

农银汇理策略价值混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40

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	41
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	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理策略价值混合型证券投资基金
基金简称	农银策略价值混合
基金主代码	660004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 29 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	148,225,488.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有较高投资价值的股票，综合运用多种有效的投资策略，力争实现基金资产的理性增值。
投资策略	通过深入的基本面分析发掘股票的内在价值，利用非有效市场的定价偏差实现股票的投资价值。基金管理人将通过自上而下的资产配置和自下而上的个股精选相结合的方法构建投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	农银汇理基金管理有限公司	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	021-6063 7103
	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）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-2,190,571.18
本期利润	20,407,880.85
加权平均基金份额本期利润	0.1370
本期加权平均净值利润率	4.32%
本期基金份额净值增长率	4.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	330,855,239.61
期末可供分配基金份额利润	2.2321
期末基金资产净值	479,080,728.60
期末基金份额净值	3.2321
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	223.21%

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

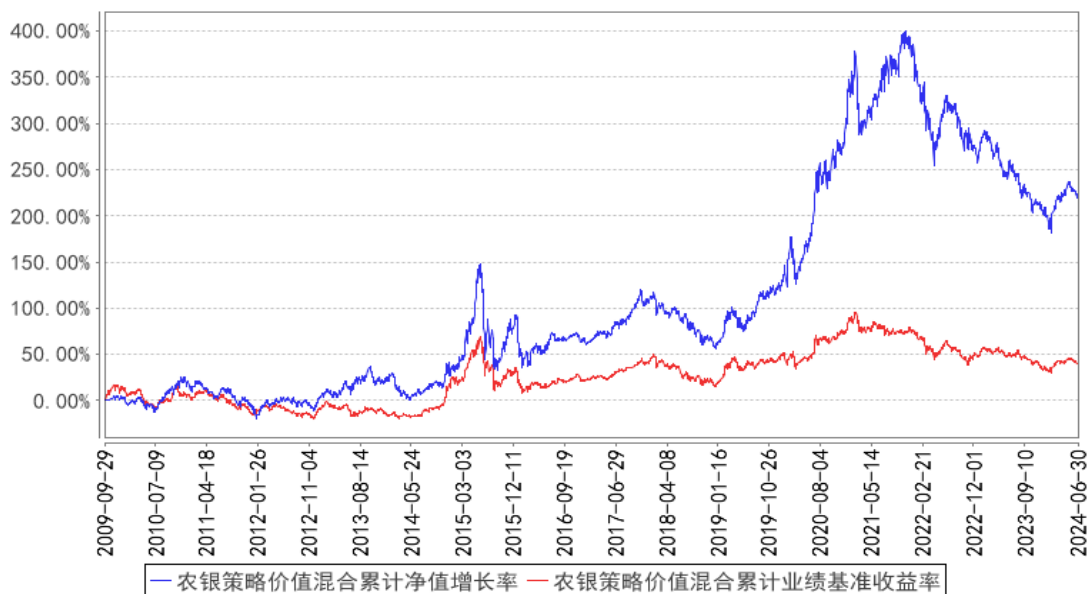
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.12%	0.49%	-2.24%	0.36%	1.12%	0.13%
过去三个月	0.67%	0.68%	-1.11%	0.56%	1.78%	0.12%
过去六个月	4.45%	0.93%	1.83%	0.67%	2.62%	0.26%
过去一年	-8.69%	0.84%	-5.87%	0.65%	-2.82%	0.19%

过去三年	-27.66%	1.11%	-22.98%	0.78%	-4.68%	0.33%
自基金合同生效起至今	223.21%	1.43%	40.06%	1.04%	183.15%	0.39%

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

农银策略价值混合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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%，其中投资于价值型股票的比例不少于股票资产的 80%，除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券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（2009 年 9 月 29 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 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 83 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农

银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理金聚高等级债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理智增一年定期开放混合型证券投资基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理策略收益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理新兴消费股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理金玉债券型证券投资基金、农银汇理金盛债券型证券投资基金、农银汇理瑞康 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理中证新华社民族品牌工程指数证券投资基金、农银汇理创新成长混合型证券投资基金、农银汇理悦利债券型证券投资基金、农银汇理均衡收益混合型证券投资基金、农银汇理金穗优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理瑞丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理金鸿短债债券型证券投资基金、农银汇理绿色能源精选混合型证券投资基金、农银汇理专精

特新混合型证券投资基金、农银汇理双利回报债券型证券投资基金、农银汇理金耀 3 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理品质农业股票型证券投资基金、农银汇理瑞泽添利债券型证券投资基金、农银汇理鑫享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、农银汇理景气优选混合型证券投资基金、农银汇理瑞云增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、农银汇理医疗精选股票型证券投资基金、农银汇理中证 1000 指数增强型证券投资基金、农银汇理均衡优选混合型证券投资基金、农银汇理金恒债券型证券投资基金、农银汇理瑞益一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理金季三个月持有期债券型发起式证券投资基金、农银汇理国企优选混合型证券投资基金、农银汇理金泽 60 天持有期债券型证券投资基金、农银汇理先进制造混合型证券投资基金、农银汇理金瑞利率债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金的基金经理	2015 年 6 月 6 日	-	16 年	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理，农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1 月市场大幅下跌，低估值大盘股表现相对抗跌，成长风格跌幅巨大。低波红利板块表现较好，其他板块多数下跌，跌幅较大的板块集中在高弹性及持仓相对拥挤的板块，如电子、计算机、军工及生物医药。2 月市场大幅反弹，风格上成长由于超跌反弹的原因表现更佳。3 月市场冲高回落，波动率大幅上升，低估值蓝筹相对抗跌，科技成长的回撤幅度较大。整体上 1 季度呈现先抑后扬、超跌反弹的特点。本基金在 1 季度的中后期小幅降低仓位，策略上保持类杠铃的配置策略，重点配置低波红利及出海成长，同时围绕 1 季度的景气情况，结合短期涨幅和拥挤度做一些个股的切换。行业层面主要增配公用事业、交通运输，减配金融、医药和电子。

4 月市场分化明显，大盘蓝筹股偏震荡，双创为代表的成长股下跌。由于前期市场反弹较多而 4 月临近 1 季度财报披露期，4 月市场风险偏好出现明显的下行，价值和成长出现显著分化，家电领涨，TMT 大幅下跌。5 月市场承压，风格分化明显。整体上红利类资产占优，特别是具备一定周期属性的高股息资产表现更好，如煤炭、银行等。下跌较多的集中在成长类别行业，特别是 TMT 的传媒和计算机。6 月市场普跌，超过半数行业出现大幅的下跌。风格上大盘好于中小盘。从行业的角度看，科技本月有所反弹，景气度 2Q 边际好转、叠加海外 AI 端侧映射的电子、通信表现靠前，此外，典型的低波红利类资产公用事业在水电稳定上涨的带动下也有较好的表现。本基金在 2 季度继续对仓位进行的小幅的下调并保持类杠铃的配置策略，重点配置公用事业、交运等红利资产以及汽零、机械等出海类资产，期间主要增配了公用事业，减配了白酒。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.2321 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.45%，业绩比较基准收益率为 1.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济或仍处磨底蓄力阶段。投资方面，在地方化债的背景下，基建投资的拉动比较有限；房地产销售在 517 政策后出现了短暂的回暖，但更持续的反弹或需继续等待，地产投资或继续偏弱；下半年制造业投资方面或有好转，更多源自超长期国债带动的设备更新需求。出口方面短期有望保持景气。由于未来关税存在加征的可能，短期海外加库存或继续带动出口的景气度，但是也容易出现后继乏力的问题。消费更多是经济的因变量，短期预计跟随经济大盘，继续磨底。

流动性方面，在美元利率高位的背景下，由于需要兼顾人民币汇率的问题，国内的流动性释放的空间短期来看相对有限。就资本市场而言，当前外资的入市意愿、居民的投资意愿均无明显变化的迹象，短期市场上流动性也预计会相对平淡。但若下半年美国如期降息，预计国内流动性会有所改善。

政策方面，从三中的全文来看，宏观政策上或会对短期的经济有一定的兼顾，但是决策上会更多的与长期问题挂钩，固本培元的思路下，货币和财政上总量发力的概率低，结构上发力更多围绕科技和安全，这一点和二十大报告的基调保持一致。产业政策方面主要还是围绕新质生产力、科技教育等领域，偏供给侧的扶持政策可能会更多一些。

对于资本市场，我们维持年初的判断，由于经济、流动性变化可能偏平，映射到指数上，股指大幅反弹有难度，行业、个股的结构性价可能更值得把握。我们认为，在资本开支周期见顶缓慢回落的背景下，不少行业和个股仍面临业绩上的压力，部分需求稳定、现金流强劲的红利股票仍有相对的配置价值，但鉴于近半年来部分高质量红利股已积累了不少的涨幅，我们认为红利股内部会出现一定的分化，汰弱留强及高低切换的现象可能会反复出现；另一方面，我们认为产能出海会是一个长期的趋势，相对于商品出口的高效率，产能出海的虽然效率不高，但是在关税壁垒的灰犀牛和非关税壁垒的黑天鹅频发的未来，具备全球产能布局的公司更有可能通过各地产能的调配，较好地熨平海外政治环境变化带来的经营波动。那些具备海外生产经验、产品的全球渗透率具备提升空间的高质量企业，有望获得确定性上的溢价。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则》、于 2022 年 7 月 1 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会于 2012

年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）、中国证券投资基金业协会于 2022 年 12 月 30 日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责：公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化，书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部，运营部参考测算结果对估值调整进行试算，并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督，根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员，均具有基金从业资格，具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求，但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：农银汇理策略价值混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	49,530,188.56	70,264,194.36
结算备付金		580,202.41	536,240.34
存出保证金		26,918.32	72,459.79
交易性金融资产	6.4.7.2	388,294,463.77	391,011,309.59
其中：股票投资		388,294,463.77	391,011,309.59
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	43,246,415.58	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		43,472.21	43,719.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		481,721,660.85	461,927,923.64
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		21,051.37	3,776.97
应付赎回款		1,268,685.92	303,472.44
应付管理人报酬		476,179.99	466,914.62
应付托管费		79,363.31	77,819.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	795,646.15	779,622.45
负债合计		2,640,932.25	1,631,605.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	148,225,488.99	148,745,116.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	330,855,239.61	311,551,202.05
净资产合计		479,080,728.60	460,296,318.05
负债和净资产总计		481,721,660.85	461,927,923.64

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.2321 元，基金份额总额 148,225,488.99 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理策略价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		23,790,926.46	-21,162,734.87

1. 利息收入		173,644.59	170,491.04
其中：存款利息收入	6.4.7.13	144,996.02	170,491.04
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		28,648.57	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		980,603.84	-35,373,588.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,601,721.71	-38,721,197.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,582,325.55	3,347,608.86
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	22,598,452.03	13,823,008.19
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	38,226.00	217,354.86
减：二、营业总支出		3,383,045.61	5,090,048.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,816,493.06	4,272,744.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	469,415.51	712,124.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		1.02	-
8. 其他费用	6.4.7.23	97,136.02	105,179.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,407,880.85	-26,252,783.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		20,407,880.85	-26,252,783.11

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,407,880.85	-26,252,783.11

6.3 净资产变动表

会计主体：农银汇理策略价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	148,745,116.00	-	311,551,202.05	460,296,318.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	148,745,116.00	-	311,551,202.05	460,296,318.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-519,627.01	-	19,304,037.56	18,784,410.55
(一)、综合收益总额	-	-	20,407,880.85	20,407,880.85
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-519,627.01	-	-1,103,843.29	-1,623,470.30
其中：1. 基金申购款	10,225,660.29	-	21,895,425.07	32,121,085.36
2. 基金赎回款	-10,745,287.30	-	-22,999,268.36	-33,744,555.66
(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	148,225,488.99	-	330,855,239.61	479,080,728.60
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	145,494,558.82	-	391,323,576.80	536,818,135.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	145,494,558.82	-	391,323,576.80	536,818,135.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,457,711.71	-	2,226,754.75	11,684,466.46
(一)、综合收益总额	-	-	-26,252,783.11	-26,252,783.11
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	9,457,711.71	-	28,479,537.86	37,937,249.57
其中：1. 基金申购款	49,457,053.23	-	137,573,040.01	187,030,093.24
2. 基金赎回款	-39,999,341.52	-	-109,093,502.15	-149,092,843.67
(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	154,952,270.53	-	393,550,331.55	548,502,602.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

程昆

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

农银汇理策略价值混合型证券投资基金(原名为“农银汇理策略价值股票型证券投资基金”,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[2009]第 821 号《关于同意农银汇理策略价值股票型证券投资基金募集的批复》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《农银汇理策略价值股票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 7,786,540,051.22 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 176 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理策略价值股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 7,788,527,651.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,987,599.94 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,农银汇理策略价值股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为农银汇理策略价值混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理策略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,包括国内依法上市的股票、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具:股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%,除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%,其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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×75%+中证全债指数×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴

纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	49,530,188.56
等于：本金	49,524,270.23
加：应计利息	5,918.33
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	49,530,188.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	379,846,951.02	-	388,294,463.77	8,447,512.75
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	379,846,951.02	-	388,294,463.77	8,447,512.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	43,246,415.58	-
银行间市场	-	-
合计	43,246,415.58	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期买入返售金融资产期末余额中无资产减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	291.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	458,333.20
其中：交易所市场	458,333.20

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48
合计	795,646.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,745,116.00	148,745,116.00
本期申购	10,225,660.29	10,225,660.29
本期赎回（以“-”号填列）	-10,745,287.30	-10,745,287.30
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	148,225,488.99	148,225,488.99

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	447,307,828.47	-135,756,626.42	311,551,202.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	447,307,828.47	-135,756,626.42	311,551,202.05
本期利润	-2,190,571.18	22,598,452.03	20,407,880.85
本期基金份额交易产生的变动数	-1,608,271.00	504,427.71	-1,103,843.29
其中：基金申购款	30,216,450.64	-8,321,025.57	21,895,425.07
基金赎回款	-31,824,721.64	8,825,453.28	-22,999,268.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	443,508,986.29	-112,653,746.68	330,855,239.61

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	140,144.27
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	4,468.60
其他	383.15
合计	144,996.02

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	463,859,780.55
减：卖出股票成本总额	466,322,857.66
减：交易费用	1,138,644.60
买卖股票差价收入	-3,601,721.71

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,582,325.55
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	4,582,325.55

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	22,598,452.03
股票投资	22,598,452.03
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	22,598,452.03

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	37,635.51
基金转换费收入	590.49
合计	38,226.00

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,114.54
账户维护费	9,000.00
合计	97,136.02

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年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	2,816,493.06	4,272,744.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,382,082.30	2,073,555.74
应支付基金管理人的净管理费	1,434,410.76	2,199,188.88

注：截至2023年8月6日，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1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《农银汇理基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 7 日起，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 1.20% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	469,415.51	712,124.11

注：

截至 2023 年 8 月 6 日，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 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《农银汇理基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 7 日起，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

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	49,530,188.56	140,144.27	76,881,139.75	159,531.30

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

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	主板锁定	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	创业板锁定	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301566	达利	2023	6个月	创业	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

	凯普	年 12 月 22 日		板锁定						
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	主板锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	主板锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

- 1、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。
- 2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。
- 3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。
- 4、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。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

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 7.4.12 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、流通受限制的投资品种比例、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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2024 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	49,530,188.56	-	-	-	49,530,188.56
结算备付金	580,202.41	-	-	-	580,202.41
存出保证金	26,918.32	-	-	-	26,918.32
交易性金融资产	-	-	-388,294,463.77	-	388,294,463.77
买入返售金融资产	43,246,415.58	-	-	-	43,246,415.58
应收申购款	-	-	-	43,472.21	43,472.21
资产总计	93,383,724.87	-	-388,337,935.98	-	481,721,660.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,268,685.92	1,268,685.92
应付管理人报酬	-	-	-	476,179.99	476,179.99
应付托管费	-	-	-	79,363.31	79,363.31
应付清算款	-	-	-	21,051.37	21,051.37
应交税费	-	-	-	5.51	5.51
其他负债	-	-	-	795,646.15	795,646.15
负债总计	-	-	-	2,640,932.25	2,640,932.25
利率敏感度缺口	93,383,724.87	-	-385,697,003.73	-	479,080,728.60
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	70,264,194.36	-	-	-	70,264,194.36
结算备付金	536,240.34	-	-	-	536,240.34
存出保证金	72,459.79	-	-	-	72,459.79
交易性金融资产	-	-	-391,011,309.59	-	391,011,309.59
应收申购款	-	-	-	43,719.56	43,719.56
资产总计	70,872,894.49	-	-391,055,029.15	-	461,927,923.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	303,472.44	303,472.44
应付管理人报酬	-	-	-	466,914.62	466,914.62
应付托管费	-	-	-	77,819.11	77,819.11
应付清算款	-	-	-	3,776.97	3,776.97
其他负债	-	-	-	779,622.45	779,622.45
负债总计	-	-	-	1,631,605.59	1,631,605.59
利率敏感度缺口	70,872,894.49	-	-389,423,423.56	-	460,296,318.05

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此，市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	388,294,463.77	81.05	391,011,309.59	84.95
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	388,294,463.77	81.05	391,011,309.59	84.95

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	26,319,611.55	22,800,057.47
业绩比较基准下降5%	-26,319,611.55	-22,800,057.47	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	388,261,912.57	390,942,902.70
第二层次	-	-
第三层次	32,551.20	68,406.89
合计	388,294,463.77	391,011,309.59

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	388,294,463.77	80.61
	其中：股票	388,294,463.77	80.61
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	43,246,415.58	8.98
	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	50,110,390.97	10.40
8	其他各项资产	70,390.53	0.01
9	合计	481,721,660.85	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	15,975,672.00	3.33
C	制造业	250,613,910.02	52.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,287,128.55	11.75
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,151,252.20	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	14,932,497.00	3.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,894,517.00	3.11
J	金融业	15,303,048.00	3.19
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,060.00	0.00

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,224,180.00	1.51
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	7,906,199.00	1.65
S	综合	-	-
	合计	388,294,463.77	81.05

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	600900	长江电力	482,900	13,965,468.00	2.92
2	601077	渝农商行	2,407,200	12,084,144.00	2.52
3	601766	中国中车	1,579,200	11,859,792.00	2.48
4	688596	正帆科技	357,852	11,809,116.00	2.46
5	000400	许继电气	340,300	11,709,723.00	2.44
6	002422	科伦药业	363,800	11,034,054.00	2.30
7	600886	国投电力	575,700	10,500,768.00	2.19
8	600989	宝丰能源	561,600	9,732,528.00	2.03
9	601989	中国重工	1,965,900	9,691,887.00	2.02
10	601899	紫金矿业	526,300	9,247,091.00	1.93
11	002415	海康威视	299,000	9,242,090.00	1.93
12	600941	中国移动	85,700	9,212,750.00	1.92
13	603225	新风鸣	590,000	9,198,100.00	1.92
14	300308	中际旭创	63,420	8,744,349.60	1.83
15	600519	贵州茅台	5,900	8,657,601.00	1.81
16	601985	中国核电	779,600	8,310,536.00	1.73
17	688234	天岳先进	175,412	8,230,331.04	1.72
18	001965	招商公路	682,700	8,096,822.00	1.69
19	601058	赛轮轮胎	575,300	8,054,200.00	1.68
20	002472	双环传动	342,700	7,546,254.00	1.58
21	000543	皖能电力	793,600	7,023,360.00	1.47
22	600276	恒瑞医药	179,820	6,915,877.20	1.44
23	600150	中国船舶	169,000	6,879,990.00	1.44
24	001872	招商港口	355,100	6,835,675.00	1.43
25	300435	中泰股份	568,615	6,692,598.55	1.40
26	000338	潍柴动力	364,100	5,912,984.00	1.23
27	002078	太阳纸业	407,000	5,677,650.00	1.19
28	600933	爱柯迪	377,300	5,580,267.00	1.16

29	003816	中国广核	1,184,800	5,485,624.00	1.15
30	000858	五 粮 液	42,400	5,428,896.00	1.13
31	605499	东鹏饮料	24,500	5,285,875.00	1.10
32	002138	顺络电子	192,100	5,275,066.00	1.10
33	300750	宁德时代	28,480	5,127,254.40	1.07
34	600875	东方电气	253,500	4,677,075.00	0.98
35	603198	迎驾贡酒	79,600	4,577,000.00	0.96
36	688332	中科蓝讯	76,412	4,507,543.88	0.94
37	300144	宋城演艺	525,300	4,218,159.00	0.88
38	601088	中国神华	89,700	3,979,989.00	0.83
39	600795	国电电力	632,000	3,785,680.00	0.79
40	601928	凤凰传媒	336,500	3,688,040.00	0.77
41	601100	恒立液压	77,500	3,609,950.00	0.75
42	002605	姚记科技	171,100	3,493,862.00	0.73
43	301039	中集车辆	390,500	3,358,300.00	0.70
44	300274	阳光电源	52,220	3,239,206.60	0.68
45	601881	中国银河	296,400	3,218,904.00	0.67
46	600054	黄山旅游	282,100	3,165,162.00	0.66
47	603099	长白山	139,400	3,103,044.00	0.65
48	600765	中航重机	150,600	3,072,240.00	0.64
49	603939	益丰药房	122,100	2,997,555.00	0.63
50	605555	德昌股份	159,100	2,960,851.00	0.62
51	002126	银轮股份	167,600	2,917,916.00	0.61
52	000100	TCL 科技	667,900	2,885,328.00	0.60
53	000426	兴业银锡	202,400	2,748,592.00	0.57
54	002179	中航光电	72,000	2,739,600.00	0.57
55	002752	昇兴股份	530,000	2,681,800.00	0.56
56	002615	哈尔斯	408,300	2,531,460.00	0.53
57	600660	福耀玻璃	51,100	2,447,690.00	0.51
58	000786	北新建材	81,000	2,402,460.00	0.50
59	002225	濮耐股份	584,900	2,392,241.00	0.50
60	002475	立讯精密	60,200	2,366,462.00	0.49
61	002517	恺英网络	229,100	2,187,905.00	0.46
62	603889	新澳股份	279,300	2,161,782.00	0.45
63	600694	大商股份	128,120	2,153,697.20	0.45
64	000596	古井贡酒	10,200	2,152,914.00	0.45
65	000960	锡业股份	122,900	1,903,721.00	0.40
66	300760	迈瑞医疗	6,500	1,890,915.00	0.39
67	300433	蓝思科技	99,900	1,823,175.00	0.38
68	600707	彩虹股份	255,400	1,739,274.00	0.36
69	300181	佐力药业	108,700	1,643,544.00	0.34
70	002353	杰瑞股份	44,300	1,554,044.00	0.32
71	600872	中炬高新	54,300	1,232,067.00	0.26

72	600066	宇通客车	46,100	1,189,380.00	0.25
73	601827	三峰环境	112,600	955,974.00	0.20
74	000999	华润三九	22,300	949,534.00	0.20
75	000521	长虹美菱	105,800	801,964.00	0.17
76	600236	桂冠电力	68,200	523,094.00	0.11
77	600398	海澜之家	54,000	498,960.00	0.10
78	301578	辰奕智能	1,528	60,462.96	0.01
79	688652	京仪装备	398	15,557.82	0.00
80	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
81	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
82	002027	分众传媒	1,000	6,060.00	0.00
83	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
84	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
85	603062	麦加芯彩	92	3,055.32	0.00
86	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	601077	渝农商行	13,156,000.00	2.86
2	601766	中国中车	11,905,124.00	2.59
3	300144	宋城演艺	11,461,393.40	2.49
4	600900	长江电力	10,450,036.00	2.27
5	601319	中国人保	10,138,830.00	2.20
6	601989	中国重工	9,727,120.00	2.11
7	603225	新凤鸣	8,703,521.00	1.89
8	601058	赛轮轮胎	8,553,768.69	1.86
9	000400	许继电气	8,011,235.00	1.74
10	688332	中科蓝讯	7,795,156.07	1.69
11	003816	中国广核	7,246,069.00	1.57
12	000338	潍柴动力	6,999,226.00	1.52
13	001872	招商港口	6,884,712.17	1.50
14	300435	中泰股份	6,837,159.88	1.49
15	601139	深圳燃气	6,707,211.00	1.46
16	000858	五粮液	6,491,575.00	1.41
17	600886	国投电力	5,956,653.00	1.29
18	002517	恺英网络	5,861,996.00	1.27
19	600309	万华化学	5,593,217.00	1.22
20	300775	三角防务	5,426,316.00	1.18

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	601882	海天精工	14,716,521.60	3.20
2	600809	山西汾酒	12,413,973.89	2.70
3	000543	皖能电力	12,123,774.00	2.63
4	600150	中国船舶	11,796,134.00	2.56
5	000568	泸州老窖	11,507,125.30	2.50
6	002475	立讯精密	11,167,347.00	2.43
7	002078	太阳纸业	10,621,574.00	2.31
8	601319	中国人保	10,166,138.00	2.21
9	601985	中国核电	8,468,787.00	1.84
10	600079	人福医药	8,256,961.00	1.79
11	603393	新天然气	7,764,112.60	1.69
12	000951	中国重汽	7,555,925.40	1.64
13	600426	华鲁恒升	7,405,274.00	1.61
14	600941	中国移动	7,254,817.00	1.58
15	300775	三角防务	7,221,921.00	1.57
16	002430	杭氧股份	7,185,239.00	1.56
17	601658	邮储银行	7,024,878.00	1.53
18	002096	易普力	6,807,060.00	1.48
19	601139	深圳燃气	6,177,552.00	1.34
20	300795	米奥会展	5,957,870.50	1.29

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	441,007,559.81
卖出股票收入（成交）总额	463,859,780.55

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。

7.12 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

2024 年 4 月 29 日，许继电气股份有限公司因信息披露管理不到位、内控管理不到位，被河南证监局采取责令改正的行政监管措施。

2024 年 4 月 30 日，许继电气股份有限公司因信息披露管理不到位、内控管理不到位，被深圳交易所出具监管函。

2023 年 12 月 29 日，中国重工因存在以下违法事实：中国重工未对下属子公司存货在相应会计期间准确计提减值，导致中国重工 2018 年多计利润 7,181.24 万元，2019 年多计利润 10,711.29 万元，2020 年少计利润 12,200 万元，上述事项导致中国重工 2018 年、2019 年、2020 年年度报告存在错报，被中国证监会北京监管局警告并处以 150 万元的罚款。

2024 年 2 月 1 日，中国重工因存在以下违法事实：中国重工未对下属子公司存货在相应会计期间准确计提减值，导致中国重工 2018 年多计利润 7,181.24 万元，2019 年多计利润 10,711.29 万元，2020 年少计利润 12,200 万元，上述事项导致中国重工 2018 年、2019 年、2020 年年度报告存在错报，被上海证券交易所予以通报批评。

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

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

责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	26,918.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	43,472.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,390.53

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

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 (%)
46,306	3,201.00	2,030,951.55	1.37	146,194,537.44	98.63

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	87,340.36	0.0589

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	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	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月29日） 基金份额总额	7,788,527,651.16
本报告期期初基金份额总额	148,745,116.00
本报告期基金总申购份额	10,225,660.29
减：本报告期基金总赎回份额	10,745,287.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	148,225,488.99

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）第五届董事会第十五次会议决议，高国鹏先生自 2024 年 6 月 27 日离任本公司副总经理职务。

本公司已于 2024 年 6 月 29 日在规定媒介以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。 本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 2 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	行政监管措施。 公司：责令改正；高级管理人员：警示函。
受到稽查或处罚等措施的原因	内部控制不健全，违反《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已按照法律法规及监管要求及时完成整改工作。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	503,279,647.36	55.63	468,972.90	55.26	-
国金证券	2	107,913,321.72	11.93	102,077.47	12.03	-
东方证券	2	107,572,591.37	11.89	101,750.34	11.99	-
中信证券	2	105,943,984.93	11.71	100,212.52	11.81	-
安信证券	2	61,461,175.44	6.79	58,133.61	6.85	-
申万宏源证券	2	16,641,129.50	1.84	15,741.01	1.85	-
海通证券	2	1,915,151.00	0.21	1,811.14	0.21	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、交易单元选择标准有：

(1) 财务状况良好，注册资本不少于 20 亿元人民币，最近一个完整年度在证券业协会披露的审计报告被出具无保留意见。

(2) 交易、研究等服务能力较强，最近一个完整年度年报披露的佣金席位占比在全市场前 1/2。

(3) 经营行为规范，合规风控能力较强，最近一年未因研究、交易业务违规而在中国证券监督管理委员会及其派出机构网站披露受到行政处罚。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	-	-	34,637,000.00	44.48	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	43,230,000.00	55.52	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	农银汇理策略价值混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
2	农银汇理策略价值混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 3 月 28 日
3	农银汇理策略价值混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2024 年 4 月 18 日
4	农银汇理策略价值混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
5	农银汇理策略价值混合型证券投资基金—招募说明书更新—2024 年第 1 次	证券日报、基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理策略价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理策略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

2024 年 8 月 29 日