

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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的情况	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理中证 500 指数证券投资基金
基金简称	农银中证 500 指数
基金主代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,172,461.84 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率}$ 。
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	汤嵩彦
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城路 9	上海市浦东新区银城中路 188

	号农银大厦 50 层	号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	于进	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 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	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,520,059.00
本期利润	-16,509,488.80
加权平均基金份额本期利润	-0.2994
本期加权平均净值利润率	-19.63%
本期基金份额净值增长率	-18.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	32,789,253.71
期末可供分配基金份额利润	0.5735
期末基金资产净值	89,961,715.55
期末基金份额净值	1.5735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	57.35%

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 06 月 30 日。

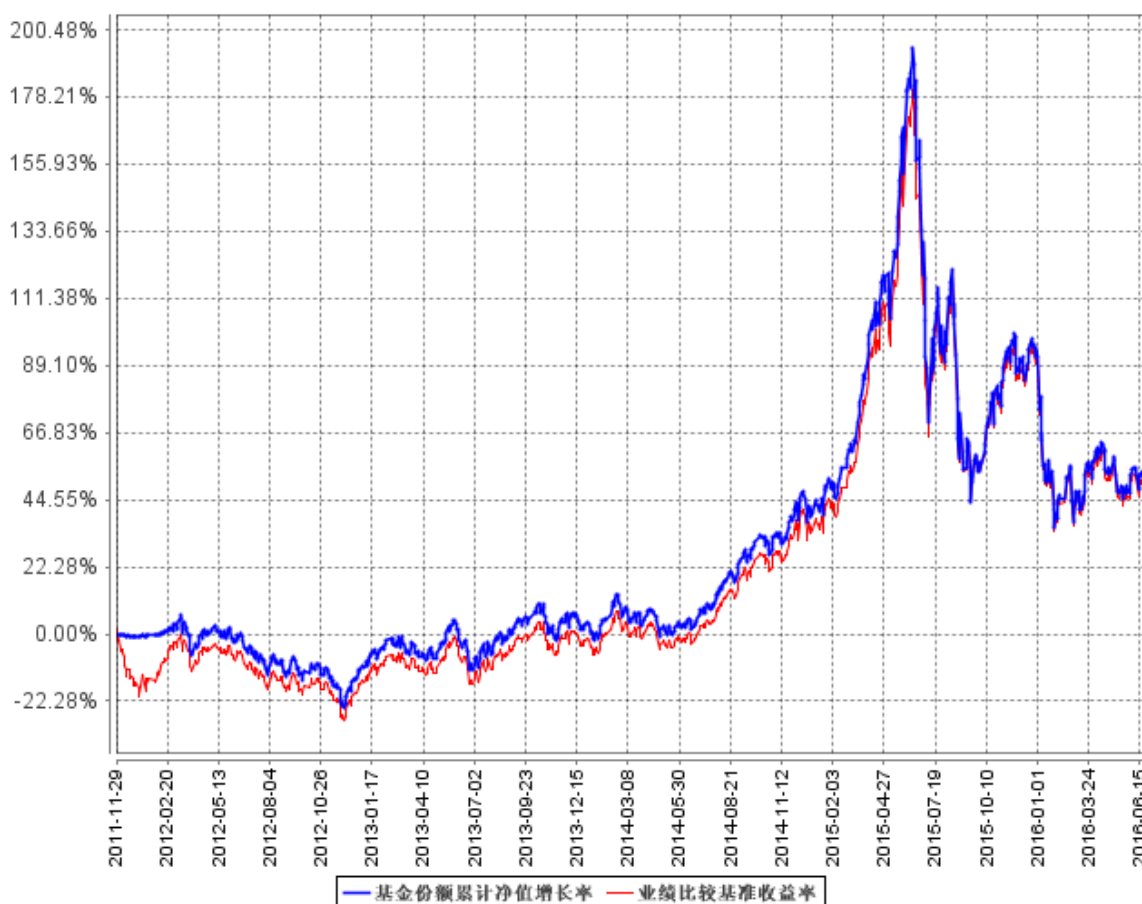
3.2 基金净值表现

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	3.03%	1.45%	2.82%	1.47%	0.21%	-0.02%
过去三个月	-0.16%	1.56%	-0.46%	1.57%	0.30%	-0.01%
过去六个月	-18.14%	2.44%	-18.57%	2.43%	0.43%	0.01%
过去一年	-31.63%	2.79%	-29.58%	2.77%	-2.05%	0.02%
过去三年	77.74%	2.04%	84.86%	2.03%	-7.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	57.35%	1.81%	54.62%	1.85%	2.73%	-0.04%

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

基金份额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：本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中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（2011 年 11 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贰亿零壹元，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%，中国铝业股份有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 32 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、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财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 14 天理财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、农银汇理物联网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和农银汇理纯债一年定期开放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		
宋永安	本基金基金经理	2014 年 2 月 10 日	—	9	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》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。

4.2 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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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。

中国证监会上海监管局对公司内部控制及风险管理情况进行了专项现场检查，于 2015 年就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施。公司以此现场检查为契机，认真落实上海监管局各项整改意见，进一步提升公司整体内部控制水平。

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。

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

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0449%，日均偏离度为 0.0275%。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长-18.14%，同期业绩比较基准收益率为-18.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证 500 指数的被动化指数产品，我们将坚持指数被动化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

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 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

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

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

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年上半年度，基金托管人在农银汇理中证 500 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 年上半年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理中证 500 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2016 年上半年度，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理中证 500 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	480,453.63	319,380.59
结算备付金		1,714,914.70	1,488,296.43
存出保证金		10,323.48	54,306.90
交易性金融资产	6.4.7.2	88,162,758.39	92,422,100.94
其中：股票投资		85,176,551.19	88,421,700.94
基金投资		-	-
债券投资		2,986,207.20	4,000,400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		776,272.62	241,084.58
应收利息	6.4.7.5	54,282.20	231,661.21
应收股利		-	-
应收申购款		73,800.08	4,392.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,272,805.10	94,761,223.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		773,774.85	241,766.44
应付管理人报酬		54,295.79	61,857.07
应付托管费		10,859.16	12,371.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,082.55	66,787.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	447,077.20	360,859.13
负债合计		1,311,089.55	743,641.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	57,172,461.84	48,913,300.02
未分配利润	6.4.7.10	32,789,253.71	45,104,281.40
所有者权益合计		89,961,715.55	94,017,581.42
负债和所有者权益总计		91,272,805.10	94,761,223.01

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5735 元，基金份额总额 57,172,461.84 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-15,820,276.81	48,821,066.24
1.利息收入		46,035.21	112,130.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,587.55	23,938.49
债券利息收入		29,447.66	88,191.79
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）		-901,093.10	34,456,353.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,263,588.75	34,089,240.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-100,355.56	-48.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	462,851.21	367,161.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,989,429.80	14,081,231.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	24,210.88	171,351.14
减：二、费用		689,211.99	1,006,846.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	313,528.19	417,828.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	62,705.59	83,565.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	59,341.51	240,070.15
5. 利息支出		344.00	7,505.41
其中：卖出回购金融资产支出		344.00	7,505.41
6. 其他费用	6.4.7.20	253,292.70	257,877.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,509,488.80	47,814,219.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,509,488.80	47,814,219.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	48,913,300.02	45,104,281.40	94,017,581.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,509,488.80	-16,509,488.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	8,259,161.82	4,194,461.11	12,453,622.93
其中：1.基金申购款	22,191,600.95	11,430,812.82	33,622,413.77
2.基金赎回款	-13,932,439.13	-7,236,351.71	-21,168,790.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,172,461.84	32,789,253.71	89,961,715.55
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	68,820,784.79	27,735,601.22	96,556,386.01

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47,814,219.56	47,814,219.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-15,145,454.28	-5,690,161.04	-20,835,615.32
其中: 1.基金申购款	75,035,775.48	85,799,495.52	160,835,271.00
2.基金赎回款	-90,181,229.76	-91,489,656.56	-181,670,886.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	53,675,330.51	69,859,659.74	123,534,990.25

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:

_____ 许金超	_____ 刘志勇	_____ 高利民
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理中证 500 指数证券投资基金(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[2011]第 1207 号《关于核准农银汇理中证 500 指数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《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 711,073,400.42 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(2011)第 453 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,243.88 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数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,包括中证 500 指数成份股及备选

成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券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的相关规定。其中:中证 500 指数成分股和备选股的投资比例不低于基金资产的 90%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%,其中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%。本基金的业绩比较基准为:95%×中证 500 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率。

根据《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金 投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	480,453.63
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	480,453.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,396,869.72	85,176,551.19	-4,220,318.53
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	2,990,988.00	2,986,207.20
	银行间市场	—	—
	合计	2,990,988.00	2,986,207.20
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	92,387,857.72	88,162,758.39	-4,225,099.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	106.27
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—

应收结算备付金利息	655.31
应收债券利息	53,516.31
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.08
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.23
合计	54,282.20

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	25,082.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,082.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	2,869.50
预提费用	194,207.70
合计	447,077.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,913,300.02	48,913,300.02
本期申购	22,191,600.95	22,191,600.95
本期赎回(以“-”号填列)	-13,932,439.13	-13,932,439.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	57,172,461.84	57,172,461.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	45,357,114.09	-252,832.69	45,104,281.40
本期利润	-1,520,059.00	-14,989,429.80	-16,509,488.80
本期基金份额交易产生的变动数	7,600,760.04	-3,406,298.93	4,194,461.11
其中：基金申购款	20,347,775.19	-8,916,962.37	11,430,812.82
基金赎回款	-12,747,015.15	5,510,663.44	-7,236,351.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,437,815.13	-18,648,561.42	32,789,253.71

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,287.94
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	8,094.01
其他	205.60
合计	16,587.55

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	15,133,416.33
减：卖出股票成本总额	16,397,005.08
买卖股票差价收入	-1,263,588.75

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-100,355.56
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-100,355.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,232,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,100,355.56
减：应收利息总额	232,000.00
买卖债券差价收入	-100,355.56

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资基金收益

本基金本报告期无资产支持证券投资基金收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	462,851.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	462,851.21

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,989,429.80
——股票投资	-15,084,604.56
——债券投资	95,174.76
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-14,989,429.80

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,653.50
转换费	7,557.38
合计	24,210.88

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

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	59,341.51
银行间市场交易费用	-
合计	59,341.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	119,344.68
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	85.00
合计	253,292.70

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**

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要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	本基金的管理人
交通银行股份有限公司	本基金的托管人

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	313,528.19	417,828.02
其中：支付销售机构的客户维护费	138,647.24	183,812.71

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	62,705.59	83,565.58

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无应支付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

本基金本报告期间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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
交通银行	480,453.63	8,287.94	6,909,771.26	9,588.17

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600654	中安消	2016 年 5 月 19 日	公告重大事件	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	18,701	340,892.21	346,716.54	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	公告重大事件	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	24,610	206,838.52	322,144.90	-
600166	福田汽车	2016 年 6 月 30 日	公告重大事件	5.52	2016 年 7 月 1 日	5.62	53,600	291,236.24	295,872.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	公告重大事件	15.36	-	-	16,900	422,813.10	259,584.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	公告重大事件	8.92	-	-	27,600	219,408.15	246,192.00	-
601168	西部矿业	2016 年 2 月 1 日	公告重大事件	5.93	2016 年 7 月 22 日	6.52	41,000	291,561.69	243,130.00	-
600497	驰宏锌锗	2016 年 6 月 13 日	公告重大事件	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	21,100	213,393.69	210,367.00	-
002512	达华	2016 年	公告	20.28	2016 年	19.38	10,100	199,758.00	204,828.00	-

	智能	6月21日	重大事项		7月21日					
600759	洲际油气	2016年6月27日	公告 重大事项	7.58	2016年7月11日	8.10	26,093	230,483.31	197,784.94	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	公告 重大事项	15.00	-	-	12,923	158,406.97	193,845.00	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	公告 重大事项	5.35	-	-	33,930	264,749.78	181,525.50	-
600511	国药股份	2016年2月18日	公告 重大事项	27.42	2016年8月4日	30.16	6,600	208,418.54	180,972.00	-
002672	东江环保	2016年5月23日	公告 重大事项	17.33	2016年7月15日	19.06	9,825	162,840.37	170,267.25	-
002373	千方科技	2016年5月12日	公告 重大事项	14.94	2016年8月16日	16.43	10,600	255,346.05	158,364.00	-
600773	西藏城投	2016年6月30日	公告 重大事项	15.67	-	-	10,100	152,101.44	158,267.00	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	公告 重大事项	20.10	2016年7月7日	19.80	7,800	136,500.00	156,780.00	-
002190	成飞集成	2016年4月21日	公告 重大事项	35.44	2016年7月12日	38.98	4,100	187,950.93	145,304.00	-
000401	冀东水泥	2016年4月6日	公告 重大事项	10.90	2016年7月14日	11.32	12,900	171,789.49	140,610.00	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	公告 重大事项	2.52	-	-	47,400	203,118.71	119,448.00	-
002663	普邦园林	2016年4月27日	公告 重大事项	7.36	-	-	16,229	118,575.57	119,445.44	-
600614	鼎立股份	2016年4月25日	公告 重大事项	8.14	-	-	14,124	117,711.24	114,969.36	-
000636	风华高科	2016年3月15日	公告 重大事项	8.84	2016年7月13日	9.72	12,800	113,400.51	113,152.00	-

600545	新疆城建	2016 年 5 月 31 日	公告重大事项	6.91	-	-	13,100	139,918.02	90,521.00	-
600640	号百控股	2016 年 4 月 18 日	公告重大事项	16.79	2016 年 8 月 22 日	18.44	5,100	105,387.20	85,629.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	公告重大事项	12.50	-	-	6,400	147,996.60	80,000.00	-
000517	荣安地产	2016 年 6 月 14 日	公告重大事项	4.84	2016 年 7 月 14 日	4.98	14,700	72,765.00	71,148.00	-
002249	大洋电机	2016 年 6 月 8 日	公告重大事项	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	5,100	49,057.66	61,047.00	-
600751	天海投资	2016 年 2 月 15 日	公告重大事项	6.11	2016 年 7 月 26 日	6.72	7,000	63,948.00	42,770.00	-
000582	北部湾港	2016 年 2 月 29 日	公告重大事项	16.32	-	-	2,000	47,182.54	32,640.00	-

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股和新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票）、货币及剩余期限在一年以内的政府债券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的相关规定。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险，并通过设定相应的

风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统，有效的控制和跟踪上述各类风险。

本基金的基金管理人的风险管理机构由董事会稽核及风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部以及各个业务部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放于本基金的托管人 - 交通银行，本基金认为与交通银行相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的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模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金为全被动的指数基金，其主要资产都将用于跟踪组合的构建。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场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交易的股票，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，本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	85,176,551.19	94.68	88,421,700.94	94.05
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	85,176,551.19	94.68	88,421,700.94	94.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5，其它变量不变		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,533,852.66	4,742,534.24
	业绩比较基准下降 5%	-4,533,852.66	-4,742,534.24

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。

§ 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	85,176,551.19	93.32
	其中：股票	85,176,551.19	93.32
2	固定收益投资	2,986,207.20	3.27
	其中：债券	2,986,207.20	3.27
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,195,368.33	2.41
7	其他各项资产	914,678.38	1.00
8	合计	91,272,805.10	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	1,613,237.00	1.79
B	采矿业	3,509,426.68	3.90
C	制造业	50,254,199.71	55.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,417,008.48	2.69
E	建筑业	2,554,629.20	2.84
F	批发和零售业	4,911,561.22	5.46
G	交通运输、仓储和邮政业	2,281,901.83	2.54
H	住宿和餐饮业	147,224.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,500,647.47	6.11
J	金融业	409,840.10	0.46
K	房地产业	5,600,509.91	6.23
L	租赁和商务服务业	1,213,135.08	1.35
M	科学研究和技术服务业	395,644.90	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	569,169.31	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	244,711.60	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1,507,630.00	1.68
S	综合	1,018,381.26	1.13
	合计	84,148,857.75	93.54

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	80,000.00	0.09
C	制造业	246,192.00	0.27
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	32,640.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	346,716.54	0.39

	服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	322, 144. 90	0. 36
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	1, 027, 693. 44	1. 14

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	13, 540	578, 022. 60	0. 64
2	600584	长电科技	23, 600	478, 844. 00	0. 53
3	002405	四维图新	19, 431	478, 002. 60	0. 53
4	002340	格林美	46, 348	406, 471. 96	0. 45
5	600522	中天科技	41, 405	405, 769. 00	0. 45
6	300072	三聚环保	13, 442	371, 536. 88	0. 41
7	002049	紫光国芯	8, 300	364, 785. 00	0. 41
8	002085	万丰奥威	20, 700	355, 833. 00	0. 40
9	600201	生物股份	13, 000	355, 290. 00	0. 39
10	300113	顺网科技	9, 300	353, 028. 00	0. 39
11	600079	人福医药	20, 500	343, 785. 00	0. 38
12	600521	华海药业	14, 110	343, 155. 20	0. 38
13	002572	索菲亚	6, 000	336, 120. 00	0. 37
14	600503	华丽家族	36, 500	334, 705. 00	0. 37

15	600219	南山铝业	45,200	334,480.00	0.37
16	600525	长园集团	23,960	331,846.00	0.37
17	002426	胜利精密	33,200	327,020.00	0.36
18	000661	长春高新	3,050	325,374.00	0.36
19	600682	南京新百	11,300	321,711.00	0.36
20	002030	达安基因	11,560	321,368.00	0.36
21	300253	卫宁健康	12,920	319,124.00	0.35
22	601012	隆基股份	24,200	315,810.00	0.35
23	600436	片仔癀	6,850	308,318.50	0.34
24	002439	启明星辰	11,900	307,377.00	0.34
25	000887	中鼎股份	13,860	306,444.60	0.34
26	002508	老板电器	8,262	303,793.74	0.34
27	002400	省广股份	21,380	302,099.40	0.34
28	600978	宜华生活	26,980	300,557.20	0.33
29	600699	均胜电子	7,800	298,740.00	0.33
30	000997	新大陆	14,900	298,596.00	0.33
31	600166	福田汽车	53,600	295,872.00	0.33
32	002131	利欧股份	17,300	295,657.00	0.33
33	002179	中航光电	6,820	295,442.40	0.33
34	600879	航天电子	18,930	294,929.40	0.33
35	000983	西山煤电	35,900	292,585.00	0.33
36	002273	水晶光电	10,400	291,096.00	0.32
37	000748	长城信息	14,800	290,376.00	0.32
38	002004	华邦健康	31,665	289,101.45	0.32
39	600498	烽火通信	11,900	288,932.00	0.32
40	600482	中国动力	8,800	288,376.00	0.32
41	000988	华工科技	14,200	284,710.00	0.32
42	002701	奥瑞金	32,132	283,725.56	0.32
43	600664	哈药股份	33,990	281,777.10	0.31
44	000970	中科三环	19,400	281,494.00	0.31
45	002038	双鹭药业	9,300	280,674.00	0.31
46	600122	宏图高科	20,900	279,642.00	0.31
47	002310	东方园林	11,500	275,080.00	0.31
48	300088	长信科技	18,400	273,608.00	0.30
49	600158	中体产业	15,400	273,350.00	0.30
50	000998	隆平高科	14,300	271,414.00	0.30
51	603019	中科曙光	6,800	270,776.00	0.30
52	600635	大众公用	44,900	270,747.00	0.30
53	000078	海王生物	36,100	268,223.00	0.30

54	600266	北京城建	21,400	267,286.00	0.30
55	000050	深天马 A	12,800	267,136.00	0.30
56	600478	科力远	22,125	267,048.75	0.30
57	000656	金科股份	68,900	263,198.00	0.29
58	600143	金发科技	40,800	262,752.00	0.29
59	002001	新 和 成	12,400	262,012.00	0.29
60	002299	圣农发展	10,100	261,590.00	0.29
61	000547	航天发展	16,900	259,584.00	0.29
62	600643	爱建集团	26,170	255,680.90	0.28
63	600138	中青旅	13,225	255,507.00	0.28
64	600418	江淮汽车	20,000	253,600.00	0.28
65	002276	万马股份	12,780	253,171.80	0.28
66	300055	万邦达	13,800	251,298.00	0.28
67	002168	深圳惠程	17,820	250,905.60	0.28
68	600487	亨通光电	19,750	248,455.00	0.28
69	600655	豫园商城	22,900	248,236.00	0.28
70	600673	东阳光科	39,318	245,737.50	0.27
71	002573	清新环境	14,508	245,475.36	0.27
72	600645	中源协和	6,985	245,452.90	0.27
73	600388	龙净环保	19,500	244,920.00	0.27
74	300244	迪安诊断	7,420	244,711.60	0.27
75	002191	劲嘉股份	21,000	243,390.00	0.27
76	601168	西部矿业	41,000	243,130.00	0.27
77	600312	平高电气	15,500	242,730.00	0.27
78	002223	鱼跃医疗	7,593	240,849.96	0.27
79	000930	中粮生化	21,900	240,462.00	0.27
80	000012	南 玻 A	20,900	239,514.00	0.27
81	600198	大唐电信	12,040	239,355.20	0.27
82	002714	牧原股份	4,700	237,491.00	0.26
83	002074	国轩高科	6,000	236,820.00	0.26
84	600200	江苏吴中	12,200	236,314.00	0.26
85	000762	西藏矿业	9,500	234,840.00	0.26
86	600094	大名城	24,700	234,650.00	0.26
87	000031	中粮地产	24,800	233,864.00	0.26
88	002595	豪迈科技	10,900	232,933.00	0.26
89	000697	炼石有色	10,190	232,841.50	0.26
90	002221	东华能源	19,006	231,683.14	0.26
91	600594	益佰制药	14,400	230,112.00	0.26
92	000581	威孚高科	11,400	229,824.00	0.26

93	600410	华胜天成	20,429	229,213.38	0.25
94	600435	北方导航	16,900	224,939.00	0.25
95	600151	航天机电	19,900	224,870.00	0.25
96	000979	中弘股份	81,868	224,318.32	0.25
97	600851	海欣股份	16,800	223,608.00	0.25
98	002308	威创股份	13,456	221,082.08	0.25
99	002311	海大集团	14,000	220,780.00	0.25
100	600770	综艺股份	17,700	220,542.00	0.25
101	600884	杉杉股份	12,800	220,288.00	0.24
102	300274	阳光电源	9,000	219,600.00	0.24
103	002048	宁波华翔	9,600	219,552.00	0.24
104	600687	刚泰控股	13,500	219,510.00	0.24
105	600160	巨化股份	20,600	218,978.00	0.24
106	002410	广联达	15,300	218,790.00	0.24
107	000671	阳光城	36,800	218,592.00	0.24
108	300010	立思辰	10,400	218,192.00	0.24
109	000566	海南海药	19,900	217,109.00	0.24
110	600811	东方集团	32,500	216,450.00	0.24
111	600499	科达洁能	12,800	216,448.00	0.24
112	000860	顺鑫农业	9,100	216,398.00	0.24
113	000598	兴蓉环境	40,800	215,424.00	0.24
114	600171	上海贝岭	12,400	215,388.00	0.24
115	600516	方大炭素	23,500	214,790.00	0.24
116	000400	许继电气	13,900	214,616.00	0.24
117	600601	方正科技	49,900	214,570.00	0.24
118	600500	中化国际	23,700	214,248.00	0.24
119	002477	雏鹰农牧	35,700	213,129.00	0.24
120	600366	宁波韵升	8,900	212,443.00	0.24
121	002665	首航节能	26,860	211,925.40	0.24
122	600176	中国巨石	22,142	211,898.94	0.24
123	002268	卫士通	5,900	210,866.00	0.23
124	300115	长盈精密	10,220	210,532.00	0.23
125	600755	厦门国贸	26,468	210,420.60	0.23
126	600497	驰宏锌锗	21,100	210,367.00	0.23
127	002353	杰瑞股份	10,900	210,152.00	0.23
128	600240	华业资本	20,960	210,019.20	0.23
129	600392	盛和资源	12,800	209,664.00	0.23
130	002657	中科金财	3,800	208,772.00	0.23
131	000758	中色股份	26,900	208,475.00	0.23

132	002051	中工国际	10,580	208,108.60	0.23
133	002366	台海核电	3,900	207,909.00	0.23
134	600565	迪马股份	32,000	206,720.00	0.23
135	300273	和佳股份	10,780	206,437.00	0.23
136	600259	广晟有色	3,600	206,136.00	0.23
137	300199	翰宇药业	10,100	205,535.00	0.23
138	002512	达华智能	10,100	204,828.00	0.23
139	002092	中泰化学	24,200	204,732.00	0.23
140	000008	神州高铁	18,800	204,732.00	0.23
141	002155	湖南黄金	15,500	204,135.00	0.23
142	000727	华东科技	61,800	203,940.00	0.23
143	600633	浙报传媒	13,500	203,040.00	0.23
144	000690	宝新能源	29,700	201,366.00	0.22
145	300043	互动娱乐	14,200	201,214.00	0.22
146	300182	捷成股份	11,700	200,187.00	0.22
147	600881	亚泰集团	41,400	199,548.00	0.22
148	601929	吉视传媒	49,500	199,485.00	0.22
149	600651	飞乐音响	15,740	199,268.40	0.22
150	002444	巨星科技	9,800	199,136.00	0.22
151	300026	红日药业	11,400	198,246.00	0.22
152	002022	科华生物	9,300	198,183.00	0.22
153	600759	洲际油气	26,093	197,784.94	0.22
154	300001	特锐德	9,100	197,379.00	0.22
155	002217	合力泰	12,900	197,370.00	0.22
156	002013	中航机电	14,635	197,279.80	0.22
157	600216	浙江医药	14,900	196,531.00	0.22
158	000878	云南铜业	19,300	196,474.00	0.22
159	002489	浙江永强	24,792	196,352.64	0.22
160	002271	东方雨虹	11,302	194,733.46	0.22
161	000975	银泰资源	12,923	193,845.00	0.22
162	600611	大众交通	28,450	193,744.50	0.22
163	600528	中铁二局	16,600	192,726.00	0.21
164	601311	骆驼股份	9,700	192,545.00	0.21
165	000066	长城电脑	15,100	192,525.00	0.21
166	002250	联化科技	13,444	192,518.08	0.21
167	603766	隆鑫通用	9,500	192,090.00	0.21
168	600316	洪都航空	9,800	191,198.00	0.21
169	300291	华录百纳	8,100	190,593.00	0.21
170	601155	新城控股	20,200	187,052.00	0.21

171	600064	南京高科	12,450	186,127.50	0.21
172	600787	中储股份	25,000	185,750.00	0.21
173	600572	康恩贝	28,565	185,101.20	0.21
174	000028	国药一致	2,832	184,363.20	0.20
175	000973	佛塑科技	17,650	184,266.00	0.20
176	000021	深科技	16,709	183,966.09	0.20
177	600058	五矿发展	9,800	183,946.00	0.20
178	600026	中海发展	31,100	183,490.00	0.20
179	600056	中国医药	11,500	182,390.00	0.20
180	002266	浙富控股	33,930	181,525.50	0.20
181	600511	国药股份	6,600	180,972.00	0.20
182	601880	大连港	30,600	180,846.00	0.20
183	002431	棕榈股份	15,650	179,975.00	0.20
184	002073	软控股份	14,900	179,545.00	0.20
185	000592	平潭发展	26,400	178,992.00	0.20
186	600108	亚盛集团	35,400	178,770.00	0.20
187	002428	云南锗业	10,400	178,672.00	0.20
188	601699	潞安环能	27,200	177,888.00	0.20
189	600597	光明乳业	14,000	177,520.00	0.20
190	002161	远望谷	11,900	177,191.00	0.20
191	600325	华发股份	15,999	177,108.93	0.20
192	300134	大富科技	5,910	177,063.60	0.20
193	300287	飞利信	13,200	176,880.00	0.20
194	002437	誉衡药业	20,250	176,175.00	0.20
195	002325	洪涛股份	19,114	175,657.66	0.20
196	000786	北新建材	19,300	175,244.00	0.19
197	000829	天音控股	13,100	174,885.00	0.19
198	600426	华鲁恒升	19,850	174,878.50	0.19
199	002354	天神娱乐	2,000	174,560.00	0.19
200	600348	阳泉煤业	27,400	174,538.00	0.19
201	000685	中山公用	16,776	174,134.88	0.19
202	000616	海航投资	32,520	173,656.80	0.19
203	600260	凯乐科技	10,600	173,416.00	0.19
204	600422	昆药集团	12,700	173,228.00	0.19
205	002375	亚厦股份	15,200	171,760.00	0.19
206	600067	冠城大通	23,680	170,732.80	0.19
207	600073	上海梅林	14,900	170,605.00	0.19
208	001696	宗申动力	15,600	170,352.00	0.19
209	002699	美盛文化	5,100	170,289.00	0.19

210	002672	东江环保	9,825	170,267.25	0.19
211	600017	日照港	42,000	170,100.00	0.19
212	002624	完美环球	4,500	169,875.00	0.19
213	600298	安琪酵母	9,518	169,801.12	0.19
214	600536	中国软件	6,800	169,456.00	0.19
215	002368	太极股份	4,750	168,767.50	0.19
216	000543	皖能电力	23,630	168,718.20	0.19
217	601777	力帆股份	14,300	168,311.00	0.19
218	600717	天津港	19,300	167,717.00	0.19
219	002063	远光软件	10,851	167,647.95	0.19
220	002371	七星电子	4,000	167,280.00	0.19
221	000667	美好集团	46,600	166,362.00	0.18
222	600380	健康元	18,100	166,158.00	0.18
223	000969	安泰科技	11,800	165,554.00	0.18
224	002603	以岭药业	10,400	165,464.00	0.18
225	002002	鸿达兴业	8,800	165,440.00	0.18
226	000777	中核科技	7,020	165,391.20	0.18
227	600580	卧龙电气	14,700	164,787.00	0.18
228	000810	创维数字	9,100	164,437.00	0.18
229	600161	天坛生物	5,900	163,961.00	0.18
230	600808	马钢股份	67,900	163,639.00	0.18
231	000418	小天鹅 A	5,000	163,100.00	0.18
232	000488	晨鸣纸业	20,500	162,770.00	0.18
233	600557	康缘药业	9,952	162,516.16	0.18
234	600039	四川路桥	41,200	162,328.00	0.18
235	600320	振华重工	37,800	160,650.00	0.18
236	600006	东风汽车	18,100	160,547.00	0.18
237	600267	海正药业	13,200	160,380.00	0.18
238	600967	北方创业	15,000	159,450.00	0.18
239	000848	承德露露	13,316	159,126.20	0.18
240	002373	千方科技	10,600	158,364.00	0.18
241	600773	西藏城投	10,100	158,267.00	0.18
242	002050	三花股份	16,400	158,260.00	0.18
243	000006	深振业 A	21,472	158,248.64	0.18
244	002056	横店东磁	9,300	158,100.00	0.18
245	300147	香雪制药	10,650	156,874.50	0.17
246	300032	金龙机电	7,800	156,780.00	0.17
247	600872	中炬高新	12,700	156,718.00	0.17
248	002640	跨境通	8,800	155,056.00	0.17

249	600765	中航重机	10,600	154,548.00	0.17
250	000563	陕国投 A	28,080	154,159.20	0.17
251	600694	大商股份	4,000	154,080.00	0.17
252	000926	福星股份	13,100	153,663.00	0.17
253	002589	瑞康医药	5,000	153,550.00	0.17
254	000939	凯迪生态	17,100	153,045.00	0.17
255	002281	光迅科技	2,383	152,988.60	0.17
256	002440	闰土股份	10,302	152,984.70	0.17
257	002384	东山精密	7,700	152,922.00	0.17
258	600175	美都能源	32,515	152,820.50	0.17
259	300202	聚龙股份	6,300	152,523.00	0.17
260	000816	智慧农业	25,800	152,478.00	0.17
261	600433	冠豪高新	17,600	152,064.00	0.17
262	600183	生益科技	16,400	152,028.00	0.17
263	601010	文峰股份	29,175	151,418.25	0.17
264	000681	视觉中国	6,400	151,360.00	0.17
265	002642	荣之联	5,750	151,282.50	0.17
266	000587	金洲慈航	9,800	151,214.00	0.17
267	600970	中材国际	23,950	150,885.00	0.17
268	600169	太原重工	38,600	150,540.00	0.17
269	600587	新华医疗	6,512	150,362.08	0.17
270	600120	浙江东方	6,900	149,799.00	0.17
271	600880	博瑞传播	17,600	149,776.00	0.17
272	600062	华润双鹤	8,200	149,404.00	0.17
273	000519	江南红箭	11,729	149,075.59	0.17
274	600086	东方金钰	15,400	149,072.00	0.17
275	600736	苏州高新	16,300	148,819.00	0.17
276	600220	江苏阳光	32,500	148,200.00	0.16
277	600187	国中水务	33,100	147,626.00	0.16
278	002414	高德红外	5,463	147,337.11	0.16
279	600754	锦江股份	4,400	147,224.00	0.16
280	600416	湘电股份	11,800	147,146.00	0.16
281	600517	置信电气	15,400	146,454.00	0.16
282	600869	智慧能源	14,200	146,260.00	0.16
283	600537	亿晶光电	18,940	146,027.40	0.16
284	002505	大康农业	37,430	145,977.00	0.16
285	002025	航天电器	5,900	145,671.00	0.16
286	600289	亿阳信通	10,400	145,496.00	0.16
287	600575	皖江物流	33,600	145,488.00	0.16

288	002190	成飞集成	4,100	145,304.00	0.16
289	002396	星网锐捷	7,375	145,287.50	0.16
290	600639	浦东金桥	5,800	144,884.00	0.16
291	002285	世联行	18,563	144,605.77	0.16
292	000600	建投能源	16,500	144,045.00	0.16
293	002390	信邦制药	15,550	143,682.00	0.16
294	603188	亚邦股份	8,000	143,680.00	0.16
295	600409	三友化工	21,300	143,562.00	0.16
296	002681	奋达科技	8,500	143,480.00	0.16
297	600270	外运发展	8,200	143,418.00	0.16
298	600277	亿利洁能	24,100	143,395.00	0.16
299	600993	马应龙	6,870	143,102.10	0.16
300	601000	唐山港	36,851	142,981.88	0.16
301	000961	中南建设	25,350	142,213.50	0.16
302	002244	滨江集团	21,200	142,040.00	0.16
303	002078	太阳纸业	29,100	142,008.00	0.16
304	002358	森源电气	9,200	141,956.00	0.16
305	600458	时代新材	9,100	141,778.00	0.16
306	600563	法拉电子	3,100	141,112.00	0.16
307	002261	拓维信息	10,200	141,066.00	0.16
308	002011	盾安环境	12,500	141,000.00	0.16
309	000401	冀东水泥	12,900	140,610.00	0.16
310	600835	上海机电	7,300	140,087.00	0.16
311	600729	重庆百货	5,597	138,805.60	0.15
312	000541	佛山照明	13,380	137,680.20	0.15
313	000572	海马汽车	26,500	137,535.00	0.15
314	600460	士兰微	17,217	136,530.81	0.15
315	002635	安洁科技	3,556	136,479.28	0.15
316	600805	悦达投资	15,707	136,336.76	0.15
317	600850	华东电脑	4,710	135,129.90	0.15
318	002498	汉缆股份	30,700	133,238.00	0.15
319	002106	莱宝高科	11,200	133,056.00	0.15
320	002005	德豪润达	22,500	132,975.00	0.15
321	002254	泰和新材	9,692	132,974.24	0.15
322	002028	思源电气	12,108	132,582.60	0.15
323	002588	史丹利	10,720	132,392.00	0.15
324	000062	深圳华强	4,900	132,300.00	0.15
325	600125	铁龙物流	20,769	132,298.53	0.15
326	600894	广日股份	9,900	131,967.00	0.15

327	000513	丽珠集团	2,861	131,920.71	0.15
328	600284	浦东建设	12,600	131,544.00	0.15
329	000669	金鸿能源	7,850	131,095.00	0.15
330	600809	山西汾酒	5,900	130,862.00	0.15
331	300257	开山股份	7,900	130,508.00	0.15
332	600004	白云机场	10,600	129,956.00	0.14
333	000937	冀中能源	24,400	129,808.00	0.14
334	600750	江中药业	4,066	129,298.80	0.14
335	600112	天成控股	11,580	129,232.80	0.14
336	002269	美邦服饰	29,150	128,260.00	0.14
337	000099	中信海直	9,800	127,400.00	0.14
338	002242	九阳股份	7,000	127,260.00	0.14
339	600859	王府井	8,340	127,101.60	0.14
340	601717	郑煤机	22,200	126,540.00	0.14
341	600395	盘江股份	15,300	126,378.00	0.14
342	000861	海印股份	25,572	126,325.68	0.14
343	002041	登海种业	8,100	125,874.00	0.14
344	600351	亚宝药业	12,545	125,826.35	0.14
345	600826	兰生股份	4,800	125,664.00	0.14
346	000869	张裕 A	3,115	125,160.70	0.14
347	000596	古井贡酒	2,600	124,670.00	0.14
348	600823	世茂股份	18,250	123,917.50	0.14
349	002344	海宁皮城	12,700	123,825.00	0.14
350	002479	富春环保	11,020	123,754.60	0.14
351	002317	众生药业	10,200	122,298.00	0.14
352	002463	沪电股份	23,108	122,010.24	0.14
353	002093	国脉科技	9,800	121,618.00	0.14
354	000158	常山股份	8,734	121,315.26	0.13
355	000090	天健集团	13,769	121,167.20	0.13
356	601005	重庆钢铁	47,400	119,448.00	0.13
357	002663	普邦园林	16,229	119,445.44	0.13
358	002309	中利科技	6,600	118,206.00	0.13
359	000620	新华联	12,900	118,035.00	0.13
360	600831	广电网络	9,100	117,936.00	0.13
361	002727	一心堂	4,700	117,500.00	0.13
362	600757	长江传媒	14,000	117,460.00	0.13
363	000049	德赛电池	2,800	117,432.00	0.13
364	600496	精工钢构	27,480	117,064.80	0.13
365	600812	华北制药	18,800	116,748.00	0.13

366	000528	柳 工	17,900	115,992.00	0.13
367	002503	搜于特	9,320	115,754.40	0.13
368	600628	新世界	9,800	115,640.00	0.13
369	000897	津滨发展	29,800	115,326.00	0.13
370	000088	盐 田 港	17,870	115,082.80	0.13
371	002551	尚荣医疗	4,919	115,006.22	0.13
372	600614	鼎立股份	14,124	114,969.36	0.13
373	300039	上海凯宝	11,300	114,921.00	0.13
374	000550	江铃汽车	4,713	114,808.68	0.13
375	600059	古越龙山	11,150	114,733.50	0.13
376	600300	维维股份	19,300	114,642.00	0.13
377	600292	远达环保	9,010	114,156.70	0.13
378	002128	露天煤业	15,100	113,401.00	0.13
379	000726	鲁 泰 A	10,200	113,322.00	0.13
380	000636	风华高科	12,800	113,152.00	0.13
381	000680	山推股份	22,900	112,897.00	0.13
382	600236	桂冠电力	16,800	112,896.00	0.13
383	603077	和邦生物	22,900	112,668.00	0.13
384	002064	华峰氨纶	23,200	111,360.00	0.12
385	601666	平煤股份	27,200	111,248.00	0.12
386	000552	靖远煤电	31,600	111,232.00	0.12
387	600428	中远航运	19,800	111,078.00	0.12
388	002277	友阿股份	9,620	110,822.40	0.12
389	000900	现代投资	16,288	109,781.12	0.12
390	000652	泰达股份	23,800	109,480.00	0.12
391	601886	江河集团	10,600	108,862.00	0.12
392	002118	紫鑫药业	7,400	108,780.00	0.12
393	600282	南钢股份	45,700	107,395.00	0.12
394	600481	双良节能	18,700	107,151.00	0.12
395	002267	陕天然气	10,200	107,100.00	0.12
396	000501	鄂武商 A	6,819	106,990.11	0.12
397	002482	广田集团	14,100	106,878.00	0.12
398	000830	鲁西化工	23,600	106,672.00	0.12
399	002029	七 匹 狼	10,457	106,138.55	0.12
400	601908	京运通	13,800	105,846.00	0.12
401	600509	天富能源	14,400	105,840.00	0.12
402	600180	瑞茂通	7,000	105,770.00	0.12
403	600053	九鼎投资	3,000	103,890.00	0.12
404	000426	兴业矿业	13,762	103,490.24	0.12

405	601001	大同煤业	19,200	103,104.00	0.11
406	000417	合肥百货	12,578	101,756.02	0.11
407	600586	金晶科技	23,500	101,050.00	0.11
408	600761	安徽合力	9,959	100,486.31	0.11
409	600790	轻纺城	16,940	99,437.80	0.11
410	601126	四方股份	9,400	98,982.00	0.11
411	000931	中关村	12,400	98,952.00	0.11
412	601678	滨化股份	19,200	97,728.00	0.11
413	600456	宝钛股份	4,850	97,582.00	0.11
414	603328	依顿电子	3,300	97,482.00	0.11
415	601801	皖新传媒	8,300	96,861.00	0.11
416	601369	陕鼓动力	15,100	96,338.00	0.11
417	600720	祁连山	14,303	95,973.13	0.11
418	601002	晋亿实业	11,000	95,700.00	0.11
419	600825	新华传媒	12,000	95,400.00	0.11
420	002345	潮宏基	9,704	94,905.12	0.11
421	002332	仙琚制药	8,450	94,640.00	0.11
422	600748	上实发展	9,800	94,472.00	0.11
423	603806	福斯特	1,800	93,942.00	0.10
424	002251	步步高	7,160	92,865.20	0.10
425	601233	桐昆股份	8,500	92,310.00	0.10
426	600776	东方通信	11,000	92,290.00	0.10
427	603699	纽威股份	5,200	92,248.00	0.10
428	600551	时代出版	4,600	91,816.00	0.10
429	000919	金陵药业	6,998	91,603.82	0.10
430	600329	中新药业	5,300	91,531.00	0.10
431	600596	新安股份	12,500	91,125.00	0.10
432	600545	新疆城建	13,100	90,521.00	0.10
433	600195	中牧股份	4,940	90,402.00	0.10
434	002408	齐翔腾达	16,380	89,926.20	0.10
435	002342	巨力索具	15,500	89,900.00	0.10
436	002698	博实股份	4,660	89,751.60	0.10
437	603883	老百姓	1,800	89,532.00	0.10
438	600280	中央商场	13,200	89,232.00	0.10
439	000703	恒逸石化	9,000	88,830.00	0.10
440	002293	罗莱生活	6,460	88,502.00	0.10
441	603169	兰石重装	7,100	88,466.00	0.10
442	002181	粤传媒	10,720	88,011.20	0.10
443	600657	信达地产	17,579	87,543.42	0.10

444	000877	天山股份	14,140	87,385.20	0.10
445	002602	世纪华通	4,700	87,091.00	0.10
446	601515	东风股份	7,700	87,010.00	0.10
447	600640	号百控股	5,100	85,629.00	0.10
448	600864	哈投股份	7,590	85,235.70	0.09
449	603567	珍宝岛	3,900	85,215.00	0.09
450	002122	天马股份	13,700	85,214.00	0.09
451	601965	中国汽研	8,850	85,048.50	0.09
452	600251	冠农股份	10,600	84,800.00	0.09
453	600141	兴发集团	7,340	84,556.80	0.09
454	002646	青青稞酒	4,100	84,501.00	0.09
455	600466	蓝光发展	9,800	83,888.00	0.09
456	600132	重庆啤酒	5,400	82,026.00	0.09
457	002194	武汉凡谷	6,400	81,792.00	0.09
458	000631	顺发恒业	16,790	81,767.30	0.09
459	600483	福能股份	7,200	81,720.00	0.09
460	002327	富安娜	9,598	81,678.98	0.09
461	600425	青松建化	19,100	81,175.00	0.09
462	000030	富奥股份	11,300	81,021.00	0.09
463	603005	晶方科技	2,100	79,527.00	0.09
464	600743	华远地产	16,801	79,468.73	0.09
465	600184	光电股份	3,500	79,240.00	0.09
466	600617	国新能源	6,785	77,756.10	0.09
467	600874	创业环保	10,000	77,700.00	0.09
468	603698	航天工程	2,800	76,832.00	0.09
469	603001	奥康国际	3,600	76,536.00	0.09
470	002315	焦点科技	1,100	74,206.00	0.08
471	601226	华电重工	8,000	73,360.00	0.08
472	600335	国机汽车	6,500	72,865.00	0.08
473	600088	中视传媒	3,000	71,160.00	0.08
474	000517	荣安地产	14,700	71,148.00	0.08
475	600801	华新水泥	11,240	70,924.40	0.08
476	600397	安源煤业	16,000	70,720.00	0.08
477	600468	百利电气	4,950	70,042.50	0.08
478	603555	贵人鸟	2,800	69,804.00	0.08
479	600618	氯碱化工	5,200	68,276.00	0.08
480	002392	北京利尔	13,800	68,172.00	0.08
481	002233	塔牌集团	8,200	65,846.00	0.07
482	002216	三全食品	7,400	63,640.00	0.07

483	600971	恒源煤电	11,500	63,480.00	0.07
484	600510	黑牡丹	7,200	62,784.00	0.07
485	002745	木林森	1,800	61,182.00	0.07
486	002249	大洋电机	5,100	61,047.00	0.07
487	002238	天威视讯	4,212	60,947.64	0.07
488	600507	方大特钢	12,200	58,560.00	0.07
489	002461	珠江啤酒	4,660	54,149.20	0.06
490	002678	珠江钢琴	4,400	53,988.00	0.06
491	603589	口子窖	1,400	50,694.00	0.06
492	603198	迎驾贡酒	1,800	43,038.00	0.05
493	600751	天海投资	7,000	42,770.00	0.05
494	603568	伟明环保	1,700	39,270.00	0.04
495	600917	重庆燃气	3,900	38,805.00	0.04
496	603355	莱克电气	1,000	38,100.00	0.04
497	603025	大豪科技	1,100	36,927.00	0.04
498	600623	华谊集团	1,700	33,677.00	0.04

7.3.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例（%）
1	600654	中安消	18,701	346,716.54	0.39
2	000718	苏宁环球	24,610	322,144.90	0.36
3	000511	*ST 烯碳	27,600	246,192.00	0.27
4	000693	ST 华泽	6,400	80,000.00	0.09
5	000582	北部湾港	2,000	32,640.00	0.04

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	300113	顺网科技	363,339.00	0.39
2	002572	索菲亚	340,346.42	0.36
3	002426	胜利精密	326,168.31	0.35

4	600682	南京新百	304,458.00	0.32
5	600166	福田汽车	293,953.00	0.31
6	002131	利欧股份	290,125.00	0.31
7	002038	双鹭药业	281,556.74	0.30
8	002310	东方园林	263,016.00	0.28
9	600266	北京城建	260,848.00	0.28
10	000983	西山煤电	257,128.00	0.27
11	002074	国轩高科	239,332.84	0.25
12	002353	杰瑞股份	230,216.00	0.24
13	000008	神州高铁	227,985.00	0.24
14	600687	刚泰控股	224,330.50	0.24
15	000581	威孚高科	222,020.60	0.24
16	000598	兴蓉环境	216,412.00	0.23
17	002366	台海核电	216,393.00	0.23
18	600565	迪马股份	209,952.00	0.22
19	000727	华东科技	208,122.00	0.22
20	600633	浙报传媒	207,144.00	0.22

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600816	安信信托	369,013.24	0.39
2	600074	保千里	345,268.86	0.37
3	600376	首开股份	304,825.00	0.32
4	000982	中银绒业	304,789.76	0.32
5	002018	华信国际	273,565.80	0.29
6	002174	游族网络	245,996.34	0.26
7	300122	智飞生物	240,625.86	0.26
8	300267	尔康制药	216,068.00	0.23
9	300085	银之杰	210,416.33	0.22
10	600885	宏发股份	205,345.96	0.22
11	600704	物产中大	204,999.00	0.22
12	600797	浙大网新	199,119.00	0.21
13	002219	恒康医疗	198,134.50	0.21
14	002180	艾派克	194,422.50	0.21

15	000732	泰禾集团	181,801.00	0.19
16	002237	恒邦股份	180,590.00	0.19
17	000748	长城信息	169,040.00	0.18
18	603369	今世缘	166,706.00	0.18
19	000650	仁和药业	160,980.75	0.17
20	002143	印纪传媒	156,016.33	0.17

注：卖出金额按卖出的成交金额（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	28,236,459.89
卖出股票收入（成交）总额	15,133,416.33

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,986,207.20	3.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,986,207.20	3.32

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019520	15 国债 20	29,880	2,986,207.20	3.32

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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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	10,323.48
2	应收证券清算款	776,272.62
3	应收股利	-
4	应收利息	54,282.20
5	应收申购款	73,800.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	914,678.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	346,716.54	0.39	公告重大事项
2	000718	苏宁环球	322,144.90	0.36	公告重大事项
3	000511	*ST 烯碳	246,192.00	0.27	公告重大事项
4	000693	ST 华泽	80,000.00	0.09	公告重大事项
5	000582	北部湾港	32,640.00	0.04	公告重大事项

§ 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

7,244	7,892.39	595,854.37	1.04%	56,576,607.47	98.96%
-------	----------	------------	-------	---------------	--------

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	247,508.54	0.4329%

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的情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	48,913,300.02
本报告期基金总申购份额	22,191,600.95
减:本报告期基金总赎回份额	13,932,439.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	57,172,461.84

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

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内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

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国信证券	2	43,335,616.22	100.00%	40,360.71	100.00%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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

综合评价。总经理办公会议根据综合评价，做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	2,990,988.00	100.00%	4,500,000.00	100.00%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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管理的基金 2015 年年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告-20160107	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	农银中证 500 基金—招募说明书更新—2015 年第 2 号	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 11 日
5	农银汇理基金管理有限公司关于参与深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
6	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
7	农银汇理基金管理有限公司关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 12 日
8	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2015 年年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
9	关于工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基	2016 年 3 月 31 日

		金管理人网站	
10	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
11	农银汇理基金管理有限公司关于参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
12	农银汇理基金管理有限公司关于参加陆金所认（申）购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
13	农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
15	农银汇理基金管理有限公司关于继续参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
16	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
17	关于中国交通银行股份有限公司开展网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数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。

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

11.3 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
2016 年 8 月 26 日