

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

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

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，数据安全管理工作不足，灾备管理工作不足，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，并处以 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，未能及时发现奥普特存在超募设计

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。

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	5,045.57
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,304.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	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

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中有流通受限的情况。

§ 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 (%)
3,707	28,847.33	998,318.99	0.93	105,938,715.56	99.07

注：

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	2,987.70	0.0028

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（2022 年 3 月 22 日） 基金份额总额	562,139,017.94
本报告期期初基金份额总额	121,051,023.87
本报告期基金总申购份额	79,320.72
减：本报告期基金总赎回份额	14,193,310.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	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。

§ 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，根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第五届董事会第十五次会议决议，高国鹏先生自 2024 年 6 月 27 日离任本公司副总经理职务。

本公司已于 2024 年 6 月 29 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 2 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	行政监管措施。 公司：责令改正；高级管理人员：警示函。
受到稽查或处罚等措施的原因	内部控制不健全，违反《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已按照法律法规及监管要求及时完成整改工作。
其他	无

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
申万宏源证券	2	1,858,898.38	32.01	1,553.76	32.36	-
中信证券	2	1,850,969.00	31.87	1,565.68	32.61	-
天风证券	2	1,305,860.00	22.49	973.98	20.28	-
东吴证券	2	791,602.00	13.63	708.06	14.75	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

证券						
海通证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

(1) 财务状况良好，注册资本不少于 20 亿元人民币，最近一个完整年度在证券业协会披露的审计报告被出具无保留意见。

(2) 交易、研究等服务能力较强，最近一个完整年度年报披露的佣金席位占比在全市场前 1/2。

(3) 经营行为规范，合规风控能力较强，最近一年未因研究、交易业务违规而在中国证券监督管理委员会及其派出机构网站披露受到行政处罚。

2、本基金本报告期无新增交易单元，剔除川财证券交易单元。

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(%)
申万宏源证券	6,060,184.42	13.37	482,740,000.00	21.27	-	-
中信证券	3,639,925.92	8.03	459,760,000.00	20.26	-	-
天风证券	13,421,603.82	29.61	738,614,000.00	32.54	-	-
东吴证券	22,200,464.00	48.98	588,610,000.00	25.93	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
2	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2024 年 3 月 28 日
3	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2024 年 4 月 18 日
4	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金-招募说明书-2024 年第 1 次	证券时报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
5	农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 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。

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 8 月 29 日