

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人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.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58

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	58
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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 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	53,836,226.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% × 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）自由贸易试验区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城路 9	上海市浦东新区银城中路 188

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	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	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层

§ 3 主要财务指标、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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-2,020,686.25	36,279,340.55	19,916,780.99
本期利润	-15,181,832.45	26,937,571.40	35,454,520.62
加权平均基金份额本期利润	-0.2735	0.4861	0.3481
本期加权平均净值利润率	-17.28%	25.59%	30.63%
本期基金份额净值增长率	-17.01%	37.00%	35.52%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	32,037,431.44	45,104,281.40	18,186,785.76
期末可供分配基金份额利润	0.5951	0.9221	0.2643
期末基金资产净值	85,873,658.29	94,017,581.42	96,556,386.01
期末基金份额净值	1.5951	1.9221	1.4030
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	59.51%	92.21%	40.30%

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。

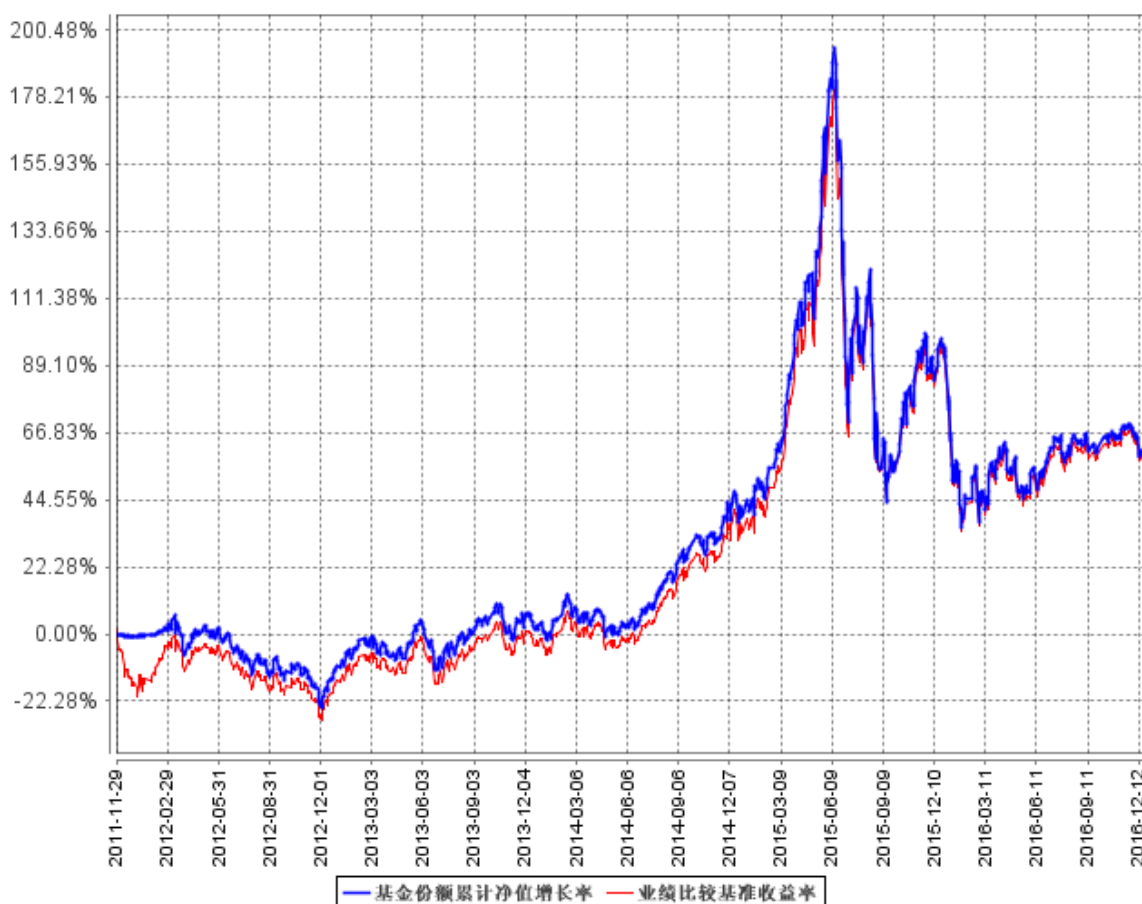
3.2 基金净值表现

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	-1.48%	0.77%	-0.96%	0.78%	-0.52%	-0.01%
过去六个月	1.37%	0.87%	2.21%	0.88%	-0.84%	-0.01%
过去一年	-17.01%	1.81%	-16.77%	1.81%	-0.24%	0.00%
过去三年	54.07%	1.99%	60.91%	1.98%	-6.84%	0.01%
过去五年	60.62%	1.76%	87.65%	1.78%	-27.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	59.51%	1.74%	58.03%	1.78%	1.48%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

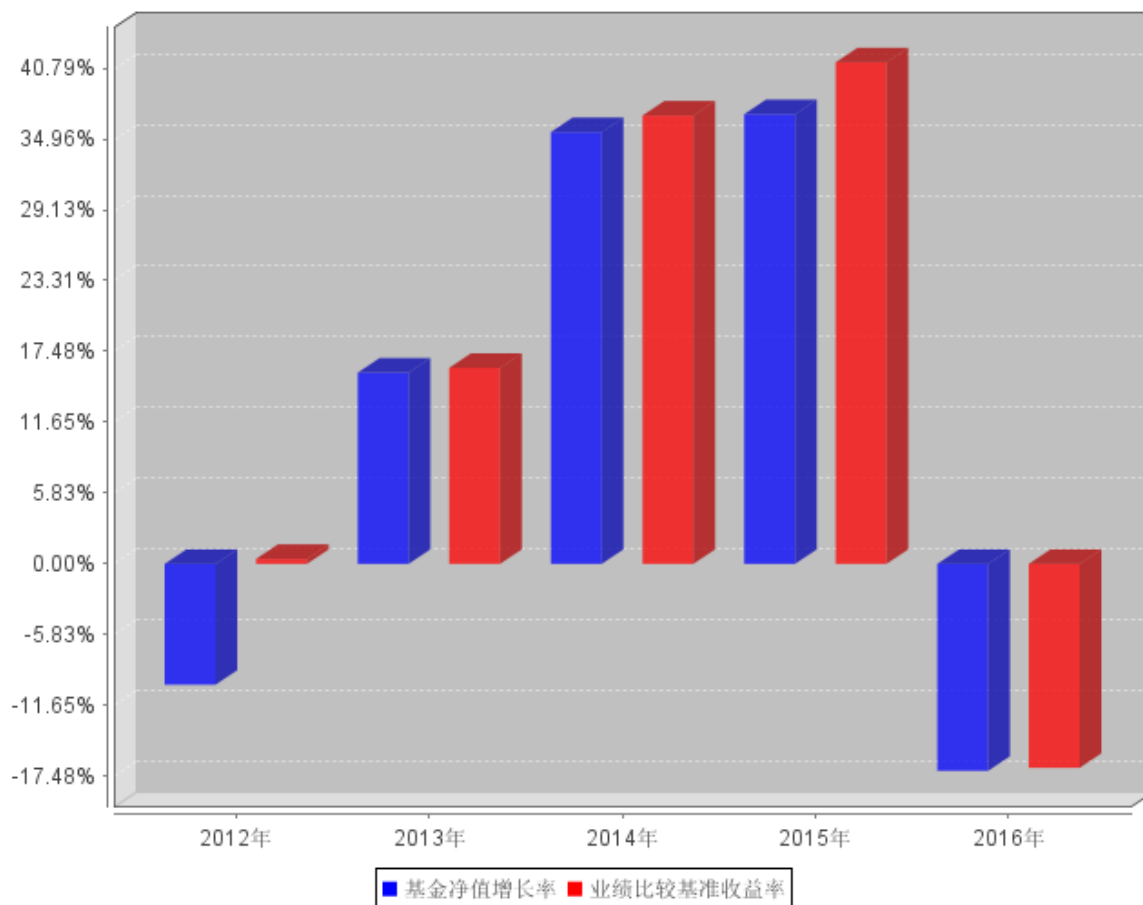
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 37 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理纯债一年定期开放债券型证券投资基金、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、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金及农银汇理日日鑫交易型货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金基金经理	2014 年 2 月 10 日	-	9	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

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

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金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，进行了基金建仓和日常运行操作。报告期内基金日跟踪误差为 0.0342%，日均偏离度为 0.0204%。报告期内基金跟踪误差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

报告期内本基金净值增长率为-17.01%，业绩比较基准收益率为-16.77%。

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）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关

于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件, 本公司制订了证券投资基金估值政策和程序, 并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责: 公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释, 并定期对估值政策和程序进行评价, 在发生影响估值政策和程序的有效性、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, 基金收益每年最多分配 6 次, 每次收益分配最低比例为收益分配基准日可供分配利润的 20%。收益分配基准日可供分配利润指当日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数; 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值; 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配”即本基金报告期无应分配利润金额。

2. 本基金报告期内没有实施利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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

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

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

2016 年度, 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

2016 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(2017)第 20956 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
引言段	我们审计了后附的农银汇理中证 500 指数证券投资基金(以下简称“农银汇理中证 500 指数基金”)的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是农银汇理中证 500 指数基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司管理层的责任。这种责任

	包括： (1) 按照企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为，上述农银汇理中证 500 指数基金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，公允反映了农银汇理中证 500 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈玲 都晓燕
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)
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	2017 年 3 月 28 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,738,147.02	319,380.59
结算备付金		3,723,078.91	1,488,296.43
存出保证金		8,773.77	54,306.90
交易性金融资产	7.4.7.2	77,992,296.27	92,422,100.94
其中: 股票投资		77,992,296.27	88,421,700.94
基金投资		-	-
债券投资		-	4,000,400.00
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		-	241,084.58
应收利息	7.4.7.5	2,600.05	231,661.21
应收股利		-	-
应收申购款		6,478.95	4,392.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		86,471,374.97	94,761,223.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		157,079.13	241,766.44
应付管理人报酬		55,180.52	61,857.07
应付托管费		11,036.09	12,371.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	24,159.73	66,787.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	350,261.21	360,859.13
负债合计		597,716.68	743,641.59
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	53,836,226.85	48,913,300.02
未分配利润	7.4.7.10	32,037,431.44	45,104,281.40
所有者权益合计		85,873,658.29	94,017,581.42

负债和所有者权益总计		86,471,374.97	94,761,223.01
------------	--	---------------	---------------

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5951 元，基金份额总额 53,836,226.85 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-13,745,286.14	28,889,729.06
1.利息收入		93,464.05	263,727.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	48,509.90	56,675.20
债券利息收入		44,954.15	207,052.07
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）		-731,551.76	37,656,521.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,224,778.81	37,150,100.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-103,343.56	-6,642.44
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	596,570.61	513,062.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-13,161,146.20	-9,341,769.15
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	53,947.77	311,249.91
减：二、费用		1,436,546.31	1,952,157.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	657,944.52	785,304.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	131,588.82	157,060.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	137,515.05	478,088.24
5. 利息支出		1,302.92	13,484.54
其中：卖出回购金融资产支出		1,302.92	13,484.54
6. 其他费用	7.4.7.20	508,195.00	518,220.00
三、利润总额（亏损总额以“-”		-15,181,832.45	26,937,571.40

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,181,832.45	26,937,571.40

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	48,913,300.02	45,104,281.40	94,017,581.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,181,832.45	-15,181,832.45
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）	4,922,926.83	2,114,982.49	7,037,909.32
其中：1. 基金申购款	35,988,210.46	20,221,533.04	56,209,743.50
2. 基金赎回款	-31,065,283.63	-18,106,550.55	-49,171,834.18
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）	53,836,226.85	32,037,431.44	85,873,658.29
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	68,820,784.79	27,735,601.22	96,556,386.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,937,571.40	26,937,571.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-19,907,484.77	-9,568,891.22	-29,476,375.99

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	136,049,465.85	137,352,811.19	273,402,277.04
2. 基金赎回款	-155,956,950.62	-146,921,702.41	-302,878,653.03
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)	48,913,300.02	45,104,281.40	94,017,581.42

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	_____ 高利民
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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[2011]第 1207 号《关于核准农银汇理中证 500 指数证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 711,073,400.42 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 453 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,243.88 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。其中:中证 500 指数成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%,其中现金或到期日在一年以内的政府

债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95% 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金 投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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公允价值变动计入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、买入返售金融资产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，但

最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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。当本基金依法 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，其公允价值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) 于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

本基金在本报告期间及上年度可比期间无须说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间及上年度可比期间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及上年度可比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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

差价收入不予征收营业税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,738,147.02	319,380.59
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,738,147.02	319,380.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,389,112.00	77,992,296.27	-2,396,815.73
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	80,389,112.00	77,992,296.27	-2,396,815.73
	项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
	股票	77,557,414.91	88,421,700.94	10,864,286.03
	贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,100,355.56	4,000,400.00	-99,955.56
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,100,355.56	4,000,400.00	-99,955.56
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	81,657,770.47	92,422,100.94	10,764,330.47

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因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	943.54	83.75
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	1,652.56	824.20
应收债券利息	-	230,728.77
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.05	0.09
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	3.90	24.40
合计	2,600.05	231,661.21

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	24,159.73	66,787.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	24,159.73	66,787.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	261.21	859.13
预提费用	100,000.00	110,000.00
合计	350,261.21	360,859.13

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,913,300.02	48,913,300.02
本期申购	35,988,210.46	35,988,210.46
本期赎回(以“-”号填列)	-31,065,283.63	-31,065,283.63
- 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	53,836,226.85	53,836,226.85

注：申购含红利再投、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	45,357,114.09	-252,832.69	45,104,281.40
本期利润	-2,020,686.25	-13,161,146.20	-15,181,832.45
本期基金份额交易产生的变动数	4,603,778.87	-2,488,796.38	2,114,982.49
其中：基金申购款	32,736,941.78	-12,515,408.74	20,221,533.04
基金赎回款	-28,133,162.91	10,026,612.36	-18,106,550.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,940,206.71	-15,902,775.27	32,037,431.44

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	16,074.99	19,114.53
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	32,161.56	36,867.25
其他	273.35	693.42
合计	48,509.90	56,675.20

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	43,887,627.39	167,514,685.38
减：卖出股票成本总额	45,112,406.20	130,364,584.76
买卖股票差价收入	-1,224,778.81	37,150,100.62

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015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	-103,343.56	-6,642.44
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	-103,343.56	-6,642.44

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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,289,022.80	2,080,438.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,091,343.56	2,054,744.44
减：应收利息总额	301,022.80	32,336.99
买卖债券差价收入	-103,343.56	-6,642.44

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衍生工具收益。

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衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	596,570.61	513,062.85
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	596,570.61	513,062.85

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-13,161,146.20	-9,341,769.15
——股票投资	-13,261,101.76	-9,241,813.59
——债券投资	99,955.56	-99,955.56
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-13,161,146.20	-9,341,769.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	39,585.50	173,202.76
转换费	14,362.27	138,047.15
合计	53,947.77	311,249.91

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

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	137,515.05	478,088.24
银行间市场交易费用	-	-
合计	137,515.05	478,088.24

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
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	195.00	220.00
合计	508,195.00	518,220.00

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 0.03% 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

本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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	本基金的管理人
交通银行股份有限公司	本基金的托管人
中国农业银行股份有限公司	本基金管理人的股东
东方汇理资产管理公司	本基金管理人的股东
中铝资本控股有限公司	本基金管理人的股东

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	657,944.52	785,304.08
其中:支付销售机构的客户维护费	291,129.00	346,301.83

注:支付基金管理人 农银汇理基金管理有限公司 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 X 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,588.82	157,060.80

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 X 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应支付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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	4,738,147.02	16,074.99	319,380.59	19,114.53

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

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

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 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

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
000887	中鼎股份	2016 年 11 月 18 日	公告重大事项	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	12,660	227,294.77	328,400.40	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	公告重大事项	7.83	-	-	38,500	275,915.10	301,455.00	-
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	15.80	-	-	18,500	214,527.62	292,300.00	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	公告重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	6,200	173,226.95	290,718.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	公告重大事项	20.31	-	-	13,600	296,159.30	276,216.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	公告重大事项	13.79	-	-	19,580	382,840.90	270,008.20	-

600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	公告重大事项	7.29	-	-	36,018	272,896.32	262,571.22	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	公告重大事项	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	16,900	422,813.10	259,584.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	12,800	257,015.37	240,896.00	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	公告重大事项	11.42	-	-	20,300	338,607.57	231,826.00	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	公告重大事项	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	13,700	224,576.70	224,954.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	公告重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	14,400	228,960.00	223,776.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	公告重大事项	23.51	-	-	9,290	190,206.79	218,407.90	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	公告重大事项	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	5,400	158,304.55	212,760.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	公告重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	26,380	143,068.28	197,322.40	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	公告重大事项	10.97	-	-	17,900	199,022.60	196,363.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	公告重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	56,600	189,555.23	190,742.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	公告重大事项	26.80	-	-	6,385	221,309.99	171,118.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 24 日	公告重大事项	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	9,802	179,259.60	160,164.68	-

600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	公告重大事项	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	11,200	171,214.01	157,360.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	25.20	-	-	5,900	126,105.17	148,680.00	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	7,375	146,295.60	145,287.50	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	公告重大事项	11.28	-	-	12,300	137,535.76	138,744.00	-
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	公告重大事项	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	16,140	114,928.74	119,920.20	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	公告重大事项	2.52	-	-	47,400	203,118.71	119,448.00	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	公告重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	3,256	77,134.83	118,518.40	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	公告重大事项	16.28	-	-	6,740	120,501.64	109,727.20	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	公告重大事项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	5,100	122,967.19	108,120.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	公告重大事项	12.93	-	-	7,700	135,604.97	99,561.00	-
603169	兰石重装	2016 年 11 月 24 日	公告重大事项	13.36	2017 年 3 月 21 日	14.32	6,400	112,600.96	85,504.00	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	公告重大事项	20.32	-	-	4,200	77,808.50	85,344.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	公告重大事项	12.50	-	-	6,400	147,996.60	80,000.00	-

603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	公告重 大事项	30.76	-	-	2,600	75,366.60	79,976.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	公告重 大事项	36.49	-	-	1,800	60,514.92	65,682.00	-

注：本基金截至 2016 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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股和新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险，并通过设定相应的风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统，有效的控制和跟踪上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	77,992,296.27	90.82	88,421,700.94	94.05
其他	-	-	-	-
合计	77,992,296.27	90.82	88,421,700.94	94.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5 %	4,301,501.46	4,742,534.24
业绩比较基准下降 5 %	-4,301,501.46	-4,742,534.24	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

7.4.14 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 2016 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 71,780,841.17 元，属于第二层次的余额为 6,211,455.10 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 79,035,583.64 元，第二层次 13,386,517.30 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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)、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 2016 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(2015 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	77,992,296.27	90.19
	其中：股票	77,992,296.27	90.19
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,461,225.93	9.79
7	其他各项资产	17,852.77	0.02
8	合计	86,471,374.97	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	988,553.20	1.15
B	采矿业	2,982,913.52	3.47
C	制造业	47,950,294.98	55.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,390,568.88	2.78
E	建筑业	2,196,014.71	2.56

F	批发和零售业	4,651,061.27	5.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,206,289.53	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,647,732.12	5.41
J	金融业	668,423.10	0.78
K	房地产业	4,940,061.77	5.75
L	租赁和商务服务业	1,163,940.65	1.36
M	科学研究和技术服务业	237,334.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	375,560.46	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	40,370.00	0.05
Q	卫生和社会工作	208,640.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	1,127,263.00	1.31
S	综合	689,426.68	0.80
	合计	77,464,447.87	90.21

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	80,000.00	0.09
C	制造业	447,848.40	0.52
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	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	527,848.40	0.61

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	000656	金科股份	73,500	385,140.00	0.45
2	600201	生物股份	12,000	379,080.00	0.44
3	600522	中天科技	35,905	378,079.65	0.44
4	300136	信维通信	13,200	376,200.00	0.44
5	600682	南京新百	9,800	365,246.00	0.43
6	600525	长园集团	25,860	360,747.00	0.42
7	600584	长电科技	20,300	358,295.00	0.42
8	600079	人福医药	17,700	353,115.00	0.41
9	600643	爱建集团	28,070	348,348.70	0.41
10	600219	南山铝业	109,000	336,810.00	0.39
11	002405	四维图新	16,731	323,744.85	0.38
12	600487	亨通光电	17,050	318,153.00	0.37
13	600158	中体产业	13,300	313,481.00	0.37
14	601012	隆基股份	23,300	311,987.00	0.36
15	002092	中泰化学	25,200	304,920.00	0.36
16	601168	西部矿业	38,500	301,455.00	0.35
17	300156	神雾环保	11,900	297,619.00	0.35
18	000661	长春高新	2,650	296,402.50	0.35

19	002572	索菲亚	5,400	292,464.00	0.34
20	300088	长信科技	18,500	292,300.00	0.34
21	002602	世纪华通	6,200	290,718.00	0.34
22	600315	上海家化	10,600	287,366.00	0.33
23	600166	福田汽车	91,300	282,117.00	0.33
24	000748	长城信息	13,600	276,216.00	0.32
25	300266	兴源环境	5,000	274,400.00	0.32
26	300115	长盈精密	10,520	274,151.20	0.32
27	002422	科伦药业	17,000	274,040.00	0.32
28	002366	台海核电	5,100	273,462.00	0.32
29	002460	赣锋锂业	10,300	273,053.00	0.32
30	600436	片仔癀	5,950	272,450.50	0.32
31	600521	华海药业	12,310	271,189.30	0.32
32	002407	多氟多	9,900	270,171.00	0.31
33	002400	省广股份	19,580	270,008.20	0.31
34	300296	利亚德	8,000	269,760.00	0.31
35	600699	均胜电子	8,100	268,029.00	0.31
36	000998	隆平高科	12,300	263,589.00	0.31
37	002508	老板电器	7,162	263,561.60	0.31
38	600673	东阳光科	36,018	262,571.22	0.31
39	600503	华丽家族	31,500	261,135.00	0.30
40	002340	格林美	39,848	261,004.40	0.30
41	000547	航天发展	16,900	259,584.00	0.30
42	000581	威孚高科	11,500	258,060.00	0.30
43	300026	红日药业	47,100	255,753.00	0.30
44	002168	深圳惠程	16,120	255,663.20	0.30
45	600664	哈药股份	29,790	255,598.20	0.30
46	600879	航天电子	16,730	254,965.20	0.30
47	002004	华邦健康	27,865	252,735.55	0.29
48	000930	中粮生化	18,800	252,672.00	0.29
49	000997	新大陆	12,900	250,647.00	0.29
50	600143	金发科技	32,000	248,960.00	0.29
51	002439	启明星辰	11,900	247,401.00	0.29
52	600978	宜华生活	23,180	246,867.00	0.29
53	600266	北京城建	18,400	245,272.00	0.29
54	600614	鼎立股份	20,724	242,470.80	0.28
55	000050	深天马 A	12,800	240,896.00	0.28
56	002176	江特电机	20,100	239,793.00	0.28
57	002701	奥瑞金	27,632	238,740.48	0.28

58	600500	中化国际	20,400	237,864.00	0.28
59	600138	中青旅	11,325	237,485.25	0.28
60	600497	驰宏锌锗	33,700	236,911.00	0.28
61	000690	宝新能源	25,500	236,385.00	0.28
62	600655	豫园商城	20,300	231,826.00	0.27
63	002013	中航机电	12,635	231,094.15	0.27
64	002030	达安基因	9,960	231,072.00	0.27
65	600635	大众公用	37,900	227,779.00	0.27
66	002311	海大集团	15,100	227,255.00	0.26
67	000961	中南建设	21,750	226,200.00	0.26
68	600426	华鲁恒升	17,050	225,912.50	0.26
69	002271	东方雨虹	10,402	225,619.38	0.26
70	600687	刚泰控股	13,700	224,954.00	0.26
71	002491	通鼎互联	14,400	223,776.00	0.26
72	000970	中科三环	16,700	222,945.00	0.26
73	600122	宏图高科	18,000	219,960.00	0.26
74	002573	清新环境	12,508	218,514.76	0.25
75	300324	旋极信息	11,300	218,429.00	0.25
76	000697	炼石有色	9,290	218,407.90	0.25
77	300253	卫宁健康	11,120	217,840.80	0.25
78	600759	洲际油气	22,093	216,953.26	0.25
79	002038	双鹭药业	8,100	216,351.00	0.25
80	000400	许继电气	11,900	215,985.00	0.25
81	300113	顺网科技	8,000	215,120.00	0.25
82	002179	中航光电	5,920	214,836.80	0.25
83	600418	江淮汽车	18,500	213,860.00	0.25
84	600161	天坛生物	5,400	212,760.00	0.25
85	600751	天海投资	25,300	211,508.00	0.25
86	600565	迪马股份	28,400	210,728.00	0.25
87	002001	新和成	10,700	209,720.00	0.24
88	600240	华业资本	19,460	209,000.40	0.24
89	300244	迪安诊断	6,520	208,640.00	0.24
90	600312	平高电气	13,300	207,746.00	0.24
91	002273	水晶光电	10,400	206,960.00	0.24
92	600388	龙净环保	16,700	206,579.00	0.24
93	600594	益佰制药	12,400	206,460.00	0.24
94	000806	银河生物	13,000	205,920.00	0.24
95	000959	首钢股份	31,000	205,220.00	0.24
96	002223	鱼跃医疗	6,593	204,514.86	0.24

97	000012	南玻 A	18,000	204,120.00	0.24
98	002665	首航节能	23,160	202,881.60	0.24
99	000598	兴蓉环境	35,000	201,600.00	0.23
100	002217	合力泰	11,200	200,480.00	0.23
101	600056	中国医药	10,500	199,815.00	0.23
102	000566	海南海药	15,700	199,547.00	0.23
103	600811	东方集团	27,900	199,485.00	0.23
104	600094	大名城	22,400	199,360.00	0.23
105	000975	银泰资源	12,723	198,987.72	0.23
106	300159	新研股份	14,600	198,268.00	0.23
107	000939	凯迪生态	15,400	198,198.00	0.23
108	600601	方正科技	42,900	197,340.00	0.23
109	000563	陕国投 A	26,380	197,322.40	0.23
110	600528	中铁二局	14,300	196,768.00	0.23
111	600151	航天机电	17,900	196,363.00	0.23
112	000878	云南铜业	16,600	196,046.00	0.23
113	000078	海王生物	31,100	195,930.00	0.23
114	002221	东华能源	15,806	195,836.34	0.23
115	600787	中储股份	21,500	195,005.00	0.23
116	300055	万邦达	11,900	194,922.00	0.23
117	600881	亚泰集团	35,600	194,732.00	0.23
118	600198	大唐电信	12,140	192,661.80	0.22
119	002410	广联达	13,100	191,260.00	0.22
120	002408	齐翔腾达	17,380	191,180.00	0.22
121	600200	江苏吴中	9,900	191,169.00	0.22
122	000988	华工科技	12,200	190,930.00	0.22
123	002353	杰瑞股份	9,400	190,820.00	0.22
124	000727	华东科技	56,600	190,742.00	0.22
125	300134	大富科技	7,510	190,453.60	0.22
126	000999	华润三九	7,700	190,421.00	0.22
127	600435	北方导航	14,600	190,384.00	0.22
128	600478	科力远	19,025	190,250.00	0.22
129	000031	中粮地产	21,300	189,996.00	0.22
130	603589	口子窖	5,900	189,567.00	0.22
131	000960	锡业股份	14,400	188,928.00	0.22
132	601699	潞安环能	23,400	188,370.00	0.22
133	000612	焦作万方	16,300	188,265.00	0.22
134	002191	劲嘉股份	18,000	187,380.00	0.22
135	600176	中国巨石	19,042	187,373.28	0.22

136	600410	华胜天成	17,229	187,279.23	0.22
137	600549	厦门钨业	8,500	187,170.00	0.22
138	600516	方大炭素	20,200	187,052.00	0.22
139	600755	厦门国贸	22,768	186,697.60	0.22
140	600851	海欣股份	14,400	186,192.00	0.22
141	000979	中弘股份	70,268	185,507.52	0.22
142	002250	联化科技	11,444	185,163.92	0.22
143	000758	中色股份	23,100	184,569.00	0.21
144	000667	美好置业	50,000	184,500.00	0.21
145	300273	和佳股份	10,780	183,906.80	0.21
146	002048	宁波华翔	8,300	183,762.00	0.21
147	000786	北新建材	17,700	182,133.00	0.21
148	600026	中远海能	26,700	181,827.00	0.21
149	002018	华信国际	17,800	181,026.00	0.21
150	000488	晨鸣纸业	17,400	180,264.00	0.21
151	600633	浙报传媒	10,200	180,132.00	0.21
152	600572	康恩贝	24,565	179,570.15	0.21
153	600098	广州发展	16,000	179,520.00	0.21
154	601000	唐山港	44,551	178,649.51	0.21
155	601929	吉视传媒	42,600	178,494.00	0.21
156	600064	南京高科	10,650	178,387.50	0.21
157	600120	浙江东方	6,100	176,412.00	0.21
158	600575	皖江物流	30,600	175,950.00	0.20
159	600325	华发股份	13,699	175,347.20	0.20
160	000825	太钢不锈	44,500	175,330.00	0.20
161	603019	中科曙光	6,300	175,266.00	0.20
162	600967	北方创业	12,900	175,053.00	0.20
163	600863	内蒙华电	56,800	174,944.00	0.20
164	600160	巨化股份	16,500	174,570.00	0.20
165	000006	深振业 A	18,472	174,560.40	0.20
166	600108	亚盛集团	30,400	173,888.00	0.20
167	002657	中科金财	4,000	172,640.00	0.20
168	603766	隆鑫通用	8,300	172,474.00	0.20
169	002544	杰赛科技	6,100	171,654.00	0.20
170	000860	顺鑫农业	7,800	171,600.00	0.20
171	600645	中源协和	6,385	171,118.00	0.20
172	600409	三友化工	18,100	169,959.00	0.20
173	601880	大连港	60,490	169,372.00	0.20
174	600511	国药股份	5,600	168,560.00	0.20

175	600039	四川路桥	35,400	167,796.00	0.20
176	600499	科达洁能	22,100	167,076.00	0.19
177	600307	酒钢宏兴	61,200	167,076.00	0.19
178	002051	中工国际	7,280	166,857.60	0.19
179	300287	飞利信	14,000	166,600.00	0.19
180	002595	豪迈科技	7,900	166,295.00	0.19
181	002375	亚厦股份	15,700	166,106.00	0.19
182	002672	东江环保	9,425	165,880.00	0.19
183	002078	太阳纸业	24,800	165,664.00	0.19
184	002444	巨星科技	10,600	165,360.00	0.19
185	600717	天津港	16,400	165,312.00	0.19
186	600316	洪都航空	8,400	165,144.00	0.19
187	002019	亿帆医药	10,800	165,132.00	0.19
188	002276	万马股份	10,980	165,029.40	0.19
189	600808	马钢股份	58,300	164,989.00	0.19
190	002390	信邦制药	16,650	164,668.50	0.19
191	600022	山东钢铁	65,800	164,500.00	0.19
192	000513	丽珠集团	2,761	164,279.50	0.19
193	002281	光迅科技	2,083	163,515.50	0.19
194	600416	湘电股份	11,100	163,281.00	0.19
195	002384	东山精密	8,300	162,763.00	0.19
196	000028	国药一致	2,432	162,700.80	0.19
197	002022	科华生物	8,100	162,000.00	0.19
198	600600	青岛啤酒	5,500	161,920.00	0.19
199	300199	翰宇药业	9,000	161,820.00	0.19
200	600466	蓝光发展	16,700	161,489.00	0.19
201	002155	湖南黄金	14,100	161,445.00	0.19
202	002489	浙江永强	21,292	161,180.44	0.19
203	600587	新华医疗	6,412	161,005.32	0.19
204	600611	大众交通	24,450	160,636.50	0.19
205	000066	长城电脑	12,900	160,476.00	0.19
206	002268	卫士通	5,100	160,242.00	0.19
207	002440	闰土股份	9,802	160,164.68	0.19
208	000543	皖能电力	21,030	160,038.30	0.19
209	000685	中山公用	14,376	160,004.88	0.19
210	000089	深圳机场	20,000	160,000.00	0.19
211	600348	阳泉煤业	23,500	158,155.00	0.18
212	600062	华润双鹤	7,100	157,833.00	0.18
213	600171	上海贝岭	11,200	157,360.00	0.18

214	600770	综艺股份	15,200	157,320.00	0.18
215	000401	冀东水泥	13,200	157,080.00	0.18
216	600597	光明乳业	12,000	156,720.00	0.18
217	002266	浙富控股	27,030	155,692.80	0.18
218	002050	三花智控	14,100	155,664.00	0.18
219	002261	拓维信息	13,000	154,960.00	0.18
220	600884	杉杉股份	11,000	154,880.00	0.18
221	300122	智飞生物	9,400	154,818.00	0.18
222	600183	生益科技	14,000	154,000.00	0.18
223	600380	健康元	15,500	153,915.00	0.18
224	002640	跨境通	8,400	153,720.00	0.18
225	002477	雏鹰农牧	30,600	153,612.00	0.18
226	600872	中炬高新	10,900	153,472.00	0.18
227	000592	平潭发展	22,700	153,452.00	0.18
228	002603	以岭药业	8,900	153,436.00	0.18
229	600187	国中水务	28,400	153,076.00	0.18
230	600300	维维股份	22,900	152,972.00	0.18
231	600366	宁波韵升	7,700	151,613.00	0.18
232	000519	江南红箭	10,129	150,922.10	0.18
233	002373	千方科技	10,800	149,040.00	0.17
234	002025	航天电器	5,900	148,680.00	0.17
235	600267	海正药业	11,300	148,595.00	0.17
236	002431	棕榈股份	16,150	147,934.00	0.17
237	002122	天马股份	11,600	147,204.00	0.17
238	002308	威创股份	9,956	146,751.44	0.17
239	600392	盛和资源	11,000	146,630.00	0.17
240	600073	上海梅林	12,800	146,560.00	0.17
241	600017	日照港	36,100	146,205.00	0.17
242	600067	冠城大通	20,380	145,920.80	0.17
243	600422	昆药集团	10,800	145,908.00	0.17
244	600970	中材国际	20,550	145,699.50	0.17
245	002396	星网锐捷	7,375	145,287.50	0.17
246	002073	软控股份	12,800	145,280.00	0.17
247	600298	安琪酵母	8,118	144,662.76	0.17
248	300274	阳光电源	13,720	144,608.80	0.17
249	600125	铁龙物流	17,869	144,381.52	0.17
250	600086	东方金钰	13,200	143,616.00	0.17
251	600216	浙江医药	11,300	143,284.00	0.17
252	600557	康缘药业	8,452	143,092.36	0.17

253	000703	恒逸石化	9,500	142,785.00	0.17
254	300291	华录百纳	6,400	142,592.00	0.17
255	600651	飞乐音响	13,540	142,576.20	0.17
256	600284	浦东建设	10,800	142,452.00	0.17
257	600260	凯乐科技	9,200	142,416.00	0.17
258	000810	创维数字	10,100	142,107.00	0.17
259	600169	太原重工	35,200	141,856.00	0.17
260	002437	誉衡药业	17,150	141,830.50	0.17
261	000926	福星股份	11,100	141,414.00	0.16
262	300010	立思辰	8,500	141,270.00	0.16
263	000816	智慧农业	22,200	141,192.00	0.16
264	002512	达华智能	8,600	140,438.00	0.16
265	002358	森源电气	7,300	140,014.00	0.16
266	600694	大商股份	3,500	139,755.00	0.16
267	000762	西藏矿业	8,200	139,646.00	0.16
268	600536	中国软件	5,800	139,548.00	0.16
269	000937	冀中能源	20,700	139,518.00	0.16
270	000418	小天鹅 A	4,300	138,976.00	0.16
271	002002	鸿达兴业	18,929	138,938.86	0.16
272	000829	天音控股	12,300	138,744.00	0.16
273	600175	美都能源	27,915	138,179.25	0.16
274	002479	富春环保	9,320	138,122.40	0.16
275	601231	环旭电子	12,800	137,088.00	0.16
276	601801	皖新传媒	7,800	137,046.00	0.16
277	000021	深科技	14,409	135,876.87	0.16
278	002028	思源电气	10,308	135,859.44	0.16
279	601311	骆驼股份	8,300	135,539.00	0.16
280	300001	特锐德	7,800	135,252.00	0.16
281	000777	中核科技	6,020	134,727.60	0.16
282	300166	东方国信	6,400	133,056.00	0.15
283	002399	海普瑞	7,300	133,006.00	0.15
284	601010	文峰股份	25,275	132,946.50	0.15
285	601717	郑煤机	18,900	132,867.00	0.15
286	300202	聚龙股份	5,400	132,840.00	0.15
287	002325	洪涛股份	16,414	131,476.14	0.15
288	600880	博瑞传播	15,000	131,400.00	0.15
289	600765	中航重机	9,100	130,403.00	0.15
290	002041	登海种业	6,900	130,272.00	0.15
291	002503	搜于特	9,020	129,797.80	0.15

292	600517	置信电气	13,300	129,409.00	0.15
293	002707	众信旅游	8,300	129,065.00	0.15
294	600545	新疆城建	10,600	128,896.00	0.15
295	000848	承德露露	11,516	128,864.04	0.15
296	600058	五矿发展	8,400	127,932.00	0.15
297	600809	山西汾酒	5,100	127,602.00	0.15
298	600259	广晟有色	3,000	127,470.00	0.15
299	002244	滨江集团	18,200	127,036.00	0.15
300	002589	瑞康医药	3,900	126,555.00	0.15
301	600736	苏州高新	14,000	126,420.00	0.15
302	002581	未名医药	5,200	126,204.00	0.15
303	002123	梦网荣信	8,400	126,000.00	0.15
304	001696	宗申动力	13,400	125,960.00	0.15
305	000620	新华联	14,800	125,504.00	0.15
306	600639	浦东金桥	6,700	124,352.00	0.14
307	000600	建投能源	14,000	124,320.00	0.14
308	002063	远光软件	9,451	124,186.14	0.14
309	000158	常山股份	9,934	124,175.00	0.14
310	002368	太极股份	4,050	123,970.50	0.14
311	002106	莱宝高科	11,000	123,640.00	0.14
312	000587	金洲慈航	8,300	123,504.00	0.14
313	002269	美邦服饰	24,650	123,496.50	0.14
314	600835	上海机电	6,300	122,976.00	0.14
315	600291	西水股份	6,400	122,752.00	0.14
316	603188	亚邦股份	6,800	121,448.00	0.14
317	002285	世联行	15,963	121,318.80	0.14
318	600220	江苏阳光	27,900	121,086.00	0.14
319	000572	海马汽车	22,500	120,600.00	0.14
320	603077	和邦生物	23,500	120,320.00	0.14
321	600282	南钢股份	38,700	119,970.00	0.14
322	600537	亿晶光电	16,140	119,920.20	0.14
323	600053	九鼎投资	2,600	119,756.00	0.14
324	600433	冠豪高新	14,900	119,498.00	0.14
325	002277	友阿股份	8,320	119,475.20	0.14
326	000062	深圳华强	4,200	119,322.00	0.14
327	600993	马应龙	5,970	119,220.90	0.14
328	000636	风华高科	12,200	119,072.00	0.14
329	601678	滨化股份	16,300	118,827.00	0.14
330	600481	双良节能	15,800	118,816.00	0.14

331	002317	众生药业	9,600	118,560.00	0.14
332	002635	安洁科技	3,256	118,518.40	0.14
333	601777	力帆股份	12,300	117,588.00	0.14
334	002354	天神娱乐	1,700	117,572.00	0.14
335	600270	外运发展	7,100	117,434.00	0.14
336	300147	香雪制药	9,050	116,745.00	0.14
337	000616	海航投资	22,320	116,510.40	0.14
338	002161	远望谷	10,100	116,453.00	0.14
339	600277	亿利洁能	16,300	115,893.00	0.13
340	300257	开山股份	6,700	114,972.00	0.13
341	600894	广日股份	8,400	114,828.00	0.13
342	600580	卧龙电气	12,600	114,660.00	0.13
343	300297	蓝盾股份	9,200	114,448.00	0.13
344	002344	海宁皮城	10,100	114,332.00	0.13
345	000669	金鸿能源	6,650	114,047.50	0.13
346	002505	大康农业	32,130	113,740.20	0.13
347	000973	佛塑科技	15,150	113,625.00	0.13
348	000501	鄂武商 A	5,819	113,586.88	0.13
349	600805	悦达投资	13,307	112,976.43	0.13
350	000541	佛山照明	11,480	112,963.20	0.13
351	002428	云南锗业	8,900	112,763.00	0.13
352	000726	鲁泰 A	8,800	112,728.00	0.13
353	000090	天健集团	11,669	112,722.54	0.13
354	000528	柳工	15,400	112,574.00	0.13
355	600729	重庆百货	4,797	112,393.71	0.13
356	002690	美亚光电	5,300	112,148.00	0.13
357	600826	兰生股份	4,100	112,012.00	0.13
358	002482	广田集团	12,100	111,925.00	0.13
359	002498	汉缆股份	26,000	111,800.00	0.13
360	000830	鲁西化工	20,000	111,800.00	0.13
361	601689	拓普集团	3,800	111,796.00	0.13
362	000652	泰达股份	20,200	111,504.00	0.13
363	600289	亿阳信通	8,600	111,370.00	0.13
364	002056	横店东磁	8,000	111,280.00	0.13
365	600823	世茂股份	15,750	110,565.00	0.13
366	600458	时代新材	7,800	110,370.00	0.13
367	002128	露天煤业	12,800	110,080.00	0.13
368	600750	江中药业	3,566	109,904.12	0.13
369	002005	德豪润达	19,100	109,825.00	0.13

370	600859	王府井	6,740	109,727.20	0.13
371	600112	天成控股	9,980	109,580.40	0.13
372	002463	沪电股份	22,908	109,500.24	0.13
373	002190	成飞集成	3,400	108,732.00	0.13
374	600596	新安股份	10,600	108,544.00	0.13
375	000897	津滨发展	25,300	108,284.00	0.13
376	002242	九阳股份	6,000	108,180.00	0.13
377	002064	华峰氨纶	19,700	108,153.00	0.13
378	002727	一心堂	5,100	108,120.00	0.13
379	600628	新世界	7,600	107,388.00	0.13
380	600006	东风汽车	15,600	107,328.00	0.12
381	000680	山推股份	19,400	107,282.00	0.12
382	600141	兴发集团	7,040	107,078.40	0.12
383	000861	海印股份	21,972	106,564.20	0.12
384	600351	亚宝药业	10,745	106,160.60	0.12
385	000969	安泰科技	10,000	105,400.00	0.12
386	002663	普邦股份	17,329	105,187.03	0.12
387	000681	视觉中国	5,500	104,830.00	0.12
388	000596	古井贡酒	2,300	104,650.00	0.12
389	600395	盘江股份	12,900	104,103.00	0.12
390	002254	泰和新材	8,392	103,725.12	0.12
391	002588	史丹利	9,120	103,512.00	0.12
392	601233	桐昆股份	7,200	103,392.00	0.12
393	600790	轻纺城	14,340	103,248.00	0.12
394	300032	金龙机电	6,400	102,976.00	0.12
395	600428	中远海特	16,800	102,816.00	0.12
396	002011	盾安环境	10,800	102,816.00	0.12
397	600773	西藏城投	8,600	102,598.00	0.12
398	000552	靖远煤电	26,800	101,572.00	0.12
399	002699	美盛文化	3,000	101,400.00	0.12
400	603198	迎驾贡酒	4,700	101,285.00	0.12
401	600496	精工钢构	23,580	100,922.40	0.12
402	000049	德赛电池	2,400	100,920.00	0.12
403	600869	智慧能源	13,000	100,620.00	0.12
404	600862	中航高科	8,200	100,368.00	0.12
405	002345	潮宏基	8,304	100,312.32	0.12
406	601001	大同煤业	16,400	100,204.00	0.12
407	002681	奋达科技	7,700	99,561.00	0.12
408	002642	荣之联	4,950	99,495.00	0.12

409	600850	华东电脑	4,110	99,379.80	0.12
410	300039	上海凯宝	9,700	99,231.00	0.12
411	600563	法拉电子	2,700	99,009.00	0.12
412	600757	长江传媒	11,900	98,889.00	0.12
413	600720	祁连山	12,103	98,881.51	0.12
414	300043	星辉娱乐	9,700	98,358.00	0.11
415	603883	老百姓	2,100	97,965.00	0.11
416	000869	张裕 A	2,715	97,740.00	0.11
417	600329	中新药业	5,600	97,664.00	0.11
418	000099	中信海直	8,300	97,193.00	0.11
419	603369	今世缘	7,400	97,088.00	0.11
420	600059	古越龙山	9,450	96,768.00	0.11
421	600280	中央商场	11,200	96,432.00	0.11
422	601886	江河集团	9,000	95,850.00	0.11
423	002371	七星电子	3,600	95,760.00	0.11
424	600292	远达环保	7,610	94,135.70	0.11
425	002093	国脉科技	8,500	94,095.00	0.11
426	600831	广电网络	7,100	92,726.00	0.11
427	600586	金晶科技	20,000	92,600.00	0.11
428	000417	合肥百货	10,678	92,151.14	0.11
429	002332	仙琚制药	7,150	92,020.50	0.11
430	600460	士兰微	14,617	90,917.74	0.11
431	600657	信达地产	14,879	90,761.90	0.11
432	002342	巨力索具	13,100	90,521.00	0.11
433	002029	七匹狼	8,857	90,429.97	0.11
434	600195	中牧股份	4,240	90,100.00	0.10
435	002416	爱施德	6,100	89,853.00	0.10
436	000931	中关村	10,600	89,782.00	0.10
437	002309	中利科技	6,300	89,523.00	0.10
438	600748	上实发展	10,860	88,943.40	0.10
439	600825	新华传媒	10,200	88,638.00	0.10
440	000426	兴业矿业	10,162	88,612.64	0.10
441	601002	晋亿实业	9,300	88,536.00	0.10
442	002551	尚荣医疗	4,319	85,991.29	0.10
443	603169	兰石重装	6,400	85,504.00	0.10
444	600551	时代出版	4,200	85,344.00	0.10
445	000877	天山股份	12,040	84,882.00	0.10
446	600640	号百控股	4,200	83,916.00	0.10
447	002698	博实股份	5,360	83,455.20	0.10

448	002414	高德红外	3,663	83,443.14	0.10
449	601908	京运通	11,700	83,304.00	0.10
450	002251	步步高	5,060	83,237.00	0.10
451	600743	华远地产	18,321	81,528.45	0.09
452	600180	瑞茂通	6,000	81,240.00	0.09
453	603555	贵人鸟	2,600	79,976.00	0.09
454	000919	金陵药业	5,898	79,799.94	0.09
455	600776	东方通信	9,300	79,608.00	0.09
456	603528	多伦科技	1,200	78,420.00	0.09
457	600338	西藏珠峰	2,600	75,348.00	0.09
458	600425	青松建化	16,200	75,330.00	0.09
459	600251	冠农股份	9,200	74,612.00	0.09
460	002118	紫鑫药业	10,300	74,160.00	0.09
461	603806	福斯特	1,600	74,032.00	0.09
462	600801	华新水泥	9,540	73,935.00	0.09
463	603355	莱克电气	1,600	73,872.00	0.09
464	002327	富安娜	8,298	73,022.40	0.09
465	600335	国机汽车	6,000	72,900.00	0.08
466	002315	焦点科技	1,200	72,348.00	0.08
467	601016	节能风电	8,100	71,685.00	0.08
468	603001	奥康国际	3,100	70,990.00	0.08
469	600864	哈投股份	6,190	70,689.80	0.08
470	000631	顺发恒业	14,290	70,021.00	0.08
471	002392	北京利尔	12,100	69,696.00	0.08
472	600397	安源煤业	13,500	69,660.00	0.08
473	600874	创业环保	8,500	69,105.00	0.08
474	600483	福能股份	6,100	67,527.00	0.08
475	002646	青青稞酒	3,500	67,375.00	0.08
476	603698	航天工程	2,400	66,216.00	0.08
477	603005	晶方科技	2,200	66,088.00	0.08
478	002745	木林森	1,800	65,682.00	0.08
479	600618	氯碱化工	4,500	65,655.00	0.08
480	002233	塔牌集团	7,000	65,450.00	0.08
481	600184	光电股份	3,028	65,344.24	0.08
482	000517	荣安地产	12,400	65,224.00	0.08
483	603567	珍宝岛	3,300	65,208.00	0.08
484	603328	依顿电子	2,000	63,960.00	0.07
485	603568	伟明环保	2,700	62,910.00	0.07
486	000723	美锦能源	4,100	61,992.00	0.07

487	600971	恒源煤电	9,800	61,446.00	0.07
488	000025	特力 A	1,100	60,797.00	0.07
489	002249	大洋电机	6,900	59,547.00	0.07
490	600088	中视传媒	2,600	56,992.00	0.07
491	600468	百利电气	4,350	56,637.00	0.07
492	002194	武汉凡谷	4,400	56,584.00	0.07
493	002238	天威视讯	3,612	52,915.80	0.06
494	600917	重庆燃气	3,300	43,527.00	0.05
495	603868	飞科电器	900	42,174.00	0.05
496	600981	汇鸿集团	4,800	40,752.00	0.05
497	603377	东方时尚	1,000	40,370.00	0.05
498	603866	桃李面包	900	39,510.00	0.05
499	603025	大豪科技	1,000	39,030.00	0.05
500	000761	本钢板材	5,900	31,742.00	0.04

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	000887	中鼎股份	12,660	328,400.40	0.38
2	601005	重庆钢铁	47,400	119,448.00	0.14
3	000693	ST 华泽	6,400	80,000.00	0.09

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	300113	顺网科技	400,641.00	0.43
2	002572	索菲亚	375,001.42	0.40
3	300136	信维通信	366,313.00	0.39
4	002426	胜利精密	361,744.55	0.38
5	600682	南京新百	328,817.00	0.35
6	002131	利欧股份	327,790.00	0.35
7	600166	福田汽车	325,126.00	0.35

8	002366	台海核电	319,225.76	0.34
9	002460	赣锋锂业	315,646.00	0.34
10	002038	双鹭药业	312,939.74	0.33
11	300156	神雾环保	306,346.31	0.33
12	002310	东方园林	304,665.00	0.32
13	000983	西山煤电	293,690.00	0.31
14	002407	多氟多	291,303.00	0.31
15	600315	上海家化	290,910.00	0.31
16	600266	北京城建	289,868.00	0.31
17	300296	利亚德	287,221.72	0.31
18	002422	科伦药业	285,254.00	0.30
19	000581	威孚高科	271,680.60	0.29
20	300266	兴源环境	266,238.00	0.28

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	300072	三聚环保	721,680.08	0.77
2	002466	天齐锂业	652,570.00	0.69
3	002085	万丰奥威	488,838.00	0.52
4	002310	东方园林	438,381.60	0.47
5	600654	中安消	408,872.33	0.43
6	000983	西山煤电	381,745.00	0.41
7	600498	烽火通信	381,115.00	0.41
8	600816	安信信托	369,013.24	0.39
9	600482	中国动力	361,791.00	0.38
10	002426	胜利精密	356,080.00	0.38
11	600074	保千里	345,268.86	0.37
12	002131	利欧股份	329,336.00	0.35
13	002049	紫光国芯	311,509.00	0.33
14	600376	首开股份	304,825.00	0.32
15	000982	中银绒业	304,789.76	0.32
16	002299	圣农发展	284,283.00	0.30
17	002018	华信国际	278,750.80	0.30
18	601155	新城控股	268,808.00	0.29

19	002714	牧原股份	267,773.00	0.28
20	300182	捷成股份	265,586.90	0.28

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	47,944,103.29
卖出股票收入（成交）总额	43,887,627.39

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

2016 年 12 月 1 日，金宇生物技术股份有限公司（以下简称“生物股份”）收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016] 7 号）。

决定书指出，经现场检查发现生物股份存在以下问题：一、公司会计估计变更未披露；二、公司财务报表列报不准确；三、内幕信息知情人登记执行不到位。针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，内蒙古证监局决定对生物股份采取责令改正的行政监管措施。2016 年 12 月 21 日，生物股份发布公告表示已对上述问题进行整改，目前处于整改完毕并持续规范阶段。

其余九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

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	8,773.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,600.05
5	应收申购款	6,478.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,852.77

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	000887	中鼎股份	328,400.40	0.38	公告重大事项
2	601005	重庆钢铁	119,448.00	0.14	公告重大事项
3	000693	ST 华泽	80,000.00	0.09	公告重大事项

§ 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
7,080	7,603.99	593,104.37	1.10%	53,243,122.48	98.90%

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	0.00	0.0000%

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

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	48,913,300.02
本报告期基金总申购份额	35,988,210.46
减：本报告期基金总赎回份额	31,065,283.63
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	53,836,226.85

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无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 5 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	91,780,939.48	100.00%	85,478.99	100.00%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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	2,990,988.00	100.00%	9,300,000.00	100.00%	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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 2015 年年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于指数熔断机制实施期间旗下	上海证券报、中国证	2016 年 1 月 4 日

	部分基金调整开放时间的公告	券报、证券时报、基金管理人网站	
3	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	农银中证 500 基金—招募说明书更新—2015 年第 2 号	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 11 日
5	农银汇理基金管理有限公司关于参与深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
6	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
7	农银汇理基金管理有限公司关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 12 日
8	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2015 年年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
9	关于工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 31 日
10	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
11	农银汇理基金管理有限公司关于参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
12	农银汇理基金管理有限公司关于参加陆金所认（申）购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
13	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
15	农银汇理基金管理有限公司关于继续参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
16	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金	上海证券报、中国证券报、证券时报、基	2016 年 6 月 1 日

	销售有限公司为代销机构的公告	金管理人网站	
17	关于中国交通银行股份有限公司开展网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 29 日
18	农银汇理基金管理有限公司关于旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
19	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2016 年半年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
20	农银中证 500 指数基金-招募说明书更新-2016 年第 1 号	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 8 日
21	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 20 日
22	农银汇理基金管理有限公司关于股东变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 6 日
23	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 15 日
24	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 22 日
25	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 26 日
26	农银汇理基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
27	关于交通银行开展手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
28	农银汇理策略精选混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 10 月 25 日
29	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四家机构为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 13 日

30	关于交通银行开展网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 22 日
31	关于农业银行开展 2017 年基金交易费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 30 日
32	关于配合工商银行展开“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

经农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会（证监许可[2016]1197 号）批准，中铝资本控股有限公司受让中国铝业股份有限公司持有的本公司 15% 的股权。本次股权转让完成后，本公司注册资本及其余股东的出资比例不变，且本公司的《公司章程》已进行了相应修改。

上述股东变更及修改《公司章程》的工商变更手续于 2016 年 8 月 1 日在上海市工商行政管理局办理完毕。本公司于 2016 年 8 月 6 日在公司网站及有关媒体发布了关于上述股东变更的公告。

§ 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。

13.2 存放地点

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 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
2017 年 3 月 30 日