

# 农银汇理致远价值混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）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                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 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                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 42        |
| 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      | 44        |
| 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   | 44        |
| 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   | 44        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 45        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 45        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 45        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 45        |
| <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 .....   | 46        |
| <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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 48        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 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>50</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 ..... | 50        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 50        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                 |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称            | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 农银致远价值混合          |                 |
| 基金主代码           | 025930            |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                 |
| 基金合同生效日         | 2026 年 1 月 27 日   |                 |
| 基金管理人           | 农银汇理基金管理有限公司      |                 |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司      |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 96,874,552.76 份   |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 农银致远价值混合 A        | 农银致远价值混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 025930            | 025931          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 81,113,313.63 份   | 15,761,239.13 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                            |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。                                                                  |
| 投资策略   | 1、大类资产配置。2、股票投资策略。3、债券投资策略。4、可转换债券和可交换债券投资策略。5、股指期货投资策略。6、国债期货投资策略。7、资产支持证券投资策略。                           |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债综合全价（总值）指数×20%                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可以投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人                  |
|---------|------|---------------------------|------------------------|
| 名称      |      | 农银汇理基金管理有限公司              | 中国建设银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 翟爱东                       | 王小飞                    |
|         | 联系电话 | 021-61095588              | 021-60637103           |
|         | 电子邮箱 | xuxin@abc-ca.com          | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 021-61095599              | 021-60637228           |
| 传真      |      | 021-61095556              | 021-60635778           |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层 | 北京市西城区金融大街 25 号        |
| 办公地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区银            | 北京市西城区闹市口大街 1 号        |

|       |             |        |
|-------|-------------|--------|
|       | 城路 9 号 50 层 | 院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 200120      | 100033 |
| 法定代表人 | 黄涛          | 张金良    |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                                                           |
|-------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 证券日报                                                      |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 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<br>据和指标 | 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日 |               |
|-------------------|--------------------------------------------|---------------|
|                   | 农银致远价值混合 A                                 | 农银致远价值混合 C    |
| 本期已实现收益           | -24,743,389.33                             | -3,018,481.77 |
| 本期利润              | -30,967,919.31                             | -3,224,408.27 |
| 加权平均基金份额<br>本期利润  | -0.1140                                    | -0.1208       |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | -11.86%                                    | -12.63%       |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | -13.32%                                    | -13.46%       |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                      |               |
|                   |                                            |               |
| 期末可供分配利<br>润      | -11,676,101.58                             | -2,290,212.88 |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | -0.1439                                    | -0.1453       |
| 期末基金资产净<br>值      | 70,308,374.68                              | 13,639,064.68 |
| 期末基金份额净<br>值      | 0.8668                                     | 0.8654        |

| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |         |
|--------------|-----------------------|---------|
| 基金份额累计净值增长率  | -13.32%               | -13.46% |

注：1、本基金的基金合同于 2026 年 1 月 27 日生效，至 2026 年 06 月 30 日不满半年。

2、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。

3、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。

4、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

农银致远价值混合 A

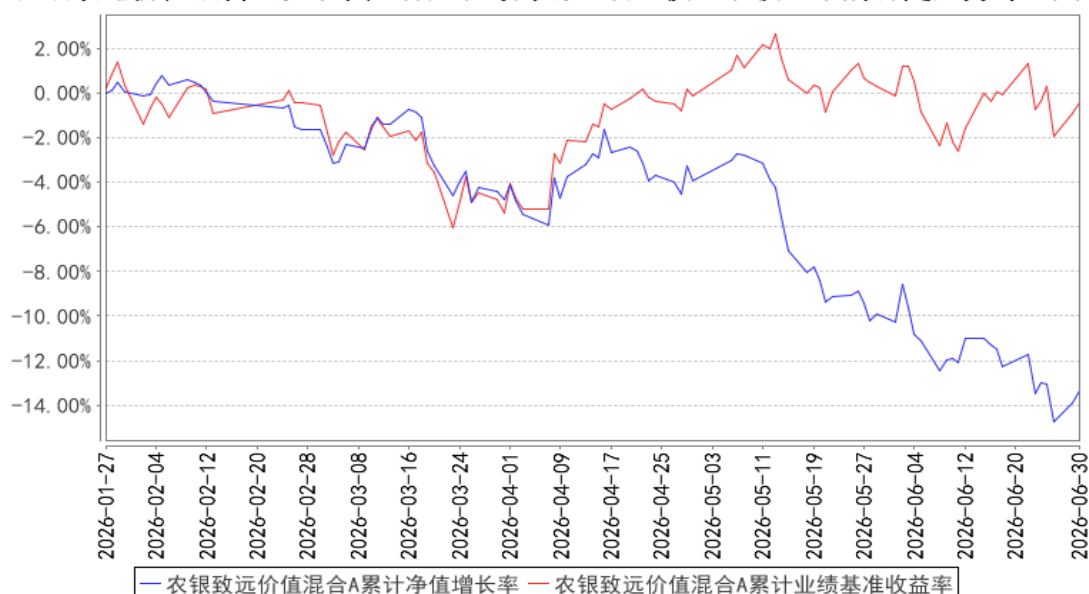
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | -8.99%   | 0.89%       | 5.25%      | 0.91%         | -14.24% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.32%  | 0.78%       | -0.42%     | 0.89%         | -12.90% | -0.11% |

农银致远价值混合 C

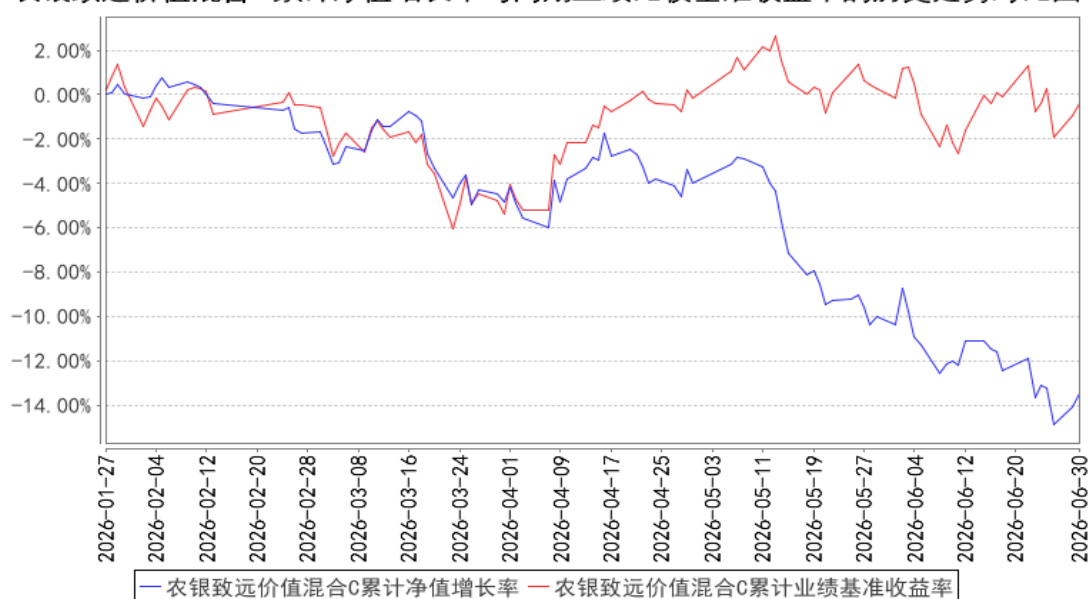
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③     | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月      | -9.07%   | 0.89%       | 5.25%      | 0.91%         | -14.32% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.46%  | 0.78%       | -0.42%     | 0.89%         | -13.04% | -0.11% |

### 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

农银致远价值混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



农银致远价值混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的比例为 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2026 年 1 月 27 日）起六个月，截至本报告期末，建仓期未满。



## § 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 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 96 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、农银汇理瑞丰 6 个月持有期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、农银汇理红利甄选混合型证券投资基金、农银汇理中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、农银汇理创新驱动混合型证券投资基金、农银汇理上证 180 指数型证券投资基金、农银汇理中证 A500 指数增强型证券投资基金、农银汇理上证科创板 50 成份指数型证券投资基金、农银汇理中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、农银汇理平衡价值混合型证券投资基金、农银汇理中证红利低波动 100 指数型证券投资基金、农银汇理创业板指数型证券投资基金、农银汇理致远价值混合型证券投资基金、农银汇理瑞恒债券型证券投资基金、农银汇理消费启航混合型证券投资基金、农银汇理安泽多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 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 |        |                                                                         |
| 谷超 | 本基金的基金经理、投资部副总监 | 2026 年 1 月 27 日 | —    | 13 年   | 历任易方达基金管理有限公司行业分析师，禾其投资互联网行业分析师，国泰基金管理有限公司行业分析师、基金经理助理兼新兴产业小组组长及拟任基金经理。 |

|  |   |  |  |  |                             |
|--|---|--|--|--|-----------------------------|
|  | 理 |  |  |  | 现任农银汇理基金管理有限公司投资部副总经理、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

2026 年上半年，A 股市场整体呈现上涨趋势，指数方面，上证指数上涨 3.16%，深证成指上涨 19.82%，沪深 300 指数上涨 7.55%，创业板指数上涨 35.58%。行业方面出现了极致的分化，建材、电子、通信等行业上涨较多；农林牧渔、美容护理、商贸零售等行业下跌较多。

本基金上半年处于建仓期，根据市场情况持续进行建仓，主要投资了新能源、社交互联网、

人工智能应用、食品饮料、金融、国防军工等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银致远价值混合 A 基金份额净值为 0.8668 元，自基金合同生效起至本报告期末基金份额净值增长率为-13.32%；截至本报告期末农银致远价值混合 C 基金份额净值为 0.8654 元，自基金合同生效起至本报告期末基金份额净值增长率为-13.46%；同期业绩比较基准收益率为-0.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年一季度 A 股市场整体呈现震荡下跌趋势；二季度市场则呈现上涨趋势，整体波动较大，并且行业层面出现了极致的分化，人工智能硬件相关的公司其股价表现明显好于其他公司。上半年港股市场也出现较为明显的分化，恒生科技指数因产业结构与流动性等因素影响下跌较多。

宏观经济方面，今年 1-2 月份国内宏观经济情况有所反复，制造业景气度回落；3 月以来，制造业 PMI 回到 50%以上，制造业景气度重回扩张区间。自伊朗美国冲突以来，霍尔木兹海峡的通航情况频繁受到影响，全球能源供应链也受到明显冲击，我国 CPI 与 PPI 均呈现上涨趋势。对外贸易方面，上半年我国进出口实现了较快增长，尤其是 5 月份以来我国出口加速增长，出口占全球出口份额处于历史高位。其中主要的出口增长来自于机电产品及汽车产业链，机电产品如集成电路主要的增长来自于价格大涨；而汽车出口主要的增长来自于数量大涨。这体现出虽然全球能源供应链受阻，但我国凭借多元化的能源结构及全产业链的工业体系，制造业具备强大的韧性。当前伊朗与美国正围绕霍尔木兹海峡控制权展开争夺，未来全球能源供应链仍存在较大不确定性，全球资本市场受此影响可能进入高波动区间，资源安全与自主可控的重要性将持续增加，相关产业链有望持续受益，我们看好新能源、人工智能、国防军工、内需消费、战略资源等领域的龙头企业。

人工智能方面，我们同样看好人工智能技术发展带来的社会生产力提升，不过当前中美两国在人工智能领域的发展侧重方向并不相同。除了辅助编程、视频生成等领域外，我国的人工智能侧重于研究人工智能在各行各业如何应用落地，如何解决实际问题，并追求合理的投入回报率，比如物流无人化、矿山无人化、检测无人化等；而美国人工智能则侧重于探索通用人工智能和人形机器人，通过不断地堆叠算力来增强大模型的能力。整体而言，我们更看好中国人工智能的发展方向，主要是基于以下两个原因：首先，当前理论难以实现通用人工智能，因为当前的生成式 AI 底层理论仍然是人工神经网络，主要基于统计数据进行概率推断，理论没有突破的情况下难以实现通用人工智能，不同的行业和场景需要不同的模型。其次，当前人工智能的商业模式与互联网不同，边际成本较高，对资本开支依赖度较高。互联网本质是信息的传递与交互，生成式人工

智能本质是信息的计算与生成。互联网企业随着用户及使用规模扩张，边际成本较低；而人工智能企业随着用户及使用规模扩张，边际成本（如电力、硬件设备折旧等）较高。实际上，我们看到中国以远低于美国的资本开支，在人工智能领域跻身全球第一梯队，并有能力提供一整套自主可控的人工智能解决方案。从美国云计算厂商最新的季度财报来看，其资本开支已经对自由现金流产生巨大影响，未来美国人工智能资本开支的进一步增加将依赖外部融资尤其是债务融资，这会受到宏观经济与利率环境的明显制约。因此，在人工智能领域，我们重点投资了拥有行业场景且商业模式持续性更好的人工智能应用领域企业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定等文件，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。

估值委员会成员由各业务相关的投资岗、研究岗、运营岗、风控岗和合规岗人员组成，公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。参与估值流程各方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。

本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# § 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：农银汇理致远价值混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------|------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 34,283,199.33          |
| 结算备付金       |         | 1,085,715.30           |
| 存出保证金       |         | 83,317.05              |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 53,496,723.56          |
| 其中：股票投资     |         | 53,496,723.56          |
| 基金投资        |         | —                      |
| 债券投资        |         | —                      |
| 资产支持证券投资    |         | —                      |
| 贵金属投资       |         | —                      |
| 其他投资        |         | —                      |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | —                      |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | —                      |
| 债权投资        | 6.4.7.5 | —                      |
| 其中：债券投资     |         | —                      |
| 资产支持证券投资    |         | —                      |
| 其他投资        |         | —                      |
| 其他债权投资      | 6.4.7.6 | —                      |
| 其他权益工具投资    | 6.4.7.7 | —                      |
| 应收清算款       |         | 1,199,918.37           |

|               |            |                                |
|---------------|------------|--------------------------------|
| 应收股利          |            | 20,687.71                      |
| 应收申购款         |            | 1,368.98                       |
| 递延所得税资产       |            | -                              |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              |
| 资产总计          |            | 90,170,930.30                  |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 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     |            | -                              |
| 应付清算款         |            | -                              |
| 应付赎回款         |            | 5,432,385.38                   |
| 应付管理人报酬       |            | 330,646.47                     |
| 应付托管费         |            | 24,171.84                      |
| 应付销售服务费       |            | 5,563.85                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                              |
| 应交税费          |            | -                              |
| 应付利润          |            | -                              |
| 递延所得税负债       |            | -                              |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 430,723.40                     |
| 负债合计          |            | 6,223,490.94                   |
| <b>净资产:</b>   |            |                                |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 96,874,552.76                  |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                              |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | -12,927,113.40                 |
| 净资产合计         |            | 83,947,439.36                  |
| 负债和净资产总计      |            | 90,170,930.30                  |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 96,874,552.76 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8668 元，基金份额总额 81,113,313.63 份；下属 C 类基金份额净值 0.8654 元，基金份额总额 15,761,239.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理致远价值混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目     | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|-----|-------------------------------------------------|
| 一、营业总收入 |     | -32,381,424.52                                  |

|                            |            |                       |
|----------------------------|------------|-----------------------|
| 1. 利息收入                    |            | 169,525.16            |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13   | 169,525.16            |
| 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                 |            | -                     |
| 其他利息收入                     |            | -                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -26,692,690.60        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -28,333,578.16        |
| 基金投资收益                     |            | -                     |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | -                     |
| 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   | 1,640,887.56          |
| 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   | -6,430,456.48         |
| 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   | 572,197.40            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>1,810,903.06</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,227,126.41          |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 243,284.73            |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 43,259.23             |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                     |
| 5. 利息支出                    |            | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                     |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -                     |
| 7. 税金及附加                   |            | -                     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 297,232.69            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>-34,192,327.58</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>-34,192,327.58</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>-34,192,327.58</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理致远价值混合型证券投资基金



本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |        |                |                 |
|------------------------------------------|-------------------------------------------------|--------|----------------|-----------------|
|                                          | 实收基金                                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | -                                               | -      | -              | -               |
| 加：会计政策变更                                 | -                                               | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                               | -      | -              | -               |
| 其他                                       | -                                               | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 358,985,645.18                                  | -      | -              | 358,985,645.18  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -<br>262,111,092.42                             | -      | -12,927,113.40 | -275,038,205.82 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                               | -      | -34,192,327.58 | -34,192,327.58  |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列）  | -<br>262,111,092.42                             | -      | 21,265,214.18  | -240,845,878.24 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,714,280.82                                    | -      | -220,867.10    | 2,493,413.72    |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>264,825,373.24                             | -      | 21,486,081.28  | -243,339,291.96 |
| （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                                | 96,874,552.76                                   | -      | -12,927,113.40 | 83,947,439.36   |

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：

孙建坤

基金管理人负责人

毕宏燕

主管会计工作负责人

丁煜琼

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

农银汇理致远价值混合型证券投资基金（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[2025]第 2538 号《关于准予农银汇理致远价值混合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《农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 358,898,450.76 元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2026]200Z0025 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 358,985,645.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,194.42 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同》和《农银汇理致远价值混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费/申购费，赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费/申购费，赎回时收取赎回费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。各类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的

股票的比例占股票资产的比例为 0%-50%); 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 20%+中债综合全价(总值)指数 $\times$ 20%。

#### 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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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>》、《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

本基金 2026 年中期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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制

等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润或累计亏损。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬（包括固定管理费、或有管理费和超额管理费）、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。其中固定管理费每日计提并收取；或有管理费每日计提并根据投资者持有期间以及持有期间的收益情况收取或返还；超额管理费在满足计提条件时于相应的基金赎回/转换转出确认日或基金终止情形发生时按投资者赎回/转换转出申请日或基金最后运作日的基金实际收益情况计算确认，未达到计提条件的暂估超额管理费不计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式仅为现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所

上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 34,283,199.33          |
| 等于：本金          | 34,279,235.36          |
| 加：应计利息         | 3,963.97               |
| 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             | 34,283,199.33          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |               |               |
|---------------|------------------------|------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 59,927,180.04          | —    | 53,496,723.56 | -6,430,456.48 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                      | —    | —             | —             |
| 债券            | 交易所市场                  | —    | —             | —             |
|               | 银行间市场                  | —    | —             | —             |
|               | 合计                     | —    | —             | —             |

|        |               |   |               |               |
|--------|---------------|---|---------------|---------------|
| 资产支持证券 | -             | - | -             | -             |
| 基金     | -             | - | -             | -             |
| 其他     | -             | - | -             | -             |
| 合计     | 59,927,180.04 | - | 53,496,723.56 | -6,430,456.48 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 12,751.84              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 125,950.11             |
| 其中：交易所市场    | 125,950.11             |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 59,439.40              |
| 应付或有管理费     | 232,582.05             |
| 合计          | 430,723.40             |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 农银致远价值混合 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|-------------------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 328,698,442.22                                  | 328,698,442.22  |
| 本期申购          | 1,375,781.36                                    | 1,375,781.36    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -248,960,909.95                                 | -248,960,909.95 |
| 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           | 81,113,313.63                                   | 81,113,313.63   |

## 农银致远价值混合 C

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|-------------------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 30,287,202.96                                   | 30,287,202.96  |
| 本期申购          | 1,338,499.46                                    | 1,338,499.46   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,864,463.29                                  | -15,864,463.29 |
| 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           | 15,761,239.13 | 15,761,239.13 |

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

农银致远价值混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -              | -             | -              |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -              |
| 前期差错更正         | -              | -             | -              |
| 其他             | -              | -             | -              |
| 本期期初           | -              | -             | -              |
| 本期利润           | -24,743,389.33 | -6,224,529.98 | -30,967,919.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 13,067,287.75  | 7,095,692.61  | 20,162,980.36  |
| 其中：基金申购款       | -64,461.16     | -67,902.81    | -132,363.97    |
| 基金赎回款          | 13,131,748.91  | 7,163,595.42  | 20,295,344.33  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -11,676,101.58 | 871,162.63    | -10,804,938.95 |

农银致远价值混合 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -           | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -           | -             |
| 前期差错更正         | -             | -           | -             |
| 其他             | -             | -           | -             |
| 本期期初           | -             | -           | -             |
| 本期利润           | -3,018,481.77 | -205,926.50 | -3,224,408.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 728,268.89    | 373,964.93  | 1,102,233.82  |
| 其中：基金申购款       | -54,566.94    | -33,936.19  | -88,503.13    |
| 基金赎回款          | 782,835.83    | 407,901.12  | 1,190,736.95  |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | -2,290,212.88 | 168,038.43  | -2,122,174.45 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------|-------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 167,261.83                                      |

|           |            |
|-----------|------------|
| 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 | 2,110.59   |
| 其他        | 152.74     |
| 合计        | 169,525.16 |

#### 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<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年<br>6 月 30 日 |
|------------|----------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 272,061,824.09                                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 299,837,214.59                                     |
| 减：交易费用     | 558,187.66                                         |
| 买卖股票差价收入   | -28,333,578.16                                     |

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 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<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,640,887.56                                    |
| 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            | 1,640,887.56                                    |

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -6,430,456.48                                   |
| 股票投资       | -6,430,456.48                                   |
| 债券投资       | —                                               |
| 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                     | -6,430,456.48 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------|----------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 426,113.93                                         |
| 基金转换费收入 | 146,083.47                                         |
| 合计      | 572,197.40                                         |

#### 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<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026<br>年 6 月 30 日 |
|---------|----------------------------------------------------|
| 审计费用    | 9,145.00                                           |
| 信息披露费   | 50,294.40                                          |
| 证券出借违约金 | -                                                  |
| 证券组合费   | 1,148.72                                           |
| 银行费用    | 3,662.52                                           |
| 其他      | 400.00                                             |
| 或有管理费   | 232,582.05                                         |
| 合计      | 297,232.69                                         |

#### 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、关联关系

##### 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 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |



|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| 理”)                  |                 |
| 中国建设银行股份有限公司(“建设银行”) | 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<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,227,126.41                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 613,570.55                                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 613,555.86                                      |

注：1. 支付基金管理人农银汇理的固定管理费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： $\text{日固定管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$ 。

2. 或有管理费按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，其计算公式为： $\text{日或有管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$ 。投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，且该笔基金份额的持有期间相对业绩比较基准

的年化超额收益率在-3%及以下，或有管理费为 0，则该笔基金份额持有期内计提的或有管理费将全额随赎回款（或清算款）一并返还给投资者；在其他情形下，该笔基金份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由管理人收取的管理费。

3. 超额管理费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率预估计算，其计算公式为：日预估计算的超额管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。每笔基金份额的超额管理费每日预估计算，但不从基金资产中实际计提，逐日累计。投资者赎回、转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，当且仅当该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率（扣除超额管理费后）超过 6%且持有收益率（扣除超额管理费后）为正，将从该笔基金份额的赎回款（或清算款）中扣除 0.30%年费率的超额管理费，并随已计提的或有管理费一同确认为应由管理人收取的管理费。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                        |
|----------------|-------------------------------------------|
|                | 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 243,284.73                                |

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                                        |            |           |
|----------------|-------------------------------------------|------------|-----------|
|                | 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |            |           |
|                | 农银致远价值混合 A                                | 农银致远价值混合 C | 合计        |
| 农业银行           | -                                         | 38,321.66  | 38,321.66 |
| 合计             | -                                         | 38,321.66  | 38,321.66 |

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<br>2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月<br>30 日 |            |
|-------|----------------------------------------------------|------------|
|       | 期末余额                                               | 当期利息收入     |
|       |                                                    |            |
| 建设银行  | 34,283,199.33                                      | 167,261.83 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，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（2026 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

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 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。董事会及其下设的风控与合规管理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与内部控制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

本报告期末本基金未持有短期信用评级债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有长期信用评级债券。

### 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 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。

### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或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。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 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                   | 34,283,199.33 | -     | -     | -             | 34,283,199.33 |
| 结算备付金                  | 1,085,715.30  | -     | -     | -             | 1,085,715.30  |
| 存出保证金                  | 83,317.05     | -     | -     | -             | 83,317.05     |
| 交易性金融资产                | -             | -     | -     | 53,496,723.56 | 53,496,723.56 |
| 应收股利                   | -             | -     | -     | 20,687.71     | 20,687.71     |

|         |               |   |   |               |               |
|---------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 应收申购款   | -             | - | - | 1,368.98      | 1,368.98      |
| 应收清算款   | -             | - | - | 1,199,918.37  | 1,199,918.37  |
| 资产总计    | 35,452,231.68 | - | - | 54,718,698.62 | 90,170,930.30 |
| 负债      |               |   |   |               |               |
| 应付赎回款   | -             | - | - | 5,432,385.38  | 5,432,385.38  |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | 330,646.47    | 330,646.47    |
| 应付托管费   | -             | - | - | 24,171.84     | 24,171.84     |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | 5,563.85      | 5,563.85      |
| 其他负债    | -             | - | - | 430,723.40    | 430,723.40    |
| 负债总计    | -             | - | - | 6,223,490.94  | 6,223,490.94  |
| 利率敏感度缺口 | 35,452,231.68 | - | - | 48,495,207.68 | 83,947,439.36 |

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

本基金本报告期末无债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动对基金资产净值的影响不重大。

#### 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。持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债会存在相应的外汇风险。本基金管理人定期对基金面临的外汇风险进行监测和分析，以控制相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                 | 本期末<br>2026年6月30日 |              |                |              |
|--------------------|-------------------|--------------|----------------|--------------|
|                    | 美元<br>折合人民币<br>元  | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计           |
| 以外币计价的资产           |                   |              |                |              |
| 交易性金融资产            | -                 | 8,831,769.73 | -              | 8,831,769.73 |
| 资产合计               | -                 | 8,831,769.73 | -              | 8,831,769.73 |
| 以外币计价的负债           |                   |              |                |              |
| 负债合计               | -                 | -            | -              | -            |
| 资产负债表外<br>外汇风险敞口净额 | -                 | 8,831,769.73 | -              | 8,831,769.73 |

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                                                |                             |
|----|------------------------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 |                             |
| 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（2026 年 6 月 30 日）        |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%                                 | 441,588.49                  |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%                                 | -441,588.49                 |

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|------------------------|--------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 53,496,723.56          | 63.73        |
| 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            | 53,496,723.56          | 63.73        |

## 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。截至本报告期末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 53,496,723.56          |
| 第二层次          | —                      |
| 第三层次          | —                      |
| 合计            | 53,496,723.56          |

#### 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。

### 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<br>(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 53,496,723.56 | 59.33            |
|    | 其中：股票             | 53,496,723.56 | 59.33            |
| 2  | 基金投资              | —             | —                |
| 3  | 固定收益投资            | —             | —                |
|    | 其中：债券             | —             | —                |
|    | 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      | 35,368,914.63 | 39.22            |
| 8  | 其他各项资产            | 1,305,292.11  | 1.45             |
| 9  | 合计                | 90,170,930.30 | 100.00           |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,831,769.73 元，占净值比例 10.52%。

### 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<br>(%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —                |
| B  | 采矿业              | 691,112.00    | 0.82             |
| C  | 制造业              | 32,357,391.83 | 38.54            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —                |
| E  | 建筑业              | —             | —                |
| F  | 批发和零售业           | —             | —                |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —                |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 894,146.00    | 1.07             |
| J  | 金融业              | 10,722,304.00 | 12.77            |
| K  | 房地产业             | —             | —                |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -     |
| 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       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 44,664,953.83 | 53.21 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料      | -            | -            |
| 非日常生活消费品 | -            | -            |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 能源       | -            | -            |
| 金融       | -            | -            |
| 医疗保健     | -            | -            |
| 工业       | -            | -            |
| 信息技术     | 1,476,561.40 | 1.76         |
| 通信服务     | 7,355,208.33 | 8.76         |
| 公用事业     | -            | -            |
| 房地产      | -            | -            |
| 合计       | 8,831,769.73 | 10.52        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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  | 002415 | 海康威视 | 199,900 | 6,836,580.00 | 8.14         |
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 83,100  | 6,623,070.00 | 7.89         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 5,400   | 6,401,646.00 | 7.63         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 15,600  | 6,130,956.00 | 7.30         |
| 5  | 00700  | 腾讯控股 | 15,762  | 5,883,998.58 | 7.01         |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 153,800 | 4,418,674.00 | 5.26         |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 119,100 | 4,228,050.00 | 5.04         |
| 8  | 600760 | 中航沈飞 | 70,100  | 2,881,110.00 | 3.43         |
| 9  | 000776 | 广发证券 | 88,700  | 2,075,580.00 | 2.47         |
| 10 | 00981  | 中芯国际 | 19,016  | 1,476,561.40 | 1.76         |
| 11 | 01024  | 快手-W | 40,718  | 1,471,209.75 | 1.75         |
| 12 | 000792 | 盐湖股份 | 47,757  | 1,441,783.83 | 1.72         |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 12,300  | 1,345,251.00 | 1.60         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 14 | 688188 | 柏楚电子 | 8,380  | 894,146.00 | 1.07 |
| 15 | 603019 | 中科曙光 | 6,500  | 696,995.00 | 0.83 |
| 16 | 601899 | 紫金矿业 | 25,800 | 648,612.00 | 0.77 |
| 17 | 000975 | 山金国际 | 2,500  | 42,500.00  | 0.05 |

#### 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1  | 002594 | 比亚迪    | 39,993,241.39 | 47.64          |
| 1  | 01211  | 比亚迪股份  | 4,676,182.14  | 5.57           |
| 2  | 002415 | 海康威视   | 28,064,854.66 | 33.43          |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 23,655,879.20 | 28.18          |
| 4  | 00700  | 腾讯控股   | 23,368,798.87 | 27.84          |
| 5  | 600809 | 山西汾酒   | 20,470,010.00 | 24.38          |
| 6  | 300750 | 宁德时代   | 19,835,422.00 | 23.63          |
| 7  | 600030 | 中信证券   | 19,162,443.00 | 22.83          |
| 8  | 600036 | 招商银行   | 18,828,401.00 | 22.43          |
| 9  | 300059 | 东方财富   | 18,509,921.00 | 22.05          |
| 10 | 600760 | 中航沈飞   | 18,345,657.00 | 21.85          |
| 11 | 000975 | 山金国际   | 16,115,325.00 | 19.20          |
| 12 | 000792 | 盐湖股份   | 14,744,949.00 | 17.56          |
| 13 | 601899 | 紫金矿业   | 14,080,210.00 | 16.77          |
| 14 | 01024  | 快手-W   | 13,109,073.25 | 15.62          |
| 15 | 600547 | 山东黄金   | 12,794,012.00 | 15.24          |
| 16 | 600031 | 三一重工   | 8,961,454.00  | 10.68          |
| 17 | 01818  | 招金矿业   | 8,911,995.09  | 10.62          |
| 18 | 00981  | 中芯国际   | 8,906,488.95  | 10.61          |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗   | 7,169,445.68  | 8.54           |
| 20 | 09988  | 阿里巴巴-W | 5,916,750.28  | 7.05           |
| 21 | 02020  | 安踏体育   | 4,690,870.74  | 5.59           |
| 22 | 688188 | 柏楚电子   | 3,417,555.39  | 4.07           |
| 23 | 06181  | 老铺黄金   | 2,312,255.22  | 2.75           |
| 24 | 000776 | 广发证券   | 2,044,132.00  | 2.44           |

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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 002594 | 比亚迪   | 33,331,020.74 | 39.70          |
| 1  | 01211  | 比亚迪股份 | 4,786,483.87  | 5.70           |
| 2  | 002415 | 海康威视  | 21,660,618.70 | 25.80          |

|    |        |        |               |       |
|----|--------|--------|---------------|-------|
| 3  | 300750 | 宁德时代   | 16,775,459.80 | 19.98 |
| 4  | 300059 | 东方财富   | 15,846,449.80 | 18.88 |
| 5  | 600519 | 贵州茅台   | 15,685,131.70 | 18.68 |
| 6  | 600036 | 招商银行   | 14,178,295.00 | 16.89 |
| 7  | 600809 | 山西汾酒   | 13,767,743.00 | 16.40 |
| 8  | 600030 | 中信证券   | 13,541,412.00 | 16.13 |
| 9  | 600547 | 山东黄金   | 12,833,721.00 | 15.29 |
| 10 | 000975 | 山金国际   | 12,523,244.00 | 14.92 |
| 11 | 601899 | 紫金矿业   | 12,258,559.00 | 14.60 |
| 12 | 600760 | 中航沈飞   | 11,839,947.08 | 14.10 |
| 13 | 000792 | 盐湖股份   | 11,061,012.07 | 13.18 |
| 14 | 00700  | 腾讯控股   | 10,975,216.24 | 13.07 |
| 15 | 01024  | 快手-W   | 8,159,538.15  | 9.72  |
| 16 | 600031 | 三一重工   | 7,991,465.00  | 9.52  |
| 17 | 00981  | 中芯国际   | 7,280,703.02  | 8.67  |
| 18 | 01818  | 招金矿业   | 6,974,025.43  | 8.31  |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗   | 6,193,471.00  | 7.38  |
| 20 | 02020  | 安踏体育   | 4,460,396.02  | 5.31  |
| 21 | 09988  | 阿里巴巴-W | 4,310,824.50  | 5.14  |
| 22 | 688188 | 柏楚电子   | 2,690,665.51  | 3.21  |
| 23 | 06181  | 老铺黄金   | 1,966,689.02  | 2.34  |

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 | 359,764,394.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 272,061,824.09 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

## 7.12 投资组合报告附注

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

2025 年 9 月 12 日，招商银行股份有限公司因数据安全管理制度不到位，被金融监管总局警告并罚款 60 万元。

2025 年 8 月，广发证券股份有限公司因在美尚生态景观股份有限公司 2018 年非公开发行股票保荐业务中未勤勉尽责，被深交所给予公开谴责的处分。

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。

本基金投资的其余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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 83,317.05    |
| 2  | 应收清算款 | 1,199,918.37 |
| 3  | 应收股利  | 20,687.71    |
| 4  | 应收利息  | —            |
| 5  | 应收申购款 | 1,368.98     |
| 6  | 其他应收款 | —            |
| 7  | 待摊费用  | —            |
| 8  | 其他    | —            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 1,305,292.11 |
|---|----|--------------|

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中有流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |           |               |           |
|------------|----------|-----------|-------|-----------|---------------|-----------|
|            |          |           | 机构投资者 |           | 个人投资者         |           |
|            |          |           | 持有份额  | 占总份额比例（%） | 持有份额          | 占总份额比例（%） |
| 农银致远价值混合 A | 956      | 84,846.56 | 0.00  | 0.00      | 81,113,313.63 | 100.00    |
| 农银致远价值混合 C | 782      | 20,155.04 | 0.00  | 0.00      | 15,761,239.13 | 100.00    |
| 合计         | 1,738    | 55,739.10 | 0.00  | 0.00      | 96,874,552.76 | 100.00    |

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 | 农银致远价值混合 A | 694,669.43 | 0.8564      |
|                  | 农银致远价值混合 C | 109.35     | 0.0007      |
|                  | 合计         | 694,778.78 | 0.7172      |

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 农银致远价值混合 A | 50~100 |
|                                | 农银致远价值混合 C | 0      |
|                                | 合计         | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 农银致远价值混合 A | 0      |
|                                | 农银致远价值混合 C | 0      |
|                                | 合计         | 0      |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                  | 农银致远价值混合 A     | 农银致远价值混合 C    |
|-------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2026 年 1 月 27 日) 基金份额总额 | 328,698,442.22 | 30,287,202.96 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额               | 1,375,781.36   | 1,338,499.46  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额             | 248,960,909.95 | 15,864,463.29 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额              | —              | —             |
| 本报告期末基金份额总额                         | 81,113,313.63  | 15,761,239.13 |

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”）第六届董事会第六次会议决议，孙建坤先生自 2026 年 6 月 5 日起担任本公司总经理职务。程昆先生自 2026 年 6 月 5 日起不再担任公司总经理，黄涛先生自 2026 年 6 月 5 日起不再代为履行总经理职务。

本公司已于 2026 年 6 月 6 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无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人公司经营或基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

#### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无因托管业务受调查或处罚等情况。

#### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

#### 10.7.1 基金租用或者通过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(%) |    |
| 广发证券   | 2      | 262,084,232.91 | 41.48           | 114,575.42 | 41.62         | —  |
| 国泰海通证券 | 4      | 129,737,728.42 | 20.53           | 56,088.59  | 20.37         | —  |
| 东方证券   | 2      | 114,382,873.98 | 18.10           | 50,123.68  | 18.21         | —  |
| 国金证券   | 2      | 80,614,863.55  | 12.76           | 35,007.80  | 12.72         | —  |
| 申万宏源   | 2      | 26,723,738.    | 4.23            | 11,863.56  | 4.31          | —  |



|      |   |               |      |          |      |   |
|------|---|---------------|------|----------|------|---|
| 证券   |   | 76            |      |          |      |   |
| 中信证券 | 2 | 18,282,781.10 | 2.89 | 7,647.92 | 2.78 | - |
| 国投证券 | 2 | -             | -    | -        | -    | - |
| 国信证券 | 2 | -             | -    | -        | -    | - |
| 银河证券 | 1 | -             | -    | -        | -    | - |

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、本基金本报告期新增以上交易单元，无剔除交易单元。

#### 10.7.2 基金租用或者通过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 (%) |
| 广发证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国泰海通证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东方证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国金证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 申万宏源证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国投证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国信证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 银河证    | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

|   |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 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  | 农银汇理基金管理有限公司关于延迟中国农业银行股份有限公司代销旗下农银汇理致远价值混合型证券投资基金的公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 01 月 05 日 |
| 2  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同生效公告                            | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 1 月 28 日  |
| 3  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 4 月 21 日  |
| 4  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告                | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 4 月 27 日  |
| 5  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金开放日常转换业务的公告                         | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 6 月 16 日  |
| 6  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金-招募说明书更新-2026 年第 1 次                | 中国证监会规定的媒介 | 2026 年 6 月 29 日  |
| 7  | 农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                          | 中国证监会规定的媒介 | 2026 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理致远价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理致远价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照复印件；
- 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

2026 年 8 月 28 日