

农银汇理瑞云增益 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：招商银行股份有限公司

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。本中期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。

基金托管人招商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	6
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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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 本基金投资股指期货的投资政策	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
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	农银瑞云增益 6 个月持有混合	
基金主代码	017624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 21 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	70,813,522.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	017624	017625
报告期末下属分级基金的份额总额	51,084,764.83 份	19,728,757.59 份

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	本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济周期各类资产的投资机会，根据基本面、社会融资水平、通胀、货币政策等因素，预测固收类资产（包括债券、可转债、可交债等）、权益类、现金管理类大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。综合运用高等级信用策略、久期配置策略、期限结构策略、量化选股策略、资产支持证券投资策略等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	翟爱东	张姗
	联系电话	021-61095588	400-61-95555
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-61095599	400-61-95555

传真	021-61095556	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	黄涛	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	588,904.02	136,938.42
本期利润	1,106,629.43	366,767.22
加权平均基金份额 本期利润	0.0141	0.0107
本期加权平均净 值利润率	1.38%	1.06%
本期基金份额净 值增长率	1.47%	1.27%
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	1,321,036.46	406,172.85
期末可供分配基 金份额利润	0.0259	0.0206

期末基金资产净值	52,497,265.89	20,170,394.12
期末基金份额净值	1.0277	1.0224
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	2.77%	2.24%

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

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

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	-0.32%	0.13%	0.05%	0.07%	-0.37%	0.06%
过去三个月	0.78%	0.14%	0.59%	0.10%	0.19%	0.04%
过去六个月	1.47%	0.16%	2.26%	0.13%	-0.79%	0.03%
过去一年	1.93%	0.13%	1.30%	0.13%	0.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.77%	0.12%	1.80%	0.13%	0.97%	-0.01%

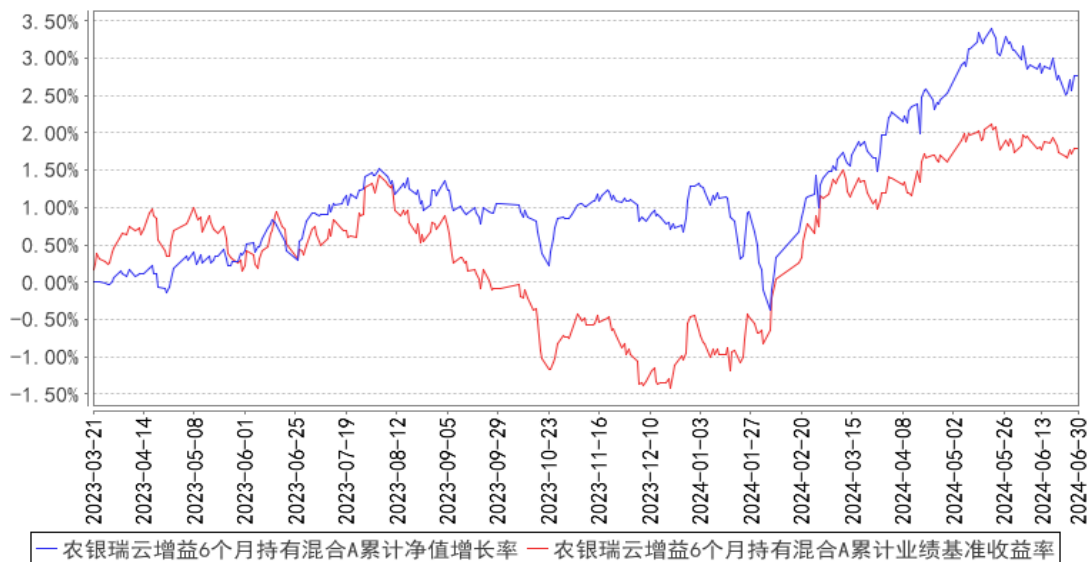
农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

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	-0.35%	0.13%	0.05%	0.07%	-0.40%	0.06%
过去三个月	0.68%	0.15%	0.59%	0.10%	0.09%	0.05%
过去六个月	1.27%	0.16%	2.26%	0.13%	-0.99%	0.03%
过去一年	1.52%	0.13%	1.30%	0.13%	0.22%	0.00%

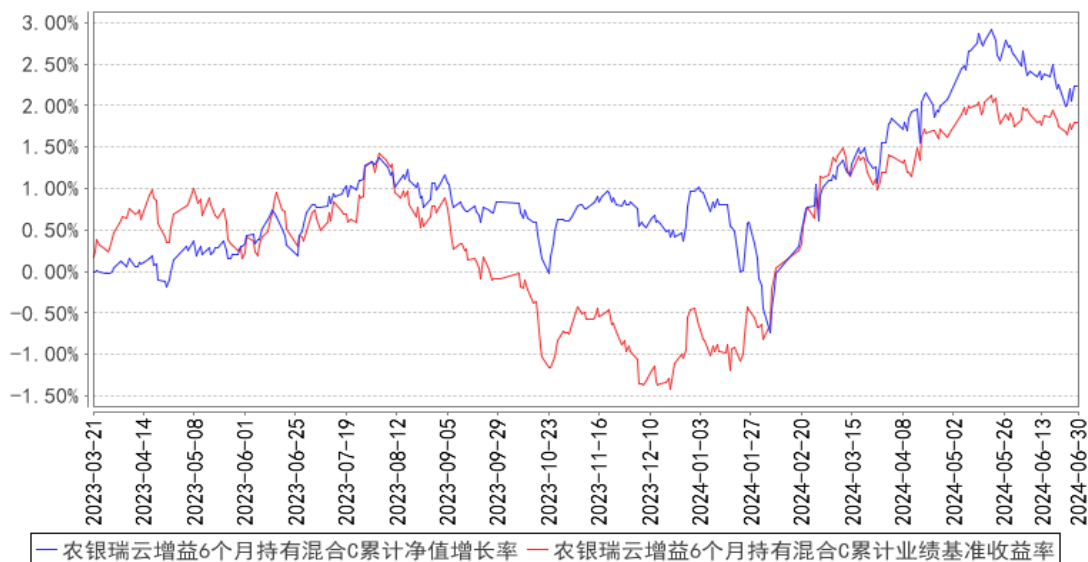
自基金合同生效 起至今	2.24%	0.12%	1.80%	0.13%	0.44%	-0.01%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

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

农银瑞云增益6个月持有混合A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



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



注：本基金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

会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票,可交换债券和可转换债券(不含分离交易可转债的纯债部分)资产的比例合计占基金资产的 10%-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,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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金建仓期为基金合同生效日(2023 年 3 月 21 日)起 6 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。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
刘莎莎	本基金的基金经理、公司固定收益部副总经理	2023 年 3 月 21 日	-	15 年	香港科技大学经济学硕士。历任中诚信证券评估公司分析师、阳光保险资产管理中心信用研究员、泰康资产管理有限公司信用研究员、国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监助理兼基金经理。2019 年 7 月加入农银汇理基金管理有限公司，现任农银汇理基金管理有限公司固定收益部副总经理、基金经理。
钱大千	本基金的基金经理	2023 年 3 月 21 日	-	13 年	上海交通大学数学系博士。2010 年 7 月加入农银汇理基金管理有限公司，历任风险控制部风控专员、研究部研究员、农银汇理资产管理有限公司资产及财富管理部的投资经理、农银汇理基金管理有限公司投资理财部投资经理，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

二季度 517 新一轮地产政策加码落地,体现出政策对于房地产的边际变化,去库存成为工作重点。基本面来说,4 月商品房销售额同比下降 30.4%,销售面积同比下降-22.8%,政策发布后,5 月一线城市房地产销售阶段性有所改善,单持续性有待跟踪。4 月房地产开发投资同比下降 10.5%,较 3 月回落 0.4%,1-4 月累计同比-9.8%。结构上,4 月新开工面积同比-14%,竣工面积同比-19.1%,存量施工面积同比-10.8%。近期市场关注点主要在地产政策端,去库存等政策持续落地,但政策效果有待观察。出口方面,5 月出口数据仍偏强,当月同比 7.6%,累计同比 2.7%,强于预期,三季度有望持续。

5 月整体流动性较为宽裕,手工补息因素外溢导致非银机构流动性充裕,债市高位震荡,短端受益于手工补息,长端受抑于央行连续喊话,4、5 月区间震荡。但地产政策前期政策待验证,债市中长债逻辑仍在。短期债市偏震荡,多空因素较为均衡,10Y 延续 2.2%-2.4%区间震荡。

权益方面,在经历了春节后持续 2 个多月的反弹后,市场有所回调,机构的增量资金边际有所回暖。房地产收储等政策的边际变化,很大程度上缓解了市场对于系统性风险的担忧,悲观情绪得到缓解,大幅度下跌的风险可控。

操作上,债券资产方面,从交易和基本面预期层面,对债券市场都十分有利,收益率持续下行。下行过程中组合主动减持超长期利率债,组合久期从年初超过 3 年逐步获利了结降到 1.5 年左右。随着绝对收益率水平的逐步走低,以及杠杆利差的压缩,组合 3 月下旬逐步降低杠杆。

权益类资产方面,股票仓位维持 10%左右。结构上考虑到整体波动性的控制,组合策略上主要配置业绩有一定成长性的红利、大盘价值、以及有一定业绩支撑的成长风格资产,市值上保持中性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银瑞云增益 6 个月持有混合 A 基金份额净值为 1.0277 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.47%,同期业绩比较基准收益率为 2.26%;截至本报告期末农银瑞云增益 6 个月

持有混合 C 基金份额净值为 1.0224 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.27%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，出口是拉动经济的重要因素。目前来看，海外库存周期走到后半段，加之美国大选临近，贸易摩擦风险加剧。我们认为随着内外基本面压力逐步显现，四季度内需稳增长政策有可能适度加码。结合目前地方债及国债发行进度及后续节奏，我们认为，在“以旧换新”、“设备更新”已有政策的基础上，需关注是否存在收储、基建适度加码的可能性。但从力度上来看，美国大选形势明朗前，政策很难有大动作，大概率维持托而不举的状态。长债阶段性释放情绪后，市场配置需求仍在。权益方面，外需逻辑存在较大不确定性，市场可能提前朝着稳增长的方向去交易。因此与内需相关的低 PB 反转类策略可能阶段性表现更佳。

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、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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：农银汇理瑞云增益 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	449,802.10	11,938,914.98
结算备付金		688,366.91	2,098,798.92
存出保证金		7,181.74	16,185.07
交易性金融资产	6.4.7.2	81,482,034.90	216,086,964.36
其中：股票投资		8,111,164.56	17,419,593.08
基金投资		-	-
债券投资		73,370,870.34	198,667,371.28
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	1,000,000.00	-
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		1,000,167.26	345,765.01
应收股利		-	-
应收申购款		249.80	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		84,627,802.71	230,486,628.34
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		10,502,381.91	55,011,315.65
应付清算款		989,328.00	5,534,265.46
应付赎回款		286,045.84	2,448,782.81
应付管理人报酬		43,361.03	104,589.71
应付托管费		12,388.89	29,882.75
应付销售服务费		7,160.59	18,279.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,408.14	7,629.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	116,068.30	224,102.33
负债合计		11,960,142.70	63,378,846.78

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	70,813,522.42	165,160,769.40
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,854,137.59	1,947,012.16
净资产合计		72,667,660.01	167,107,781.56
负债和净资产总计		84,627,802.71	230,486,628.34

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 70,813,522.42 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0277 元，基金份额总额 51,084,764.83 份；下属 C 类基金份额净值 1.0224 元，基金份额总额 19,728,757.59 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理瑞云增益 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 3 月 21 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,486,002.87	3,183,580.49
1. 利息收入		27,708.85	447,612.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,211.77	25,359.01
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		2,497.08	422,253.80
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,710,739.81	2,263,017.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,038,923.65	198,243.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,621,604.93	1,738,953.26
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	128,058.53	325,820.75
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	747,554.21	472,950.04
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		1,012,606.22	1,041,862.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	400,955.19	526,697.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	114,558.64	150,485.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	69,199.84	81,282.07
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		312,866.21	225,264.43
其中：卖出回购金融资产支出		312,866.21	225,264.43
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,284.78	3,587.64
8. 其他费用	6.4.7.23	111,741.56	54,545.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,473,396.65	2,141,717.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,473,396.65	2,141,717.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,473,396.65	2,141,717.96

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理瑞云增益 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	165,160,769.40	-	1,947,012.16	167,107,781.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	165,160,769.40	-	1,947,012.16	167,107,781.56

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-94,347,246.98	-	-92,874.57	-94,440,121.55
(一)、综合收益总额	-	-	1,473,396.65	1,473,396.65
(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)	-94,347,246.98	-	-1,566,271.22	-95,913,518.20
其中：1. 基金申购款	749,570.09	-	11,818.74	761,388.83
2. 基金赎回款	-95,096,817.07	-	-1,578,089.96	-96,674,907.03
(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	70,813,522.42	-	1,854,137.59	72,667,660.01
项目	上年度可比期间			
	2023 年 3 月 21 日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	271,168,185.01	-	-	271,168,185.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	147,853.47	-	2,142,517.20	2,290,370.67
(一)、综合收益总额	-	-	2,141,717.96	2,141,717.96

(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)	147,853.47	-	799.24	148,652.71
其中：1. 基金申购款	147,853.47	-	799.24	148,652.71
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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	271,316,038.48	-	2,142,517.20	273,458,555.68

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

农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)按照国家相关法律、法规、农银汇理[2022]169 号《关于农银汇理中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金变更注册为农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金的请示》和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[2022]3062 号《关于准予农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 271,078,959.63 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(2023)第 0157 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券

投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 271,168,185.01 份基金份额，其中认购资金利息折合 89,225.38 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。各类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、可交换债券和可转换债券(不含分离交易可转债的纯债部分)资产的比例合计占基金资产的 10%-30%，同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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	449,802.10
等于：本金	449,709.49
加：应计利息	92.61
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	449,802.10

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	8,330,437.08	-	8,111,164.56	-219,272.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	801,826.35	64,948,905.35	384,760.25
	银行间市场	8,312,740.57	8,421,964.99	-12,740.57
	合计	923,791.34	73,370,870.34	372,019.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	80,405,496.40	923,791.34	81,482,034.90	152,747.16

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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	29,046.82
其中：交易所市场	28,401.82
银行间市场	645.00
应付利息	-
预提费用	87,021.48
合计	116,068.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

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	113,816,485.72	113,816,485.72
本期申购	337,718.41	337,718.41
本期赎回（以“-”号填列）	-63,069,439.30	-63,069,439.30
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	51,084,764.83	51,084,764.83

农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

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	51,344,283.68	51,344,283.68
本期申购	411,851.68	411,851.68
本期赎回（以“-”号填列）	-32,027,377.77	-32,027,377.77
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	19,728,757.59	19,728,757.59

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

农银瑞云增益 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,365,156.94	88,452.76	1,453,609.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,365,156.94	88,452.76	1,453,609.70
本期利润	588,904.02	517,725.41	1,106,629.43
本期基金份额交易产生的变动数	-633,024.50	-514,713.57	-1,147,738.07
其中：基金申购款	4,261.31	2,380.11	6,641.42
基金赎回款	-637,285.81	-517,093.68	-1,154,379.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,321,036.46	91,464.60	1,412,501.06

农银瑞云增益 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	453,649.50	39,752.96	493,402.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	453,649.50	39,752.96	493,402.46
本期利润	136,938.42	229,828.80	366,767.22
本期基金份额交易产生的变动数	-184,415.07	-234,118.08	-418,533.15
其中：基金申购款	1,015.01	4,162.31	5,177.32
基金赎回款	-185,430.08	-238,280.39	-423,710.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,172.85	35,463.68	441,636.53

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	4,233.96
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	20,878.06
其他	99.75
合计	25,211.77

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	59,496,740.83
减：卖出股票成本总额	60,417,138.46
减：交易费用	118,526.02
买卖股票差价收入	-1,038,923.65

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	1,853,293.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	768,311.71
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	2,621,604.93

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	138,746,269.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	135,957,038.45
减：应计利息总额	2,018,593.21
减：交易费用	2,325.66
买卖债券差价收入	768,311.71

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	128,058.53
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	128,058.53

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	747,554.21
股票投资	303,478.69
债券投资	444,075.52
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	747,554.21

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	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	6,120.08
账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	111,741.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（“农银汇理”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金管理人的股东、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 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	400,955.19	526,697.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	198,274.59	258,793.49
应支付基金管理人的净管理费	202,680.60	267,904.24

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 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	114,558.64	150,485.10

注：支付基金托管人招商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银瑞云增益 6 个月 持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月 持有混合 C	合计
农业银行	-	62,460.79	62,460.79

招商银行	-	4,486.77	4,486.77
合计	-	66,947.56	66,947.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	合计
农银汇理	-	0.52	0.52
农业银行	-	66,092.69	66,092.69
招商银行	-	11,763.47	11,763.47
合计	-	77,856.68	77,856.68

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给农银汇理，再由农银汇理计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 3 月 21 日（基金合同生效日）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
招商银行	449,802.10	4,233.96	1,017,080.66	11,459.26

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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（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 10,502,381.91 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	4,571,555.48	8,077,720.55
合计	4,571,555.48	8,077,720.55

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	61,929,016.85	158,566,521.64
AAA 以下	1,752,968.97	360,304.16
未评级	5,117,329.04	31,662,824.93
合计	68,799,314.86	190,589,650.73

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	449,802.10	-	-	-	449,802.10
结算备付金	688,366.91	-	-	-	688,366.91
存出保证金	7,181.74	-	-	-	7,181.74
交易性金融资产	58,881,354.44	14,489,515.90	-	8,111,164.56	81,482,034.90
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收申购款	-	-	-	249.80	249.80
应收清算款	-	-	-	1,000,167.26	1,000,167.26
资产总计	61,026,705.19	14,489,515.90	-	9,111,581.62	84,627,802.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	286,045.84	286,045.84
应付管理人报酬	-	-	-	43,361.03	43,361.03
应付托管费	-	-	-	12,388.89	12,388.89
应付清算款	-	-	-	989,328.00	989,328.00
卖出回购金融资产款	10,502,381.91	-	-	-	10,502,381.91
应付销售服务费	-	-	-	7,160.59	7,160.59
应交税费	-	-	-	3,408.14	3,408.14
其他负债	-	-	-	116,068.30	116,068.30
负债总计	10,502,381.91	-	-	1,457,760.79	11,960,142.70
利率敏感度缺口	50,524,323.28	14,489,515.90	-	7,653,820.83	72,667,660.01
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	11,938,914.98	-	-	-	11,938,914.98
结算备付金	2,098,798.92	-	-	-	2,098,798.92
存出保证金	16,185.07	-	-	-	16,185.07
交易性金融资产	106,610,187.46	70,507,357.79	21,549,826.03	17,419,593.08	216,086,964.36
应收清算款	-	-	-	345,765.01	345,765.01
资产总计	120,664,086.43	70,507,357.79	21,549,826.03	17,765,358.09	230,486,628.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,448,782.81	2,448,782.81
应付管理人报酬	-	-	-	104,589.71	104,589.71
应付托管费	-	-	-	29,882.75	29,882.75
应付清算款	-	-	-	5,534,265.46	5,534,265.46
卖出回购金融资产款	55,011,315.65	-	-	-	55,011,315.65
应付销售服务费	-	-	-	18,279.02	18,279.02
应交税费	-	-	-	7,629.05	7,629.05
其他负债	-	-	-	224,102.33	224,102.33
负债总计	55,011,315.65	-	-	8,367,531.13	63,378,846.78
利率敏感度缺口	65,652,770.78	70,507,357.79	21,549,826.03	9,397,826.96	167,107,781.56

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	-		
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 个基点	-192,944.87	-1,060,587.61
市场利率下降 25 个基点	192,944.87	1,060,587.61	

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	8,111,164.56	11.16	17,419,593.08	10.42
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	8,111,164.56	11.16	17,419,593.08	10.42

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（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%	2,645,777.26	-
	业绩比较基准下降 5%	-2,645,777.26	-

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	21,789,432.21	39,822,985.36
第二层次	59,692,602.69	176,263,979.00
第三层次	-	-
合计	81,482,034.90	216,086,964.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,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	8,111,164.56	9.58
	其中:股票	8,111,164.56	9.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	73,370,870.34	86.70
	其中:债券	73,370,870.34	86.70
	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	1,000,000.00	1.18
	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	1,138,169.01	1.34
8	其他各项资产	1,007,598.80	1.19
9	合计	84,627,802.71	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	274,346.00	0.38
C	制造业	6,173,833.02	8.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	251,179.80	0.35
E	建筑业	170,599.00	0.23
F	批发和零售业	122,831.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	348,314.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	207,440.00	0.29
J	金融业	394,871.00	0.54
K	房地产业	1,848.00	0.00
L	租赁和商务服务业	17,860.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	982.74	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	145,860.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,200.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,111,164.56	11.16

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	601328	交通银行	25,800	192,726.00	0.27
2	600023	浙能电力	22,000	156,420.00	0.22
3	600054	黄山旅游	13,000	145,860.00	0.20
4	002327	富安娜	14,000	140,700.00	0.19
5	601567	三星医疗	3,800	133,000.00	0.18
6	300577	开润股份	6,300	131,229.00	0.18
7	601038	一拖股份	7,500	118,575.00	0.16
8	300308	中际旭创	840	115,819.20	0.16
9	600398	海澜之家	12,000	110,880.00	0.15
10	002422	科伦药业	3,500	106,155.00	0.15
11	002237	恒邦股份	9,000	103,590.00	0.14
12	601156	东航物流	5,000	101,750.00	0.14
13	603871	嘉友国际	5,600	99,064.00	0.14

14	601918	新集能源	10,000	97,500.00	0.13
15	000333	美的集团	1,500	96,750.00	0.13
16	600487	亨通光电	6,000	94,620.00	0.13
17	600582	天地科技	13,600	93,704.00	0.13
18	603556	海兴电力	2,000	93,660.00	0.13
19	600282	南钢股份	18,400	91,632.00	0.13
20	300433	蓝思科技	5,000	91,250.00	0.13
21	601975	招商南油	25,000	89,750.00	0.12
22	000830	鲁西化工	7,700	89,243.00	0.12
23	601717	郑煤机	5,900	87,320.00	0.12
24	301187	欧圣电气	3,600	87,300.00	0.12
25	300274	阳光电源	1,400	86,842.00	0.12
26	000338	潍柴动力	5,100	82,824.00	0.11
27	002223	鱼跃医疗	2,200	82,720.00	0.11
28	600872	中炬高新	3,600	81,684.00	0.11
29	000426	兴业银锡	6,000	81,480.00	0.11
30	605007	五洲特纸	6,400	80,832.00	0.11
31	300705	九典制药	2,940	78,615.60	0.11
32	601728	中国电信	12,700	78,105.00	0.11
33	603889	新澳股份	10,000	77,400.00	0.11
34	002001	新和成	4,000	76,800.00	0.11
35	002594	比亚迪	300	75,075.00	0.10
36	600285	羚锐制药	3,100	75,051.00	0.10
37	300502	新易盛	700	73,885.00	0.10
38	603193	润本股份	4,000	73,560.00	0.10
39	000404	长虹华意	13,600	72,488.00	0.10
40	600690	海尔智家	2,500	70,950.00	0.10
41	603055	台华新材	7,000	70,910.00	0.10
42	600210	紫江企业	13,200	70,224.00	0.10
43	601233	桐昆股份	4,400	70,224.00	0.10
44	603258	电魂网络	4,300	69,445.00	0.10
45	688766	普冉股份	700	68,019.00	0.09
46	002215	诺普信	9,100	67,795.00	0.09
47	002997	瑞鹄模具	2,100	67,137.00	0.09
48	000589	贵州轮胎	13,200	66,924.00	0.09
49	603605	珀莱雅	600	66,594.00	0.09
50	603408	建霖家居	5,000	65,950.00	0.09
51	601179	中国西电	8,200	65,928.00	0.09
52	688578	艾力斯	1,000	63,740.00	0.09
53	000528	柳工	5,500	61,545.00	0.08
54	600765	中航重机	3,000	61,200.00	0.08
55	605333	沪光股份	2,100	58,485.00	0.08
56	600312	平高电气	3,000	58,350.00	0.08

57	001872	招商港口	3,000	57,750.00	0.08
58	600480	凌云股份	5,800	57,014.00	0.08
59	000409	云鼎科技	7,000	56,490.00	0.08
60	002906	华阳集团	2,100	56,196.00	0.08
61	002415	海康威视	1,800	55,638.00	0.08
62	000552	甘肃能化	16,000	55,520.00	0.08
63	688408	中信博	600	55,248.00	0.08
64	000400	许继电气	1,600	55,056.00	0.08
65	002053	云南能投	4,500	54,405.00	0.07
66	300673	佩蒂股份	4,100	53,792.00	0.07
67	002979	雷赛智能	2,900	52,780.00	0.07
68	603348	文灿股份	1,900	52,611.00	0.07
69	300783	三只松鼠	2,400	52,488.00	0.07
70	003000	劲仔食品	4,300	51,815.00	0.07
71	603733	仙鹤股份	2,900	50,982.00	0.07
72	000065	北方国际	4,900	50,813.00	0.07
73	300005	探路者	9,900	49,599.00	0.07
74	002273	水晶光电	2,900	49,242.00	0.07
75	000913	钱江摩托	3,100	48,856.00	0.07
76	300953	震裕科技	900	48,780.00	0.07
77	601886	江河集团	9,800	47,824.00	0.07
78	002035	华帝股份	7,100	44,233.00	0.06
79	002835	同为股份	2,300	38,847.00	0.05
80	600469	风神股份	6,600	38,544.00	0.05
81	601126	四方股份	2,000	38,440.00	0.05
82	000598	兴蓉环境	5,100	38,352.00	0.05
83	603809	豪能股份	4,736	38,266.88	0.05
84	002078	太阳纸业	2,700	37,665.00	0.05
85	000630	铜陵有色	10,400	37,544.00	0.05
86	600038	中直股份	900	36,999.00	0.05
87	600875	东方电气	2,000	36,900.00	0.05
88	002674	兴业科技	3,600	36,792.00	0.05
89	600987	航民股份	5,200	36,712.00	0.05
90	000600	建投能源	5,800	36,540.00	0.05
91	601838	成都银行	2,400	36,456.00	0.05
92	601058	赛轮轮胎	2,600	36,400.00	0.05
93	300638	广和通	2,100	35,910.00	0.05
94	600320	振华重工	10,500	35,910.00	0.05
95	600299	安迪苏	3,700	35,890.00	0.05
96	600420	国药现代	3,300	35,244.00	0.05
97	600502	安徽建工	8,100	34,830.00	0.05
98	600618	氯碱化工	3,900	34,242.00	0.05
99	002140	东华科技	4,400	34,100.00	0.05

100	000541	佛山照明	6,900	33,603.00	0.05
101	000513	丽珠集团	900	33,489.00	0.05
102	600581	八一钢铁	12,500	33,125.00	0.05
103	600284	浦东建设	6,200	33,108.00	0.05
104	002139	拓邦股份	3,100	32,922.00	0.05
105	000030	富奥股份	6,700	32,897.00	0.05
106	300140	节能环保	5,500	32,835.00	0.05
107	601003	柳钢股份	12,900	32,637.00	0.04
108	600761	安徽合力	1,500	32,460.00	0.04
109	600459	贵研铂业	2,400	32,424.00	0.04
110	000921	海信家电	1,000	32,240.00	0.04
111	688036	传音控股	420	32,146.80	0.04
112	600819	耀皮玻璃	7,500	31,650.00	0.04
113	603337	杰克股份	1,200	31,584.00	0.04
114	603766	隆鑫通用	4,600	31,188.00	0.04
115	300522	世名科技	2,800	30,940.00	0.04
116	300857	协创数据	500	28,500.00	0.04
117	300679	电连技术	700	28,161.00	0.04
118	000703	恒逸石化	3,900	27,651.00	0.04
119	600479	千金药业	2,700	27,459.00	0.04
120	601601	中国太保	900	25,074.00	0.03
121	301280	珠城科技	600	23,280.00	0.03
122	002850	科达利	300	22,914.00	0.03
123	002008	大族激光	1,100	22,880.00	0.03
124	300207	欣旺达	1,500	22,755.00	0.03
125	601963	重庆银行	2,800	21,700.00	0.03
126	601665	齐鲁银行	4,300	21,113.00	0.03
127	002340	格林美	3,300	21,021.00	0.03
128	600028	中国石化	3,300	20,856.00	0.03
129	601318	中国平安	500	20,680.00	0.03
130	601577	长沙银行	2,500	20,450.00	0.03
131	601668	中国建筑	3,800	20,178.00	0.03
132	603501	韦尔股份	200	19,874.00	0.03
133	002106	莱宝高科	1,800	19,620.00	0.03
134	600704	物产中大	4,500	19,530.00	0.03
135	601166	兴业银行	1,100	19,382.00	0.03
136	688253	英诺特	500	19,055.00	0.03
137	601818	光大银行	6,000	19,020.00	0.03
138	002128	电投能源	900	18,990.00	0.03
139	600585	海螺水泥	800	18,872.00	0.03
140	600578	京能电力	5,800	18,792.00	0.03
141	600926	杭州银行	1,400	18,270.00	0.03
142	601636	旗滨集团	2,800	18,060.00	0.02

143	600153	建发股份	2,000	17,860.00	0.02
144	000709	河钢股份	9,100	17,654.00	0.02
145	600177	雅戈尔	2,400	17,088.00	0.02
146	002601	龙佰集团	900	16,713.00	0.02
147	002225	濮耐股份	4,000	16,360.00	0.02
148	002276	万马股份	1,300	9,321.00	0.01
149	688166	博瑞医药	75	2,625.00	0.00
150	002016	世荣兆业	300	1,848.00	0.00
151	688599	天合光能	100	1,692.00	0.00
152	300101	振芯科技	100	1,477.00	0.00
153	300872	天阳科技	100	1,325.00	0.00
154	300244	迪安诊断	100	1,200.00	0.00
155	002096	易普力	100	1,190.00	0.00
156	688073	毕得医药	33	982.74	0.00
157	688472	阿特斯	93	946.74	0.00
158	002911	佛燃能源	70	639.80	0.00
159	600037	歌华有线	100	598.00	0.00
160	601669	中国电建	100	559.00	0.00
161	600905	三峡能源	100	436.00	0.00
162	002687	乔治白	64	268.80	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	600985	淮北矿业	964,390.93	0.58
2	600312	平高电气	437,810.00	0.26
3	600019	宝钢股份	433,127.00	0.26
4	000932	华菱钢铁	411,413.00	0.25
5	002422	科伦药业	386,307.00	0.23
6	600971	恒源煤电	380,964.00	0.23
7	300001	特锐德	347,444.00	0.21
8	002687	乔治白	335,485.00	0.20
9	300703	创源股份	317,983.00	0.19
10	603283	赛腾股份	315,840.00	0.19
11	603337	杰克股份	311,271.00	0.19
12	000920	沃顿科技	309,466.00	0.19
13	600188	兖矿能源	303,884.00	0.18
14	601717	郑煤机	294,147.00	0.18
15	002236	大华股份	292,812.00	0.18
16	600398	海澜之家	290,468.00	0.17
17	601318	中国平安	287,798.00	0.17
18	688169	石头科技	284,006.50	0.17

19	000404	长虹华意	281,976.00	0.17
20	000521	长虹美菱	277,289.00	0.17

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	600985	淮北矿业	939,419.68	0.56
2	600019	宝钢股份	532,819.28	0.32
3	603283	赛腾股份	472,290.00	0.28
4	600971	恒源煤电	425,600.00	0.25
5	000932	华菱钢铁	414,613.00	0.25
6	600312	平高电气	410,644.00	0.25
7	002687	乔治白	391,385.00	0.23
8	000404	长虹华意	390,196.00	0.23
9	300001	特锐德	381,266.00	0.23
10	600282	南钢股份	376,804.00	0.23
11	601058	赛轮轮胎	365,360.52	0.22
12	000521	长虹美菱	353,743.00	0.21
13	601666	平煤股份	353,210.00	0.21
14	002588	史丹利	352,846.00	0.21
15	688169	石头科技	349,820.41	0.21
16	600519	贵州茅台	340,647.00	0.20
17	002367	康力电梯	340,139.00	0.20
18	000880	潍柴重机	329,923.00	0.20
19	601857	中国石油	319,649.00	0.19
20	002236	大华股份	317,609.00	0.19

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	50,805,231.25
卖出股票收入（成交）总额	59,496,740.83

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	4,571,555.48	6.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,421,964.99	11.59

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	46,375,440.78	63.82
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,001,909.09	19.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	73,370,870.34	100.97

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	188883	21 铁投 01	65,000	6,654,378.74	9.16
2	115003	23 海通 03	60,000	6,088,651.40	8.38
3	188889	21 中关 05	50,000	5,117,329.04	7.04
4	188918	国电投 13	50,000	5,109,915.89	7.03
5	188790	21 电建 05	50,000	5,107,802.74	7.03

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 11 月 7 日，海通证券股份有限公司因在保荐某公司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的监督管理措施。

2023 年 11 月 17 日，海通证券股份有限公司作为保荐机构之一，因在开展募集资金核查时未能真实、准确反映募集资金管理使用情况，被湖北证监局采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。同时，由于海通证券作为时任持续督导保荐机构，在持续督导期内未能勤勉尽责，被上海证券交易所予以监管警示。

2024 年 1 月 5 日，海通证券股份有限公司因以下违法违规事实：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深圳证券交易所报告，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等违规情形，被上海证监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因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，被上海证券交易所予以监管谈话。

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，被上海证监局采取责令处分有关人员的措施。

2024 年 4 月 12 日，海通证券股份有限公司收到中国证监会《立案告知书》。因该公司在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，被中国证监会立案；2024 年 4 月 30 日，海通证券股份有限公司受到中国证监会行政处罚决定书，没收海通证券股份有限公司违法所得 789,445.21 元，并处以 6,975,000 元罚款。

2024 年 4 月 24 日，海通证券股份有限公司作为债券主承销商和受托管理人，因存在违规行为，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，海通证券股份有限公司作为债券主承销商和受托管理人，因存在违规行为，被上海证券交易所予以书面警示。

2024 年 4 月 29 日，海通证券股份有限公司因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等违规行为，被上海证监局采取责令改正的监督管理措施。

2024 年 5 月 6 日，海通证券股份有限公司因保荐核查工作履职尽责不到位、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 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 7 月 7 日，中信证券股份有限公司因在 2023 年 6 月 19 日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，被深圳证监局采取出具警示函的行政监管措施；2023 年 8 月 29 日，中信证券股份有限公司因在交易及相关系统管理方面存在信息系统设备可靠性管理疏漏、安全运行管理制度执行不到位等问题，被上海证券交易所采取书面警示的监管措施；2023 年 9 月 22 日，中信证券股份有限公司因存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2023 年 9 月 22 日，中信证券股份有限公司在担任重大资产重组财务顾问过程中存在违规情形，被中国证监会采取监管谈话的行政监管措施。

2024 年 1 月 12 日，中信证券股份有限公司因保荐的可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50%以上，被中国证监会采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 4 月 12 日，中信证券股份有限公司因在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》；2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司违反限制性规定转让股票的行为被中国证监会合计没收违法所得 1,910,680.83 元，并处以 23,250,000 元罚款。

2024 年 4 月 30 日，中信证券股份有限公司因在担任首次公开发行股票并在创业板上市项目保荐人过程中存在违规行为，被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024 年 5 月 8 日，中信证券股份有限公司作为广东泉为科技股份有限公司首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在违规行为，被广东证监局采取出具警示函的行政监管措施。

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	7,181.74
2	应收清算款	1,000,167.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	249.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,007,598.80

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	113042	上银转债	2,841,837.67	3.91
2	110059	浦发转债	2,756,884.25	3.79
3	113056	重银转债	1,952,265.21	2.69
4	113044	大秦转债	962,120.77	1.32
5	113052	兴业转债	865,741.37	1.19
6	123107	温氏转债	630,995.21	0.87
7	127018	本钢转债	543,152.62	0.75
8	132026	G 三峡 EB2	323,641.44	0.45
9	127045	牧原转债	272,203.49	0.37
10	113641	华友转债	253,667.53	0.35
11	113055	成银转债	251,888.22	0.35
12	127015	希望转债	212,315.45	0.29
13	113024	核建转债	198,644.79	0.27
14	123114	三角转债	196,622.47	0.27
15	127016	鲁泰转债	181,211.92	0.25
16	110075	南航转债	148,780.96	0.20
17	113634	珀莱转债	135,259.32	0.19
18	127022	恒逸转债	132,871.15	0.18
19	127032	苏行转债	125,703.01	0.17
20	111011	冠盛转债	122,838.24	0.17
21	113623	凤 21 转债	111,461.55	0.15
22	128129	青农转债	106,425.34	0.15
23	127049	希望转 2	103,502.58	0.14
24	113631	皖天转债	101,271.23	0.14
25	127073	天赐转债	100,933.15	0.14

26	111010	立昂转债	77,469.67	0.11
27	113050	南银转债	75,247.25	0.10
28	113066	平煤转债	75,041.90	0.10
29	127084	柳工转 2	74,752.08	0.10
30	127050	麒麟转债	67,159.25	0.09

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

份额级别	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 (%)
农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	984	51,915.41	0.00	0.00	51,084,764.83	100.00
农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	918	21,491.02	190,068.40	0.96	19,538,689.19	99.04
合计	1,902	37,231.08	190,068.40	0.27	70,623,454.02	99.73

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	67,915.87	0.1329
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	17,986.64	0.0912
	合计	85,902.51	0.1213

注：从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	0~10
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	0
	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银瑞云增益 6 个月持有混合 A	农银瑞云增益 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 21 日) 基金份额总额	197,909,008.87	73,259,176.14
本报告期期初基金份额总额	113,816,485.72	51,344,283.68
本报告期基金总申购份额	337,718.41	411,851.68
减：本报告期基金总赎回份额	63,069,439.30	32,027,377.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	51,084,764.83	19,728,757.59

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，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国金证券	2	31,832,372.50	29.05	23,743.36	29.05	-
东方证券	2	24,606,302.19	22.45	18,354.00	22.45	-

华创证券	2	17,789,561.10	16.23	13,269.71	16.23	-
中信建投证券	2	17,087,734.82	15.59	12,745.83	15.59	-
国海证券	2	10,219,545.32	9.32	7,622.50	9.32	-
中信证券	2	6,504,352.08	5.93	4,851.63	5.93	-
长江证券	2	1,554,226.14	1.42	1,159.32	1.42	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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 (%)
国金证券	7,973,153.00	10.51	506,100,000.00	20.29	-	-
东方证券	23,282,753.14	30.68	824,500,000.00	33.06	-	-
华创证券	1,492,183.28	1.97	118,500,000.00	4.75	-	-
中信建	12,378,743	16.31	223,200,000.00	8.95	-	-

投证券	.35		00			
国海证 券	21,444,864 .86	28.26	366,400,000. 00	14.69	-	-
中信证 券	7,175,573. 50	9.46	99,500,000.0 0	3.99	-	-
长江证 券	2,134,012. 52	2.81	355,900,000. 00	14.27	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 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	农银汇理瑞云增益 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	农银汇理瑞云增益 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	农银汇理瑞云增益 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	农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混 合型证券投资基金-招募说明书更新 -2024 年第 1 次	证券时报、基金管理人 网站	2024 年 6 月 28 日
5	农银汇理瑞云增益 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、《农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理瑞云增益 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、营业执照；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

12.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日