

# 农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 14 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 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 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
8.7 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.....	63
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.....	63

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 .....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
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 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	72
13.2 存放地点 .....	72
13.3 查阅方式 .....	72

## § 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	76,684,715.96 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% × 中证 500 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	luzj@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）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		许金超	任德奇

## 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	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-4,586,507.35	-8,332,817.23	658,280.17
本期利润	19,524,739.87	-30,761,601.89	-288,254.81
加权平均基金份额本期利润	0.2466	-0.4999	-0.0051
本期加权平均净值利润率	19.34%	-37.43%	-0.32%
本期基金份额净值增长率	24.32%	-31.80%	-1.10%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	25,896,767.60	5,289,474.52	31,520,319.33
期末可供分配基金份额利润	0.3377	0.0760	0.5776
期末基金资产净值	102,581,483.56	74,907,676.39	86,087,154.16
期末基金份额净值	1.3377	1.0760	1.5776
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	33.77%	7.60%	57.76%

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。

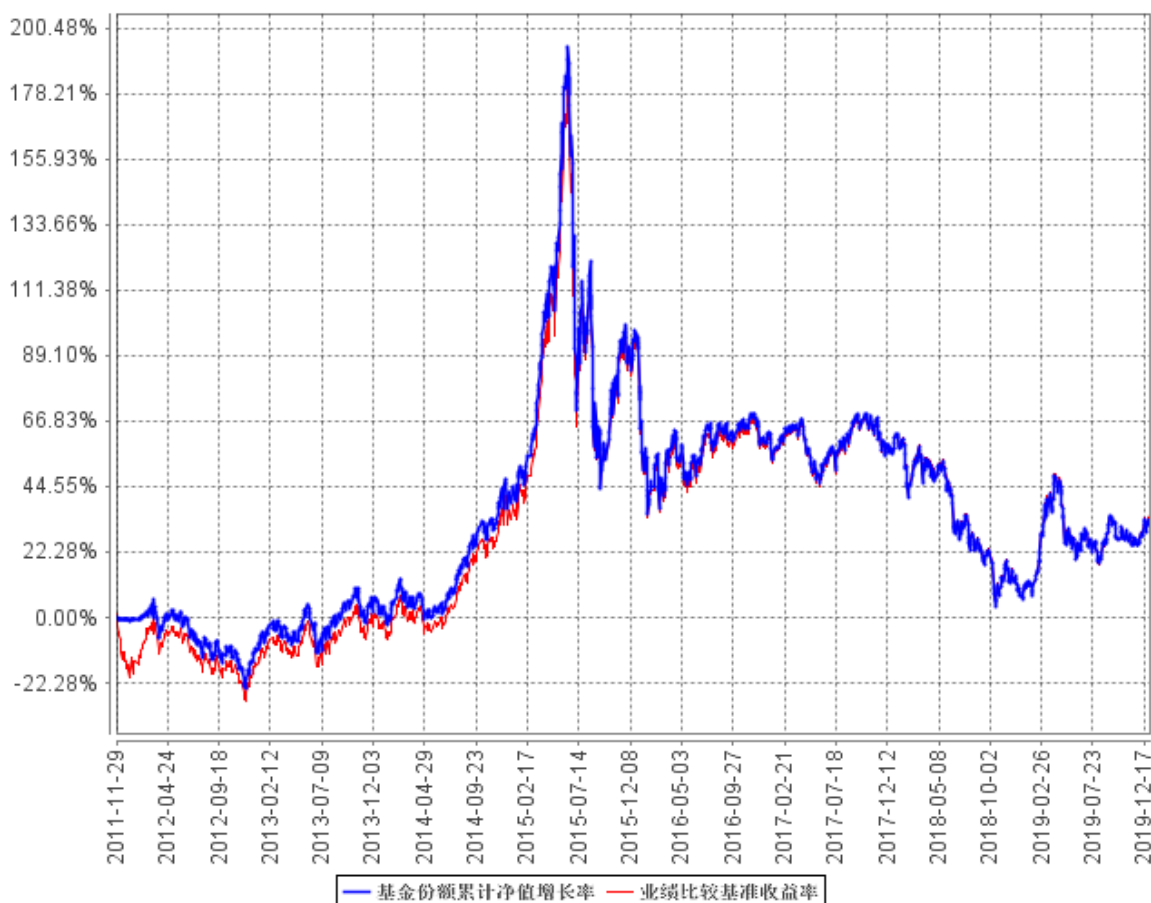
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	5.64%	0.87%	6.29%	0.88%	-0.65%	-0.01%
过去六个月	5.63%	1.02%	6.12%	1.03%	-0.49%	-0.01%
过去一年	24.32%	1.39%	25.08%	1.39%	-0.76%	0.00%
过去三年	-16.14%	1.25%	-14.87%	1.26%	-1.27%	-0.01%
过去五年	-4.65%	1.75%	0.08%	1.74%	-4.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	33.77%	1.58%	34.53%	1.61%	-0.76%	-0.03%

### 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

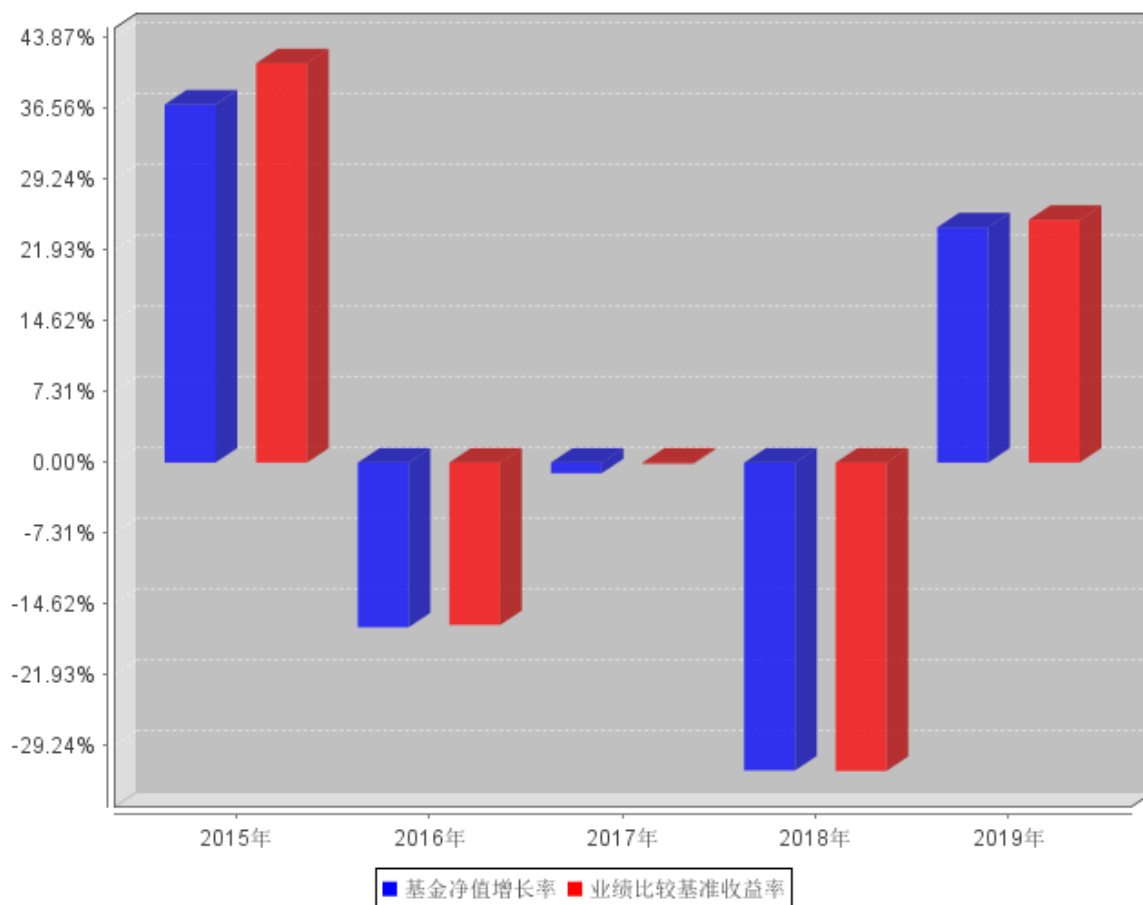
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 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

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



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

本基金过去三年无利润分配。

## § 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 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 58 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 个月定期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、农银汇理永安混合型证券投资基金、农银汇理稳进多因子股票型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型

证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理可转债债券型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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	-	12	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，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0255%，日均偏离度为 0.0161%。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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3377 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.32%，业绩比较基准收益率为 25.08%。

### 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。

#### **4.7.1 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

2019 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

2019 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。

### 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

2019 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 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(2020)第 22852 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	农银汇理中证 500 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了农银汇理中证 500 指数证券投资基金(以下简称“农银中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 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>(二)我们的意见</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,公允反映了农银中证 500 指数基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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,我们独立于农银中证 500 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	农银中证 500 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>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估农银中证 500 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中证 500 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中证 500 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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, 就可能对农银中证 500 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中证 500 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <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。</p>
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   李隐煜
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	2020 年 4 月 13 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,146,066.22	6,374,635.75
结算备付金		32,372.60	38,979.36
存出保证金		7,092.20	6,710.53
交易性金融资产	7.4.7.2	98,860,143.39	70,692,340.87
其中：股票投资		97,359,243.39	70,692,340.87
基金投资		-	-
债券投资		1,500,900.00	-
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		246,662.67	-
应收利息	7.4.7.5	34,017.38	1,253.14
应收股利		-	-
应收申购款		30,625.83	16,830.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		103,356,980.29	77,130,750.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	1,534,521.62
应付赎回款		451,821.41	139,397.40
应付管理人报酬		63,829.71	48,843.68
应付托管费		12,765.98	9,768.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	56,282.74	40,075.05
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	190,796.89	450,467.69
负债合计		775,496.73	2,223,074.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	76,684,715.96	69,618,201.87
未分配利润	7.4.7.10	25,896,767.60	5,289,474.52
所有者权益合计		102,581,483.56	74,907,676.39
负债和所有者权益总计		103,356,980.29	77,130,750.54

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3377 元，基金份额总额 76,684,715.96 份。

## 7.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		20,999,298.59	-29,495,081.21
1.利息收入		75,535.60	41,559.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	36,855.33	41,559.28
债券利息收入		38,680.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,306,497.95	-7,139,562.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-4,622,472.56	-8,049,971.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-6,800.00	-
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	1,322,774.61	910,408.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	24,111,247.22	-22,428,784.66
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	119,013.72	31,706.66
<b>减：二、费用</b>		1,474,558.72	1,266,520.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	753,929.49	615,829.35

2. 托管费	7.4.10.2.2	150,785.94	123,165.78
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	207,796.89	129,325.55
5. 利息支出		3,816.40	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,816.40	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	358,230.00	398,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		19,524,739.87	-30,761,601.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		19,524,739.87	-30,761,601.89

### 7.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	69,618,201.87	5,289,474.52	74,907,676.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,524,739.87	19,524,739.87
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）	7,066,514.09	1,082,553.21	8,149,067.30
其中：1. 基金申购款	60,649,094.73	18,187,985.33	78,837,080.06
2. 基金赎回款	-53,582,580.64	-17,105,432.12	-70,688,012.76
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）	76,684,715.96	25,896,767.60	102,581,483.56
项目	上年度可比期间 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）	54,566,834.83	31,520,319.33	86,087,154.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-30,761,601.89	-30,761,601.89
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）	15,051,367.04	4,530,757.08	19,582,124.12
其中：1. 基金申购款	33,399,035.98	12,626,642.32	46,025,678.30
2. 基金赎回款	-18,347,668.94	-8,095,885.24	-26,443,554.18
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）	69,618,201.87	5,289,474.52	74,907,676.39

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：

<u>施卫</u>	<u>Celine Zhang</u>	<u>丁煜琼</u>
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 指数成份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%，权证投资范围为基金资产净值的 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率 + 5% X 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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和托管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

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(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国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(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

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

纳增值税。

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

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

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

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

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

## 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	4,146,066.22	6,374,635.75
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：	4,146,066.22	6,374,635.75

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	99,024,631.54	97,359,243.39	-1,665,388.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,496,400.00	1,500,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,496,400.00	1,500,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	100,521,031.54	98,860,143.39	-1,660,888.15
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	96,464,476.24	70,692,340.87	-25,772,135.37
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	96,464,476.24	70,692,340.87	-25,772,135.37

### 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**

本基金本报告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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	868.58	1,232.64
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	14.50	17.50
应收债券利息	33,131.10	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3.20	3.00
合计	34,017.38	1,253.14

**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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	56,282.74	40,075.05
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	56,282.74	40,075.05

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	250,000.00
应付赎回费	796.89	467.69
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	190,000.00	200,000.00

合计	190,796.89	450,467.69
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,618,201.87	69,618,201.87
本期申购	60,649,094.73	60,649,094.73
本期赎回(以“-”号填列)	-53,582,580.64	-53,582,580.64
— 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	76,684,715.96	76,684,715.96

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,101,981.77	-48,812,507.25	5,289,474.52
本期利润	-4,586,507.35	24,111,247.22	19,524,739.87
本期基金份额交易产生的变动数	5,709,747.19	-4,627,193.98	1,082,553.21
其中：基金申购款	46,225,221.92	-28,037,236.59	18,187,985.33
基金赎回款	-40,515,474.73	23,410,042.61	-17,105,432.12
本期已分配利润	—	—	—
本期末	55,225,221.61	-29,328,454.01	25,896,767.60

#### 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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	35,467.56	40,702.66
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	1,191.82	755.32
其他	195.95	101.30
合计	36,855.33	41,559.28

**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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	66,286,244.24	36,003,588.95
减：卖出股票成本总额	70,908,716.80	44,053,560.40
买卖股票差价收入	-4,622,472.56	-8,049,971.45

**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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-6,800.00	-
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	-6,800.00	-

**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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,151,200.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,006,800.00	-
减：应收利息总额	151,200.00	-
买卖债券差价收入	-6,800.00	-

**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 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,322,774.61	910,408.96
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	1,322,774.61	910,408.96
----	--------------	------------

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	24,111,247.22	-22,428,784.66
——股票投资	24,106,747.22	-22,428,784.66
——债券投资	4,500.00	-
——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	24,111,247.22	-22,428,784.66

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	99,918.38	26,754.37
转换费收入	19,095.34	4,952.29
合计	119,013.72	31,706.66

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	207,796.89	129,325.55
银行间市场交易费用	-	-
合计	207,796.89	129,325.55

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
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	230.00	200.00
合计	358,230.00	398,200.00

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 0.02% 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
农银汇理资产管理有限公司	基金管理人的子公司
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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：

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
2. 2019 年 3 月 26 日，本基金管理人的子公司农银汇理(上海)资产管理有限公司的名称变更为农银汇理资产管理有限公司。

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	753,929.49	615,829.35
其中：支付销售机构的客户维护费	333,993.24	273,203.62

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 0.75%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.75% / 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	150,785.94	123,165.78

注：支付基金托管人交通银行的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

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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
交通银行-活期存款	4,146,066.22	35,467.56	6,374,635.75	40,702.66

注：本基金的活期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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**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（2019 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**

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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

**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、三道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了层次明晰、权责统一、监管明确的三道内部控制防线，实现了业务经营部门、风险管理部门、审计部门的分工协作，前、中、后台的相互制约，以及对公司决策层、管理层、操作层的全面监督和控制。

### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,500,900.00	-
合计	1,500,900.00	-

注：未评级的债券投资一般包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末本基金未持有长期信用评级债券。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-

合计	-	-
----	---	---

### 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“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本报告期内，本基金管理人通过独立的风险管理部门对本基金投资品种变现指标、持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、以及组合在短时间内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

### 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 2019年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	4,146,066.22	-	-	-	4,146,066.22
结算备付金	32,372.60	-	-	-	32,372.60
存出保证金	7,092.20	-	-	-	7,092.20
交易性金融资产	1,500,900.00	-	-	-97,359,243.39	98,860,143.39
应收证券清算款	-	-	-	246,662.67	246,662.67
应收利息	-	-	-	34,017.38	34,017.38
应收申购款	-	-	-	30,625.83	30,625.83
资产总计	5,686,431.02	-	-	-97,670,549.27	103,356,980.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,821.41	451,821.41
应付管理人报酬	-	-	-	63,829.71	63,829.71
应付托管费	-	-	-	12,765.98	12,765.98
应付交易费用	-	-	-	56,282.74	56,282.74
其他负债	-	-	-	190,796.89	190,796.89
负债总计	-	-	-	775,496.73	775,496.73
利率敏感度缺口	5,686,431.02	-	-	-96,895,052.54	102,581,483.56
上年度末 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	6,374,635.75	-	-	-	6,374,635.75
结算备付金	38,979.36	-	-	-	38,979.36
存出保证金	6,710.53	-	-	-	6,710.53
交易性金融资产	-	-	-	-70,692,340.87	70,692,340.87
应收利息	-	-	-	1,253.14	1,253.14
应收申购款	-	-	-	16,830.89	16,830.89
资产总计	6,420,325.64	-	-	-70,710,424.90	77,130,750.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,534,521.62	1,534,521.62
应付赎回款	-	-	-	139,397.40	139,397.40
应付管理人报酬	-	-	-	48,843.68	48,843.68
应付托管费	-	-	-	9,768.71	9,768.71
应付交易费用	-	-	-	40,075.05	40,075.05
其他负债	-	-	-	450,467.69	450,467.69
负债总计	-	-	-	2,223,074.15	2,223,074.15
利率敏感度缺口	6,420,325.64	-	-	-68,487,350.75	74,907,676.39

注：按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	收益率曲线平行变化		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响		
	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-178.71	-
	市场利率平行下降 25 个基点	178.71	-

**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 2019年12月31日		上年度末 2018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	97,359,243.39	94.91	70,692,340.87	94.37
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	97,359,243.39	94.91	70,692,340.87	94.37

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,103,382.08	3,705,016.11
	业绩比较基准下降5%	-5,103,382.08	-3,705,016.11

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2019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97,359,243.39元，属于第二层次的余额为1,500,900.00元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次70,447,508.87元，第二层次244,832.00元，无第三层次)。

(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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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(2018 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	97,359,243.39	94.20
	其中：股票	97,359,243.39	94.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,500,900.00	1.45
	其中：债券	1,500,900.00	1.45
	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	4,178,438.82	4.04
8	其他各项资产	318,398.08	0.31
9	合计	103,356,980.29	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	655,641.00	0.64
B	采矿业	3,138,379.87	3.06
C	制造业	55,409,624.51	54.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,706,049.24	2.64
E	建筑业	1,276,628.62	1.24
F	批发和零售业	4,496,844.65	4.38
G	交通运输、仓储和邮政业	3,402,348.16	3.32
H	住宿和餐饮业	440,415.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,889,035.46	9.64
J	金融业	5,707,156.99	5.56
K	房地产业	3,730,593.92	3.64
L	租赁和商务服务业	1,382,634.50	1.35
M	科学研究和技术服务业	575,310.05	0.56

N	水利、环境和公共设施管理业	690,845.90	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	98,238.80	0.10
Q	卫生和社会工作	852,590.60	0.83
R	文化、体育和娱乐业	1,901,072.00	1.85
S	综合	1,005,834.12	0.98
	合计	97,359,243.39	94.91

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

### 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	600745	闻泰科技	7,600	703,000.00	0.69
2	000066	中国长城	39,872	620,408.32	0.60
3	002463	沪电股份	27,408	608,731.68	0.59
4	002384	东山精密	25,550	591,482.50	0.58
5	601099	太平洋	154,600	585,934.00	0.57
6	601128	常熟银行	62,200	566,642.00	0.55
7	600584	长电科技	25,400	558,292.00	0.54
8	300014	亿纬锂能	11,000	551,760.00	0.54
9	600426	华鲁恒升	25,815	512,944.05	0.50
10	002371	北方华创	5,600	492,800.00	0.48
11	300383	光环新网	24,446	490,631.22	0.48
12	002049	紫光国微	9,600	488,064.00	0.48
13	600536	中国软件	6,700	480,323.00	0.47
14	300207	欣旺达	24,600	480,192.00	0.47
15	002439	启明星辰	14,200	479,960.00	0.47
16	600201	生物股份	25,590	479,044.80	0.47
17	002340	格林美	94,372	459,591.64	0.45
18	002812	恩捷股份	9,090	459,045.00	0.45
19	601872	招商轮船	55,000	454,300.00	0.44
20	002465	海格通信	41,800	452,694.00	0.44

21	600763	通策医疗	4,400	451,132.00	0.44
22	300012	华测检测	30,200	450,282.00	0.44
23	002129	中环股份	38,000	448,780.00	0.44
24	300253	卫宁健康	29,888	447,722.24	0.44
25	002065	东华软件	42,500	438,600.00	0.43
26	300088	长信科技	41,900	430,313.00	0.42
27	002127	南极电商	39,100	426,581.00	0.42
28	600739	辽宁成大	27,800	423,394.00	0.41
29	002273	水晶光电	25,515	412,322.40	0.40
30	600801	华新水泥	15,436	407,973.48	0.40
31	002353	杰瑞股份	10,900	402,864.00	0.39
32	002821	凯莱英	3,100	401,450.00	0.39
33	002180	纳思达	12,100	398,332.00	0.39
34	002797	第一创业	47,800	395,784.00	0.39
35	300315	掌趣科技	62,700	386,859.00	0.38
36	000050	深天马 A	23,200	377,928.00	0.37
37	601233	桐昆股份	25,200	377,748.00	0.37
38	000988	华工科技	18,200	369,278.00	0.36
39	000401	冀东水泥	21,400	364,014.00	0.35
40	000009	中国宝安	58,720	363,476.80	0.35
41	000750	国海证券	67,100	358,314.00	0.35
42	600673	东阳光	34,318	351,416.32	0.34
43	600885	宏发股份	10,180	350,701.00	0.34
44	300285	国瓷材料	15,300	349,605.00	0.34
45	000623	吉林敖东	21,142	349,477.26	0.34
46	002078	太阳纸业	35,300	347,352.00	0.34
47	600298	安琪酵母	11,218	344,056.06	0.34
48	002268	卫士通	13,340	344,038.60	0.34
49	002195	二三四五	105,130	339,569.90	0.33
50	600150	中国船舶	15,600	339,456.00	0.33
51	300529	健帆生物	4,700	337,648.00	0.33
52	002507	涪陵榨菜	12,500	334,125.00	0.33
53	600161	天坛生物	11,814	330,083.16	0.32
54	002926	华西证券	29,900	329,199.00	0.32
55	600642	申能股份	55,900	324,779.00	0.32
56	603517	绝味食品	6,900	320,505.00	0.31
57	002500	山西证券	38,600	319,994.00	0.31
58	600699	均胜电子	17,700	316,830.00	0.31
59	002131	利欧股份	105,959	314,698.23	0.31

60	300296	利亚德	40,500	310,635.00	0.30
61	300168	万达信息	20,000	308,600.00	0.30
62	000975	银泰黄金	22,592	307,477.12	0.30
63	000998	隆平高科	20,900	307,439.00	0.30
64	600256	广汇能源	92,800	307,168.00	0.30
65	002373	千方科技	16,900	304,876.00	0.30
66	002572	索菲亚	14,500	303,775.00	0.30
67	600704	物产中大	57,600	302,400.00	0.29
68	600325	华发股份	38,458	301,126.14	0.29
69	600909	华安证券	41,200	300,760.00	0.29
70	601100	恒立液压	6,000	298,500.00	0.29
71	603444	吉比特	1,000	298,490.00	0.29
72	600143	金发科技	41,000	298,480.00	0.29
73	600879	航天电子	49,560	296,368.80	0.29
74	000686	东北证券	31,800	295,740.00	0.29
75	002387	维信诺	18,600	295,740.00	0.29
76	601799	星宇股份	3,100	294,438.00	0.29
77	600528	中铁工业	25,300	290,950.00	0.28
78	600079	人福医药	21,500	290,465.00	0.28
79	600486	扬农化工	4,200	288,246.00	0.28
80	601168	西部矿业	43,400	287,308.00	0.28
81	002250	联化科技	16,744	286,824.72	0.28
82	600132	重庆啤酒	5,500	285,780.00	0.28
83	002013	中航机电	41,100	285,234.00	0.28
84	601231	环旭电子	14,800	284,604.00	0.28
85	002385	大北农	57,100	284,358.00	0.28
86	600728	佳都科技	30,300	284,214.00	0.28
87	000513	丽珠集团	8,398	283,012.60	0.28
88	000999	华润三九	8,900	281,952.00	0.27
89	600446	金证股份	13,700	281,946.00	0.27
90	002174	游族网络	12,100	281,567.00	0.27
91	002670	国盛金控	22,004	279,670.84	0.27
92	002223	鱼跃医疗	13,689	278,160.48	0.27
93	600460	士兰微	17,817	275,628.99	0.27
94	600567	山鹰纸业	73,100	275,587.00	0.27
95	002281	光迅科技	9,249	275,435.22	0.27
96	002019	亿帆医药	16,700	271,375.00	0.26
97	600895	张江高科	17,600	269,456.00	0.26
98	603858	步长制药	12,900	265,998.00	0.26

99	002092	中泰化学	39,100	265,489.00	0.26
100	000778	新兴铸管	63,600	265,212.00	0.26
101	000878	云南铜业	19,300	263,638.00	0.26
102	000997	新大陆	16,600	263,608.00	0.26
103	002152	广电运通	27,400	263,314.00	0.26
104	002074	国轩高科	18,000	261,900.00	0.26
105	000547	航天发展	25,600	261,632.00	0.26
106	002110	三钢闽光	27,950	261,612.00	0.26
107	300418	昆仑万维	15,600	261,300.00	0.25
108	600572	康恩贝	42,465	261,159.75	0.25
109	600820	隧道股份	42,900	259,116.00	0.25
110	600521	华海药业	15,000	258,900.00	0.25
111	600410	华胜天成	25,029	258,048.99	0.25
112	300058	蓝色光标	45,400	256,510.00	0.25
113	600273	嘉化能源	22,800	256,500.00	0.25
114	603659	璞泰来	3,000	255,450.00	0.25
115	600497	驰宏锌锗	58,000	254,040.00	0.25
116	000581	威孚高科	13,300	253,365.00	0.25
117	600466	蓝光发展	34,200	252,054.00	0.25
118	300308	中际旭创	4,820	251,363.00	0.25
119	002075	沙钢股份	40,200	250,446.00	0.24
120	600845	宝信软件	7,610	250,369.00	0.24
121	601966	玲珑轮胎	10,900	249,937.00	0.24
122	300166	东方国信	19,179	249,327.00	0.24
123	600549	厦门钨业	19,100	249,064.00	0.24
124	002212	南洋股份	13,100	249,031.00	0.24
125	603939	益丰药房	3,400	248,948.00	0.24
126	603000	人民网	12,500	247,375.00	0.24
127	601005	重庆钢铁	133,600	247,160.00	0.24
128	600260	凯乐科技	18,200	246,974.00	0.24
129	000830	鲁西化工	23,300	244,883.00	0.24
130	600839	四川长虹	84,100	244,731.00	0.24
131	000060	中金岭南	56,900	244,670.00	0.24
132	300274	阳光电源	23,220	244,506.60	0.24
133	300113	顺网科技	9,400	241,486.00	0.24
134	000636	风华高科	16,200	241,218.00	0.24
135	600884	杉杉股份	17,800	240,478.00	0.23
136	600415	小商品城	62,000	239,940.00	0.23
137	600021	上海电力	29,800	239,890.00	0.23

138	002690	美亚光电	6,100	238,510.00	0.23
139	000039	中集集团	24,260	238,233.20	0.23
140	000960	锡业股份	22,800	238,032.00	0.23
141	002217	合力泰	42,600	236,430.00	0.23
142	601333	广深铁路	77,200	236,232.00	0.23
143	600881	亚泰集团	74,000	236,060.00	0.23
144	300251	光线传媒	20,000	236,000.00	0.23
145	600315	上海家化	7,600	235,144.00	0.23
146	600376	首开股份	29,400	234,318.00	0.23
147	601866	中远海发	90,300	233,877.00	0.23
148	300001	特锐德	13,600	233,648.00	0.23
149	600258	首旅酒店	11,200	230,832.00	0.23
150	002807	江阴银行	49,460	230,483.60	0.22
151	600875	东方电气	25,000	229,750.00	0.22
152	300316	晶盛机电	14,600	229,512.00	0.22
153	600380	健康元	22,072	228,445.20	0.22
154	002191	劲嘉股份	20,000	228,200.00	0.22
155	600779	水井坊	4,400	227,700.00	0.22
156	000089	深圳机场	23,300	227,641.00	0.22
157	600811	东方集团	67,630	227,236.80	0.22
158	600160	巨化股份	31,200	227,136.00	0.22
159	600959	江苏有线	56,900	226,462.00	0.22
160	600776	东方通信	10,800	224,964.00	0.22
161	000690	宝新能源	39,600	223,740.00	0.22
162	600718	东软集团	19,700	223,595.00	0.22
163	600155	华创阳安	15,800	221,674.00	0.22
164	603338	浙江鼎力	3,100	221,650.00	0.22
165	300115	长盈精密	12,420	220,951.80	0.22
166	000402	金融街	27,200	220,864.00	0.22
167	002368	太极股份	5,650	219,898.00	0.21
168	000983	西山煤电	35,800	219,454.00	0.21
169	600166	福田汽车	104,800	219,032.00	0.21
170	600392	盛和资源	23,910	216,863.70	0.21
171	300009	安科生物	14,300	215,787.00	0.21
172	600755	厦门国贸	29,368	215,561.12	0.21
173	603882	金域医学	4,200	215,124.00	0.21
174	600022	山东钢铁	149,550	213,856.50	0.21
175	000825	太钢不锈	51,900	212,271.00	0.21
176	600643	爱建集团	22,070	211,872.00	0.21

177	600094	大名城	36,200	211,770.00	0.21
178	600580	卧龙电驱	17,600	211,552.00	0.21
179	600373	中文传媒	15,500	210,955.00	0.21
180	002589	瑞康医药	27,390	210,629.10	0.21
181	600754	锦江酒店	7,300	209,583.00	0.20
182	000729	燕京啤酒	32,000	208,640.00	0.20
183	002085	万丰奥威	29,800	208,600.00	0.20
184	600266	城建发展	25,700	208,170.00	0.20
185	600282	南钢股份	60,300	208,035.00	0.20
186	600808	马钢股份	67,700	207,839.00	0.20
187	000970	中科三环	19,300	207,475.00	0.20
188	300027	华谊兄弟	44,500	206,035.00	0.20
189	600737	中粮糖业	24,300	205,578.00	0.20
190	300010	立思辰	15,900	205,269.00	0.20
191	600167	联美控股	15,530	204,374.80	0.20
192	600216	浙江医药	15,300	204,255.00	0.20
193	002221	东华能源	26,306	204,134.56	0.20
194	002233	塔牌集团	16,200	204,120.00	0.20
195	600967	内蒙一机	19,200	204,096.00	0.20
196	000021	深科技	16,709	203,515.62	0.20
197	603707	健友股份	4,900	203,252.00	0.20
198	002407	多氟多	15,500	203,205.00	0.20
199	600171	上海贝岭	12,800	201,600.00	0.20
200	603885	吉祥航空	13,400	201,000.00	0.20
201	600804	鹏博士	32,600	199,512.00	0.19
202	000563	陕国投 A	44,966	199,199.38	0.19
203	600037	歌华有线	22,100	199,121.00	0.19
204	600026	中远海能	31,100	198,418.00	0.19
205	600435	北方导航	23,700	197,184.00	0.19
206	601699	潞安环能	27,100	196,746.00	0.19
207	601098	中南传媒	16,300	194,622.00	0.19
208	600777	新潮能源	92,600	194,460.00	0.19
209	600060	海信视像	17,800	193,130.00	0.19
210	000031	大悦城	26,700	191,706.00	0.19
211	002028	思源电气	13,908	191,513.16	0.19
212	601118	海南橡胶	38,900	191,388.00	0.19
213	600064	南京高科	19,600	191,100.00	0.19
214	002317	众生药业	14,900	189,230.00	0.18
215	000598	兴蓉环境	40,700	188,441.00	0.18

216	603866	桃李面包	4,440	188,433.60	0.18
217	002372	伟星新材	14,260	187,804.20	0.18
218	603816	顾家家居	4,100	187,493.00	0.18
219	300244	迪安诊断	8,420	186,334.60	0.18
220	600782	新钢股份	36,300	186,219.00	0.18
221	002936	郑州银行	40,000	186,000.00	0.18
222	600640	号百控股	7,200	185,832.00	0.18
223	600511	国药股份	6,800	185,572.00	0.18
224	002038	双鹭药业	14,100	185,415.00	0.18
225	000883	湖北能源	44,400	185,148.00	0.18
226	000932	华菱钢铁	38,320	183,169.60	0.18
227	000807	云铝股份	35,600	182,984.00	0.18
228	002064	华峰氨纶	29,200	182,500.00	0.18
229	601106	中国一重	62,300	181,293.00	0.18
230	600863	内蒙华电	65,900	181,225.00	0.18
231	603228	景旺电子	4,124	180,713.68	0.18
232	002414	高德红外	8,494	178,374.00	0.17
233	603077	和邦生物	120,340	178,103.20	0.17
234	002004	华邦健康	35,965	177,667.10	0.17
235	600597	光明乳业	14,000	177,660.00	0.17
236	300133	华策影视	24,000	177,600.00	0.17
237	600409	三友化工	28,100	177,592.00	0.17
238	002048	宁波华翔	11,400	176,244.00	0.17
239	601958	金钼股份	22,000	176,220.00	0.17
240	002242	九阳股份	7,000	176,120.00	0.17
241	002583	海能达	20,900	175,769.00	0.17
242	002440	闰土股份	15,653	175,313.60	0.17
243	601000	唐山港	67,226	174,787.60	0.17
244	603806	福斯特	3,540	172,044.00	0.17
245	000738	航发控制	13,100	171,217.00	0.17
246	300180	华峰超纤	19,300	170,612.00	0.17
247	600008	首创股份	51,600	169,764.00	0.17
248	601179	中国西电	46,500	169,260.00	0.17
249	000877	天山股份	14,240	168,744.00	0.16
250	300072	三聚环保	26,600	168,112.00	0.16
251	000559	万向钱潮	31,300	168,081.00	0.16
252	300026	红日药业	47,800	167,778.00	0.16
253	000027	深圳能源	27,000	167,670.00	0.16
254	601689	拓普集团	9,575	166,892.25	0.16

255	603883	老百姓	2,600	166,608.00	0.16
256	002399	海普瑞	8,500	165,835.00	0.16
257	600388	龙净环保	17,000	165,750.00	0.16
258	000930	中粮科技	25,100	165,660.00	0.16
259	000685	中山公用	20,076	165,426.24	0.16
260	600138	中青旅	13,125	165,375.00	0.16
261	600039	四川路桥	49,200	165,312.00	0.16
262	600507	方大特钢	16,400	164,984.00	0.16
263	600970	中材国际	23,650	164,840.50	0.16
264	600649	城投控股	28,700	164,164.00	0.16
265	600729	重庆百货	5,497	164,085.45	0.16
266	600827	百联股份	18,200	163,436.00	0.16
267	600908	无锡银行	29,400	163,170.00	0.16
268	300182	捷成股份	46,700	162,983.00	0.16
269	600500	中化国际	30,713	162,778.90	0.16
270	000528	柳工	23,420	162,534.80	0.16
271	601718	际华集团	49,800	162,348.00	0.16
272	600633	浙数文化	17,700	161,955.00	0.16
273	601228	广州港	42,200	161,626.00	0.16
274	000008	神州高铁	44,100	160,083.00	0.16
275	000012	南玻 A	31,695	158,791.95	0.15
276	002831	裕同科技	5,960	158,238.00	0.15
277	600056	中国医药	12,100	157,905.00	0.15
278	600515	海航基础	35,400	157,884.00	0.15
279	600120	浙江东方	18,029	157,393.17	0.15
280	000090	天健集团	29,686	157,335.80	0.15
281	600598	北大荒	16,100	156,814.00	0.15
282	600062	华润双鹤	11,952	155,973.60	0.15
283	000028	国药一致	3,432	155,675.52	0.15
284	000712	锦龙股份	10,200	155,040.00	0.15
285	002665	首航节能	46,060	154,761.60	0.15
286	000488	晨鸣纸业	30,300	154,227.00	0.15
287	600158	中体产业	15,300	153,459.00	0.15
288	600563	法拉电子	3,100	153,295.00	0.15
289	600823	世茂股份	34,000	153,000.00	0.15
290	601717	郑煤机	23,600	152,692.00	0.15
291	600418	江淮汽车	30,400	152,608.00	0.15
292	002056	横店东磁	18,600	152,520.00	0.15
293	601598	中国外运	35,800	152,508.00	0.15

294	600348	阳泉煤业	27,300	150,969.00	0.15
295	002155	湖南黄金	19,100	150,699.00	0.15
296	000887	中鼎股份	16,600	150,230.00	0.15
297	000826	启迪环境	16,200	148,716.00	0.14
298	000158	常山北明	21,714	148,089.48	0.14
299	601608	中信重工	39,800	148,056.00	0.14
300	002266	浙富控股	35,930	148,031.60	0.14
301	600648	外高桥	8,500	147,645.00	0.14
302	000400	许继电气	13,700	147,549.00	0.14
303	002002	鸿达兴业	35,229	146,552.64	0.14
304	600307	酒钢宏兴	71,000	146,260.00	0.14
305	002408	齐翔腾达	20,380	145,717.00	0.14
306	002030	达安基因	12,636	145,314.00	0.14
307	300002	神州泰岳	44,500	145,070.00	0.14
308	600717	天津港	23,000	144,440.00	0.14
309	600277	亿利洁能	31,400	143,184.00	0.14
310	601880	大连港	70,190	142,485.70	0.14
311	000301	东方盛虹	27,400	141,932.00	0.14
312	002183	怡亚通	33,700	141,877.00	0.14
313	000078	海王生物	38,000	141,740.00	0.14
314	002701	奥瑞金	32,032	141,261.12	0.14
315	000501	鄂武商 A	10,605	140,834.40	0.14
316	600557	康缘药业	9,552	140,796.48	0.14
317	002244	滨江集团	28,500	140,220.00	0.14
318	002390	信邦制药	26,450	138,862.50	0.14
319	600862	中航高科	12,600	138,852.00	0.14
320	000758	中色股份	31,600	138,408.00	0.13
321	002815	崇达技术	8,000	138,320.00	0.13
322	002203	海亮股份	13,400	137,350.00	0.13
323	000156	华数传媒	13,100	136,764.00	0.13
324	002603	以岭药业	11,000	136,730.00	0.13
325	002640	跨境通	17,700	136,644.00	0.13
326	002925	盈趣科技	3,100	136,245.00	0.13
327	000681	视觉中国	7,900	136,196.00	0.13
328	600291	西水股份	15,000	134,850.00	0.13
329	300134	大富科技	8,710	134,308.20	0.13
330	600195	中牧股份	11,614	134,141.70	0.13
331	002280	联络互动	34,600	133,902.00	0.13
332	300324	旋极信息	23,768	133,100.80	0.13

333	000967	盈峰环境	21,500	132,655.00	0.13
334	002444	巨星科技	12,300	132,102.00	0.13
335	600545	卓郎智能	21,700	131,719.00	0.13
336	601928	凤凰传媒	17,300	131,653.00	0.13
337	000718	苏宁环球	34,400	131,408.00	0.13
338	000717	韶钢松山	27,700	131,298.00	0.13
339	002302	西部建设	11,600	130,964.00	0.13
340	600765	中航重机	12,800	130,944.00	0.13
341	600664	哈药股份	34,490	130,717.10	0.13
342	002426	胜利精密	55,200	130,272.00	0.13
343	600339	中油工程	38,400	130,176.00	0.13
344	002635	安洁科技	7,784	129,759.28	0.13
345	600901	江苏租赁	20,500	129,560.00	0.13
346	601975	招商南油	46,100	129,541.00	0.13
347	002709	天赐材料	6,240	129,168.00	0.13
348	601611	中国核建	18,100	129,053.00	0.13
349	600316	洪都航空	9,900	128,997.00	0.13
350	000727	华东科技	61,600	128,744.00	0.13
351	000959	首钢股份	36,400	128,492.00	0.13
352	603712	七一二	5,300	128,154.00	0.12
353	000813	德展健康	20,300	127,687.00	0.12
354	600748	上实发展	21,160	125,690.40	0.12
355	600125	铁龙物流	20,969	125,394.62	0.12
356	601678	滨化股份	24,500	125,195.00	0.12
357	600499	科达洁能	28,900	125,137.00	0.12
358	600859	王府井	8,940	125,070.60	0.12
359	600645	中源协和	7,385	125,028.05	0.12
360	600869	智慧能源	25,500	124,950.00	0.12
361	002249	大洋电机	32,200	124,292.00	0.12
362	000761	本钢板材	31,500	124,110.00	0.12
363	603233	大参林	2,360	123,310.00	0.12
364	600017	日照港	42,300	123,093.00	0.12
365	002839	张家港行	20,700	122,958.00	0.12
366	000987	越秀金控	12,600	121,842.00	0.12
367	000519	中兵红箭	15,929	121,378.98	0.12
368	600751	海航科技	41,300	121,009.00	0.12
369	600141	兴发集团	11,768	120,975.04	0.12
370	600835	上海机电	7,300	120,961.00	0.12
371	600312	平高电气	18,700	120,802.00	0.12

372	000543	皖能电力	26,030	120,779.20	0.12
373	600565	迪马股份	33,500	119,930.00	0.12
374	002745	木林森	8,800	119,768.00	0.12
375	600582	天地科技	37,500	119,625.00	0.12
376	600073	上海梅林	14,900	118,753.00	0.12
377	600259	广晟有色	3,400	118,218.00	0.12
378	600478	科力远	26,525	116,710.00	0.11
379	002434	万里扬	12,300	116,604.00	0.11
380	000006	深振业 A	21,672	116,161.92	0.11
381	601200	上海环境	10,460	116,106.00	0.11
382	002419	天虹股份	11,000	116,050.00	0.11
383	002491	通鼎互联	17,400	115,014.00	0.11
384	002128	露天煤业	13,200	114,312.00	0.11
385	600317	营口港	44,500	113,475.00	0.11
386	600126	杭钢股份	23,190	113,399.10	0.11
387	002920	德赛西威	3,700	112,221.00	0.11
388	002051	中工国际	11,356	110,380.32	0.11
389	002505	大康农业	62,930	110,127.50	0.11
390	002118	紫鑫药业	17,600	109,824.00	0.11
391	002544	杰赛科技	7,900	107,598.00	0.10
392	603198	迎驾贡酒	5,400	107,568.00	0.10
393	300159	新研股份	27,300	107,016.00	0.10
394	002382	蓝帆医疗	8,800	106,832.00	0.10
395	002375	亚厦股份	18,400	106,720.00	0.10
396	600639	浦东金桥	7,800	105,300.00	0.10
397	600787	中储股份	20,200	105,242.00	0.10
398	002285	世联行	28,063	105,236.25	0.10
399	000848	承德露露	13,316	104,796.92	0.10
400	601326	秦港股份	32,700	104,313.00	0.10
401	603328	依顿电子	9,200	104,144.00	0.10
402	002681	奋达科技	18,618	103,888.44	0.10
403	300459	金科文化	32,547	103,824.93	0.10
404	002176	江特电机	27,400	103,024.00	0.10
405	000553	安道麦 A	10,300	103,000.00	0.10
406	000062	深圳华强	7,210	102,670.40	0.10
407	601139	深圳燃气	13,000	101,790.00	0.10
408	600759	洲际油气	36,293	100,531.61	0.10
409	002470	金正大	37,700	100,282.00	0.10
410	601019	山东出版	14,400	100,080.00	0.10

411	600985	淮北矿业	10,000	99,900.00	0.10
412	000537	广宇发展	12,800	99,456.00	0.10
413	603888	新华网	4,700	99,170.00	0.10
414	000564	供销大集	41,300	98,707.00	0.10
415	300197	铁汉生态	32,250	98,685.00	0.10
416	603568	伟明环保	4,295	98,527.30	0.10
417	603377	东方时尚	5,380	98,238.80	0.10
418	300376	易事特	21,300	97,554.00	0.10
419	300297	蓝盾股份	17,200	97,008.00	0.09
420	600770	综艺股份	17,900	96,481.00	0.09
421	002573	清新环境	14,908	96,156.60	0.09
422	002867	周大生	5,000	95,200.00	0.09
423	603515	欧普照明	3,380	95,011.80	0.09
424	600428	中远海特	24,626	92,101.24	0.09
425	002093	国脉科技	11,400	91,884.00	0.09
426	601016	节能风电	38,100	91,821.00	0.09
427	600575	淮河能源	35,700	91,749.00	0.09
428	002625	光启技术	9,900	90,585.00	0.09
429	600694	大商股份	3,300	90,387.00	0.09
430	600329	中新药业	6,500	90,090.00	0.09
431	002358	森源电气	12,800	89,472.00	0.09
432	000869	张裕 A	3,100	88,970.00	0.09
433	000937	冀中能源	24,300	88,938.00	0.09
434	603766	隆鑫通用	23,550	87,841.50	0.09
435	000061	农产品	15,600	87,204.00	0.09
436	000766	通化金马	13,300	86,982.00	0.08
437	002416	爱施德	11,320	86,145.20	0.08
438	300257	开山股份	7,900	85,952.00	0.08
439	600757	长江传媒	13,900	85,624.00	0.08
440	000536	华映科技	31,700	85,590.00	0.08
441	600623	华谊集团	12,800	85,120.00	0.08
442	002503	搜于特	35,440	84,701.60	0.08
443	002424	贵州百灵	9,700	84,487.00	0.08
444	601001	大同煤业	19,200	84,480.00	0.08
445	000990	诚志股份	5,700	84,474.00	0.08
446	002672	东江环保	9,325	83,925.00	0.08
447	600006	东风汽车	18,300	83,814.00	0.08
448	000426	兴业矿业	16,862	83,804.14	0.08
449	002366	台海核电	11,900	82,824.00	0.08

450	600098	广州发展	12,500	81,750.00	0.08
451	000980	众泰汽车	27,900	81,747.00	0.08
452	000600	建投能源	16,400	80,196.00	0.08
453	603486	科沃斯	3,880	78,725.20	0.08
454	600058	五矿发展	9,800	78,596.00	0.08
455	600657	信达地产	19,579	78,120.21	0.08
456	600338	西藏珠峰	6,240	78,000.00	0.08
457	601615	明阳智能	6,300	77,490.00	0.08
458	002482	广田集团	17,600	77,088.00	0.08
459	600903	贵州燃气	5,200	76,856.00	0.07
460	002437	誉衡药业	25,250	76,507.50	0.07
461	600350	山东高速	15,400	75,614.00	0.07
462	002653	海思科	3,700	75,332.00	0.07
463	601801	皖新传媒	13,700	75,076.00	0.07
464	002948	青岛银行	12,600	74,844.00	0.07
465	600053	九鼎投资	2,900	73,747.00	0.07
466	603056	德邦股份	6,600	73,326.00	0.07
467	601127	小康股份	6,400	72,960.00	0.07
468	603556	海兴电力	4,460	72,698.00	0.07
469	600874	创业环保	9,900	71,181.00	0.07
470	600707	彩虹股份	16,400	68,880.00	0.07
471	601003	柳钢股份	11,700	66,105.00	0.06
472	002818	富森美	5,150	65,147.50	0.06
473	300199	翰宇药业	10,500	60,900.00	0.06
474	603983	丸美股份	1,000	60,030.00	0.06
475	601869	长飞光纤	1,800	59,454.00	0.06
476	600335	国机汽车	10,000	58,000.00	0.06
477	600996	贵广网络	7,200	57,960.00	0.06
478	000025	特力 A	2,690	57,028.00	0.06
479	603379	三美股份	1,400	52,290.00	0.05
480	601860	紫金银行	9,200	51,704.00	0.05
481	601969	海南矿业	8,900	51,531.00	0.05
482	603225	新凤鸣	3,956	48,856.60	0.05
483	601811	新华文轩	3,600	47,484.00	0.05
484	603650	彤程新材	2,700	47,034.00	0.05
485	603317	天味食品	1,000	44,900.00	0.04
486	603355	莱克电气	1,800	42,606.00	0.04
487	603868	飞科电器	1,100	41,448.00	0.04
488	601865	福莱特	3,400	41,242.00	0.04

489	001872	招商港口	2,400	41,184.00	0.04
490	002423	中粮资本	4,200	40,782.00	0.04
491	603025	大豪科技	4,233	40,086.51	0.04
492	600939	重庆建工	8,300	39,923.00	0.04
493	601068	中铝国际	7,000	38,780.00	0.04
494	603256	宏和科技	2,200	32,494.00	0.03
495	600917	重庆燃气	4,300	31,218.00	0.03
496	002957	科瑞技术	900	29,493.00	0.03
497	002941	新疆交建	1,600	28,080.00	0.03
498	002946	新乳业	2,200	27,632.00	0.03
499	603877	太平鸟	1,300	19,851.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

## 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	600745	闻泰科技	1,566,592.00	2.09
2	002405	四维图新	708,753.00	0.95
3	002157	正邦科技	605,291.00	0.81
4	300014	亿纬锂能	600,352.00	0.80
5	002926	华西证券	589,684.00	0.79
6	600497	驰宏锌锗	589,624.98	0.79
7	601099	太平洋	581,541.00	0.78
8	300383	光环新网	550,305.00	0.73
9	600909	华安证券	534,603.00	0.71
10	601333	广深铁路	526,227.00	0.70
11	601598	中国外运	504,462.00	0.67
12	603939	益丰药房	486,162.00	0.65
13	600739	辽宁成大	477,623.00	0.64
14	300012	华测检测	474,086.00	0.63
15	002607	中公教育	473,339.00	0.63
16	600763	通策医疗	463,315.00	0.62
17	002065	东华软件	461,737.00	0.62

18	600256	广汇能源	446,774.00	0.60
19	002180	纳思达	431,012.00	0.58
20	601128	常熟银行	430,914.00	0.58

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	600745	闻泰科技	1,490,139.00	1.99
2	600183	生益科技	969,644.80	1.29
3	000860	顺鑫农业	841,785.10	1.12
4	002405	四维图新	719,197.00	0.96
5	600872	中炬高新	713,430.52	0.95
6	002916	深南电路	694,932.40	0.93
7	603501	韦尔股份	690,647.00	0.92
8	300347	泰格医药	674,223.00	0.90
9	603369	今世缘	667,775.00	0.89
10	300450	先导智能	634,805.00	0.85
11	002410	广联达	597,045.00	0.80
12	002299	圣农发展	596,020.00	0.80
13	002607	中公教育	591,633.00	0.79
14	000656	金科股份	528,985.00	0.71
15	300146	汤臣倍健	511,466.00	0.68
16	002157	正邦科技	510,976.00	0.68
17	600600	青岛啤酒	500,824.00	0.67
18	300383	光环新网	490,289.44	0.65
19	002506	协鑫集成	478,596.00	0.64
20	600256	广汇能源	458,121.20	0.61

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	73,468,872.10
卖出股票收入（成交）总额	66,286,244.24

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

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	1,500,900.00	1.46
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	1,500,900.00	1.46

## 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

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	019611	19 国债 01	15,000	1,500,900.00	1.46

## 8.7 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。

## 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

2019 年 8 月 16 日, 上海证券交易所出具纪律处分决定书 (2019) 62 号: 闻泰科技因在重大资产重组决策程序、停复牌事项办理和信息披露方面, 公司时任董事长张学政、董事会秘书周斌在职责履行方面存在违规行为, 公司及时任董事长、董事会秘书受到上交所通报批评的纪律处分。

2019 年 7 月 16 日, 太平洋证券股份有限公司 (以下简称“公司”) 对外发布公告称: 中国证券监督管理委员会云南监管局出具中国证券监督管理委员会云南监管局行政处罚决定书 (2019) 9 号, 公司存在对下属全资另类投资子公司太证非凡投资有限公司 (以下简称太证非凡) 管控不到位, 未有效督促太证非凡强化合规风险管理及审慎开展业务等问题, 如多数审批事项审批及留痕不规范, 总经理离任未开展离任审计, 重要印章管理, 用印不规范, 风险管理委员会缺乏独立性, 部分协议, 合同及投资决策表未经合规与风险管理负责人审核, 投后管理不到位, 存在一定投资风险, 以上事实有相关合同文件, 审批单, 公司制度等证据证明, 上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条, 《证券公司风险控制指标管理办法》第六条的规定, 按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定, 云南证监局决定: 自收到行政监管措施决定书之日起暂停太平洋证券股份有限公司另类投资子公司业务 (项目退出或投资标的股权转让除外) 3 个月。

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

### 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	7,092.20
2	应收证券清算款	246,662.67
3	应收股利	-
4	应收利息	34,017.38

5	应收申购款	30,625.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,398.08

#### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

## § 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

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
7,579	10,118.05	494,996.43	0.65%	76,189,719.53	99.35%

### 9.2 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	33,944.04	0.0443%

### 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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 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	69,618,201.87
本报告期基金总申购份额	60,649,094.73
减:本报告期基金总赎回份额	53,582,580.64
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	76,684,715.96

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

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）董事会有关决议，自 2019 年 3 月 4 日起，许金超先生任职公司董事长并代任公司总经理职位。本公司已于 2019 年 3 月 6 日在指定媒体以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）董事会有关决议，自 2019 年 5 月 7 日起，施卫先生任职本公司总经理职位，同日起本公司董事长许金超先生不再代为履行总经理职务。本公司已于 2019 年 5 月 9 日在指定媒体以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

根据农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）总办会有关决议，自 2019 年 8 月 27 日起，本公司总经理施卫先生兼任首席信息官职位。另根据本公司董事会有关决议，自 2019 年 9 月 10 日起，Céline Zhang 女士起任本公司副总经理职位。本公司已分别于 2019 年 8 月 29 日、2019 年 9 月 11 日在证券时报以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内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 6 万元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	74,750,386.86	53.76%	69,616.01	53.76%	-
高华证券	2	64,303,112.48	46.24%	59,889.91	46.24%	-

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	5,503,200.00	100.00%	15,000,000.00	100.00%	-	-

## 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	农银中证 500 基金—招募说明书更新—2018 年第 2 号	上证报	2019 年 1 月 12 日
2	农银汇理基金 2018 年 4 季度报告	上证报	2019 年 1 月 21 日
3	农银汇理基金 2018 年年度报告	上证报	2019 年 3 月 27 日
4	农银汇理基金 2019 年一季度报告	上证报	2019 年 4 月 19 日
5	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2019 年半年度资产净值公告	上证报	2019 年 7 月 1 日
6	农银中证 500 基金—招募说明书更新—2019 年第 1 号	上证报	2019 年 7 月 11 日

7	农银汇理基金 2019 年二季度报告	上证报	2019 年 7 月 16 日
8	农银汇理基金 2019 年半年度报告	上证报	2019 年 8 月 23 日
9	农银汇理基金 2019 年第三季度报告	上证报	2019 年 10 月 25 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

无。

## § 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、《农银汇理中证 500 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 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

2020 年 4 月 14 日