

农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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
§ 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的真实、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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
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	46

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	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.11 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 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	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
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	52
§ 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	53
12.1 备查文件目录	53
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	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金	
基金简称	农银瑞泽添利债券	
基金主代码	017017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	198,396,415.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银瑞泽添利债券 A	农银瑞泽添利债券 C
下属分级基金的交易代码	017017	017018
报告期末下属分级基金的份额总额	181,550,715.89 份	16,845,699.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性和严格控制风险的基础上，综合利用多种投资策略，实现基金资产的长期稳定增值。
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*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于股票型、混合型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	滕菲菲
	联系电话	021-61095588	4006800000
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		021-61095599	95558
传真		021-61095556	010-85230024

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	黄涛	方合英

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)	
	农银瑞泽添利债券 A	农银瑞泽添利债券 C
本期已实现收益	1,722,956.01	258,981.04
本期利润	2,400,483.01	369,372.57
加权平均基金份额 本期利润	0.0140	0.0167
本期加权平均净 值利润率	1.37%	1.64%
本期基金份额净 值增长率	1.54%	1.34%
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	6,408,376.04	488,196.21
期末可供分配基 金份额利润	0.0353	0.0290

期末基金资产净值	187,959,091.93	17,333,895.81
期末基金份额净值	1.0353	1.0290
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	3.53%	2.90%

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

农银瑞泽添利债券 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	-0.13%	0.14%	0.25%	0.05%	-0.38%	0.09%
过去三个月	1.00%	0.15%	0.75%	0.07%	0.25%	0.08%
过去六个月	1.54%	0.21%	2.31%	0.09%	-0.77%	0.12%
过去一年	1.54%	0.17%	1.96%	0.09%	-0.42%	0.08%
自基金合同生效起至今	3.53%	0.15%	3.38%	0.09%	0.15%	0.06%

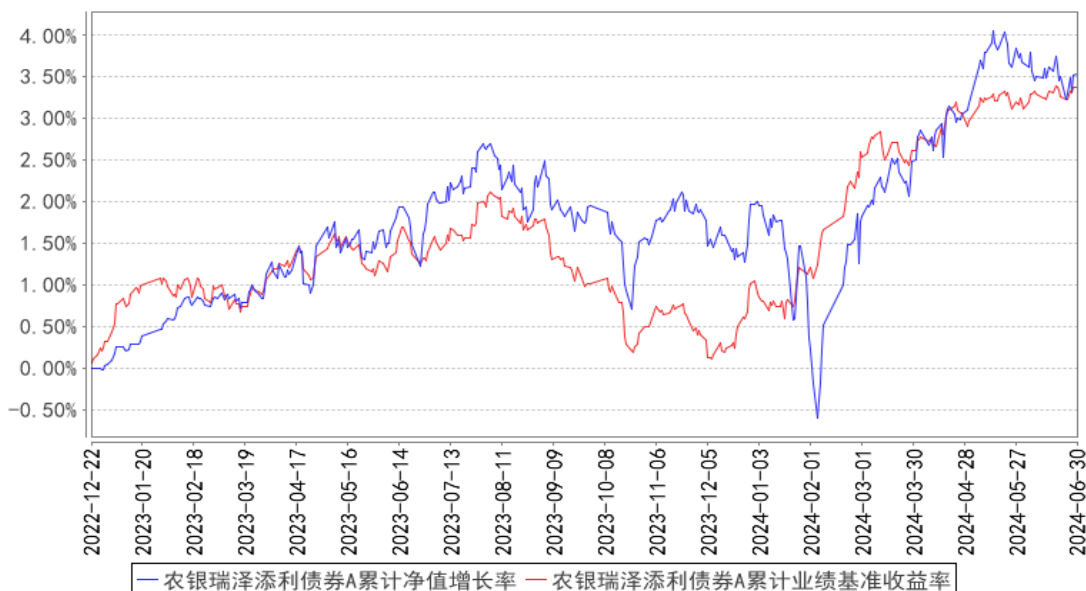
农银瑞泽添利债券 C

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	-0.16%	0.14%	0.25%	0.05%	-0.41%	0.09%
过去三个月	0.91%	0.16%	0.75%	0.07%	0.16%	0.09%
过去六个月	1.34%	0.21%	2.31%	0.09%	-0.97%	0.12%
过去一年	1.13%	0.17%	1.96%	0.09%	-0.83%	0.08%

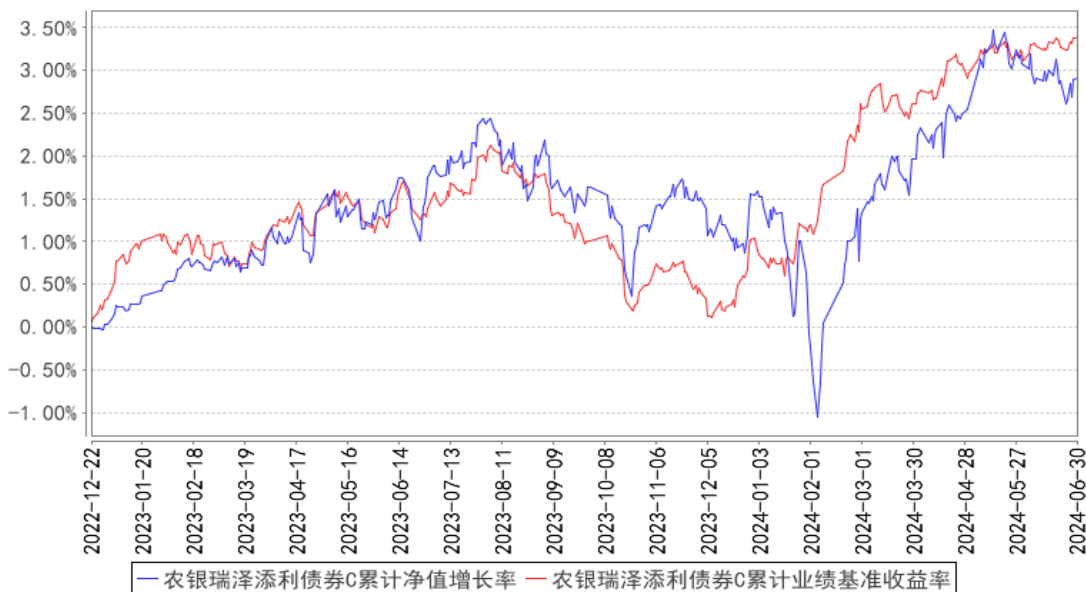
自基金合同生效 起至今	2.90%	0.15%	3.38%	0.09%	-0.48%	0.06%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

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

农银瑞泽添利债券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



农银瑞泽添利债券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（包括主板，创业板及其他经中国证监会核准，注册发行的股票），债券（包括国债，金融债，公司债，企业债，可转换债券，可交换债券，地方政府债券，政府支持债券，政府支持机构债券，央行票据，中期票据，短期融资券，超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券），资产支持证券，债券回购，同业存单，银行存款（包含协议存款，定期存款及其他银行存款），货币市场工具，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)。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:债券资产占基金资产的比例不低于 80%;投资于股票,可转换债券和可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,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(2022 年 12 月 22 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。

§ 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		
钱大千	本基金的基金经理	2022 年 12 月 22 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。
刘莎莎	本基金的基金经理、公司固定收益部副总经理	2022 年 12 月 22 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。

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，权益资产方面，股票仓位调整到 13%。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。

债券资产方面，组合久期在 2-3 年灵活调整。二季度抓住长端利率调整机会，拉长组合久期，近期获利了结。央行展开借券业务，控制收益率曲线，后续仍有波段机会。

当前债券仓位 93% 左右，留出波段操作空间。目前信用债利差较窄，杠杆套息空间不大，待市场调整后再做积极操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 基金份额净值为 1.0353 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 2.31%；截至本报告期末本基金 C 基金份额净值为 1.0290 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.34%，业绩比较基准收益率为 2.31%。

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应用性的情况、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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，农银汇理基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金

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	11,099,759.97	25,709,712.97
结算备付金		3,123,757.34	2,421,053.81
存出保证金		21,258.76	27,255.69
交易性金融资产	6.4.7.2	244,021,608.30	252,393,367.92
其中：股票投资		29,672,800.14	34,161,819.48
基金投资		-	-
债券投资		214,348,808.16	218,231,548.44
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	10,100,000.00	19,000,000.00
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		2,723,221.69	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,999,309.94	13,415,670.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		276,088,916.00	312,967,060.63
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		45,010,199.91	56,051,693.17
应付清算款		13,077,522.47	23,143,645.35
应付赎回款		12,399,400.71	2,373,236.85
应付管理人报酬		106,030.60	99,593.59
应付托管费		17,671.75	16,598.94
应付销售服务费		6,465.33	21,521.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,006.88	3,177.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	173,630.61	316,955.92
负债合计		70,795,928.26	82,026,422.55

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	198,396,415.49	226,622,846.14
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,896,572.25	4,317,791.94
净资产合计		205,292,987.74	230,940,638.08
负债和净资产总计		276,088,916.00	312,967,060.63

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 198,396,415.49 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0353 元，基金份额总额 181,550,715.89 份；下属 C 类基金份额净值 1.0290 元，基金份额总额 16,845,699.60 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金

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		3,902,757.46	7,002,352.09
1. 利息收入		31,984.64	442,794.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,718.33	42,594.65
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		11,266.31	400,199.80
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,958,760.36	6,540,533.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,562,644.82	1,079,430.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,104,797.32	5,220,716.13
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	416,607.86	240,386.24
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	787,918.53	-70,643.02
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	124,093.93	89,667.39
减：二、营业总支出		1,132,901.88	1,687,532.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	589,605.12	884,831.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,267.56	147,471.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	44,938.24	366,921.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		285,774.53	180,526.84
其中：卖出回购金融资产支出		285,774.53	180,526.84
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,892.82	7,421.61
8. 其他费用	6.4.7.23	111,423.61	100,359.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,769,855.58	5,314,819.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,769,855.58	5,314,819.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,769,855.58	5,314,819.18

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金

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	226,622,846.14	-	4,317,791.94	230,940,638.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	226,622,846.14	-	4,317,791.94	230,940,638.08

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,226,430.65	-	2,578,780.31	-25,647,650.34
(一)、综合收益总额	-	-	2,769,855.58	2,769,855.58
(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)	-28,226,430.65	-	-191,075.27	-28,417,505.92
其中：1. 基金申购款	97,688,777.43	-	2,509,955.34	100,198,732.77
2. 基金赎回款	- 125,915,208.08	-	-2,701,030.61	-128,616,238.69
(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	198,396,415.49	-	6,896,572.25	205,292,987.74
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	476,207,513.72	-	169,047.56	476,376,561.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	476,207,513.72	-	169,047.56	476,376,561.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 290,790,716.69	-	3,262,023.00	-287,528,693.69
(一)、综合收益总额	-	-	5,314,819.18	5,314,819.18

(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)	- 290,790,716.69	-	-2,052,796.18	-292,843,512.87
其中：1. 基金申购款	134,109,266.01	-	2,219,046.93	136,328,312.94
2. 基金赎回款	- 424,899,982.70	-	-4,271,843.11	-429,171,825.81
(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	185,416,797.03	-	3,431,070.56	188,847,867.59

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：

<u>程昆</u>	<u>毕宏燕</u>	<u>丁煜琼</u>
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

农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]第 2475 号《关于准予农银汇理瑞泽添利债券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《农银汇理瑞泽添利债券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 476,093,554.34 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(2022)第 1038 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 476,207,513.72 份基金份额,其中认购资金利息折合

113,959.38 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金基金合同》和《农银汇理瑞泽添利债券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。在投资人认/申购基金时收取认购/申购费，并不再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；从本类别基金资产中计提销售服务费，投资者认购/申购时不收取认购费/申购费，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理瑞泽添利债券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(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票)、债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于股票、可转换债券和可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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	11,099,759.97
等于：本金	11,099,568.51
加：应计利息	191.46
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	11,099,759.97

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	30,496,797.49	-	29,672,800.14	-823,997.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	70,217,525.78	912,850.08	71,347,257.58	216,881.72
	银行间市场	140,230,920.02	1,888,330.58	143,001,550.58	882,299.98
	合计	210,448,445.80	2,801,180.66	214,348,808.16	1,099,181.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		240,945,243.29	2,801,180.66	244,021,608.30	275,184.35

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	10,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,100,000.00	-

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	86,609.13
其中：交易所市场	83,007.13
银行间市场	3,602.00
应付利息	-
预提费用	87,021.48
合计	173,630.61

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

农银瑞泽添利债券 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	195,356,798.75	195,356,798.75
本期申购	78,620,989.77	78,620,989.77
本期赎回（以“-”号填列）	-92,427,072.63	-92,427,072.63
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	181,550,715.89	181,550,715.89
-----	----------------	----------------

农银瑞泽添利债券 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	31,266,047.39	31,266,047.39
本期申购	19,067,787.66	19,067,787.66
本期赎回(以“-”号填列)	-33,488,135.45	-33,488,135.45
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	16,845,699.60	16,845,699.60

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

农银瑞泽添利债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,064,850.43	-1,229,248.65	3,835,601.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,064,850.43	-1,229,248.65	3,835,601.78
本期利润	1,722,956.01	677,527.00	2,400,483.01
本期基金份额交易产生的变动数	-133,850.17	306,141.42	172,291.25
其中：基金申购款	2,038,200.25	158,905.85	2,197,106.10
基金赎回款	-2,172,050.42	147,235.57	-2,024,814.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,653,956.27	-245,580.23	6,408,376.04

农银瑞泽添利债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	680,425.47	-198,235.31	482,190.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	680,425.47	-198,235.31	482,190.16
本期利润	258,981.04	110,391.53	369,372.57
本期基金份额交易产	-427,337.23	63,970.71	-363,366.52

生的变动数			
其中：基金申购款	262,545.35	50,303.89	312,849.24
基金赎回款	-689,882.58	13,666.82	-676,215.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	512,069.28	-23,873.07	488,196.21

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	4,625.34
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	14,788.35
其他	1,304.64
合计	20,718.33

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	121,489,472.38
减：卖出股票成本总额	122,778,661.24
减：交易费用	273,455.96
买卖股票差价收入	-1,562,644.82

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	2,888,912.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,215,885.13
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	4,104,797.32

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	166,426,323.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	162,029,166.46
减：应计利息总额	3,175,559.64
减：交易费用	5,712.06
买卖债券差价收入	1,215,885.13

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	416,607.86
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	416,607.86

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	787,918.53
股票投资	-394,367.09
债券投资	1,182,285.62
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	787,918.53

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	121,294.48
基金转换费收入	2,799.45
合计	124,093.93

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	5,802.13
账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	111,423.61

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	589,605.12	884,831.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,552.10	321,808.02
应支付基金管理人的净管理费	497,053.02	563,023.23

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×0.60%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×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	98,267.56	147,471.82

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值×0.10%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×0.10%/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		
	农银瑞泽添利债券 A	农银瑞泽添利债券 C	合计
农业银行	-	23,534.60	23,534.60
中信银行	-	7,616.14	7,616.14
农银汇理	-	0.16	0.16
合计	-	31,150.90	31,150.90
	上年度可比期间		

获得销售服务费的各关联方名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银瑞泽添利债券 A	农银瑞泽添利债券 C	合计
农业银行	-	218,000.12	218,000.12
中信银行	-	28,611.65	28,611.65
农银汇理	-	52,573.02	52,573.02
合计	-	299,184.79	299,184.79

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：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 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
中信银行	11,099,759.97	4,625.34	1,279,313.15	16,484.60

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管，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 45,010,199.91 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	32,146,439.29	7,004,239.23
合计	32,146,439.29	7,004,239.23

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	130,188,380.07	134,192,986.73
AAA 以下	4,908,466.29	1,553,023.53
未评级	47,105,522.51	75,481,298.95
合计	182,202,368.87	211,227,309.21

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	11,099,759.97	-	-	-	11,099,759.97
结算备付金	3,123,757.34	-	-	-	3,123,757.34
存出保证金	21,258.76	-	-	-	21,258.76
交易性金融资产	114,799,269.13	76,883,789.28	22,665,749.75	29,672,800.14	244,021,608.30
买入返售金融资产	10,100,000.00	-	-	-	10,100,000.00
应收申购款	4,999,299.94	-	-	10.00	4,999,309.94
应收清算款	-	-	-	2,723,221.69	2,723,221.69

资产总计	144,143,345.14	76,883,789.28	22,665,749.75	32,396,031.83	276,088,916.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,399,400.71	12,399,400.71
应付管理人报酬	-	-	-	106,030.60	106,030.60
应付托管费	-	-	-	17,671.75	17,671.75
应付清算款	-	-	-	13,077,522.47	13,077,522.47
卖出回购金融资产款	45,010,199.91	-	-	-	45,010,199.91
应付销售服务费	-	-	-	6,465.33	6,465.33
应交税费	-	-	-	5,006.88	5,006.88
其他负债	-	-	-	173,630.61	173,630.61
负债总计	45,010,199.91	-	-	25,785,728.35	70,795,928.26
利率敏感度缺口	99,133,145.23	76,883,789.28	22,665,749.75	6,610,303.48	205,292,987.74
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	25,709,712.97	-	-	-	25,709,712.97
结算备付金	2,421,053.81	-	-	-	2,421,053.81
存出保证金	27,255.69	-	-	-	27,255.69
交易性金融资产	59,328,131.70	108,628,373.15	50,275,043.59	34,161,819.48	252,393,367.92
买入返售金融资产	19,000,000.00	-	-	-	19,000,000.00
应收申购款	13,401,251.02	-	-	14,419.22	13,415,670.24
资产总计	119,887,405.19	108,628,373.15	50,275,043.59	34,176,238.70	312,967,060.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,373,236.85	2,373,236.85
应付管理人报酬	-	-	-	99,593.59	99,593.59
应付托管费	-	-	-	16,598.94	16,598.94
应付清算款	-	-	-	23,143,645.35	23,143,645.35
卖出回购金融资产款	56,051,693.17	-	-	-	56,051,693.17
应付销售服务费	-	-	-	21,521.68	21,521.68
应交税费	-	-	-	3,177.05	3,177.05
其他负债	-	-	-	316,955.92	316,955.92
负债总计	56,051,693.17	-	-	25,974,729.38	82,026,422.55
利率敏感度缺口	63,835,712.02	108,628,373.15	50,275,043.59	8,201,509.32	230,940,638.08

注：按照合同约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 个基点		-1,135,036.94	-1,923,000.56
市场利率下降 25 个基点		1,135,036.94	1,923,000.56

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	29,672,800.14	14.45	34,161,819.48	14.79
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	29,672,800.14	14.45	34,161,819.48	14.79

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	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%		13,629,081.48
业绩比较基准下降 5%		-13,629,081.48	-12,378,039.90

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	42,305,109.91	42,460,625.15
第二层次	201,716,498.39	209,932,742.77
第三层次	-	-
合计	244,021,608.30	252,393,367.92

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	29,672,800.14	10.75
	其中：股票	29,672,800.14	10.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	214,348,808.16	77.64
	其中：债券	214,348,808.16	77.64
	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	10,100,000.00	3.66
	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	14,223,517.31	5.15
8	其他各项资产	7,743,790.39	2.80
9	合计	276,088,916.00	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	91,560.00	0.04
B	采矿业	1,641,797.00	0.80
C	制造业	21,358,900.06	10.40
D	电力、热力、燃气及水生产和	760,452.00	0.37

	供应业		
E	建筑业	1,002,789.00	0.49
F	批发和零售业	398,069.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,008,907.40	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	891,130.68	0.43
J	金融业	2,007,365.00	0.98
K	房地产业	2,464.00	0.00
L	租赁和商务服务业	73,226.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	436,140.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,672,800.14	14.45

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	601398	工商银行	81,000	461,700.00	0.22
2	601601	中国太保	16,100	448,546.00	0.22
3	600023	浙能电力	58,200	413,802.00	0.20
4	601800	中国交建	43,100	385,314.00	0.19
5	603556	海兴电力	7,900	369,957.00	0.18
6	600377	宁沪高速	28,000	352,800.00	0.17
7	000333	美的集团	5,300	341,850.00	0.17
8	600582	天地科技	48,300	332,787.00	0.16
9	600282	南钢股份	66,500	331,170.00	0.16
10	000830	鲁西化工	27,900	323,361.00	0.16
11	300760	迈瑞医疗	1,100	320,001.00	0.16
12	601156	东航物流	15,600	317,460.00	0.15
13	601233	桐昆股份	19,800	316,008.00	0.15
14	301187	欧圣电气	12,900	312,825.00	0.15
15	002327	富安娜	30,000	301,500.00	0.15
16	002422	科伦药业	9,700	294,201.00	0.14
17	605007	五洲特纸	23,100	291,753.00	0.14

18	601225	陕西煤业	11,100	286,047.00	0.14
19	300705	九典制药	10,680	285,583.20	0.14
20	601728	中国电信	45,700	281,055.00	0.14
21	000338	潍柴动力	17,300	280,952.00	0.14
22	688036	传音控股	3,640	278,605.60	0.14
23	002594	比亚迪	1,100	275,275.00	0.13
24	002001	新和成	14,300	274,560.00	0.13
25	601058	赛轮轮胎	19,600	274,400.00	0.13
26	600285	羚锐制药	11,200	271,152.00	0.13
27	002475	立讯精密	6,800	267,308.00	0.13
28	603605	珀莱雅	2,400	266,376.00	0.13
29	600690	海尔智家	9,200	261,096.00	0.13
30	600054	黄山旅游	23,000	258,060.00	0.13
31	600210	紫江企业	48,500	258,020.00	0.13
32	002215	诺普信	33,500	249,575.00	0.12
33	601717	郑煤机	16,800	248,640.00	0.12
34	603258	电魂网络	15,300	247,095.00	0.12
35	002997	瑞鹄模具	7,700	246,169.00	0.12
36	688766	普冉股份	2,520	244,868.40	0.12
37	601179	中国西电	30,200	242,808.00	0.12
38	300502	新易盛	2,300	242,765.00	0.12
39	000589	贵州轮胎	47,500	240,825.00	0.12
40	603408	建霖家居	18,100	238,739.00	0.12
41	601918	新集能源	24,000	234,000.00	0.11
42	000725	京东方 A	57,200	233,948.00	0.11
43	600489	中金黄金	15,600	230,880.00	0.11
44	000404	长虹华意	43,200	230,256.00	0.11
45	688578	艾力斯	3,600	229,464.00	0.11
46	000552	甘肃能化	66,000	229,020.00	0.11
47	603501	韦尔股份	2,300	228,551.00	0.11
48	000528	柳工	20,200	226,038.00	0.11
49	600480	凌云股份	22,600	222,158.00	0.11
50	603871	嘉友国际	12,460	220,417.40	0.11
51	603889	新澳股份	28,100	217,494.00	0.11
52	601038	一拖股份	13,700	216,597.00	0.11
53	600312	平高电气	11,000	213,950.00	0.10
54	601567	三星医疗	6,000	210,000.00	0.10
55	605333	沪光股份	7,400	206,090.00	0.10
56	600765	中航重机	10,000	204,000.00	0.10
57	688408	中信博	2,200	202,576.00	0.10
58	002906	华阳集团	7,500	200,700.00	0.10
59	300750	宁德时代	1,100	198,033.00	0.10
60	002053	云南能投	16,200	195,858.00	0.10

61	002223	鱼跃医疗	5,200	195,520.00	0.10
62	000409	云鼎科技	24,100	194,487.00	0.09
63	603733	仙鹤股份	10,900	191,622.00	0.09
64	300673	佩蒂股份	14,600	191,552.00	0.09
65	002979	雷赛智能	10,500	191,100.00	0.09
66	603348	文灿股份	6,900	191,061.00	0.09
67	003000	劲仔食品	15,600	187,980.00	0.09
68	603365	水星家纺	12,000	187,800.00	0.09
69	000065	北方国际	17,900	185,623.00	0.09
70	603809	豪能股份	22,644	182,963.52	0.09
71	300005	探路者	36,400	182,364.00	0.09
72	601336	新华保险	6,000	180,180.00	0.09
73	000913	钱江摩托	11,300	178,088.00	0.09
74	603099	长白山	8,000	178,080.00	0.09
75	000426	兴业银锡	13,000	176,540.00	0.09
76	601886	江河集团	36,000	175,680.00	0.09
77	300953	震裕科技	3,200	173,440.00	0.08
78	601939	建设银行	23,300	172,420.00	0.08
79	000400	许继电气	5,000	172,050.00	0.08
80	002835	同为股份	9,900	167,211.00	0.08
81	600487	亨通光电	10,300	162,431.00	0.08
82	002035	华帝股份	26,000	161,980.00	0.08
83	002415	海康威视	5,200	160,732.00	0.08
84	688256	寒武纪	789	156,750.63	0.08
85	600469	风神股份	24,600	143,664.00	0.07
86	300783	三只松鼠	6,400	139,968.00	0.07
87	600038	中直股份	3,400	139,774.00	0.07
88	002078	太阳纸业	9,900	138,105.00	0.07
89	000598	兴蓉环境	18,300	137,616.00	0.07
90	601126	四方股份	7,100	136,462.00	0.07
91	000630	铜陵有色	37,500	135,375.00	0.07
92	600938	中国海油	4,100	135,300.00	0.07
93	300308	中际旭创	980	135,122.40	0.07
94	600875	东方电气	7,300	134,685.00	0.07
95	000600	建投能源	21,300	134,190.00	0.07
96	600987	航民股份	18,900	133,434.00	0.06
97	300638	广和通	7,800	133,380.00	0.06
98	600320	振华重工	38,800	132,696.00	0.06
99	000726	鲁泰 A	20,000	132,400.00	0.06
100	601838	成都银行	8,700	132,153.00	0.06
101	603055	台华新材	13,000	131,690.00	0.06
102	600420	国药现代	12,300	131,364.00	0.06
103	600299	安迪苏	13,500	130,950.00	0.06

104	600398	海澜之家	14,000	129,360.00	0.06
105	002225	濮耐股份	31,400	128,426.00	0.06
106	600618	氯碱化工	14,400	126,432.00	0.06
107	002140	东华科技	16,100	124,775.00	0.06
108	000513	丽珠集团	3,300	122,793.00	0.06
109	600581	八一钢铁	46,200	122,430.00	0.06
110	000541	佛山照明	25,100	122,237.00	0.06
111	600284	浦东建设	22,700	121,218.00	0.06
112	600761	安徽合力	5,600	121,184.00	0.06
113	603337	杰克股份	4,600	121,072.00	0.06
114	002139	拓邦股份	11,400	121,068.00	0.06
115	000030	富奥股份	24,600	120,786.00	0.06
116	002674	兴业科技	11,800	120,596.00	0.06
117	601003	柳钢股份	47,600	120,428.00	0.06
118	600502	安徽建工	28,000	120,400.00	0.06
119	600459	贵研铂业	8,900	120,239.00	0.06
120	000921	海信家电	3,700	119,288.00	0.06
121	601598	中国外运	21,000	118,230.00	0.06
122	300140	节能环保	19,800	118,206.00	0.06
123	600819	耀皮玻璃	27,500	116,050.00	0.06
124	603766	隆鑫通用	17,100	115,938.00	0.06
125	600872	中炬高新	5,100	115,719.00	0.06
126	300856	科思股份	3,600	115,236.00	0.06
127	002237	恒邦股份	9,900	113,949.00	0.06
128	600887	伊利股份	4,400	113,696.00	0.06
129	300522	世名科技	10,200	112,710.00	0.05
130	605166	聚合顺	10,700	112,243.00	0.05
131	600188	兖矿能源	4,800	109,104.00	0.05
132	002273	水晶光电	6,400	108,672.00	0.05
133	300577	开润股份	5,200	108,316.00	0.05
134	000703	恒逸石化	14,700	104,223.00	0.05
135	300274	阳光电源	1,680	104,210.40	0.05
136	688009	中国通号	16,799	100,794.00	0.05
137	300729	乐歌股份	6,500	100,685.00	0.05
138	300433	蓝思科技	5,500	100,375.00	0.05
139	601899	紫金矿业	5,600	98,392.00	0.05
140	002714	牧原股份	2,100	91,560.00	0.04
141	601328	交通银行	11,400	85,158.00	0.04
142	300207	欣旺达	5,500	83,435.00	0.04
143	603816	顾家家居	2,500	80,725.00	0.04
144	300857	协创数据	1,400	79,800.00	0.04
145	601318	中国平安	1,900	78,584.00	0.04
146	600585	海螺水泥	3,300	77,847.00	0.04

147	002340	格林美	12,200	77,714.00	0.04
148	600028	中国石化	12,200	77,104.00	0.04
149	600926	杭州银行	5,900	76,995.00	0.04
150	601668	中国建筑	14,200	75,402.00	0.04
151	600578	京能电力	23,100	74,844.00	0.04
152	600153	建发股份	8,200	73,226.00	0.04
153	600704	物产中大	16,700	72,478.00	0.04
154	300679	电连技术	1,800	72,414.00	0.04
155	000709	河钢股份	37,200	72,168.00	0.04
156	002008	大族激光	3,400	70,720.00	0.03
157	301280	珠城科技	1,800	69,840.00	0.03
158	601818	光大银行	21,800	69,106.00	0.03
159	601166	兴业银行	3,900	68,718.00	0.03
160	688253	英诺特	1,800	68,598.00	0.03
161	601963	重庆银行	8,800	68,200.00	0.03
162	601665	齐鲁银行	13,800	67,758.00	0.03
163	601636	旗滨集团	10,500	67,725.00	0.03
164	601577	长沙银行	8,200	67,076.00	0.03
165	002128	电投能源	3,100	65,410.00	0.03
166	600177	雅戈尔	8,800	62,656.00	0.03
167	002601	龙佰集团	3,300	61,281.00	0.03
168	002850	科达利	700	53,466.00	0.03
169	301004	嘉益股份	500	45,500.00	0.02
170	002463	沪电股份	1,200	43,800.00	0.02
171	600079	人福医药	2,500	42,925.00	0.02
172	002276	万马股份	4,900	35,133.00	0.02
173	600036	招商银行	900	30,771.00	0.01
174	002003	伟星股份	1,600	20,080.00	0.01
175	688316	青云科技	100	2,991.00	0.00
176	300872	天阳科技	200	2,650.00	0.00
177	600406	国电南瑞	100	2,496.00	0.00
178	002016	世荣兆业	400	2,464.00	0.00
179	002156	通富微电	100	2,239.00	0.00
180	688030	山石网科	197	2,058.65	0.00
181	600479	千金药业	200	2,034.00	0.00
182	603208	江山欧派	100	1,914.00	0.00
183	600438	通威股份	100	1,911.00	0.00
184	688039	当虹科技	60	1,547.40	0.00
185	688505	复旦张江	184	1,177.60	0.00
186	688373	盟科药业	99	430.65	0.00
187	688382	益方生物	23	166.29	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	1,180,484.10	0.51
2	600019	宝钢股份	892,077.00	0.39
3	002422	科伦药业	868,419.00	0.38
4	600282	南钢股份	854,465.00	0.37
5	600312	平高电气	807,216.00	0.35
6	000521	长虹美菱	788,697.00	0.34
7	600971	恒源煤电	787,018.60	0.34
8	601800	中国交建	783,389.00	0.34
9	002367	康力电梯	779,168.00	0.34
10	601398	工商银行	761,463.00	0.33
11	600188	兖矿能源	750,347.00	0.32
12	000404	长虹华意	741,051.00	0.32
13	688036	传音控股	719,567.00	0.31
14	603337	杰克股份	707,334.00	0.31
15	000932	华菱钢铁	706,250.00	0.31
16	601038	一拖股份	663,018.00	0.29
17	603283	赛腾股份	654,788.00	0.28
18	002687	乔治白	632,756.00	0.27
19	002236	大华股份	615,471.00	0.27
20	300703	创源股份	613,575.98	0.27

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	1,191,434.00	0.52
2	600019	宝钢股份	1,131,938.00	0.49
3	603283	赛腾股份	990,104.00	0.43
4	002367	康力电梯	988,939.00	0.43
5	000521	长虹美菱	954,710.00	0.41
6	600282	南钢股份	943,017.00	0.41
7	600971	恒源煤电	886,831.00	0.38
8	002588	史丹利	861,478.00	0.37
9	000404	长虹华意	853,033.00	0.37
10	601666	平煤股份	750,805.00	0.33
11	002687	乔治白	733,449.78	0.32
12	000932	华菱钢铁	724,794.00	0.31

13	600519	贵州茅台	680,073.00	0.29
14	002236	大华股份	677,648.00	0.29
15	600312	平高电气	675,470.00	0.29
16	300001	特锐德	670,372.00	0.29
17	300218	安利股份	655,603.00	0.28
18	603337	杰克股份	647,729.00	0.28
19	000550	江铃汽车	628,455.00	0.27
20	600060	海信视像	615,008.00	0.27

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	118,684,008.99
卖出股票收入（成交）总额	121,489,472.38

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	12,508,682.80	6.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	65,843,577.94	32.07
	其中：政策性金融债	11,618,043.72	5.66
4	企业债券	46,206,265.01	22.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	47,557,009.38	23.17
7	可转债（可交换债）	12,632,309.77	6.15
8	同业存单	29,600,963.26	14.42
9	其他	-	-
10	合计	214,348,808.16	104.41

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

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	112493654	24 成都银行 CD052	300,000	29,600,963.26	14.42
2	160205	16 国开 05	100,000	11,618,043.72	5.66
3	2028051	20 浦发银行 永续债	100,000	10,654,453.55	5.19
4	2128025	21 建设银行 二级 01	100,000	10,588,836.07	5.16

5	102101838	21 鲁黄金 MTN008	100,000	10,295,010.93	5.01
---	-----------	------------------	---------	---------------	------

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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 22 日，中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品及代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料等十八项违法违规事实，被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计 3791.879382 万元。其中，总行 2041.879382 万元，分支机构 1750 万元。

2023 年 12 月 27 日，中国建设银行股份有限公司因并表管理内部审计存在不足、母行对境外机构案件管理不到位、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况及监管检查发现问题整改不力，被国家金融监督管理总局处以罚款 170 万元。

2023 年 11 月 15 日，上海银行股份有限公司因封闭式产品投资非标准化资产终止日期晚于产品到期日、理财产品老产品投资新资产的到期日晚于 2020 年等多项违法违规事实，被国家金融监督管理总局上海监管局责令改正，并处罚款共计 690 万元。

2023 年 11 月 27 日，上海银行股份有限公司因未尽审核办理股权转让购付汇业务，被国家外汇管理局上海市分局处以罚款 70 万元人民币，没收违法所得 2,572,326.64 元人民币。

2023 年 12 月 28 日，上海银行股份有限公司因以下违法违规事实：1. 未按规定提供报表；2. 未根据标的项目的实际进度和资金需求发放贷款，导致贷款资金被挪用；3. 个人贷款贷前调查严重违反审慎经营规则；4. 个人消费贷款违规流入股市，被国家金融监督管理总局上海监管局处以

罚款合计 145 万元。其中总行 15 万元，分支机构 130 万元。

2024 年 5 月 30 日，上海银行股份有限公司因境外机构重大投资事项未经行政许可，被国家金融监督管理总局上海监管局处罚款 80 万元。

2024 年 5 月 15 日，本钢板材股份有限公司因在 2019 年以前存在未及时结算代采原材料损耗、途耗情况，导致当期相关报表科目金额披露不准确，同时还存在采购业务缺乏独立性和会计档案管理不规范问题，被辽宁证监局采取出具警示函的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案；2024 年 5 月 17 日，本钢板材股份有限公司因上述有关问题被深圳证券交易所出具监管函。

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	21,258.76
2	应收清算款	2,723,221.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,999,309.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,743,790.39

7.11.4 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	123107	温氏转债	1,577,488.01	0.77
2	127018	本钢转债	1,180,766.58	0.58
3	113044	大秦转债	1,082,385.86	0.53
4	110059	浦发转债	992,478.33	0.48
5	113042	上银转债	738,877.79	0.36
6	127022	恒逸转债	490,601.16	0.24
7	111011	冠盛转债	409,460.79	0.20
8	123114	三角转债	393,244.93	0.19

9	127073	天赐转债	381,303.01	0.19
10	113631	皖天转债	379,767.12	0.18
11	113050	南银转债	376,236.25	0.18
12	127049	希望转 2	362,259.01	0.18
13	113634	珀莱转债	351,674.22	0.17
14	111017	蓝天转债	322,520.82	0.16
15	113623	凤 21 转债	322,000.03	0.16
16	123119	康泰转 2	321,115.90	0.16
17	113641	华友转债	304,401.04	0.15
18	113066	平煤转债	300,167.62	0.15
19	113052	兴业转债	270,544.18	0.13
20	127050	麒麟转债	268,636.99	0.13
21	127032	苏行转债	251,406.03	0.12
22	113055	成银转债	240,553.25	0.12
23	127016	鲁泰转债	203,863.41	0.10
24	127015	希望转债	191,083.91	0.09
25	127045	牧原转债	177,524.01	0.09
26	113516	苏农转债	175,967.56	0.09
27	127041	弘亚转债	172,808.84	0.08
28	113065	齐鲁转债	159,596.66	0.08
29	113666	爱玛转债	114,130.27	0.06
30	118043	福立转债	110,161.07	0.05
31	118031	天 23 转债	9,285.12	0.00

7.11.5 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 (%)
农银瑞泽添利债券 A	597	304,105.05	170,951,697.46	94.16	10,599,018.43	5.84
农银瑞泽添利债券 C	622	27,083.12	4,914,971.00	29.18	11,930,728.60	70.82

合计	1,219	162,753.42	175,866,668.46	88.64	22,529,747.03	11.36
----	-------	------------	----------------	-------	---------------	-------

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	农银瑞泽添利债券 A	362,866.71	0.1999
	农银瑞泽添利债券 C	244,948.33	1.4541
	合计	607,815.04	0.3064

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、基金投资和研究人员、基金投资和研究人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	农银瑞泽添利债券 A	0~10
	农银瑞泽添利债券 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	农银瑞泽添利债券 A	10~50
	农银瑞泽添利债券 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银瑞泽添利债券 A	农银瑞泽添利债券 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 22 日）基金份额总额	154,407,393.69	321,800,120.03
本报告期期初基金份额总额	195,356,798.75	31,266,047.39
本报告期基金总申购份额	78,620,989.77	19,067,787.66
减：本报告期基金总赎回份额	92,427,072.63	33,488,135.45

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	181,550,715.89	16,845,699.60

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,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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,中信银行股份有限公司托管业务未涉及诉讼。

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	公司已按照法律法规及监管要求及时完成整改工作。

提出整改意见)	
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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
国盛证券	1	59,186,160.79	24.73	55,985.57	28.37	-
德邦证券	2	56,517,149.00	23.62	42,155.84	21.36	-
申万宏源证券	2	46,940,861.88	19.62	35,012.60	17.74	-
长江证券	2	31,101,723.12	13.00	23,199.33	11.75	-
东吴证券	1	20,526,027.82	8.58	19,414.80	9.84	-
兴业证券	2	15,129,712.97	6.32	14,202.38	7.20	-
开源证券	2	9,906,567.10	4.14	7,389.81	3.74	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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(%)
国盛证券	10,209,563.02	22.55	749,000,000.00	30.17	-	-
德邦证券	9,937,056.57	21.94	364,700,000.00	14.69	-	-
申万宏源证券	1,463,534.13	3.23	34,200,000.00	1.38	-	-
长江证券	1,366,534.43	3.02	429,500,000.00	17.30	-	-
东吴证券	1,864,458.02	4.12	21,700,000.00	0.87	-	-
兴业证券	4,439,459.37	9.80	280,700,000.00	11.31	-	-
开源证券	16,003,626.85	35.34	602,500,000.00	24.27	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
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	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金 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	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2024 年 3 月 28 日
3	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金 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	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金--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	农银汇理瑞泽添利债券型证券投资	证券时报、基金管理人	2024 年 6 月 28 日

基金基金产品资料概要更新	网站
--------------	----

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-01-16 至 2024-03-28, 2024-04-03 至 2024-04-09, 2024-04-11 至 2024-05-27	39,435,078.38	0.00	0.00	39,435,078.38	19.88

产品特有风险

本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：

（一）赎回申请延期办理的风险

单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理或延缓支付的风险。

（二）基金净值大幅波动的风险

单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入（或舍去尾数）等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

（三）基金投资目标偏离的风险

单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

（四）基金合同提前终止的风险

单一投资者大额赎回后可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将面临根据基金合同的约定终止基金合同、清算或转型等风险。

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、《农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《农银汇理瑞泽添利债券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