

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 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.....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	67

8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 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	71
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	农银沪深 300 指数	
场内简称	-	
基金主代码	660008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 4 月 12 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	672,999,198.78 份	
下属分级基金的基金简称:	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码:	660008	005152
报告期末下属分级基金的份额总额	672,990,315.90 份	8,882.88 份

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，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在 4% 以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将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。基金管理人将根据中证指数公司提供的成分股及权重数据进行相应的买入或卖出操作，使跟踪组合的构成基本与标的指数一致。但若出现较为特殊的情况（例如成分股流动性不足、成分股投资受限等），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得实际组合对标的指数的风险暴露程度尽可能近似于理论全复制组合。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数+5%×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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105798
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105799
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		许金超	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年		2016 年	
	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
本期已实现收益	-471,126.67	-4.81	42,329,772.64	-	-13,942,797.04	-
本期利润	-190,214,590.23	-124.58	181,443,568.79	-	-78,224,999.36	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2989	-0.0400	0.2494	-	-0.0956	-
本期加权平均净值利润率	-24.67%	-3.83%	20.65%	-	-9.10%	-
本期基金份额净值增长率	-22.64%	-7.14%	22.65%	-	-9.05%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供分配利润	22,243,751.86	292.54	215,520,724.11	-	68,875,292.72	-
期末可供分配基金份额利润	0.0331	0.0329	0.3355	-	0.0889	-

期末基金 资产净值	695,234,067.76	9,175.42	857,891,506.15	-	843,936,758.54	-
期末基金 份额净值	1.0331	1.0329	1.3355	-	1.0889	-
3.1.3 累 计期末指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金份额 累计净值 增长率	3.31%	-7.14%	33.55%	-	8.89%	-

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 12 月 31 日。

4、本基金于 2011 年 4 月 12 日成立。经中国证监会批准，于 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。本期的指标计算期农银沪深 300 指数 A 为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日；农银沪深 300 指数 C 为 2018 年 3 月 21 日至 2018 年 12 月 31 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

农银沪深 300 指数 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	-11.86%	1.54%	-11.83%	1.56%	-0.03%	-0.02%
过去六个月	-12.77%	1.41%	-13.53%	1.42%	0.76%	-0.01%
过去一年	-22.64%	1.26%	-24.12%	1.27%	1.48%	-0.01%
过去三年	-13.71%	1.13%	-18.21%	1.12%	4.50%	0.01%

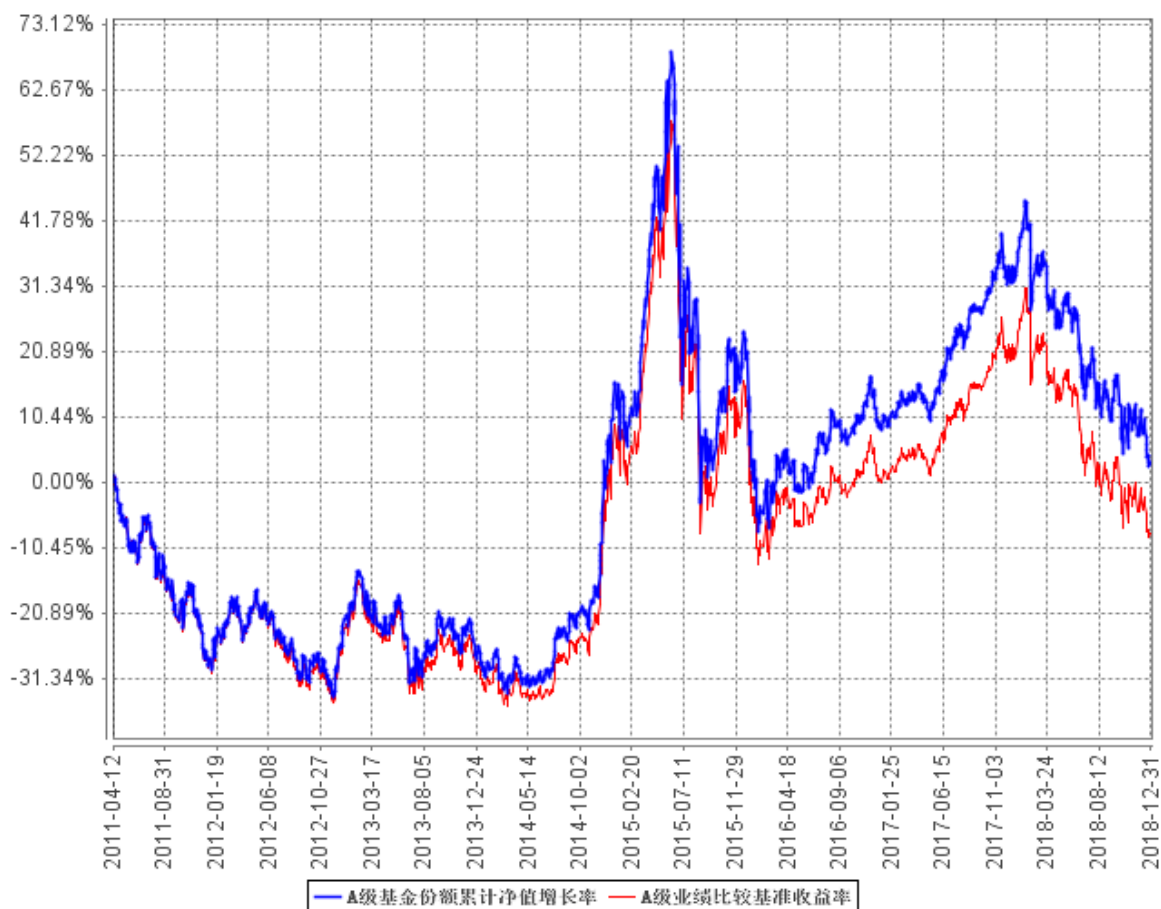
过去五年	39.85%	1.47%	28.54%	1.46%	11.31%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.31%	1.40%	-8.24%	1.39%	11.55%	0.01%

农银沪深 300 指数 C

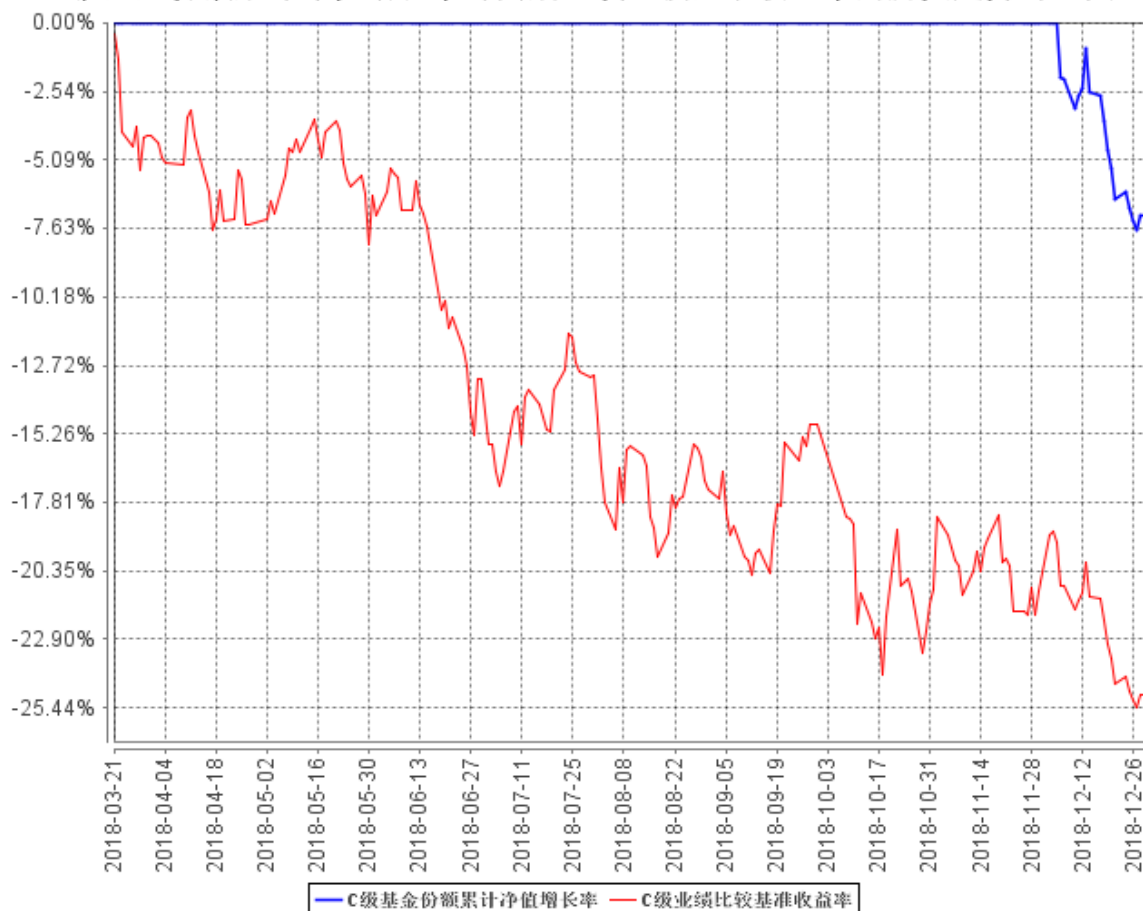
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.13%	0.50%	-11.83%	1.56%	4.70%	-1.06%
过去六个月	-7.13%	0.35%	-13.53%	1.42%	6.40%	-1.07%
自基金合同生效起至今	-7.13%	0.28%	-24.96%	1.31%	17.83%	-1.03%

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

A级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



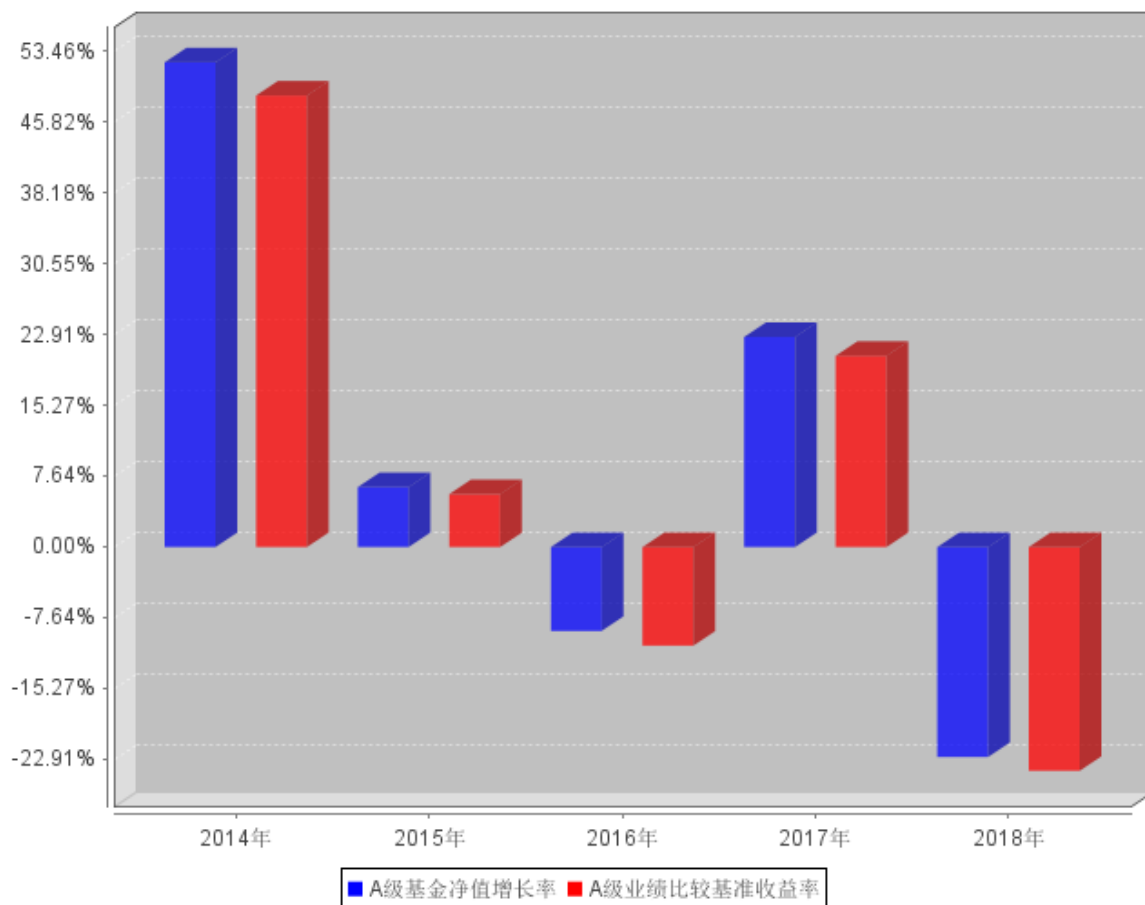
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

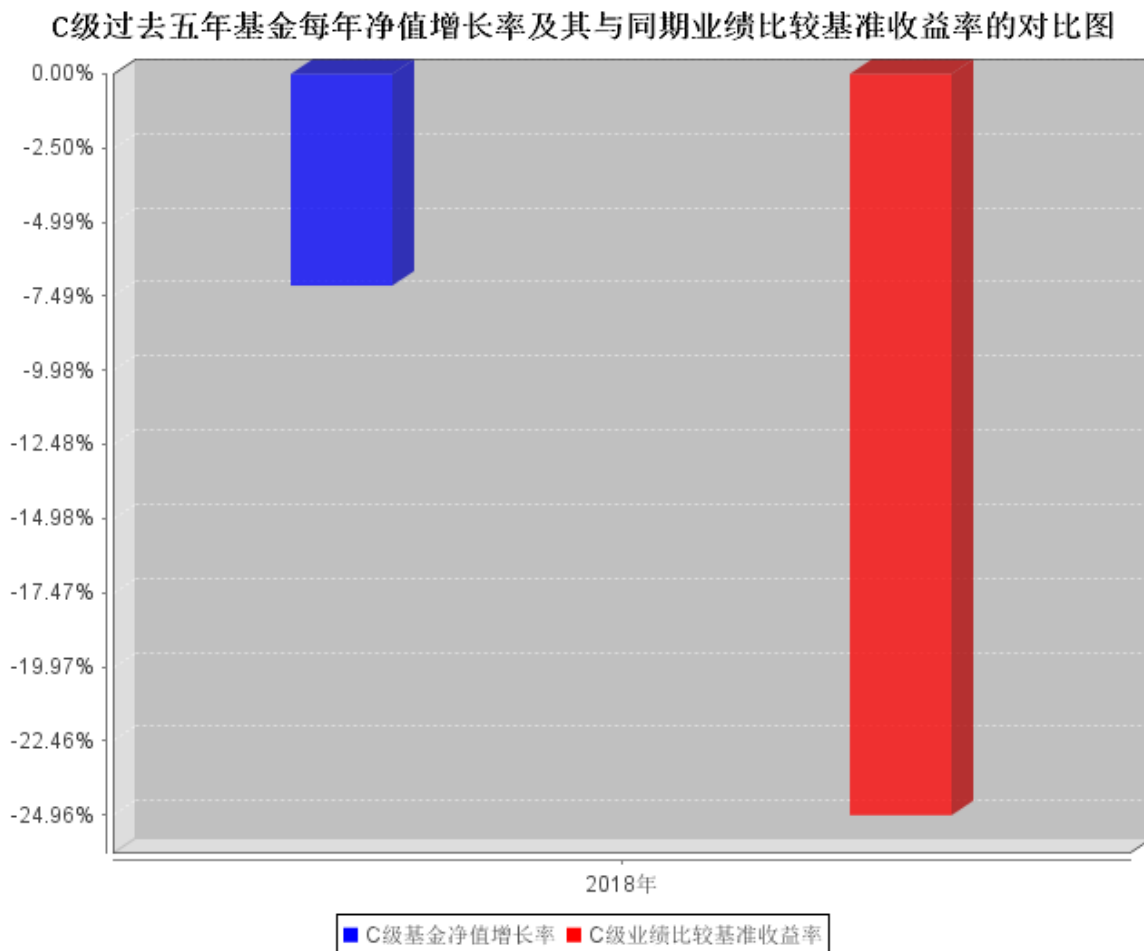


注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 4 月 12 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

§ 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。公司法定代表人为许金超先生。

截止 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 46 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、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利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、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、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、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理永益定期开放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及农银汇理永安混合型证券投资基金。

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	2012年8月3日	-	11	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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》、《特定客户资产管理业务公平交易管理办法》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合

公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告风险管理委员会。

4.3.2 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。

4.3.3 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，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0350%，日均偏离度为 0.0229%，符合基金合同约定规定的日均偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制不超过 4%。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) 指数中成份股票的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.0331 元，本报告期基金份额净值增长率为-22.64%，同期业绩比较基准收益率为-24.12%；截至本报告期末农银沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.0329 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.13%，同期业绩比较基准收益率为-24.96%。

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沪深 300 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司建立了比较完善的监察稽核制度和组织结构。公司督察长组织指导对基金包括本基金的监察稽核工作，监察稽核部具体监督检查基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并向公司总经理报告。公司风险管理委员会批准适用本基金的风险管理措施，定期回顾执行情况，并由风险控制部实施日常监控。督察长及监察稽核部对其他部门及人员执行业务进行稽核审计，

督促其合规运作、加强风险控制。督察长定期编制监察稽核报告，提交总经理和董事会成员收阅。报告期内，公司监察稽核体系运行顺利，本基金没有出现违反法律规定的事项，有效的保证了本基金的合规运作。

本报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：

(1) 全面开展基金运作稽核工作，防范内幕交易，确保基金投资的独立性、公平性及合规性
主要措施有：严格执行集中交易制度，确保研究、投资决策和交易隔离；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序。通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求。

(2) 修订内部管理制度，完善投资业务流程

根据监管机关的规定，更新公司内部投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规与稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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）、《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）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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金基金合同约定“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20 %。”即本基金本年无应分配利润。

2. 报告期内没有实施过利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未实施的利润。

4.9 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，本基金托管人在对农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，农银汇理沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21733 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	农银汇理沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了农银汇理沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“农银沪深 300 指数基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了农银沪深 300 指数基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于农银沪深 300 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>农银沪深 300 指数基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银沪深 300 指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算农银沪深 300 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	<p>基金管理人治理层负责监督农银沪深 300 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对农银沪深 300 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致农银沪深 300 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	都晓燕
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	47,191,891.58	54,048,688.84
结算备付金		16,682.83	572,862.08
存出保证金		44,164.44	50,268.71
交易性金融资产	7.4.7.2	658,193,217.85	805,426,237.78
其中：股票投资		658,193,217.85	805,426,237.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	9,106.42	9,999.73
应收股利		-	-
应收申购款		98,145.20	555,569.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		705,553,208.32	860,663,626.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,779,040.46	-
应付赎回款		566,298.97	1,509,158.84
应付管理人报酬		363,629.29	432,352.45
应付托管费		90,907.33	108,088.10
应付销售服务费		0.88	-
应付交易费用	7.4.7.7	116,826.50	279,955.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	393,261.71	442,565.54
负债合计		10,309,965.14	2,772,120.39
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	672,999,198.78	642,370,782.04
未分配利润	7.4.7.10	22,244,044.40	215,520,724.11
所有者权益合计		695,243,243.18	857,891,506.15
负债和所有者权益总计		705,553,208.32	860,663,626.54

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 672,999,198.78 份，其中 A 类基金份额净值 1.0331 元，基金份额总额 672,990,315.90 份；C 类基金份额净值 1.0329 元，基金份额总额 8,882.88 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-183,229,647.41	189,841,621.57
1.利息收入		337,815.17	444,312.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	337,815.17	322,052.40
债券利息收入		-	122,260.28
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）		5,840,749.09	49,801,067.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,887,041.27	33,176,756.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	17,100.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	15,727,790.36	16,607,211.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-189,743,583.33	139,113,796.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	335,371.66	482,444.99
减：二、费用		6,985,067.40	8,398,052.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,628,841.96	5,269,160.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,157,210.50	1,317,289.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	0.88	-
4. 交易费用	7.4.7.19	592,486.18	1,186,525.68
5. 利息支出		-	9,158.00

其中：卖出回购金融资产支出		-	9,158.00
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	606,527.88	615,919.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-190,214,714.81	181,443,568.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-190,214,714.81	181,443,568.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	642,370,782.04	215,520,724.11	857,891,506.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-190,214,714.81	-190,214,714.81
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）	30,628,416.74	-3,061,964.90	27,566,451.84
其中：1. 基金申购款	263,065,900.29	65,504,720.90	328,570,621.19
2. 基金赎回款	-232,437,483.55	-68,566,685.80	-301,004,169.35
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）	672,999,198.78	22,244,044.40	695,243,243.18
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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）	775,061,465.82	68,875,292.72	843,936,758.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	181,443,568.79	181,443,568.79
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）	-132,690,683.78	-34,798,137.40	-167,488,821.18
其中：1. 基金申购款	358,368,335.65	65,348,801.31	423,717,136.96
2. 基金赎回款	-491,059,019.43	-100,146,938.71	-591,205,958.14
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）	642,370,782.04	215,520,724.11	857,891,506.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

许金超

刘志勇

丁煜琼

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理沪深 300 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 125 号《关于核准农银汇理沪深 300 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《农银汇理沪深 300 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 3,296,561,559.84 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 123 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,297,550,055.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 988,495.60 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人农银汇理基金管理有限公司 2018 年 3 月 20 日《农银汇理基金管理有限公司关于农银汇理沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2018 年 3 月 21 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额);C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 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,包括沪深 300 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:股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,其中投资于沪深 300 指数成分股的比例不低于股票投资的 80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—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%,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:95%×沪深 300 指数+5%×同期银行活期存款利率。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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。本基金持有的其他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。

7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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/(累计亏损)。

7.4.4.9 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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、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

法逐日确认。

其他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。

7.4.4.11 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。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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，本基金确定以下类别股票投资和债券投资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)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外),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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	47,191,891.58	54,048,688.84
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	47,191,891.58	54,048,688.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	729,284,971.27	658,193,217.85	-71,091,753.42
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	729,284,971.27	658,193,217.85	-71,091,753.42
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	686,774,407.87	805,426,237.78	118,651,829.91
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	686,774,407.87	805,426,237.78	118,651,829.91

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	9,079.12	9,719.33
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	7.50	257.80
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	19.80	22.60
合计	9,106.42	9,999.73

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

交易所市场应付交易费用	116,826.50	279,955.46
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	116,826.50	279,955.46

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	761.71	2,565.54
预提费用	342,500.00	390,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	393,261.71	442,565.54

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	642,370,782.04	642,370,782.04
本期申购	263,057,017.41	263,057,017.41
本期赎回 (以“-”号填列)	-232,437,483.55	-232,437,483.55
- 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	672,990,315.90	672,990,315.90

金额单位：人民币元

农银沪深 300 指数 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	8,882.88	8,882.88
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
- 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	8,882.88	8,882.88

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

农银沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	236,851,813.83	-21,331,089.72	215,520,724.11
本期利润	-471,126.67	-189,743,463.56	-190,214,590.23
本期基金份额交易产生的变动数	12,025,448.58	-15,087,830.60	-3,062,382.02
其中：基金申购款	100,597,780.08	-35,093,476.30	65,504,303.78
基金赎回款	-88,572,331.50	20,005,645.70	-68,566,685.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,406,135.74	-226,162,383.88	22,243,751.86

单位：人民币元

农银沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

本期利润	-4.81	-119.77	-124.58
本期基金份额交易产生的变动数	3,282.58	-2,865.46	417.12
其中：基金申购款	3,282.58	-2,865.46	417.12
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,277.77	-2,985.23	292.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	333,663.41	316,696.47
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	3,391.04	4,481.88
其他	760.72	874.05
合计	337,815.17	322,052.40

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	178,700,681.35	443,020,174.12
减：卖出股票成本总额	188,587,722.62	409,843,417.37
买卖股票差价收入	-9,887,041.27	33,176,756.75

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31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	-	17,100.00
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	-	17,100.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	9,189,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	8,982,900.00
减：应收利息总额	-	189,000.00
买卖债券差价收入	-	17,100.00

7.4.7.13.3 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赎回差价收入。

7.4.7.13.4 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申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,727,790.36	16,607,211.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,727,790.36	16,607,211.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-189,743,583.33	139,113,796.15
——股票投资	-189,743,583.33	139,113,796.15
——债券投资	-	-
——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	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-189,743,583.33	139,113,796.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	313,337.90	452,523.06
转换费	22,033.76	29,921.93
合计	335,371.66	482,444.99

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	592,486.18	1,186,525.68
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	592,486.18	1,186,525.68

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	85,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
账户服务费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费	3,527.88	7,919.01
合计	606,527.88	615,919.01

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
农银汇理(上海)资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
东方汇理资产管理公司	基金管理人的股东
中铝资本控股有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,628,841.96	5,269,160.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,853,662.44	2,113,574.09

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,157,210.50	1,317,289.92

注：支付基金托管人工商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。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给关联方的销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	工商银行	47,191,891.58	333,663.41	54,048,688.84

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.2 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
600030	中信证券	2018年12月25日	公告重大事项	16.01	2019年1月10日	17.15	541,465	10,734,016.74	8,668,854.65	-
600485	信威集团	2016年12月26日	公告重大事项	14.59	-	-	135,770	2,791,360.34	1,980,884.30	-
000540	中天金融	2017年8月21日	公告重大事项	4.87	2019年1月2日	4.38	331,200	1,440,438.40	1,612,944.00	-

注：1 本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 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、二道防线”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。公司建立了管理和控制各类单项风险的二道防线机制，明确了相应防线的责任主体和职责。督察长及其指导下的监察稽核部对公司的风险管理进行监督检查。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 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，本基金流动性风险可控。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	47,191,891.58	-	-	-	47,191,891.58
结算备付金	16,682.83	-	-	-	16,682.83
存出保证金	44,164.44	-	-	-	44,164.44
交易性金融资产	-	-	-	658,193,217.85	658,193,217.85
应收利息	-	-	-	9,106.42	9,106.42
应收申购款	-	-	-	98,145.20	98,145.20
资产总计	47,252,738.85	-	-	658,300,469.47	705,553,208.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,779,040.46	8,779,040.46
应付赎回款	-	-	-	566,298.97	566,298.97
应付管理人报酬	-	-	-	363,629.29	363,629.29
应付托管费	-	-	-	90,907.33	90,907.33
应付销售服务费	-	-	-	0.88	0.88
应付交易费用	-	-	-	116,826.50	116,826.50
其他负债	-	-	-	393,261.71	393,261.71

负债总计	-	-	-	10,309,965.14	10,309,965.14
利率敏感度缺口	47,252,738.85	-	-	-647,990,504.33	695,243,243.18
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,048,688.84	-	-	-	54,048,688.84
结算备付金	572,862.08	-	-	-	572,862.08
存出保证金	50,268.71	-	-	-	50,268.71
交易性金融资产	-	-	-	-805,426,237.78	805,426,237.78
应收利息	-	-	-	9,999.73	9,999.73
应收申购款	-	-	-	555,569.40	555,569.40
资产总计	54,671,819.63	-	-	-805,991,806.91	860,663,626.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,509,158.84	1,509,158.84
应付管理人报酬	-	-	-	432,352.45	432,352.45
应付托管费	-	-	-	108,088.10	108,088.10
应付交易费用	-	-	-	279,955.46	279,955.46
其他负债	-	-	-	442,565.54	442,565.54
负债总计	-	-	-	2,772,120.39	2,772,120.39
利率敏感度缺口	54,671,819.63	-	-	-803,219,686.52	857,891,506.15

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	658,193,217.85	94.67	805,426,237.78	93.88
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	658,193,217.85	94.67	805,426,237.78	93.88

7.4.13.4.3.2 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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	34,478,240.21	43,012,426.48
	业绩比较基准下降 5%	-34,478,240.21	-43,012,426.48

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 645,880,389.10 元，属于第二层次的余额为 10,331,944.45 元，属于第三层次的余额为 1,980,884.30 元(2017 年 12 月 31 日：第一层次 787,675,961.68 元，第二层次 16,956,546.10 元，第三层次 793,730.00 元)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的余额为 1,980,884.30 元(2017 年 12 月 31 日：793,730.00 元)。本期出售第三层次的金額 931,770.00 元，计入损益的利得为 138,040.00 元；本期转入第三层次的金額为 1,980,884.30 元，无计入损益的利得或损失(即本基金仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失(从转入第三层次起算))。使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值采用市场法及相关估值技术确定，不可观察输入值为最近交易价格。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	658,193,217.85	93.29
	其中：股票	658,193,217.85	93.29
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	47,208,574.41	6.69
8	其他各项资产	151,416.06	0.02
9	合计	705,553,208.32	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,252,925.00	0.18
B	采矿业	25,100,873.87	3.61
C	制造业	256,378,110.22	36.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,087,090.96	2.89

E	建筑业	25,707,001.77	3.70
F	批发和零售业	10,910,825.21	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	20,870,814.62	3.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,835,562.60	3.28
J	金融业	223,700,201.95	32.18
K	房地产业	31,294,526.88	4.50
L	租赁和商务服务业	8,140,533.96	1.17
M	科学研究和技术服务业	546,478.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,543,876.28	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,696,703.90	0.53
R	文化、体育和娱乐业	2,290,544.80	0.33
S	综合	-	-
	合计	654,356,070.02	94.12

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,174,058.03	0.31
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		-
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	1,612,944.00	0.23
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	3,837,147.83	0.55

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	601318	中国平安	754,538	42,329,581.80	6.09
2	600519	贵州茅台	35,018	20,660,970.18	2.97
3	600036	招商银行	718,473	18,105,519.60	2.60
4	601166	兴业银行	868,259	12,971,789.46	1.87
5	000651	格力电器	335,206	11,963,502.14	1.72
6	000333	美的集团	323,182	11,912,488.52	1.71

7	601939	建设银行	1,754,207	11,174,298.59	1.61
8	601988	中国银行	3,083,405	11,131,092.05	1.60
9	601328	交通银行	1,913,910	11,081,538.90	1.59
10	600016	民生银行	1,729,164	9,908,109.72	1.43
11	600887	伊利股份	423,344	9,686,110.72	1.39
12	600030	中信证券	541,465	8,668,854.65	1.25
13	601668	中国建筑	1,462,269	8,334,933.30	1.20
14	600276	恒瑞医药	153,919	8,119,227.25	1.17
15	000002	万科 A	338,731	8,068,572.42	1.16
16	600000	浦发银行	817,845	8,014,881.00	1.15
17	600900	长江电力	459,775	7,301,227.00	1.05
18	000858	五粮液	135,242	6,881,112.96	0.99
19	002415	海康威视	257,058	6,621,814.08	0.95
20	600104	上汽集团	244,185	6,512,413.95	0.94
21	601601	中国太保	218,941	6,224,492.63	0.90
22	601766	中国中车	677,884	6,114,513.68	0.88
23	600048	保利地产	497,077	5,860,537.83	0.84
24	601169	北京银行	1,030,933	5,783,534.13	0.83
25	000001	平安银行	598,015	5,609,380.70	0.81
26	600837	海通证券	563,666	4,960,260.80	0.71
27	601211	国泰君安	314,100	4,812,012.00	0.69
28	600028	中国石化	865,311	4,369,820.55	0.63
29	000725	京东方 A	1,651,196	4,342,645.48	0.62
30	601229	上海银行	380,620	4,259,137.80	0.61
31	601818	光大银行	1,109,267	4,104,287.90	0.59
32	601888	中国国旅	68,052	4,096,730.40	0.59
33	600585	海螺水泥	139,291	4,078,440.48	0.59
34	601857	中国石油	564,008	4,066,497.68	0.58

35	600019	宝钢股份	620,509	4,033,308.50	0.58
36	002304	洋河股份	42,023	3,980,418.56	0.57
37	603288	海天味业	56,467	3,884,929.60	0.56
38	601009	南京银行	591,834	3,823,247.64	0.55
39	601899	紫金矿业	1,144,062	3,821,167.08	0.55
40	601688	华泰证券	227,507	3,685,613.40	0.53
41	601390	中国中铁	519,323	3,630,067.77	0.52
42	600015	华夏银行	477,742	3,530,513.38	0.51
43	600690	青岛海尔	254,800	3,528,980.00	0.51
44	601186	中国铁建	320,554	3,484,421.98	0.50
45	601006	大秦铁路	414,254	3,409,310.42	0.49
46	600009	上海机场	67,122	3,407,112.72	0.49
47	600050	中国联通	648,450	3,352,486.50	0.48
48	000063	中兴通讯	165,717	3,246,396.03	0.47
49	002594	比亚迪	63,158	3,221,058.00	0.46
50	600309	万华化学	114,225	3,197,157.75	0.46
51	600340	华夏幸福	125,522	3,194,534.90	0.46
52	600031	三一重工	380,269	3,171,443.46	0.46
53	300059	东方财富	252,032	3,049,587.20	0.44
54	002142	宁波银行	181,400	2,942,308.00	0.42
55	600919	江苏银行	482,500	2,880,525.00	0.41
56	001979	招商蛇口	165,155	2,865,439.25	0.41
57	601989	中国重工	637,556	2,709,613.00	0.39
58	000538	云南白药	36,291	2,684,082.36	0.39
59	002027	分众传媒	511,263	2,679,018.12	0.39
60	600999	招商证券	199,211	2,669,427.40	0.38
61	000776	广发证券	206,124	2,613,652.32	0.38
62	000338	潍柴动力	337,376	2,597,795.20	0.37

63	002024	苏宁易购	259,454	2,555,621.90	0.37
64	600362	江西铜业	192,675	2,535,603.00	0.36
65	002230	科大讯飞	102,065	2,514,881.60	0.36
66	601088	中国神华	137,891	2,476,522.36	0.36
67	601336	新华保险	58,088	2,453,637.12	0.35
68	002475	立讯精密	171,931	2,417,349.86	0.35
69	601012	隆基股份	136,032	2,372,398.08	0.34
70	600406	国电南瑞	127,680	2,365,910.40	0.34
71	601628	中国人寿	116,019	2,365,627.41	0.34
72	600886	国投电力	283,660	2,283,463.00	0.33
73	600011	华能国际	306,400	2,261,232.00	0.33
74	600660	福耀玻璃	97,635	2,224,125.30	0.32
75	600795	国电电力	821,318	2,102,574.08	0.30
76	601933	永辉超市	266,708	2,098,991.96	0.30
77	000568	泸州老窖	51,020	2,074,473.20	0.30
78	601225	陕西煤业	278,600	2,072,784.00	0.30
79	601669	中国电建	426,262	2,071,633.32	0.30
80	600741	华域汽车	109,812	2,020,540.80	0.29
81	601998	中信银行	367,224	2,001,370.80	0.29
82	600958	东方证券	249,400	1,987,718.00	0.29
83	002044	美年健康	130,420	1,949,779.00	0.28
84	600703	三安光电	170,414	1,927,382.34	0.28
85	000166	申万宏源	470,939	1,916,721.73	0.28
86	600518	康美药业	207,834	1,914,151.14	0.28
87	600010	宝钢股份	1,270,143	1,879,811.64	0.27
88	603993	洛阳钼业	492,200	1,850,672.00	0.27
89	000100	TCL 集团	755,077	1,849,938.65	0.27
90	601800	中国交建	163,644	1,842,631.44	0.27

91	600436	片仔癀	21,000	1,819,650.00	0.26
92	000069	华侨城 A	285,750	1,814,512.50	0.26
93	002008	大族激光	59,449	1,804,871.64	0.26
94	600570	恒生电子	34,398	1,788,008.04	0.26
95	600271	航天信息	77,850	1,781,986.50	0.26
96	600089	特变电工	258,701	1,756,579.79	0.25
97	600111	北方稀土	199,955	1,753,605.35	0.25
98	600352	浙江龙盛	181,288	1,749,429.20	0.25
99	300015	爱尔眼科	66,423	1,746,924.90	0.25
100	601985	中国核电	325,300	1,714,331.00	0.25
101	000661	长春高新	9,500	1,662,500.00	0.24
102	300142	沃森生物	85,700	1,636,870.00	0.24
103	600196	复星医药	70,042	1,629,877.34	0.23
104	000895	双汇发展	68,981	1,627,261.79	0.23
105	002202	金风科技	161,937	1,617,750.63	0.23
106	600029	南方航空	239,664	1,591,368.96	0.23
107	601111	中国国航	208,181	1,590,502.84	0.23
108	600487	亨通光电	92,800	1,582,240.00	0.23
109	600547	山东黄金	51,730	1,564,832.50	0.23
110	600606	绿地控股	254,300	1,553,773.00	0.22
111	300003	乐普医疗	74,501	1,550,365.81	0.22
112	601618	中国中冶	497,460	1,547,100.60	0.22
113	601901	方正证券	286,739	1,522,584.09	0.22
114	601377	兴业证券	326,515	1,515,029.60	0.22
115	600383	金地集团	157,246	1,512,706.52	0.22
116	600221	海航控股	801,488	1,506,797.44	0.22
117	601155	新城控股	62,900	1,490,101.00	0.21
118	600637	东方明珠	143,481	1,469,245.44	0.21

119	601877	正泰电器	59,900	1,451,976.00	0.21
120	002236	大华股份	125,300	1,435,938.00	0.21
121	002736	国信证券	171,400	1,434,618.00	0.21
122	600588	用友网络	66,750	1,421,775.00	0.20
123	600176	中国巨石	146,400	1,415,688.00	0.20
124	600100	同方股份	144,561	1,406,578.53	0.20
125	300124	汇川技术	69,604	1,401,824.56	0.20
126	600332	白云山	39,200	1,401,792.00	0.20
127	002466	天齐锂业	47,690	1,398,270.80	0.20
128	600522	中天科技	170,900	1,392,835.00	0.20
129	600498	烽火通信	48,800	1,389,336.00	0.20
130	000783	长江证券	269,660	1,388,749.00	0.20
131	600867	通化东宝	99,200	1,378,880.00	0.20
132	601607	上海医药	80,324	1,365,508.00	0.20
133	600893	航发动力	62,722	1,362,321.84	0.20
134	000963	华东医药	50,833	1,345,041.18	0.19
135	600023	浙能电力	284,190	1,344,218.70	0.19
136	600705	中航资本	309,700	1,313,128.00	0.19
137	600115	东方航空	273,278	1,298,070.50	0.19
138	300122	智飞生物	33,400	1,294,584.00	0.19
139	000768	中航飞机	96,439	1,276,852.36	0.18
140	002311	海大集团	55,100	1,276,667.00	0.18
141	002007	华兰生物	38,893	1,275,690.40	0.18
142	000423	东阿阿胶	31,930	1,262,831.50	0.18
143	600177	雅戈尔	174,628	1,255,575.32	0.18
144	002714	牧原股份	43,580	1,252,925.00	0.18
145	600516	方大炭素	74,800	1,249,908.00	0.18
146	002422	科伦药业	60,200	1,243,130.00	0.18

147	300408	三环集团	72,800	1,231,776.00	0.18
148	600068	葛洲坝	192,427	1,216,138.64	0.17
149	002456	欧菲科技	132,265	1,215,515.35	0.17
150	600535	天士力	63,204	1,213,516.80	0.17
151	601727	上海电气	245,600	1,213,264.00	0.17
152	600109	国金证券	168,510	1,206,531.60	0.17
153	000413	东旭光电	267,200	1,202,400.00	0.17
154	002460	赣锋锂业	54,400	1,201,152.00	0.17
155	601788	光大证券	136,100	1,193,597.00	0.17
156	300136	信维通信	54,406	1,175,713.66	0.17
157	600018	上港集团	226,000	1,170,680.00	0.17
158	002450	康得新	148,010	1,130,796.40	0.16
159	601555	东吴证券	167,200	1,120,240.00	0.16
160	600438	通威股份	135,200	1,119,456.00	0.16
161	000157	中联重科	313,054	1,114,472.24	0.16
162	002352	顺丰控股	33,900	1,110,225.00	0.16
163	600066	宇通客车	92,561	1,096,847.85	0.16
164	300144	宋城演艺	50,608	1,080,480.80	0.16
165	600027	华电国际	227,000	1,078,250.00	0.16
166	600482	中国动力	48,300	1,075,641.00	0.15
167	601919	中远海控	265,900	1,074,236.00	0.15
168	000876	新希望	146,880	1,069,286.40	0.15
169	600674	川投能源	122,654	1,063,410.18	0.15
170	600398	海澜之家	125,202	1,061,712.96	0.15
171	000425	徐工机械	327,424	1,057,579.52	0.15
172	600926	杭州银行	142,900	1,057,460.00	0.15
173	000703	恒逸石化	91,500	1,054,080.00	0.15
174	600219	南山铝业	499,450	1,053,839.50	0.15

175	600085	同仁堂	38,262	1,052,205.00	0.15
176	603799	华友钴业	34,720	1,045,419.20	0.15
177	600489	中金黄金	120,168	1,031,041.44	0.15
178	300070	碧水源	131,634	1,026,745.20	0.15
179	601997	贵阳银行	96,100	1,026,348.00	0.15
180	300024	机器人	76,085	1,005,843.70	0.14
181	000728	国元证券	140,657	981,785.86	0.14
182	002146	荣盛发展	121,180	963,381.00	0.14
183	601138	工业富联	82,300	953,857.00	0.14
184	002050	三花智控	74,200	941,598.00	0.14
185	600170	上海建工	310,104	939,615.12	0.14
186	002673	西部证券	121,928	935,187.76	0.13
187	002241	歌尔股份	135,620	933,065.60	0.13
188	002179	中航光电	27,500	926,200.00	0.13
189	601018	宁波港	275,261	919,371.74	0.13
190	601198	东兴证券	96,100	918,716.00	0.13
191	002065	东华软件	130,224	905,056.80	0.13
192	002001	新和成	59,900	899,099.00	0.13
193	000625	长安汽车	135,809	894,981.31	0.13
194	002081	金螳螂	110,476	894,855.60	0.13
195	600739	辽宁成大	85,202	891,212.92	0.13
196	002493	荣盛石化	87,600	883,884.00	0.13
197	600208	新湖中宝	299,474	868,474.60	0.12
198	000630	铜陵有色	439,915	866,632.55	0.12
199	000709	河钢股份	295,900	840,356.00	0.12
200	600153	建发股份	118,539	835,699.95	0.12
201	002252	上海莱士	103,938	832,543.38	0.12
202	002558	巨人网络	42,320	819,738.40	0.12

203	300296	利亚德	106,300	817,447.00	0.12
204	601992	金隅集团	232,400	813,400.00	0.12
205	002271	东方雨虹	62,700	811,965.00	0.12
206	600760	中航沈飞	29,300	811,903.00	0.12
207	000786	北新建材	58,800	809,088.00	0.12
208	300072	三聚环保	81,905	805,945.20	0.12
209	300017	网宿科技	101,744	796,655.52	0.11
210	000503	国新健康	50,113	795,794.44	0.11
211	002797	第一创业	146,360	793,271.20	0.11
212	603858	步长制药	30,830	779,382.40	0.11
213	600038	中直股份	20,519	766,589.84	0.11
214	002624	完美世界	27,500	765,875.00	0.11
215	600688	上海石化	153,200	764,468.00	0.11
216	600566	济川药业	22,700	761,131.00	0.11
217	600583	海油工程	153,955	754,379.50	0.11
218	002572	索菲亚	45,000	753,750.00	0.11
219	601333	广深铁路	236,200	746,392.00	0.11
220	600977	中国电影	52,000	744,640.00	0.11
221	601117	中国化学	137,500	737,000.00	0.11
222	000961	中南建设	129,250	725,092.50	0.10
223	600004	白云机场	72,100	724,605.00	0.10
224	600118	中国卫星	41,223	713,982.36	0.10
225	600549	厦门钨业	59,050	713,324.00	0.10
226	002085	万丰奥威	91,400	708,350.00	0.10
227	603833	欧派家居	8,822	703,289.84	0.10
228	600346	恒力股份	52,815	699,798.75	0.10
229	600297	广汇汽车	171,740	697,264.40	0.10
230	600369	西南证券	196,634	684,286.32	0.10

231	000792	盐湖股份	96,995	677,025.10	0.10
232	601878	浙商证券	92,900	674,454.00	0.10
233	002602	世纪华通	32,520	671,538.00	0.10
234	002508	老板电器	33,100	668,289.00	0.10
235	600816	安信信托	152,407	666,018.59	0.10
236	601238	广汽集团	64,600	664,734.00	0.10
237	600415	小商品城	189,456	661,201.44	0.10
238	000898	鞍钢股份	128,500	659,205.00	0.09
239	002310	东方园林	93,500	650,760.00	0.09
240	000839	中信国安	191,150	644,175.50	0.09
241	600809	山西汾酒	18,100	634,405.00	0.09
242	603986	兆易创新	9,900	616,968.00	0.09
243	601216	君正集团	235,096	615,951.52	0.09
244	601881	中国银河	89,800	612,436.00	0.09
245	601021	春秋航空	19,200	610,752.00	0.09
246	002294	信立泰	29,100	607,899.00	0.09
247	000983	西山煤电	109,800	602,802.00	0.09
248	002032	苏泊尔	11,400	598,500.00	0.09
249	600909	华安证券	126,100	595,192.00	0.09
250	601898	中煤能源	127,400	592,410.00	0.09
251	000671	阳光城	112,800	585,432.00	0.08
252	600157	永泰能源	432,821	579,980.14	0.08
253	000627	天茂集团	103,200	578,952.00	0.08
254	002153	石基信息	22,256	577,765.76	0.08
255	601360	三六零	28,300	576,471.00	0.08
256	300033	同花顺	15,000	573,000.00	0.08
257	600998	九州通	39,200	572,320.00	0.08
258	600704	物产中大	119,905	549,164.90	0.08

259	603259	药明康德	7,300	546,478.00	0.08
260	601991	大唐发电	172,600	543,690.00	0.08
261	600188	兖州煤业	61,829	542,858.62	0.08
262	000402	金融街	83,291	536,394.04	0.08
263	600061	国投资本	58,900	529,511.00	0.08
264	002601	龙蟠佰利	42,400	521,520.00	0.08
265	000826	启迪桑德	49,772	517,131.08	0.07
266	601228	广州港	129,400	512,424.00	0.07
267	603160	汇顶科技	6,400	503,680.00	0.07
268	600372	中航电子	36,702	476,391.96	0.07
269	601633	长城汽车	83,904	469,862.40	0.07
270	000408	藏格控股	41,700	467,874.00	0.07
271	300251	光线传媒	61,240	465,424.00	0.07
272	000415	渤海租赁	129,200	465,120.00	0.07
273	002411	延安必康	21,100	444,788.00	0.06
274	000938	紫光股份	14,200	443,892.00	0.06
275	600339	中油工程	116,600	423,258.00	0.06
276	002555	三七互娱	44,400	419,136.00	0.06
277	000959	首钢股份	110,500	412,165.00	0.06
278	600025	华能水电	125,300	394,695.00	0.06
279	601611	中国核建	54,800	357,844.00	0.05
280	300433	蓝思科技	54,948	357,711.48	0.05
281	601808	中海油服	41,200	351,848.00	0.05
282	002468	申通快递	21,300	350,385.00	0.05
283	002773	康弘药业	9,400	320,258.00	0.05
284	001965	招商公路	38,700	310,761.00	0.04
285	002625	光启技术	29,970	296,703.00	0.04
286	002120	韵达股份	9,400	284,820.00	0.04

287	002925	盈趣科技	6,300	276,444.00	0.04
288	601066	中信建投	30,700	267,397.00	0.04
289	600390	五矿资本	36,500	254,040.00	0.04
290	600233	圆通速递	25,300	253,000.00	0.04
291	601828	美凯龙	21,600	238,464.00	0.03
292	603260	合盛硅业	5,100	223,380.00	0.03
293	601838	成都银行	27,700	222,985.00	0.03
294	601108	财通证券	27,500	198,550.00	0.03
295	601212	白银有色	58,500	172,575.00	0.02
296	603156	养元饮品	4,100	170,478.00	0.02
297	000553	安道麦 A	17,200	157,036.00	0.02

8.3.2 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	600485	信威集团	135,770	1,980,884.30	0.28
2	000540	中天金融	331,200	1,612,944.00	0.23
3	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.01
4	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.01
5	002942	新农股份	1,441	44,123.42	0.01
6	300753	爱朋医疗	1,055	42,326.60	0.01
7	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	10,346,201.00	1.21
2	600519	贵州茅台	4,992,534.10	0.58
3	603288	海天味业	4,727,351.45	0.55
4	600016	民生银行	4,448,178.20	0.52
5	600036	招商银行	4,387,029.00	0.51
6	601229	上海银行	3,787,593.20	0.44
7	601939	建设银行	3,768,041.00	0.44
8	000651	格力电器	3,026,641.00	0.35
9	601988	中国银行	2,952,922.00	0.34
10	601166	兴业银行	2,923,392.85	0.34
11	600867	通化东宝	2,669,708.00	0.31
12	601766	中国中车	2,461,011.00	0.29
13	000333	美的集团	2,434,981.00	0.28
14	600487	亨通光电	2,433,336.06	0.28
15	601328	交通银行	2,418,284.00	0.28
16	600887	伊利股份	2,360,367.64	0.28
17	600516	方大炭素	2,167,749.00	0.25
18	600276	恒瑞医药	1,980,652.47	0.23
19	600028	中国石化	1,953,786.00	0.23
20	000661	长春高新	1,949,302.00	0.23

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

8.4.2 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	601318	中国平安	9,585,713.88	1.12
2	600016	民生银行	5,795,721.80	0.68
3	600519	贵州茅台	4,700,230.30	0.55

4	600036	招商银行	4,006,261.00	0.47
5	601939	建设银行	3,590,350.00	0.42
6	000651	格力电器	2,844,812.00	0.33
7	601988	中国银行	2,757,703.00	0.32
8	601166	兴业银行	2,685,226.00	0.31
9	600887	伊利股份	2,328,271.00	0.27
10	601328	交通银行	2,174,392.00	0.25
11	000333	美的集团	2,069,763.47	0.24
12	000002	万科 A	1,856,211.00	0.22
13	600030	中信证券	1,854,191.00	0.22
14	600276	恒瑞医药	1,785,420.00	0.21
15	600000	浦发银行	1,729,568.00	0.20
16	002415	海康威视	1,713,091.00	0.20
17	601668	中国建筑	1,630,855.87	0.19
18	000858	五粮液	1,602,031.00	0.19
19	601099	太平洋	1,532,913.20	0.18
20	600104	上汽集团	1,438,633.00	0.17

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。

8.4.3 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	231,098,286.02
卖出股票收入（成交）总额	178,700,681.35

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

2018 年 2 月 12 日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）受到中国银行保险监督管理委员会（以下简称“银保监会”）行政处罚（银监罚决字[2018]1 号）。处罚书指出：招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等问题，对招商银行给予罚款的行政处罚。

中国银行保险监督管理委员会于 2018 年 4 月 19 日对兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）作出处罚决定（银保监银罚决字【2018】1 号），就兴业银行的重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产及无授信额度或超授信额度办理同业业务等违规行为作出了罚款的行政处罚决定。

其余八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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 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	44,164.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,106.42
5	应收申购款	98,145.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151,416.06

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	600485	信威集团	1,980,884.30	0.28	公告重大事项
2	000540	中天金融	1,612,944.00	0.23	公告重大事项
3	601860	紫金银行	50,145.80	0.01	新股流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 沪 深 300 指 数 A	48,324	13,926.63	11,525,910.29	1.71%	661,464,405.61	98.29%
农 银 沪 深 300 指 数 C	2	4,441.44	0.00	0.00%	8,882.88	100.00%
合计	48,326	13,926.23	11,525,910.29	1.71%	661,473,288.49	98.29%

注：1、本基金于 2011 年 4 月 12 日成立，自 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。

2、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。

9.2 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	农银沪深 300 指数 A	0.00	0.0000%
	农银沪深 300 指数 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

注：1、本基金于 2011 年 4 月 12 日成立，自 2018 年 3 月 21 日分为 A、C 两类。

2、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。

9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	农银沪深 300 指数 A	0
	农银沪深 300 指数 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2011 年 4 月 12 日）基金份额总额	3,297,550,055.44	-
本报告期期初基金份额总额	642,370,782.04	-
本报告期期间基金总申购份额	263,057,017.41	8,882.88
减:本报告期期间基金总赎回份额	232,437,483.55	-
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	672,990,315.90	8,882.88

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人于 2018 年 4 月 3 日新任刘志勇先生为副总经理；原董事长于进先生于 2018 年 12 月 4 日离任，同日由许金超先生代理董事长职位。上述变更均事先经基金管理人相关董事会决议通过，向监管机构进行了备案并在指定媒体和基金管理人网站进行了公告。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 10 万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为四年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚情况。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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中金公司	2	405,664,609.09	100.00%	377,799.14	100.00%	-
申万宏源	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。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

11.7.2 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
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

11.8 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 2017 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 1 月 1 日
2	农银沪深 300 基金 2017 年 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 1 月 22 日

3	关于农银沪深 300 基金增设 C 类份额并修改基金合同、托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 3 月 20 日
4	农银汇理沪深 300-基金合同-增加 C 类份额	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 3 月 20 日
5	农银汇理沪深 300-托管协议-增加 C 类份额	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 3 月 20 日
6	农银沪深 300 基金 2017 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 3 月 29 日
7	农银沪深 300 基金 2018 年 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 4 月 20 日
8	农银沪深 300 指数基金一招募说明书更新-2018 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 5 月 25 日
9	农银沪深 300 基金 2018 年 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 7 月 18 日
10	农银沪深 300 基金 2018 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 8 月 27 日
11	农银沪深 300 基金 2018 年 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 10 月 26 日
12	关于调整旗下部分基金在渤海银行股份有限公司最低转	中国证券报、上海证券报、证券时报、基	2018 年 11 月 13 日

	换份额的公告	金管理人网站	
13	农银沪深 300 指数基金一招募说明书更新—2018 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 11 月 20 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于新增代销机构上海浦东发展银行股份有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2018 年 11 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会有关决议，本公司注册资本由人民币 200,000,001 元增加至人民币 1,750,000,001 元，增加注册资本后，本公司股东及股东出资比例均保持不变。本公司根据相关法律法规及规范性文件的规定，结合上述增资事项同步修改了公司章程中的有关内容。上述增资事项已按规定向中国证券监督管理委员会及中国证券监督管理委员会上海监管局备案，相应的工商变更手续于 2018 年 6 月 21 日在上海市工商行政管理局办理完毕。本公司已于 2018 年 6 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述增加注册资本及修改公司章程的公告。

本公司董事长于进先生于 2018 年 12 月 4 日离任，根据本公司董事会有关决议，自 2018 年 12 月 4 日起由总经理许金超先生代任董事长职位。本公司已于 2018 年 12 月 6 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述高级管理人员变更的公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理沪深 300 指数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。

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。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

2019 年 3 月 27 日