

# 农银汇理双利回报债券型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 25 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 2023 年 8 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	8
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	16
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 .....	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.11 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理双利回报债券型证券投资基金	
基金简称	农银双利回报债券	
基金主代码	016327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 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	
报告期末基金份额总额	108,305,551.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	农银双利回报债券 A	农银双利回报债券 C
下属分级基金的交易代码	016327	016328
报告期末下属分级基金的份额总额	92,178,490.98 份	16,127,060.30 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	<p>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。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。</p> <p>2、债券等固定收益类资产的投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金债券投资管理将主要采取以下策略：</p> <p>（1）合理预计利率水平 对市场长期、中期和短期利率的正确预</p>

测是实现有效债券投资的基础。管理人将全面研究物价、就业、国际收支和政策变更等宏观经济运行状况，预测未来财政政策和货币政策等宏观经济政策走向，以此判断资金市场长期的供求关系变化。同时，通过具体分析货币供应量变动，M1 和 M2 增长率等因素判断中短期资金市场供求的趋势。在此基础上，管理人将对于市场利率水平的变动进行合理预测，对包括收益率曲线斜度等因素的变化进行科学预判。

(2) 灵活调整组合久期 管理人将在合理预测市场利率水平的基础上，在不同的市场环境下灵活调整组合的目标久期。当预期市场利率上升时，通过增加持有短期债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场利率下降时，通过增持长期债券等方式提高组合久期，以充分分享债券价格上升的收益。

(3) 科学配置投资品种 管理人将通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、央票、金融债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

(4) 谨慎选择个券 在具体券种的选择上，管理人主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估和流动性分析等方式，合理评估不同券种的风险收益水平。筛选出的券种一般具有流动性较好、符合目标久期、同等条件下信用质量较好或预期信用质量将得到改善、风险水平合理、有较好下行保护等特征。

(5) 信用债和资产支持证券投资投资策略

1) 信用债投资策略 本基金将充分借鉴外部的信用评级结果，并建立内部信用评级体系，根据对债券发行人及债券资信状况的分析，给发行主体和标的债券打分，给出各目标信用债券基于其综合得分的信用评级等级，并建立信用债备选库。基金管理人将密切跟踪发行人基本面的变化情况，通过卖方报告及实地调研等方式，对于发行人的行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险进行综合评价，从而得出信用债违约可能性和理论信用利差水平，并以此为基础进行债券定价，并投资于信用评级较高的个券。

2) 资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。同时，管理人将密切关注流动性对标的的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

3) 本基金投资于信用评级在 AA+及以上级别的信用债和资产支持证券。其中 AAA 级（包括 AAA-、AAA、AAA+）的信用债和资产支持证券投资比例不低于信用债和资产支持证券总体投资比例的

	<p>50%，AA+级的信用债和资产支持证券投资比例不超过信用债和资产支持证券总体投资比例的 50%。债券的信用等级以其债项评级为准，如无债项评级或债项评级为短期信用评级的，则以主体评级为准。相关资信评级机构需取得相关监管机构评级业务的许可。基金持有信用债期间，如其信用评级下降，不再符合投资标准，管理人在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。</p> <p>(6) 可转换债券和可交换债券投资策略 对于可转债投资，本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益，具体策略包括个券精选策略、条款价值发现策略、套利策略。对于可交换债，本基金将通过目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>在大类资产配置和行业配置的基础上，本基金研究市场流动性趋势，判断市场风险特征，将定性和定量方法相结合，对上市公司的投资价值进行综合评估，精选优质个股。</p> <p>(1) 定性分析 本基金将深入研究公司的基本面，遴选出具备核心竞争优势和长期持续增长模式的公司。本基金对上市公司的基本面的分析包括但不限于：资源禀赋与资源储备增长潜力、产品和服务的竞争力、产品和服务的生命周期、研发能力、营销能力、管理能力、财务状况、治理结构、发展战略等。</p> <p>(2) 定量分析 本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、盈利指标、营运能力指标、负债水平指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有相对优势的个股。A、成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；B、盈利指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等；C、营运能力指标：总资产周转率、存货周转率、应收账款周转率等；D、负债水平指标：资产负债率、流动比率、速动比率等；E、估值指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市销率（PS）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/摊销前利润（EV/EBITDA）等。</p> <p>4、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。</p> <p>5、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	<p>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%</p>

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	姜敏
	联系电话	021-61095588	4006800000
	电子邮箱	xuxin@abc-ca.com	jiangmin@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	朱鹤新

### 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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	农银双利回报债券 A	农银双利回报债券 C
本期已实现收益	442,313.23	162,496.01
本期利润	646,510.80	241,479.36
加权平均基金份额本期利润	0.0099	0.0040
本期加权平均净值利润率	0.98%	0.40%
本期基金份额净值	0.66%	0.57%



值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	721,333.15	102,461.35
期末可供分配基金份额利润	0.0078	0.0064
期末基金资产净值	93,085,880.92	16,262,093.73
期末基金份额净值	1.0098	1.0084
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.98%	0.84%

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

农银双利回报债券 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	0.67%	0.18%	0.28%	0.09%	0.39%	0.09%
过去三个月	0.56%	0.16%	0.33%	0.08%	0.23%	0.08%
过去六个月	0.66%	0.15%	1.06%	0.08%	-0.40%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.98%	0.12%	0.63%	0.10%	0.35%	0.02%

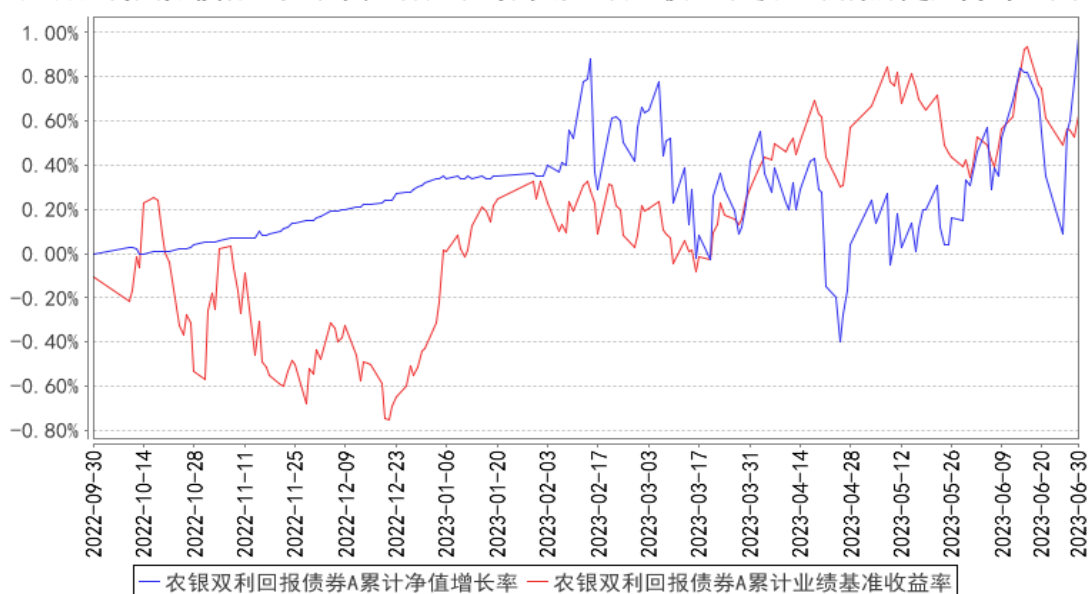
农银双利回报债券 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

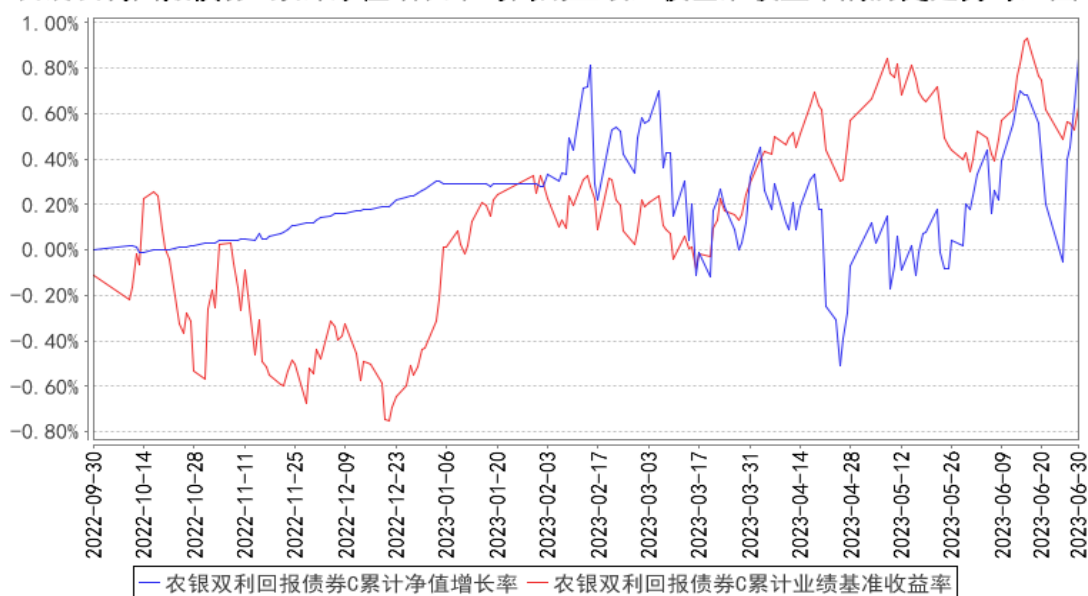
	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	0.66%	0.17%	0.28%	0.09%	0.38%	0.08%
过去三个月	0.52%	0.16%	0.33%	0.08%	0.19%	0.08%
过去六个月	0.57%	0.15%	1.06%	0.08%	-0.49%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.84%	0.12%	0.63%	0.10%	0.21%	0.02%

### 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

农银双利回报债券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



农银双利回报债券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：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%，本基金建仓期为基金合同生效日（2022 年 9 月 30 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 75 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）、农银汇理瑞祥一年持有期混合型发起式证券投资基金、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、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。

#### 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		
马逸钧	本基金的基金经理	2022 年 9 月 30 日	-	8 年	2011 年 7 月至 2014 年 8 月任交通银行股份有限公司客户经理；2014 年 9 月至 2016 年 10 月就职于国泰君安股份有限公司，从事资金管理及相关研究工作；2016 年 11 月至 2018 年 8 月就职于上海华信证券有限责任公司，从事投资与交易工作；2018 年 8 月起于农银汇理基金管理有限公司从事投资研究工作；现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
钱大千	本基金的基金经理	2023 年 2 月 3 日	-	12 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	2023 年 2 月 3 日	-	14 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遵规守信情况的说明

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

上半年海外来看，美国增长韧性较强，联储延续鹰派强调两次加息，美债回落，美元指数微升，汇率贬值逼近 7.3。国内经济下行斜率最快阶段或已过，5 月工业企业盈利降幅边际收窄，6 月 PMI 景气低位弱回升，疫后复苏的季节性规律和库存周期看，下半年经济环比企稳概率较大。国常会要求采取更加有力的措施，增强发展动能，央行重提要加大逆周期调节力度，组合拳有望陆续出台。从高频数据来看，信心下行仍制约消费，地产销售仍在趋势性转冷，投资和生产处于淡季，积极信号是制造业开始回升。总体来看，一季度基本面低位反弹后，4、5 月单月数据走弱，近期环比企稳，稳增长信号增多，二季度央行货币政策报告重提逆周期调节，后续政策工具空间打开。

上半年债券市场先上后下，一季度信用利差下行，二季度信用利差维持低位，同时利率震荡下行。股票市场在经历一月份的修复后震荡下行，价值、成长风格快速轮动，核心资产调整幅度较大。

组合中债券主要为利率债及少量信用债中短久期，负债端稳定的前提下，整体维持 125% 以上的组合杠杆，权益仓位维持 15-20% 仓位，未来将根据市场情况，择机配置信用债及灵活杠杆操作。股票组合在季度初风格略偏价值，一季报后我们增加了部分绩优成长板块配置，如汽车零部件、电力设备、医药等，当前风格较为均衡。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银双利回报债券 A 基金份额净值为 1.0098 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%；截至本报告期末农银双利回报债券 C 基金份额净值为 1.0084 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，逆周期政策的逐步落地背景下，仍需关注社融数据改善的持续性以及就业及居民收入的变化。目前从高频数据来看，房地产的销售仍较为低迷，债券维持中性操作，但需要观察后续政策落地后基本面的变化情况。权益方面计划维持均衡的风格配置，积极寻找二季度中延续增长趋势的行业和板块。

#### 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

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，对农银汇理双利回报债券型证券投资基金 2023 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合规守信、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双利回报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 2023 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：农银汇理双利回报债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	549,705.10	202,240,819.72
结算备付金		2,256,273.54	-
存出保证金		23,697.71	4,309.41
交易性金融资产	6.4.7.2	143,886,193.26	79,971,707.94
其中：股票投资		20,584,311.30	-
基金投资		-	-
债券投资		123,301,881.96	79,971,707.94
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	-	532,728,922.57
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		232,641.16	85,778,233.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		146,948,510.77	900,723,993.14
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		37,196,233.49	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		90,566.59	-
应付管理人报酬		54,610.66	458,167.97
应付托管费		9,101.78	76,361.29
应付销售服务费		2,788.07	117,818.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,213.48	82,818.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	242,022.05	128,317.36
负债合计		37,600,536.12	863,483.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	108,305,551.28	897,366,984.30
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,042,423.37	2,493,525.75
净资产合计		109,347,974.65	899,860,510.05
负债和净资产总计		146,948,510.77	900,723,993.14

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 108,305,551.28 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0098 元，基金份额总额 92,178,490.98 份；下属 C 类基金份额净值 1.0084 元，基金份额总额 16,127,060.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理双利回报债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,669,263.73
1. 利息收入		320,059.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	109,942.31
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		210,117.54
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,065,373.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-265,045.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	1,103,677.85
资产支持证券投资收益	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	226,741.42
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	283,180.92
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	649.38
<b>减：二、营业总支出</b>		781,273.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	389,054.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,842.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	63,749.28
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		142,040.72
其中：卖出回购金融资产支出		142,040.72
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		1,209.42
8. 其他费用	6.4.7.23	120,377.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		887,990.16
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填 列）</b>		887,990.16
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-

六、综合收益总额		887,990.16
----------	--	------------

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理双利回报债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	897,366,984.30	-	2,493,525.75	899,860,510.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	897,366,984.30	-	2,493,525.75	899,860,510.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-1,451,102.38	-790,512,535.40
(一)、综合收益总额	-	-	887,990.16	887,990.16
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-2,339,092.54	-791,400,525.56
其中：1. 基金申购款	79,738,038.89	-	293,981.12	80,032,020.01
2. 基金赎回款	-	-	-2,633,073.66	-871,432,545.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	108,305,551.28	-	1,042,423.37	109,347,974.65

资产(基金净值)				
----------	--	--	--	--

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

农银汇理双利回报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 1450 号《关于准予农银汇理双利回报债券型证券投资基金注册的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理双利回报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 897,202,669.11 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 0820 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 897,366,984.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 164,315.19 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《农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金合同》和《农银汇理双利回报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、赎回时收取赎回费,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,并不收取认购费/申购费、赎回时收取赎回费的基金份额,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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理双利回报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》、《农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金合同》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

本基金的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	549,705.10

等于：本金	549,632.16
加：应计利息	72.94
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	549,705.10

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	20,581,373.97	-	20,584,311.30	2,937.33	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	68,069,095.76	997,056.84	69,145,128.70	78,976.10
	银行间市场	53,185,554.29	789,053.26	54,156,753.26	182,145.71
	合计	121,254,650.05	1,786,110.10	123,301,881.96	261,121.81
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	141,836,024.02	1,786,110.10	143,886,193.26	264,059.14	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	77,802.50



其中：交易所市场	76,147.50
银行间市场	1,655.00
应付利息	-
预提费用	164,219.55
合计	242,022.05

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 农银双利回报债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,025,558.19	205,025,558.19
本期申购	79,692,179.41	79,692,179.41
本期赎回（以“-”号填列）	-192,539,246.62	-192,539,246.62
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	92,178,490.98	92,178,490.98

##### 农银双利回报债券 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	692,341,426.11	692,341,426.11
本期申购	45,859.48	45,859.48
本期赎回（以“-”号填列）	-676,260,225.29	-676,260,225.29
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	16,127,060.30	16,127,060.30

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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

##### 农银双利回报债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	654,037.69	-4,359.06	649,678.63
本期利润	442,313.23	204,197.57	646,510.80
本期基金份额交易产生	-375,017.77	-13,781.72	-388,799.49

的变动数			
其中：基金申购款	304,456.34	-10,615.74	293,840.60
基金赎回款	-679,474.11	-3,165.98	-682,640.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	721,333.15	186,056.79	907,389.94

## 农银双利回报债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,858,609.84	-14,762.72	1,843,847.12
本期利润	162,496.01	78,983.35	241,479.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,918,644.50	-31,648.55	-1,950,293.05
其中：基金申购款	140.69	-0.17	140.52
基金赎回款	-1,918,785.19	-31,648.38	-1,950,433.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,461.35	32,572.08	135,033.43

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	64,790.37
定期存款利息收入	35,958.13
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,883.51
其他	310.30
合计	109,942.31

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	61,831,510.10
减：卖出股票成本总额	61,909,152.09
减：交易费用	187,403.70
买卖股票差价收入	-265,045.69

## 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,069,111.83
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券	34,566.02

到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,103,677.85

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,595,829.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,510,183.24
减：应计利息总额	1,048,677.22
减：交易费用	2,402.90
买卖债券差价收入	34,566.02

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	226,741.42
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	226,741.42

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	283,180.92
股票投资	2,937.33
债券投资	280,243.59
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	283,180.92

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	649.38
合计	649.38

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

2. 本基金的转换费由转出基金的赎回费和申购费补差两部分组成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,492.79
账户维护费	7,500.00
上清所账户维护费	7,340.00
其他	-175.00
合计	120,377.34

#### 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
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

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	389,054.36
其中：支付销售机构的客户维护费	155,097.46

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 0.6% 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 × 0.6% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	64,842.45

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 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

	农银双利回报债券 A	农银双利回报债券 C	合计
农业银行	-	63,749.28	63,749.28
合计	-	63,749.28	63,749.28

注：C 级基金份额支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值 0.2% 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：

$$C \text{ 级基金日销售服务费} = \text{前一日 C 级基金基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	549,705.10	64,790.37

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，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(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023年6月27日	1个月以内(含)	增发流通受限	2.02	2.64	6,750	13,635.00	17,820.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

##### 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 2023 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 37,196,233.49 元于 2023 年 07 月 03 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,814,103.72	79,971,707.94
合计	14,814,103.72	79,971,707.94

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	47,172,653.22	-
AAA 以下	273,442.56	-
未评级	61,041,682.46	-

合计	108,487,778.24	-
----	----------------	---

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	549,705.10	-	-	-	549,705.10
结算备付金	2,256,273.54	-	-	-	2,256,273.54
存出保证金	23,697.71	-	-	-	23,697.71
交易性金融资产	33,566,158.31	76,256,379.21	13,479,344.44	20,584,311.30	143,886,193.26
应收清算款	-	-	-	232,641.16	232,641.16
资产总计	36,395,834.66	76,256,379.21	13,479,344.44	20,816,952.46	146,948,510.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	90,566.59	90,566.59
应付管理人报酬	-	-	-	54,610.66	54,610.66
应付托管费	-	-	-	9,101.78	9,101.78
卖出回购金融资产款	37,196,233.49	-	-	-	37,196,233.49
应付销售服务费	-	-	-	2,788.07	2,788.07
应交税费	-	-	-	5,213.48	5,213.48
其他负债	-	-	-	242,022.05	242,022.05
负债总计	37,196,233.49	-	-	404,302.63	37,600,536.12
利率敏感度缺口	-800,398.83	76,256,379.21	13,479,344.44	20,412,649.83	109,347,974.65
上年度末 2022年12月31日					
资产					
银行存款	202,240,819.72	-	-	-	202,240,819.72
存出保证金	4,309.41	-	-	-	4,309.41
交易性金融资产	79,971,707.94	-	-	-	79,971,707.94
买入返售金融资产	532,728,922.57	-	-	-	532,728,922.57
应收清算款	-	-	-	85,778,233.50	85,778,233.50
资产总计	814,945,759.64	-	-	85,778,233.50	900,723,993.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	458,167.97	458,167.97
应付托管费	-	-	-	76,361.29	76,361.29
应付销售服务费	-	-	-	117,818.20	117,818.20
应交税费	-	-	-	82,818.27	82,818.27
其他负债	-	-	-	128,317.36	128,317.36
负债总计	-	-	-	863,483.09	863,483.09
利率敏感度缺口	814,945,759.64	-	-	84,914,750.41	899,860,510.05

注：按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化。
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响。

	其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-822,307.01	-35,221.51
市场利率平行下降 25 个基点	822,307.01	35,221.51	

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	20,584,311.30	18.82	-	-
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	20,584,311.30	18.82	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至上年度末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露上年度末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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	21,429,140.17	-
第二层次	122,439,233.09	79,971,707.94
第三层次	17,820.00	-
合计	143,886,193.26	79,971,707.94

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：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	20,584,311.30	14.01
	其中：股票	20,584,311.30	14.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,301,881.96	83.91
	其中：债券	123,301,881.96	83.91
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,805,978.64	1.91
8	其他各项资产	256,338.87	0.17
9	合计	146,948,510.77	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	767,934.00	0.70
C	制造业	12,842,732.00	11.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	483,255.00	0.44
E	建筑业	1,568,521.00	1.43
F	批发和零售业	113,296.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	474,974.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,739,070.00	1.59
J	金融业	1,410,645.00	1.29
K	房地产业	569,835.00	0.52
L	租赁和商务服务业	152,243.30	0.14
M	科学研究和技术服务业	272,046.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	107,888.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	81,872.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	20,584,311.30	18.82

### 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	601318	中国平安	7,100	329,440.00	0.30
2	000801	四川九洲	41,600	303,680.00	0.28
3	000521	长虹美菱	39,600	302,544.00	0.28
4	000338	潍柴动力	22,200	276,612.00	0.25
5	603518	锦泓集团	24,300	275,805.00	0.25
6	600582	天地科技	47,100	274,593.00	0.25
7	002060	粤水电	39,100	257,278.00	0.24
8	301039	中集车辆	19,300	255,339.00	0.23
9	300185	通裕重工	86,600	241,614.00	0.22
10	000048	京基智农	11,700	228,384.00	0.21
11	603801	志邦家居	6,600	217,932.00	0.20
12	003031	中瓷电子	1,500	199,680.00	0.18
13	601336	新华保险	5,400	198,558.00	0.18
14	002478	常宝股份	26,300	195,935.00	0.18
15	000937	冀中能源	30,300	193,314.00	0.18
16	600986	浙文互联	29,200	186,880.00	0.17
17	600489	中金黄金	18,000	185,940.00	0.17
18	600268	国电南自	23,000	172,270.00	0.16
19	603156	养元饮品	6,900	170,430.00	0.16
20	600741	华域汽车	9,200	169,832.00	0.16
21	600498	烽火通信	8,300	169,071.00	0.15
22	000568	泸州老窖	800	167,656.00	0.15

23	600875	东方电气	8,900	165,985.00	0.15
24	002605	姚记科技	3,500	162,505.00	0.15
25	000552	甘肃能化	48,000	159,840.00	0.15
26	601618	中国中冶	40,200	159,594.00	0.15
27	600820	隧道股份	26,500	159,265.00	0.15
28	600587	新华医疗	4,500	158,985.00	0.15
29	600284	浦东建设	25,900	158,508.00	0.14
30	002576	通达动力	7,900	157,921.00	0.14
31	000717	中南股份	56,800	157,904.00	0.14
32	000728	国元证券	24,000	156,480.00	0.14
33	600970	中材国际	12,200	155,550.00	0.14
34	600528	中铁工业	15,700	155,116.00	0.14
35	603126	中材节能	19,900	154,026.00	0.14
36	601333	广深铁路	38,700	153,252.00	0.14
37	000957	中通客车	14,500	153,120.00	0.14
38	601128	常熟银行	22,400	152,768.00	0.14
39	600513	联环药业	15,800	152,628.00	0.14
40	600267	海正药业	13,200	150,216.00	0.14
41	300129	泰胜风能	15,500	148,645.00	0.14
42	600502	安徽建工	28,100	148,368.00	0.14
43	002367	康力电梯	15,700	143,341.00	0.13
44	000921	海信家电	5,300	142,835.00	0.13
45	002997	瑞鹤模具	4,800	142,704.00	0.13
46	300473	德尔股份	7,900	142,674.00	0.13
47	601890	亚星锚链	12,300	142,434.00	0.13
48	002270	华明装备	13,000	142,350.00	0.13
49	603877	太平鸟	5,600	141,568.00	0.13
50	002454	松芝股份	16,600	140,602.00	0.13
51	300532	今天国际	6,800	139,808.00	0.13
52	002929	润建股份	3,200	138,912.00	0.13
53	600985	淮北矿业	12,000	138,240.00	0.13
54	002394	联发股份	16,200	137,862.00	0.13
55	300349	金卡智能	9,900	137,412.00	0.13
56	600736	苏州高新	27,100	137,397.00	0.13
57	603757	大元泵业	4,600	137,264.00	0.13
58	300745	欣锐科技	3,100	136,927.00	0.13
59	002381	双箭股份	17,700	136,644.00	0.12
60	002912	中新赛克	3,100	136,431.00	0.12
61	603238	诺邦股份	10,800	136,188.00	0.12
62	300881	盛德鑫泰	4,130	136,083.50	0.12
63	300756	金马游乐	7,100	135,752.00	0.12
64	601326	秦港股份	40,000	135,200.00	0.12
65	000599	青岛双星	31,600	134,932.00	0.12



66	688569	铁科轨道	3,200	134,624.00	0.12
67	003003	天元股份	12,700	134,366.00	0.12
68	002732	燕塘乳业	6,200	134,044.00	0.12
69	000030	富奥股份	26,500	133,560.00	0.12
70	600894	广日股份	17,700	133,281.00	0.12
71	002533	金杯电工	16,300	133,008.00	0.12
72	002809	红墙股份	12,300	132,840.00	0.12
73	601956	东贝集团	22,300	132,016.00	0.12
74	000560	我爱我家	49,800	131,970.00	0.12
75	603700	宁水集团	9,000	131,580.00	0.12
76	003007	直真科技	5,100	131,529.00	0.12
77	000153	丰原药业	13,000	131,300.00	0.12
78	600681	百川能源	28,100	131,227.00	0.12
79	300314	戴维医疗	6,200	131,068.00	0.12
80	600211	西藏药业	2,200	130,680.00	0.12
81	600197	伊力特	4,800	130,416.00	0.12
82	603697	有友食品	14,200	130,214.00	0.12
83	603536	惠发食品	20,200	130,088.00	0.12
84	002233	塔牌集团	16,800	129,696.00	0.12
85	000850	华茂股份	34,700	128,737.00	0.12
86	301087	可孚医疗	2,600	128,180.00	0.12
87	600512	腾达建设	47,600	127,568.00	0.12
88	688488	艾迪药业	10,300	126,896.00	0.12
89	600066	宇通客车	8,600	126,764.00	0.12
90	000533	顺钠股份	29,800	126,650.00	0.12
91	688345	博力威	3,400	126,174.00	0.12
92	603878	武进不锈	14,900	125,905.00	0.12
93	002959	小熊电器	1,500	125,250.00	0.11
94	688551	科威尔	1,900	124,602.00	0.11
95	688030	山石网科	5,800	124,294.00	0.11
96	300839	博汇股份	9,300	123,597.00	0.11
97	688225	亚信安全	5,800	121,510.00	0.11
98	688316	青云科技	2,400	119,160.00	0.11
99	688004	博汇科技	3,400	118,898.00	0.11
100	688373	盟科药业	13,900	118,845.00	0.11
101	688505	复旦张江	13,700	118,231.00	0.11
102	301257	普蕊斯	2,100	118,020.00	0.11
103	002697	红旗连锁	19,400	113,296.00	0.10
104	300856	科思股份	1,400	110,278.00	0.10
105	601377	兴业证券	18,000	110,160.00	0.10
106	301239	普瑞眼科	1,100	107,888.00	0.10
107	688520	神州细胞	1,900	107,806.00	0.10
108	002673	西部证券	16,900	107,315.00	0.10

109	000333	美的集团	1,800	106,056.00	0.10
110	605100	华丰股份	6,000	105,780.00	0.10
111	000928	中钢国际	10,900	105,185.00	0.10
112	601163	三角轮胎	6,600	104,742.00	0.10
113	001979	招商蛇口	8,000	104,240.00	0.10
114	603027	千禾味业	4,900	103,488.00	0.09
115	601668	中国建筑	18,000	103,320.00	0.09
116	000528	柳 工	13,000	102,700.00	0.09
117	000951	中国重汽	6,000	101,100.00	0.09
118	000517	荣安地产	32,600	99,430.00	0.09
119	600170	上海建工	36,500	98,185.00	0.09
120	601686	友发集团	14,200	97,128.00	0.09
121	600639	浦东金桥	7,800	96,798.00	0.09
122	002713	东易日盛	11,000	95,700.00	0.09
123	000061	农 产 品	15,900	95,241.00	0.09
124	600120	浙江东方	24,800	94,984.00	0.09
125	002156	通富微电	4,200	94,920.00	0.09
126	600642	申能股份	13,500	94,365.00	0.09
127	300785	值得买	3,600	94,248.00	0.09
128	000783	长江证券	16,200	93,960.00	0.09
129	000685	中山公用	12,400	93,868.00	0.09
130	000828	东莞控股	10,200	93,330.00	0.09
131	601000	唐山港	26,400	93,192.00	0.09
132	300926	博俊科技	4,000	91,360.00	0.08
133	600938	中国海油	5,000	90,600.00	0.08
134	600928	西安银行	25,500	89,760.00	0.08
135	600903	贵州燃气	10,300	89,095.00	0.08
136	600750	江中药业	3,900	85,527.00	0.08
137	000999	华润三九	1,400	84,924.00	0.08
138	603799	华友钴业	1,800	82,638.00	0.08
139	601916	浙商银行	29,250	77,220.00	0.07
140	600863	内蒙华电	18,000	74,700.00	0.07
141	300842	帝科股份	800	73,152.00	0.07
142	688382	益方生物	5,100	69,819.00	0.06
143	002798	帝欧家居	10,100	68,377.00	0.06
144	688234	天岳先进	800	59,152.00	0.05
145	688676	金盘科技	1,900	57,551.00	0.05
146	301169	零点有数	900	44,541.00	0.04
147	603345	安井食品	300	44,040.00	0.04
148	688580	伟思医疗	600	43,380.00	0.04
149	000670	盈方微	7,000	43,260.00	0.04
150	600757	长江传媒	4,900	42,140.00	0.04
151	002852	道道全	3,200	41,376.00	0.04

152	688109	品茗科技	1,530	39,627.00	0.04
153	601728	中国电信	6,200	34,906.00	0.03
154	600469	风神股份	5,400	34,776.00	0.03
155	002536	飞龙股份	2,300	34,500.00	0.03
156	603589	口子窖	600	29,610.00	0.03
157	600373	中文传媒	2,200	29,304.00	0.03
158	600941	中国移动	300	27,990.00	0.03
159	600050	中国联通	5,200	24,960.00	0.02
160	605168	三人行	145	12,461.30	0.01
161	601921	浙版传媒	1,200	10,428.00	0.01
162	300246	宝莱特	50	622.50	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	601003	柳钢股份	706,677.00	0.08
2	600483	福能股份	607,462.00	0.07
3	600022	山东钢铁	604,884.00	0.07
4	600039	四川路桥	562,514.00	0.06
5	600284	浦东建设	532,192.00	0.06
6	603338	浙江鼎力	529,896.00	0.06
7	000048	京基智农	517,457.00	0.06
8	002050	三花智控	489,203.00	0.05
9	000027	深圳能源	478,930.00	0.05
10	002249	大洋电机	478,755.00	0.05
11	600469	风神股份	475,143.00	0.05
12	002126	银轮股份	470,571.00	0.05
13	603027	千禾味业	467,770.00	0.05
14	603757	大元泵业	467,588.00	0.05
15	002937	兴瑞科技	463,034.00	0.05
16	603767	中马传动	441,661.00	0.05
17	300777	中简科技	419,839.00	0.05
18	601336	新华保险	419,370.00	0.05
19	002061	浙江交科	417,501.00	0.05
20	300910	瑞丰新材	406,975.00	0.05

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	601003	柳钢股份	718,157.00	0.08

2	600022	山东钢铁	597,864.00	0.07
3	600039	四川路桥	597,202.00	0.07
4	600483	福能股份	575,234.00	0.06
5	603338	浙江鼎力	519,600.00	0.06
6	002050	三花智控	503,549.00	0.06
7	603767	中马传动	483,694.00	0.05
8	000027	深圳能源	483,409.00	0.05
9	600469	风神股份	477,907.00	0.05
10	002249	大洋电机	469,132.00	0.05
11	002126	银轮股份	441,963.00	0.05
12	002230	科大讯飞	434,933.00	0.05
13	002937	兴瑞科技	430,576.00	0.05
14	601699	潞安环能	418,284.00	0.05
15	002061	浙江交科	410,899.00	0.05
16	300777	中简科技	404,897.00	0.04
17	300433	蓝思科技	398,992.00	0.04
18	603027	千禾味业	387,786.12	0.04
19	300625	三雄极光	385,726.00	0.04
20	600210	紫江企业	378,031.00	0.04

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	82,490,526.06
卖出股票收入（成交）总额	61,831,510.10

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	30,545,446.33	27.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,025,396.83	35.69
	其中：政策性金融债	23,246,867.37	21.26
4	企业债券	34,936,827.99	31.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	6,150,747.54	5.62
7	可转债（可交换债）	862,648.87	0.79
8	同业存单	11,780,814.40	10.77
9	其他	-	-
10	合计	123,301,881.96	112.76

**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	019691	22 国债 26	164,000	16,638,087.56	15.22
2	200220	20 国开 20	100,000	11,382,739.73	10.41
3	188889	21 中关 05	100,000	10,282,658.08	9.40
4	188288	21 陆集 02	100,000	10,100,101.37	9.24
5	112317112	23 光大银行 CD112	100,000	9,815,787.65	8.98

**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**

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

**7.11.2 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	23,697.71
2	应收清算款	232,641.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,338.87

#### 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	113044	大秦转债	488,633.38	0.45
2	127058	科伦转债	273,442.56	0.25
3	110053	苏银转债	100,572.93	0.09

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
农银双利回报债券 A	299	308,289.27	79,690,200.48	86.45	12,488,290.50	13.55
农银双利回报债券 C	253	63,743.32	0.00	0.00	16,127,060.30	100.00
合计	552	196,205.71	79,690,200.48	73.58	28,615,350.80	26.42

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	农银双利回报债券 A	99.40	0.0001
	农银双利回报债券 C	-	-
	合计	99.40	0.0001

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	农银双利回报债券 A	0
	农银双利回报债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	农银双利回报债券 A	0
	农银双利回报债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银双利回报债券 A	农银双利回报债券 C
基金合同生效日 (2022 年 9 月 30 日) 基金份额总额	205,025,558.19	692,341,426.11
本报告期期初基金份额总额	205,025,558.19	692,341,426.11
本报告期基金总申购份额	79,692,179.41	45,859.48
减：本报告期基金总赎回份额	192,539,246.62	676,260,225.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,178,490.98	16,127,060.30

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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、

非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内，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

报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

#### 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 (%)	
长江证券	2	60,008,177.32	41.58	43,884.72	38.42	-
国盛证券	1	41,438,511.33	28.72	38,591.58	33.79	-
开源证券	2	30,498,412.60	21.13	22,304.20	19.53	-
申万宏源证券	2	8,485,440.37	5.88	6,205.76	5.43	-
中泰证券	2	1,232,740.54	0.85	901.44	0.79	-



东吴证券	1	1,011,437.00	0.70	942.01	0.82	-
兴业证券	2	931,025.00	0.65	867.14	0.76	-
信达证券	2	702,657.00	0.49	513.82	0.45	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

2、本基金本报告期无新增交易单元,剔除宏信证券、天风证券交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	13,568,347.05	12.52	210,300,000.00	15.24	-	-
国盛证券	71,664,492.20	66.11	577,640,000.00	41.85	-	-
开源证券	14,964,855.96	13.80	346,100,000.00	25.08	-	-
申万宏	2,518.00	0.00	31,600,000.00	2.29	-	-

源证券			0			
中泰证 券	-	-	37,200,000.0 0	2.70	-	-
东吴证 券	66,795.12	0.06	4,000,000.00	0.29	-	-
兴业证 券	7,521,320. 00	6.94	169,200,000. 00	12.26	-	-
信达证 券	614,597.45	0.57	4,100,000.00	0.30	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 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	农银汇理双利回报债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 1 月 19 日
2	农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
3	农银汇理双利回报债券型证券投资基金招募说明书更新-2023 年第 1 次	证券时报、基金管理人网站	2023 年 2 月 8 日
4	农银汇理双利回报债券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	2023 年 2 月 8 日
5	农银汇理双利回报债券型证券投资基金 2022 年年度报告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 3 月 29 日
6	农银汇理双利回报债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站	2023 年 4 月 20 日
7	农银汇理双利回报债券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	2023 年 6 月 29 日
8	农银汇理双利回报债券型证券投资基金-招募说明书更新-2023 年第 2 次	证券时报、基金管理人网站	2023 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	2023-04-07 至 2023-04-17	0.00	15,953,330.67	0.00	15,953,330.67	14.73
	2	2023-04-18 至 2023-06-30	0.00	49,789,882.49	0.00	49,789,882.49	45.97

#### 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、《农银汇理双利回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理双利回报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和营业执照复印件；

6、本报告期内公开披露的临时公告。

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的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

2023 年 8 月 25 日