

农银汇理恒久增利债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§ 1 重要提示

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

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	农银恒久增利债券	
基金主代码	660002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 月 23 日	
报告期末基金份额总额	57,020,636.90 份	
投资目标	本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	采用大类资产类属配置策略进行固定收益及权益类资产的大类资产配置，在普通债券投资上将利用数量化的辅助手段，通过对国民经济发展、宏观调控政策走向、基准利率走势以及不同债券品种利率变化尤其是利差演变趋向的分析构筑稳健的债券投资组合。	
业绩比较基准	中债国债总指数×50% +中债金融债总指数×30%+中债企业债总指数×20%。	
风险收益特征	本基金风险和收益水平低于股票型和混合型基金，但高于货币市场基金。	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	农银恒久增利债券 A	农银恒久增利债券 C
下属分级基金的交易代码	660002	660102
报告期末下属分级基金的份额总额	52,198,208.37 份	4,822,428.53 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	农银恒久增利债券 A	农银恒久增利债券 C
1. 本期已实现收益	258,044.62	19,591.84
2. 本期利润	269,350.87	20,455.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0052	0.0041
4. 期末基金资产净值	63,246,278.29	5,736,987.57
5. 期末基金份额净值	1.2117	1.1896

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银恒久增利债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.43%	0.13%	0.93%	0.08%	-0.50%	0.05%
过去六个月	0.77%	0.11%	2.21%	0.08%	-1.44%	0.03%
过去一年	1.22%	0.09%	3.03%	0.07%	-1.81%	0.02%
过去三年	6.94%	0.07%	5.97%	0.07%	0.97%	0.00%
过去五年	13.66%	0.07%	6.94%	0.09%	6.72%	-0.02%
自基金合同生效起至今	103.05%	0.20%	3.32%	0.10%	99.73%	0.10%

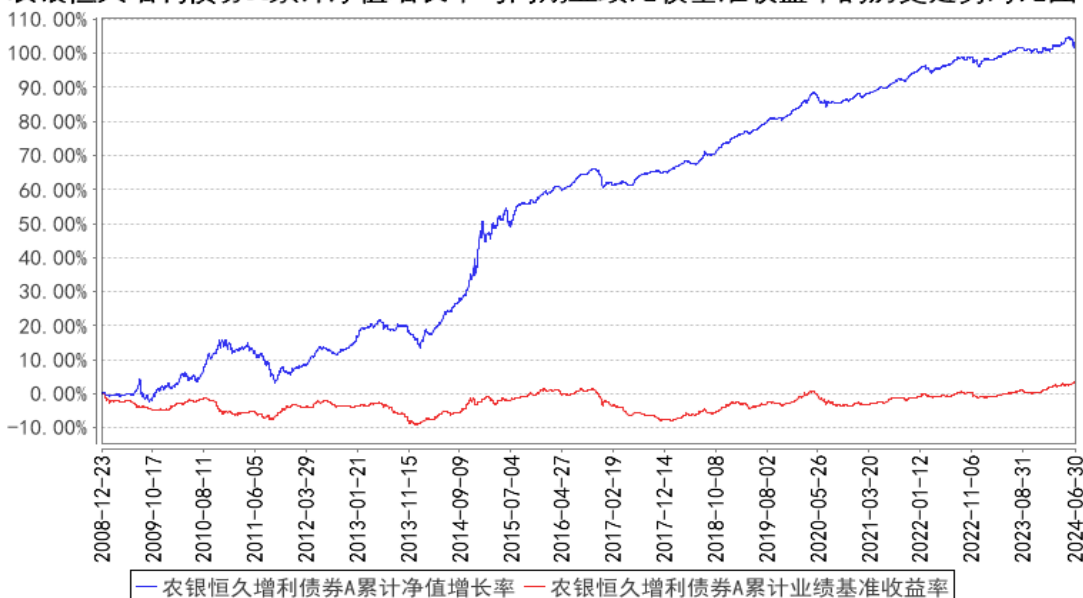
农银恒久增利债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.35%	0.13%	0.93%	0.08%	-0.58%	0.05%

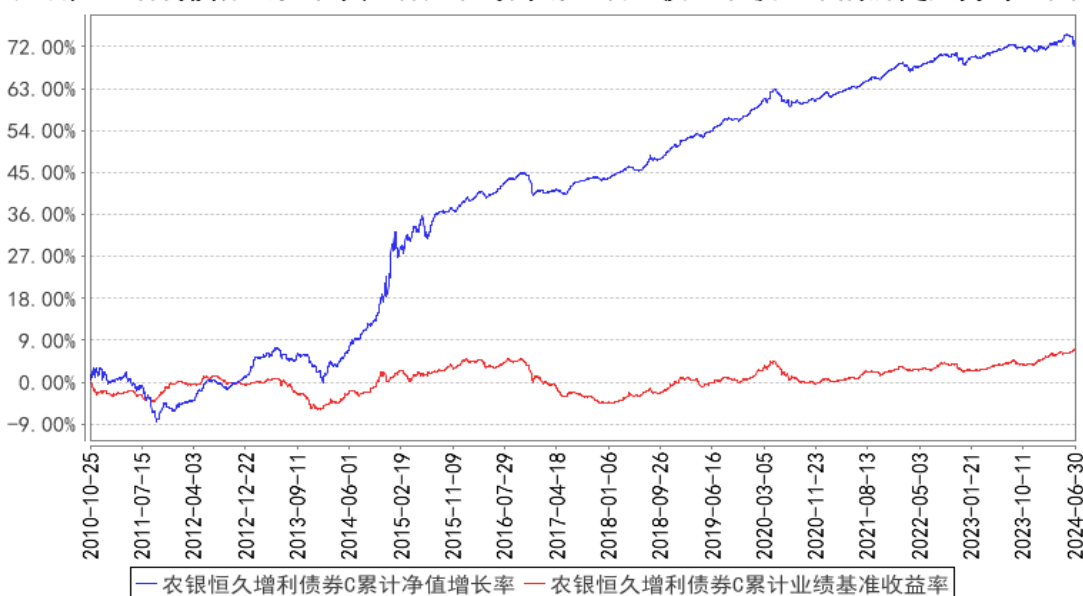
过去六个月	0.61%	0.11%	2.21%	0.08%	-1.60%	0.03%
过去一年	0.93%	0.09%	3.03%	0.07%	-2.10%	0.02%
过去三年	6.01%	0.07%	5.97%	0.07%	0.04%	0.00%
过去五年	12.02%	0.07%	6.94%	0.09%	5.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	73.12%	0.19%	6.97%	0.10%	66.15%	0.09%

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

农银恒久增利债券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



农银恒久增利债券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：1、本基金债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中企业债券、公司债券、金融债、短期融资券、资产支持证券（含资产收益计划）、次级债等除国债、央行票据以外的债券类资产投资比例不低于债券类资产的 50%，股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%。现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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（2008 年 12 月 23 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。

2、经中国证监会批准，本基金于 2010 年 10 月 25 日分为 A、C 两类，具体内容详见本基金管理人于 2010 年 10 月 22 日刊登的《农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理恒久增利债券型证券投资基金增加 C 类基金份额类别的公告》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
史向明	本基金的基金经理，公司投资副总监	2012 年 2 月 6 日	-	23 年	理学硕士，具有基金从业资格。历任中国银河证券公司上海总部债券研究员、天治基金管理公司债券研究员及基金经理、上投摩根基金管理公司固定收益部投资经理。现任农银汇理基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

本基金持仓以中高评级信用债为主，辅以可转债投资。二季度主要操作集中在可转债，投资策略侧重双低转债，主要投资具备一定债性支撑又具备一定期权弹性的转债。随着转债市场 4 月和 5 月的上涨，基金在二季度对一季度增持的部分可转债资产进行了止盈，6 月在市场调整的过程中择机增加可转债的配置。本基金以绝对收益为目标，秉承价值理念，力图打造波动率低的产品，希望让投资者获得稳稳的幸福。

经济基本面和资金欠配压力对债市的支撑逻辑依旧延续，货币政策保持支持性，债市利率上行动力不足，非银资金充裕，利率下行仍然有诉求，整体看目前有利债市的大环境仍在，但随着利率逐步创出新低，资本利得的博弈空间愈加有限，供给预计将逐步放量，叠加央行面向一级交易商开展国债借入的操作，谨慎情绪也随之积累。当前市场处于资产荒与周期底修复的博弈状态，三季度随着稳增长措施逐步落地以及债券供给增加，预计后市可能出现收益下行空间有限而震荡加剧的格局，且不排除收益率负向波动的可能。基金现阶段拟保持较低久期，持续关注地产数据变化、政策的持续和延展对于推动经济的实际效果，并根据市场变化调整组合久期和杠杆。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银恒久增利债券 A 基金份额净值为 1.2117 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%；截至本报告期末农银恒久增利债券 C 基金份额净值为 1.1896 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%；同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,701,958.56	90.82
	其中：债券	80,701,958.56	90.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,256,712.23	1.41
8	其他资产	6,899,376.53	7.76
9	合计	88,858,047.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,974,174.93	5.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,195,148.96	17.68
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	44,083,739.18	63.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,448,895.49	29.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,701,958.56	116.99

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	137799	22 海通 05	60,000	6,132,950.14	8.89
2	188884	21 光证 10	60,000	6,104,258.63	8.85
3	115781	23 中证 16	50,000	5,161,684.38	7.48
4	188418	21 兴业 03	50,000	5,121,496.71	7.42
5	2228020	22 兴业银行 02	50,000	5,078,357.81	7.36

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

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

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

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

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

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

2024 年 1 月 29 日，海通证券股份有限公司（以下简称海通证券或公司）存在首发保荐业务

履职尽责明显不到位、投行质控内核部门未识别项目重大风险及对尽职调查把关不审慎等缺陷，被上海证券交易所采取监管措施。

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

2024 年 4 月 24 日，海通证券股份有限公司作为格力地产股份有限公司债券“21 格地 02”“22 格地 02”的主承销商和受托管理人，未对个别存货周边楼盘开盘价格低于项目楼面价的情况予以审慎分析核查；在“22 格地 02”期后事项核查中，未对存货可变现净值的评估进行持续关注和尽职调查；未制作咨询审计机构工作底稿；未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告；对发行人差错更正事项披露临时受托管理事务报告不及时，被广东证监局采取责令改正的行政监管措施。2024 年 5 月 28 日，上海证券交易所就前述事项对海通证券股份有限公司予以书面警示。

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

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

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

2024 年 4 月 10 日，光大证券股份有限公司（以下简称光大证券）因在金通灵科技集团股份有限公司 2018 年发行股份购买资产并募集配套资金项目履行持续督导职责过程中，未充分履行核查义务，利用其他证券服务机构专业意见未进行必要的审慎核查，导致制作、出具的 2018-2020 年度持续督导意见存在不实记载，被江苏证监局采取出具警示函的措施。

2024 年 5 月 14 日，光大证券因在金通灵科技集团股份有限公司（以下简称金通灵）2018 年发行股份购买资产并募集配套资金项目履行持续督导职责过程中，未按照《上市公司重大资产重组管理办法》《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》有关规定充分履行核查义务，利用其他

证券服务机构专业意见时未进行必要的审慎核查，导致制作、出具的 2018 年度至 2020 年度持续督导意见存在不实记载，被深圳证券交易所通报批评。

2024 年 5 月 29 日，因个别发行人在债券发行工作中，未严格落实中央关于防范化解地方债务风险的重大部署，交易商协会决定对光大证券股份有限公司启动自律调查。

2023 年 7 月 7 日，中信证券股份有限公司因在 2023 年 6 月 19 日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，被深圳证监局采取出具警示函措施。

2023 年 8 月 29 日，中信证券股份有限公司因北京总部大楼机房因一路 UPS 电源供电中断，导致 4 台集中交易系统服务器异常关机，最终导致部分客户无法正常登录 APP 或网上交易，被上海证券交易所采取书面警示的监管措施。

2023 年 9 月 22 日，中信证券股份有限公司在担任航天通信控股集团股份有限公司收购智慧海派科技有限公司重大资产重组财务顾问过程中，存在以下违规情形：一是重组阶段未对标的公司的主要供应商、主要客户和关联关系等进行审慎核查；二是持续督导阶段未对上市公司销售真实性等进行审慎核查；三是重大资产重组实施完毕后，上市公司所购买资产真实实现的利润未达到预测金额的 50%；四是内部控制制度执行不严格，被中国证监会采取监管谈话措施。

2023 年 9 月 22 日，中信证券因存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，被深圳证券交易所出具警示函。

2024 年 1 月 5 日，中信证券股份有限公司因保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50%以上，被中国证监会采取出具警示函的行政监督管理措施。

2024 年 4 月 30 日，中信证券因知悉客户融券目的是定增套利，配合其提供融券服务，被中国证监会合计没收违法所得 1,910,680.83 元，并处以 23,250,000 元罚款。

2024 年 4 月 30 日，中信证券在尽职调查过程中，未按照《保荐人尽职调查工作准则》第七十条以及《监管规则适用指引——发行类第 4 号》4-11 等执业规范要求，对发行人关联交易情况进行充分核查，导致招股说明书遗漏披露关联交易相关信息；在核查工作底稿已有记录的情况下，中信证券未充分关注并执行进一步的核查程序，在本所问询后仍未审慎核查，发表的核查意见不准确。被深圳交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024 年 5 月 8 日，中信证券股份有限公司因作为广东泉为科技股份有限公司（原广东国立科技股份有限公司）首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在以下违规行为：一是对二甲苯贸易业务客户和供应商之间的关联关系核查不充分。二是对二甲苯贸易业务真实性

核查不充分。三是对二甲苯业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异。四是对二甲苯业务单据审核中未关注到销售合同和租合同约定的装货港存在明显异常。被广东证监局采取出具警示函的行政监管措施。

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

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,280.73
2	应收证券清算款	6,898,095.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,899,376.53

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	4,852,116.27	7.03
2	113053	隆 22 转债	814,002.85	1.18
3	113641	华友转债	811,736.11	1.18
4	118008	海优转债	671,683.45	0.97
5	118031	天 23 转债	649,958.63	0.94
6	118034	晶能转债	585,738.74	0.85
7	127066	科利转债	545,461.64	0.79
8	113033	利群转债	508,295.07	0.74
9	127032	苏行转债	502,812.05	0.73
10	110079	杭银转债	483,068.93	0.70
11	110073	国投转债	432,958.68	0.63

12	118022	锂科转债	396,832.88	0.58
13	127089	晶澳转债	389,210.19	0.56
14	113061	拓普转债	356,095.81	0.52
15	127018	本钢转债	354,229.97	0.51
16	128136	立讯转债	342,597.12	0.50
17	113616	韦尔转债	336,804.66	0.49
18	113638	台 21 转债	336,279.86	0.49
19	128048	张行转债	328,537.81	0.48
20	113052	兴业转债	324,653.01	0.47
21	123210	信服转债	310,808.71	0.45
22	118005	天奈转债	299,669.18	0.43
23	110081	闻泰转债	297,306.74	0.43
24	118023	广大转债	283,624.11	0.41
25	123158	宙邦转债	227,429.32	0.33
26	113042	上银转债	227,347.01	0.33
27	123133	佩蒂转债	225,997.26	0.33
28	127073	天赐转债	224,295.89	0.33
29	113049	长汽转债	223,613.64	0.32
30	118024	冠宇转债	219,307.95	0.32
31	113644	艾迪转债	215,317.53	0.31
32	113633	科沃转债	213,493.70	0.31
33	113661	福 22 转债	212,710.63	0.31
34	113046	金田转债	208,264.11	0.30
35	113048	晶科转债	189,013.70	0.27
36	110086	精工转债	178,266.85	0.26
37	113050	南银转债	125,412.08	0.18
38	113044	大秦转债	120,265.10	0.17
39	113045	环旭转债	118,789.07	0.17
40	113632	鹤 21 转债	118,005.34	0.17
41	123104	卫宁转债	114,781.78	0.17
42	113666	爱玛转债	114,130.27	0.17
43	123113	仙乐转债	113,300.00	0.16
44	127031	洋丰转债	112,502.19	0.16
45	113043	财通转债	111,154.93	0.16
46	123115	捷捷转债	110,735.62	0.16
47	113024	核建转债	110,358.22	0.16
48	127056	中特转债	109,338.55	0.16
49	110076	华海转债	108,602.33	0.16
50	113655	欧 22 转债	108,011.64	0.16
51	113627	太平转债	108,009.32	0.16
52	113059	福莱转债	106,812.05	0.15
53	123108	乐普转 2	106,245.75	0.15

54	110085	通 22 转债	105,767.01	0.15
55	127049	希望转 2	103,502.58	0.15
56	127022	恒逸转债	102,208.58	0.15
57	123149	通裕转债	100,984.11	0.15
58	110075	南航转债	96,707.63	0.14
59	123144	裕兴转债	92,407.53	0.13
60	110095	双良转债	80,563.34	0.12
61	123128	首华转债	70,760.41	0.10

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银恒久增利债券 A	农银恒久增利债券 C
报告期期初基金份额总额	52,300,983.05	5,917,008.07
报告期期间基金总申购份额	1,012,721.27	601,923.10
减：报告期期间基金总赎回份额	1,115,495.95	1,696,502.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	52,198,208.37	4,822,428.53

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理恒久增利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理恒久增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和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

农银汇理基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日