

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 23 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 2017 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	7
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
§4 管理人报告	10
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
§5 托管人报告	15
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
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	19
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
§8 投资组合报告	47
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64

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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	65
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§10 开放式基金份额变动	68
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
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	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 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	54,566,834.83 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	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	上海市浦东新区银城中路 188 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	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	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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	658,280.17	-2,020,686.25	36,279,340.55
本期利润	-288,254.81	-15,181,832.45	26,937,571.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0051	-0.2735	0.4861
本期加权平均净值利润率	-0.32%	-17.28%	25.59%
本期基金份额净值增长率	-1.10%	-17.01%	37.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	31,520,319.33	32,037,431.44	45,104,281.40
期末可供分配基金份额利润	0.5776	0.5951	0.9221
期末基金资产净值	86,087,154.16	85,873,658.29	94,017,581.42
期末基金份额净值	1.5776	1.5951	1.9221
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	57.76%	59.51%	92.21%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

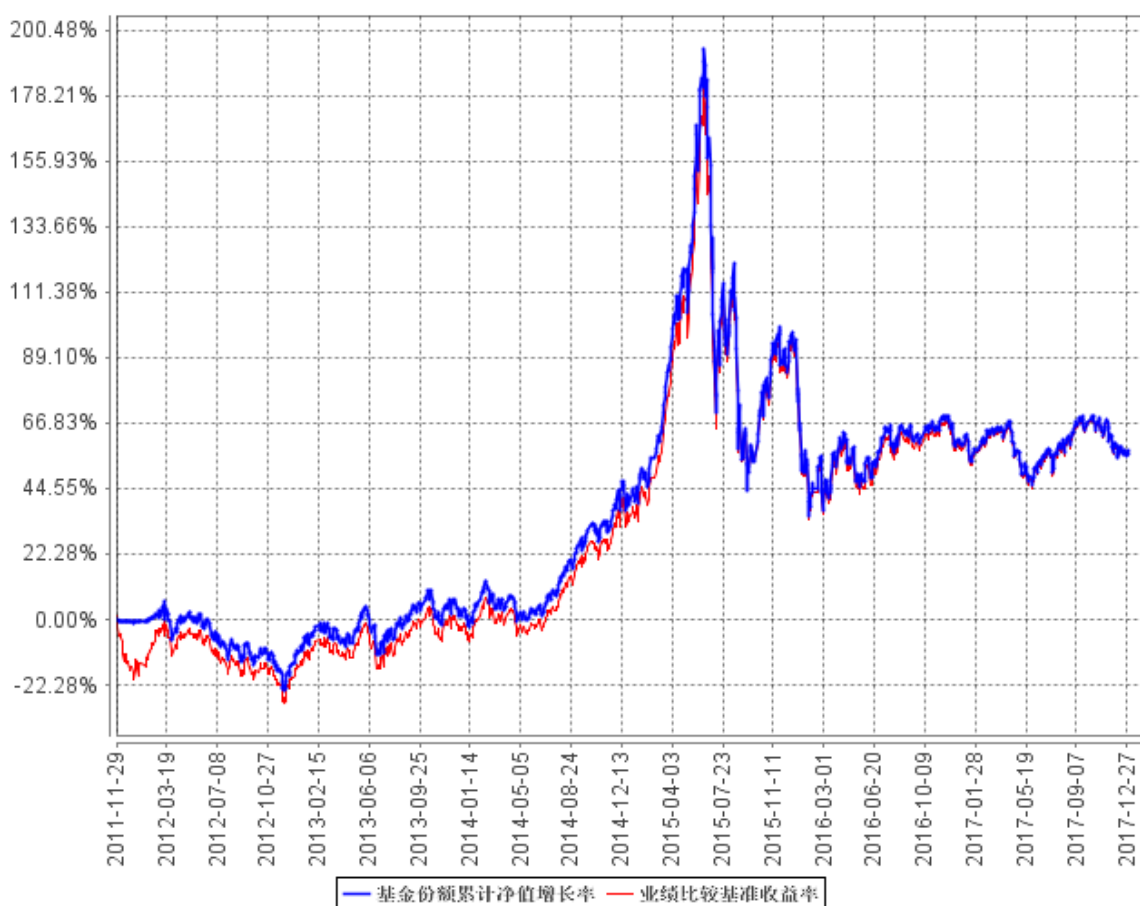
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.53%	0.92%	-5.06%	0.93%	-0.47%	-0.01%
过去六个月	1.02%	0.90%	1.78%	0.91%	-0.76%	-0.01%
过去一年	-1.10%	0.87%	-0.13%	0.88%	-0.97%	-0.01%
过去三年	12.44%	1.94%	17.41%	1.93%	-4.97%	0.01%
过去五年	76.37%	1.71%	86.63%	1.70%	-10.26%	0.01%
自基金合同	57.76%	1.63%	57.82%	1.67%	-0.06%	-0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

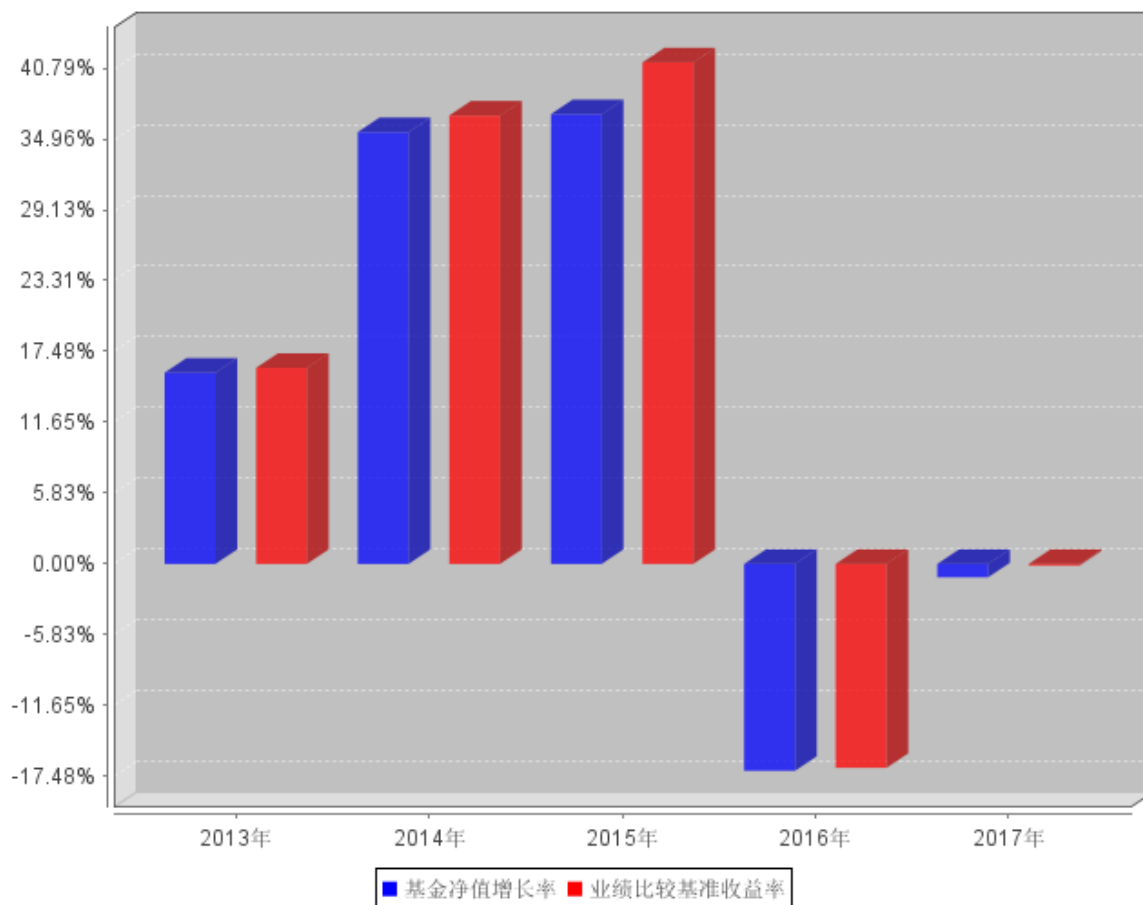
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2017 年 12 月 31 日，公司共管理 41 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、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金鸿一年定期开放债券型证券投资基金及农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.1602%，日均偏离度为 0.0399%。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为-1.10%，业绩比较基准收益率为-0.13%。

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

以上参与估值流程各方为公司各部门人员，均具有基金从业资格，具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委

员，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求，但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7.1 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。

4.8 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

2017 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

2017 年度,农银汇理基金管理有限公司在农银汇理中证 500 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 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(2018)第 22162 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“农银汇理中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 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,公允反映了农银汇理中证 500 指数基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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,我们独立于农银汇理中证 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	<p>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(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估农银汇理中证 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汇理中证 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汇理中证 500 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对农银汇理中证 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</p>

	<p>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汇理中证 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、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <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 都晓燕
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,176,445.97	4,738,147.02
结算备付金		-	3,723,078.91
存出保证金		5,416.87	8,773.77
交易性金融资产	7.4.7.2	81,601,022.67	77,992,296.27
其中：股票投资		81,601,022.67	77,992,296.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,046.24	2,600.05
应收股利		-	-
应收申购款		51,550.55	6,478.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		86,835,482.30	86,471,374.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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		182,668.13	157,079.13
应付管理人报酬		54,697.87	55,180.52
应付托管费		10,939.56	11,036.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	29,492.75	24,159.73
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	470,529.83	350,261.21
负债合计		748,328.14	597,716.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	54,566,834.83	53,836,226.85
未分配利润	7.4.7.10	31,520,319.33	32,037,431.44
所有者权益合计		86,087,154.16	85,873,658.29
负债和所有者权益总计		86,835,482.30	86,471,374.97

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5776 元，基金份额总额 54,566,834.83 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		1,046,288.15	-13,745,286.14
1.利息收入		65,601.74	93,464.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	44,453.65	48,509.90
债券利息收入		21,148.09	44,954.15
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）		1,872,804.14	-731,551.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,174,984.79	-1,224,778.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,104.75	-103,343.56
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	685,714.60	596,570.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-946,534.98	-13,161,146.20
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	54,417.25	53,947.77

减：二、费用		1,334,542.96	1,436,546.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	681,064.60	657,944.52
2. 托管费	7.4.10.2.2	136,212.88	131,588.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	128,915.76	137,515.05
5. 利息支出		154.72	1,302.92
其中：卖出回购金融资产支出		154.72	1,302.92
6. 其他费用	7.4.7.20	388,195.00	508,195.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-288,254.81	-15,181,832.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-288,254.81	-15,181,832.45

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	53,836,226.85	32,037,431.44	85,873,658.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-288,254.81	-288,254.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	730,607.98	-228,857.30	501,750.68
其中：1. 基金申购款	35,567,977.09	21,725,835.05	57,293,812.14
2. 基金赎回款	-34,837,369.11	-21,954,692.35	-56,792,061.46
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）	54,566,834.83	31,520,319.33	86,087,154.16
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理中证 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%，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。

本财务报表由本基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2018 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 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 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按

照中央国债登记结算有限责任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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	5,176,445.97	4,738,147.02
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,176,445.97	4,738,147.02

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	84,944,373.38	81,601,022.67	-3,343,350.71
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	84,944,373.38	81,601,022.67	-3,343,350.71
项目	上年度末 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

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,043.78	943.54
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
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.06	0.05
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	2.40	3.90
合计	1,046.24	2,600.05

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	29,492.75	24,159.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	29,492.75	24,159.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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	529.83	261.21
预提费用	220,000.00	100,000.00
合计	470,529.83	350,261.21

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,836,226.85	53,836,226.85
本期申购	35,567,977.09	35,567,977.09
本期赎回(以“-”号填列)	-34,837,369.11	-34,837,369.11
- 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	54,566,834.83	54,566,834.83

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	47,940,206.71	-15,902,775.27	32,037,431.44
本期利润	658,280.17	-946,534.98	-288,254.81
本期基金份额交易产生的变动数	673,752.81	-902,610.11	-228,857.30
其中：基金申购款	31,567,248.96	-9,841,413.91	21,725,835.05
基金赎回款	-30,893,496.15	8,938,803.80	-21,954,692.35
本期已分配利润	-	-	-

本期末	49,272,239.69	-17,751,920.36	31,520,319.33
-----	---------------	----------------	---------------

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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	24,791.75	16,074.99
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	19,538.33	32,161.56
其他	123.57	273.35
合计	44,453.65	48,509.90

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	41,552,993.26	43,887,627.39
减：卖出股票成本总额	40,378,008.47	45,112,406.20
买卖股票差价收入	1,174,984.79	-1,224,778.81

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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016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	12,104.75	-103,343.56
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	12,104.75	-103,343.56

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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,574,459.00	7,289,022.80
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	1,530,850.00	7,091,343.56
减：应收利息总额	31,504.25	301,022.80
买卖债券差价收入	12,104.75	-103,343.56

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	685,714.60	596,570.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	685,714.60	596,570.61

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-946,534.98	-13,161,146.20
——股票投资	-946,534.98	-13,261,101.76
——债券投资	-	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	-946,534.98	-13,161,146.20

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日

基金赎回费收入	49,015.57	39,585.50
转换费	5,401.68	14,362.27
合计	54,417.25	53,947.77

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。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	128,915.76	137,515.05
银行间市场交易费用	-	-
合计	128,915.76	137,515.05

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	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	195.00
合计	388,195.00	508,195.00

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

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	681,064.60	657,944.52
其中：支付销售机构的客户维护费	301,331.05	291,129.00

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	136,212.88	131,588.82

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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	5,176,445.97	24,791.75	4,738,147.02	16,074.99

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 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
600525	长园集团	-	公告重大事项	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	25,680	361,940.60	405,487.20	-

300156	神雾环保	-	公告 重大事项	24.16	2018 年 1 月 17 日	21.74	13,100	340,455.11	316,496.00	-
002366	台海核电	-	公告 重大事项	26.45	-	-	10,300	271,149.44	272,435.00	-
000930	中粮生化	-	公告 重大事项	13.34	-	-	20,100	256,201.78	268,134.00	-
002168	深圳惠程	-	公告 重大事项	13.76	-	-	17,220	205,057.08	236,947.20	-
300383	光环新网	-	公告 重大事项	13.19	2018 年 3 月 19 日	14.51	17,900	224,391.15	236,101.00	-
000547	航天发展	-	公告 重大事项	10.83	-	-	20,700	445,489.98	224,181.00	-
600614	鹏起科技	-	公告 重大事项	10.16	-	-	20,524	203,087.03	208,523.84	-
000979	中弘股份	-	公告 重大事项	1.94	2018 年 2 月 14 日	1.75	106,295	214,327.59	206,212.30	-
000566	海南海药	-	公告 重大事项	12.89	-	-	15,900	176,941.47	204,951.00	-
002512	达华智能	-	公告 重大事项	18.07	2018 年 3 月 6 日	16.26	10,900	198,545.53	196,963.00	-
000006	深振业 A	-	公告 重大事项	9.85	2018 年 3 月 8 日	8.87	19,772	182,705.10	194,754.20	-
000031	中粮地产	-	公告 重大事项	8.00	-	-	23,800	258,994.71	190,400.00	-
600664	哈药股份	-	公告 重大事项	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	32,490	300,596.31	188,766.90	-

000592	平潭发展	-	公告 重大事项	5.75	2018年 1月29 日	5.70	32,700	361,703.31	188,025.00	-
600645	中源协和	-	公告 重大事项	28.40	2018年 1月19 日	25.56	6,585	217,741.92	187,014.00	-
002745	木林森	-	公告 重大事项	45.50	2018年 1月5日	46.50	4,100	192,796.00	186,550.00	-
002004	华邦健康	-	公告 重大事项	6.73	2018年 3月14 日	7.30	27,565	284,263.87	185,512.45	-
000401	冀东水泥	-	公告 重大事项	13.79	2018年 1月15 日	15.17	13,300	179,953.58	183,407.00	-
000926	福星股份	-	公告 重大事项	10.89	2018年 1月10 日	11.98	14,700	170,785.41	160,083.00	-
000939	凯迪生态	-	公告 重大事项	4.99	-	-	31,100	180,599.07	155,189.00	-
300159	新研股份	-	公告 重大事项	10.40	2018年 3月22 日	9.36	14,700	232,007.28	152,880.00	-
000806	银河生物	-	公告 重大事项	10.76	2018年 1月18 日	10.01	14,200	231,013.37	152,792.00	-
300116	坚瑞沃能	-	公告 重大事项	7.62	-	-	18,900	187,853.25	144,018.00	-
600187	国中水务	-	公告 重大事项	4.68	2018年 3月20 日	4.21	27,600	158,898.19	129,168.00	-
000156	华数传媒	-	公告 重大事项	11.40	-	-	11,100	144,149.77	126,540.00	-
300134	大富科技	-	公告 重大事项	16.45	2018年 3月19 日	14.81	7,410	193,997.84	121,894.50	-

002122	天马股份	-	公告 重大事项	8.49	-	-	13,800	114,415.34	117,162.00	-
002358	森源电气	-	公告 重大事项	14.86	2018年 3月7日	15.05	7,300	126,674.71	108,478.00	-
000766	通化金马	-	公告 重大事项	13.60	-	-	7,600	132,157.67	103,360.00	-
300010	立思辰	-	公告 重大事项	11.17	2018年 2月22日	10.05	8,600	161,047.20	96,062.00	-
002345	潮宏基	-	公告 重大事项	10.75	-	-	8,804	82,912.01	94,643.00	-
300032	金龙机电	-	公告 重大事项	13.89	-	-	6,600	112,951.36	91,674.00	-
002344	海宁皮城	-	公告 重大事项	7.93	2018年 1月31日	7.44	10,800	158,474.87	85,644.00	-
000693	*ST 华泽	-	公告 重大事项	12.50	2018年 3月21日	11.88	6,400	147,996.60	80,000.00	-

注：本基金截至 2017 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

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，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

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。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并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。

7.4.13.3.1 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。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	不计息	合计
资产			
银行存款	5,176,445.97	-	5,176,445.97
存出保证金	5,416.87	-	5,416.87
交易性金融资产		81,601,022.67	81,601,022.67
应收利息	-	1,046.24	1,046.24
应收申购款	-	51,550.55	51,550.55
资产总计	5,181,862.84	81,653,619.46	86,835,482.30
负债			
应付赎回款	-	182,668.13	182,668.13

应付管理人报酬	-	54,697.87	54,697.87
应付托管费	-	10,939.56	10,939.56
应付交易费用	-	29,492.75	29,492.75
其他负债	-	470,529.83	470,529.83
负债总计	-	748,328.14	748,328.14
利率敏感度缺口	5,181,862.84	80,905,291.32	86,087,154.16
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	不计息	合计
资产			
银行存款	4,738,147.02	-	4,738,147.02
清算备付金	3,723,078.91	-	3,723,078.91
存出保证金	8,773.77	-	8,773.77
交易性金融资产	-	77,992,296.27	77,992,296.27
应收利息	-	2,600.05	2,600.05
应收申购款	-	6,478.95	6,478.95
其他资产	-	-	-
资产总计	8,469,999.70	78,001,375.27	86,471,374.97
负债			
应付赎回款	-	157,079.13	157,079.13
应付管理人报酬	-	55,180.52	55,180.52
应付托管费	-	11,036.09	11,036.09
应付交易费用	-	24,159.73	24,159.73
其他负债	-	350,261.21	350,261.21
负债总计	-	597,716.68	597,716.68
利率敏感度缺口	8,469,999.70	77,403,658.59	85,873,658.29

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本年末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

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。

7.4.14 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 2017 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 75,400,574.08 元，属于第二层次的余额为 6,200,448.59 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 71,780,841.17 元，第二层次 6,211,455.10 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)、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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	81,601,022.67	93.97
	其中：股票	81,601,022.67	93.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,176,445.97	5.96
8	其他各项资产	58,013.66	0.07
9	合计	86,835,482.30	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,378,560.20	1.60
B	采矿业	2,773,300.92	3.22
C	制造业	48,013,336.71	55.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,577,035.30	2.99
E	建筑业	1,856,213.47	2.16
F	批发和零售业	4,328,449.98	5.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,638,213.89	3.06
H	住宿和餐饮业	100,099.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,705,778.43	7.79
J	金融业	1,520,934.25	1.77

K	房地产业	4,869,194.21	5.66
L	租赁和商务服务业	1,374,663.17	1.60
M	科学研究和技术服务业	187,014.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	907,348.34	1.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	99,950.00	0.12
Q	卫生和社会工作	151,640.40	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,068,150.20	1.24
S	综合	417,697.00	0.49
	合计	80,967,579.47	94.05

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	553,443.20	0.64
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	633,443.20	0.74

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	600516	方大炭素	20,900	603,592.00	0.70
2	600176	中国巨石	34,110	555,651.90	0.65
3	600201	生物股份	17,500	555,450.00	0.65
4	002405	四维图新	20,031	528,618.09	0.61
5	000661	长春高新	2,650	484,950.00	0.56
6	002422	科伦药业	16,800	418,320.00	0.49
7	002271	东方雨虹	10,302	411,667.92	0.48
8	600525	长园集团	25,680	405,487.20	0.47
9	002001	新和成	10,600	403,436.00	0.47
10	600584	长电科技	18,500	394,605.00	0.46
11	000786	北新建材	17,400	391,500.00	0.45
12	000998	隆平高科	14,700	378,084.00	0.44
13	002340	格林美	52,072	374,397.68	0.43
14	300274	阳光电源	19,720	370,144.40	0.43
15	600521	华海药业	12,210	367,765.20	0.43
16	600438	通威股份	30,300	366,933.00	0.43
17	603019	中科曙光	8,800	354,112.00	0.41
18	600426	华鲁恒升	22,115	352,070.80	0.41
19	002049	紫光国芯	7,100	340,729.00	0.40
20	600315	上海家化	9,200	339,388.00	0.39
21	000039	中集集团	14,800	338,180.00	0.39
22	002092	中泰化学	25,100	334,081.00	0.39
23	600079	人福医药	18,500	330,040.00	0.38
24	300266	兴源环境	12,200	329,400.00	0.38
25	000050	深天马 A	16,400	323,244.00	0.38
26	000830	鲁西化工	19,900	316,808.00	0.37
27	600298	安琪酵母	9,618	314,700.96	0.37
28	002583	海能达	17,000	314,670.00	0.37

29	600642	申能股份	53,200	311,752.00	0.36
30	600256	广汇能源	61,000	308,660.00	0.36
31	601168	西部矿业	37,100	304,220.00	0.35
32	002179	中航光电	7,706	303,462.28	0.35
33	000009	中国宝安	41,900	302,937.00	0.35
34	002050	三花智控	16,500	302,610.00	0.35
35	600291	西水股份	12,800	301,056.00	0.35
36	600392	盛和资源	15,800	300,200.00	0.35
37	000977	浪潮信息	15,100	300,188.00	0.35
38	002410	广联达	15,300	299,880.00	0.35
39	600004	白云机场	20,200	296,940.00	0.34
40	002384	东山精密	10,400	295,984.00	0.34
41	000418	小天鹅 A	4,300	291,755.00	0.34
42	600879	航天电子	37,060	290,550.40	0.34
43	000488	晨鸣纸业	17,400	290,058.00	0.34
44	600388	龙净环保	16,700	288,910.00	0.34
45	002311	海大集团	12,300	287,820.00	0.33
46	601233	桐昆股份	12,700	285,623.00	0.33
47	000513	丽珠集团	4,279	284,339.55	0.33
48	002573	清新环境	12,508	284,306.84	0.33
49	300055	万邦达	13,500	283,905.00	0.33
50	002078	太阳纸业	30,300	281,184.00	0.33
51	300088	长信科技	35,800	280,314.00	0.33
52	600022	山东钢铁	127,950	273,813.00	0.32
53	002366	台海核电	10,300	272,435.00	0.32
54	600499	科达洁能	24,500	271,705.00	0.32
55	000690	宝新能源	33,900	271,200.00	0.32
56	600872	中炬高新	10,900	269,884.00	0.31
57	000930	中粮生化	20,100	268,134.00	0.31
58	600600	青岛啤酒	6,800	267,444.00	0.31
59	603589	口子窖	5,800	267,090.00	0.31
60	601699	潞安环能	23,200	264,016.00	0.31
61	600811	东方集团	57,630	263,945.40	0.31
62	002019	亿帆医药	11,800	262,550.00	0.30
63	000887	中鼎股份	14,400	261,648.00	0.30
64	600875	东方电气	23,200	260,536.00	0.30
65	600056	中国医药	10,400	258,856.00	0.30
66	002176	江特电机	22,800	258,096.00	0.30
67	002407	多氟多	12,600	257,292.00	0.30

68	600885	宏发股份	6,200	256,494.00	0.30
69	000656	金科股份	51,700	255,915.00	0.30
70	600166	福田汽车	91,000	255,710.00	0.30
71	000066	中国长城	34,172	249,113.88	0.29
72	600839	四川长虹	71,500	248,820.00	0.29
73	002517	恺英网络	11,200	248,752.00	0.29
74	002038	双鹭药业	8,000	247,760.00	0.29
75	000997	新大陆	13,800	247,434.00	0.29
76	600643	爱建集团	22,270	246,751.60	0.29
77	600718	东软集团	16,800	246,288.00	0.29
78	002273	水晶光电	10,400	245,336.00	0.28
79	002439	启明星辰	10,500	245,175.00	0.28
80	600755	厦门国贸	24,268	245,106.80	0.28
81	600183	生益科技	14,100	243,366.00	0.28
82	600325	华发股份	33,058	243,306.88	0.28
83	600418	江淮汽车	25,700	243,122.00	0.28
84	600260	凯乐科技	8,300	241,613.00	0.28
85	002244	滨江集团	30,100	239,295.00	0.28
86	600266	北京城建	18,200	239,148.00	0.28
87	002359	北讯集团	10,600	239,030.00	0.28
88	600808	马钢股份	57,800	238,714.00	0.28
89	000970	中科三环	16,500	237,270.00	0.28
90	600138	中青旅	11,325	236,352.75	0.27
91	300383	光环新网	17,900	236,101.00	0.27
92	000581	威孚高科	9,800	235,200.00	0.27
93	600787	中储股份	21,300	234,300.00	0.27
94	000878	云南铜业	16,500	234,135.00	0.27
95	002223	鱼跃医疗	11,689	229,104.40	0.27
96	600060	海信电器	15,200	228,304.00	0.27
97	002670	国盛金控	11,717	227,895.65	0.26
98	600673	东阳光科	33,418	225,571.50	0.26
99	002195	二三四五	38,500	224,840.00	0.26
100	000547	航天发展	20,700	224,181.00	0.26
101	600460	士兰微	14,517	223,997.31	0.26
102	002285	世联行	19,763	220,357.45	0.26
103	000825	太钢不锈	44,100	218,736.00	0.25
104	600160	巨化股份	20,500	217,915.00	0.25
105	002408	齐翔腾达	17,180	217,842.40	0.25
106	600094	大名城	30,900	215,991.00	0.25

107	300197	铁汉生态	17,700	215,055.00	0.25
108	002640	跨境通	11,200	214,368.00	0.25
109	000960	锡业股份	16,200	213,840.00	0.25
110	300182	捷成股份	24,800	213,528.00	0.25
111	600435	北方导航	17,300	213,309.00	0.25
112	300146	汤臣倍健	14,200	213,284.00	0.25
113	600884	杉杉股份	10,900	211,242.00	0.25
114	300115	长盈精密	10,520	211,136.40	0.25
115	600978	宜华生活	22,980	210,037.20	0.24
116	600655	豫园股份	19,500	209,430.00	0.24
117	600062	华润双鹤	8,460	209,385.00	0.24
118	600614	鹏起科技	20,524	208,523.84	0.24
119	601000	唐山港	44,151	207,951.21	0.24
120	600143	金发科技	31,600	207,612.00	0.24
121	000703	恒逸石化	9,600	207,072.00	0.24
122	000999	华润三九	7,600	206,720.00	0.24
123	600282	南钢股份	42,700	206,668.00	0.24
124	000807	云铝股份	20,200	206,646.00	0.24
125	000981	银亿股份	23,400	206,622.00	0.24
126	000979	中弘股份	106,295	206,212.30	0.24
127	600179	安通控股	8,300	205,425.00	0.24
128	000566	海南海药	15,900	204,951.00	0.24
129	600346	恒力股份	16,500	203,445.00	0.24
130	600970	中材国际	20,550	203,239.50	0.24
131	000778	新兴铸管	38,900	203,058.00	0.24
132	600503	华丽家族	31,000	203,050.00	0.24
133	002183	怡亚通	28,700	202,335.00	0.24
134	002013	中航机电	18,652	201,255.08	0.23
135	002051	中工国际	10,836	199,707.48	0.23
136	601231	环旭电子	12,600	198,702.00	0.23
137	002048	宁波华翔	8,300	197,540.00	0.23
138	002512	达华智能	10,900	196,963.00	0.23
139	002589	瑞康医药	14,590	196,235.50	0.23
140	000988	华工科技	11,800	195,644.00	0.23
141	002221	东华能源	16,006	195,433.26	0.23
142	000006	深振业 A	19,772	194,754.20	0.23
143	000732	泰禾集团	9,700	194,194.00	0.23
144	002127	南极电商	15,800	192,602.00	0.22
145	600409	三友化工	20,000	191,800.00	0.22

146	600125	铁龙物流	17,669	191,178.58	0.22
147	000031	中粮地产	23,800	190,400.00	0.22
148	600240	华业资本	22,060	189,274.80	0.22
149	600664	哈药股份	32,490	188,766.90	0.22
150	600161	天坛生物	6,550	188,574.50	0.22
151	000598	兴蓉环境	34,700	188,421.00	0.22
152	000592	平潭发展	32,700	188,025.00	0.22
153	002373	千方科技	12,800	187,520.00	0.22
154	002268	卫士通	8,140	187,382.80	0.22
155	600645	中源协和	6,585	187,014.00	0.22
156	002745	木林森	4,100	186,550.00	0.22
157	002004	华邦健康	27,565	185,512.45	0.22
158	002491	通鼎互联	14,700	185,220.00	0.22
159	000729	燕京啤酒	27,300	184,002.00	0.21
160	000401	冀东水泥	13,300	183,407.00	0.21
161	002030	达安基因	9,860	183,198.80	0.21
162	000078	海王生物	30,700	181,130.00	0.21
163	002281	光迅科技	6,149	180,780.60	0.21
164	600597	光明乳业	11,900	180,285.00	0.21
165	600410	华胜天成	17,129	180,197.08	0.21
166	002400	省广股份	33,774	180,015.42	0.21
167	600566	济川药业	4,700	179,305.00	0.21
168	600635	大众公用	37,500	179,250.00	0.21
169	300166	东方国信	14,279	179,201.45	0.21
170	002440	闰土股份	9,002	177,249.38	0.21
171	000028	国药一致	2,932	176,653.00	0.21
172	000685	中山公用	17,176	176,054.00	0.20
173	600037	歌华有线	13,500	175,365.00	0.20
174	002152	广电运通	23,500	174,840.00	0.20
175	000089	深圳机场	20,000	174,000.00	0.20
176	600122	宏图高科	17,900	173,451.00	0.20
177	600307	酒钢宏兴	60,600	173,316.00	0.20
178	000012	南玻 A	20,500	173,225.00	0.20
179	600348	阳泉煤业	23,300	171,954.00	0.20
180	600572	康恩贝	24,265	171,553.55	0.20
181	600500	中化国际	20,200	170,892.00	0.20
182	600171	上海贝岭	10,500	170,835.00	0.20
183	002056	横店东磁	15,900	170,130.00	0.20
184	600380	健康元	15,200	170,088.00	0.20

185	600717	天津港	16,200	169,938.00	0.20
186	002131	利欧股份	65,259	169,673.40	0.20
187	601200	上海环境	6,800	169,592.00	0.20
188	600267	海正药业	11,200	169,568.00	0.20
189	002431	棕榈股份	20,150	169,260.00	0.20
190	000975	银泰资源	12,623	168,643.28	0.20
191	601880	大连港	59,890	167,093.10	0.19
192	002506	协鑫集成	39,100	166,957.00	0.19
193	600863	内蒙华电	56,200	166,914.00	0.19
194	600511	国药股份	6,000	166,800.00	0.19
195	600881	亚泰集团	31,400	165,792.00	0.19
196	300058	蓝色光标	30,000	165,600.00	0.19
197	300324	旋极信息	11,300	165,319.00	0.19
198	000636	风华高科	13,900	165,132.00	0.19
199	002028	思源电气	10,408	164,966.80	0.19
200	002665	首航节能	24,560	163,569.60	0.19
201	300002	神州泰岳	26,600	162,792.00	0.19
202	600120	浙江东方	6,600	162,426.00	0.19
203	600026	中远海能	26,500	162,180.00	0.19
204	002280	联络互动	21,100	161,626.00	0.19
205	002477	雏鹰农牧	36,400	161,616.00	0.19
206	002191	劲嘉股份	17,400	160,950.00	0.19
207	002249	大洋电机	23,000	160,310.00	0.19
208	000926	福星股份	14,700	160,083.00	0.19
209	600416	湘电股份	12,800	159,872.00	0.19
210	600737	中粮糖业	19,900	158,205.00	0.18
211	600967	内蒙一机	13,100	157,855.00	0.18
212	600936	广西广电	22,700	155,722.00	0.18
213	002354	天神娱乐	9,080	155,268.00	0.18
214	000939	凯迪生态	31,100	155,189.00	0.18
215	600835	上海机电	6,300	154,350.00	0.18
216	000400	许继电气	11,700	154,323.00	0.18
217	600466	蓝光发展	16,500	154,275.00	0.18
218	600633	浙数文化	10,100	153,520.00	0.18
219	002635	安洁科技	5,884	153,513.56	0.18
220	300159	新研股份	14,700	152,880.00	0.18
221	000806	银河生物	14,200	152,792.00	0.18
222	600575	皖江物流	37,700	152,685.00	0.18
223	000612	焦作万方	16,200	152,280.00	0.18

224	600751	天海投资	24,900	152,139.00	0.18
225	002709	天赐材料	3,300	151,767.00	0.18
226	300244	迪安诊断	6,420	151,640.40	0.18
227	002505	大康农业	53,130	150,889.20	0.18
228	600216	浙江医药	11,200	150,528.00	0.17
229	000667	美好置业	49,500	150,480.00	0.17
230	603369	今世缘	9,700	150,447.00	0.17
231	000860	顺鑫农业	7,800	149,838.00	0.17
232	002371	北方华创	3,600	149,184.00	0.17
233	300026	红日药业	35,000	149,100.00	0.17
234	600598	北大荒	13,800	148,764.00	0.17
235	300133	华策影视	13,700	148,508.00	0.17
236	600064	南京高科	10,450	148,285.50	0.17
237	300113	顺网科技	8,100	148,149.00	0.17
238	300199	翰宇药业	9,100	148,148.00	0.17
239	600151	航天机电	19,500	148,005.00	0.17
240	000712	锦龙股份	8,700	147,726.00	0.17
241	000758	中色股份	22,900	147,247.00	0.17
242	600478	科力远	19,925	147,046.50	0.17
243	002603	以岭药业	9,400	146,264.00	0.17
244	002353	杰瑞股份	11,100	145,632.00	0.17
245	300253	卫宁健康	21,688	145,526.48	0.17
246	300287	飞利信	19,500	144,495.00	0.17
247	000596	古井贡酒	2,200	144,474.00	0.17
248	300116	坚瑞沃能	18,900	144,018.00	0.17
249	002444	巨星科技	10,400	143,832.00	0.17
250	603766	隆鑫通用	20,450	143,559.00	0.17
251	600823	世茂股份	29,000	143,260.00	0.17
252	002701	奥瑞金	22,832	142,700.00	0.17
253	600039	四川路桥	34,900	142,043.00	0.16
254	002807	江阴银行	17,100	141,588.00	0.16
255	600908	无锡银行	17,900	140,873.00	0.16
256	002128	露天煤业	12,700	140,716.00	0.16
257	002390	信邦制药	16,550	139,847.50	0.16
258	002299	圣农发展	9,700	139,680.00	0.16
259	600086	东方金钰	13,100	139,515.00	0.16
260	000027	深圳能源	23,000	139,380.00	0.16
261	600017	日照港	35,700	138,516.00	0.16
262	000021	深科技	14,209	138,253.57	0.16

263	002147	新光圆成	10,670	138,069.80	0.16
264	300376	易事特	18,100	137,017.00	0.16
265	002002	鸿达兴业	20,029	136,998.36	0.16
266	603077	和邦生物	68,340	136,680.00	0.16
267	002155	湖南黄金	14,000	135,800.00	0.16
268	600648	外高桥	7,300	135,050.00	0.16
269	600158	中体产业	13,100	134,668.00	0.16
270	600801	华新水泥	9,440	133,387.20	0.15
271	600366	宁波韵升	7,600	133,152.00	0.15
272	300001	特锐德	9,700	132,793.00	0.15
273	002266	浙富控股	30,630	132,627.90	0.15
274	000681	视觉中国	6,800	132,600.00	0.15
275	600563	法拉电子	2,600	132,106.00	0.15
276	600848	上海临港	5,900	131,570.00	0.15
277	600312	平高电气	13,100	130,869.00	0.15
278	601678	滨化股份	16,100	130,732.00	0.15
279	002672	东江环保	8,025	130,406.25	0.15
280	002308	威创股份	10,656	130,003.20	0.15
281	000528	柳工	15,200	129,656.00	0.15
282	002032	苏泊尔	3,200	129,216.00	0.15
283	600187	国中水务	27,600	129,168.00	0.15
284	600317	营口港	37,600	127,464.00	0.15
285	000718	苏宁环球	29,400	127,302.00	0.15
286	000877	天山股份	12,240	127,296.00	0.15
287	000762	西藏矿业	8,100	127,170.00	0.15
288	000563	陕国投 A	29,880	126,990.00	0.15
289	002489	浙江永强	21,092	126,762.92	0.15
290	000156	华数传媒	11,100	126,540.00	0.15
291	600594	益佰制药	12,300	125,706.00	0.15
292	000727	华东科技	52,600	125,188.00	0.15
293	002018	华信国际	17,600	124,432.00	0.14
294	600393	粤泰股份	19,600	124,264.00	0.14
295	600108	亚盛集团	30,200	124,122.00	0.14
296	600859	王府井	6,040	123,216.00	0.14
297	002368	太极股份	4,850	123,044.50	0.14
298	600651	飞乐音响	13,440	122,976.00	0.14
299	600270	外运发展	7,100	122,688.00	0.14
300	002251	步步高	6,760	122,018.00	0.14
301	002428	云南锗业	10,100	121,907.00	0.14

302	300134	大富科技	7,410	121,894.50	0.14
303	002463	沪电股份	22,708	121,033.64	0.14
304	600545	卓郎智能	11,000	120,780.00	0.14
305	600611	大众交通	24,250	120,765.00	0.14
306	600993	马应龙	5,870	120,217.60	0.14
307	600729	重庆百货	4,797	120,212.82	0.14
308	600169	太原重工	34,700	120,062.00	0.14
309	601928	凤凰传媒	14,800	120,028.00	0.14
310	000501	鄂武商 A	7,505	119,779.80	0.14
311	002437	誉衡药业	17,350	119,541.50	0.14
312	000937	冀中能源	20,500	119,310.00	0.14
313	600316	洪都航空	8,300	117,528.00	0.14
314	002375	亚厦股份	15,600	117,312.00	0.14
315	002122	天马股份	13,800	117,162.00	0.14
316	002663	普邦股份	20,929	116,155.95	0.13
317	000090	天健集团	11,569	116,152.76	0.13
318	603000	人民网	10,700	115,881.00	0.13
319	600141	兴发集团	6,840	115,596.00	0.13
320	000587	金洲慈航	16,400	114,800.00	0.13
321	600770	综艺股份	15,100	114,760.00	0.13
322	600694	大商股份	3,400	114,682.00	0.13
323	002250	联化科技	10,744	114,101.28	0.13
324	600259	广晟有色	2,900	113,941.00	0.13
325	601717	郑煤机	17,300	113,834.00	0.13
326	002277	友阿股份	19,240	112,938.80	0.13
327	600557	康缘药业	8,352	112,584.96	0.13
328	600565	迪马股份	28,100	112,400.00	0.13
329	600098	广州发展	15,800	111,706.00	0.13
330	600582	天地科技	24,000	111,600.00	0.13
331	002064	华峰氨纶	22,700	111,230.00	0.13
332	603188	亚邦股份	6,700	111,153.00	0.13
333	002106	莱宝高科	10,900	110,853.00	0.13
334	002434	万里扬	10,500	110,250.00	0.13
335	002233	塔牌集团	9,200	109,572.00	0.13
336	600874	创业环保	8,400	109,284.00	0.13
337	300297	蓝盾股份	11,400	108,756.00	0.13
338	601311	骆驼股份	8,200	108,650.00	0.13
339	002358	森源电气	7,300	108,478.00	0.13
340	600765	中航重机	9,000	108,180.00	0.13

341	000848	承德露露	11,416	107,995.36	0.13
342	002022	科华生物	7,900	107,519.00	0.12
343	000600	建投能源	13,900	107,169.00	0.12
344	603883	老百姓	1,700	107,083.00	0.12
345	000426	兴业矿业	10,862	106,773.46	0.12
346	000519	中兵红箭	10,829	106,665.65	0.12
347	601689	拓普集团	4,300	106,382.00	0.12
348	600587	新华医疗	6,312	105,978.48	0.12
349	601016	节能风电	32,200	105,938.00	0.12
350	000969	安泰科技	11,900	105,791.00	0.12
351	002657	中科金财	4,600	104,972.00	0.12
352	000541	佛山照明	11,380	104,696.00	0.12
353	000543	皖能电力	20,830	104,566.60	0.12
354	002123	梦网集团	10,100	104,535.00	0.12
355	600338	西藏珠峰	2,500	104,125.00	0.12
356	000766	通化金马	7,600	103,360.00	0.12
357	600155	宝硕股份	10,100	103,323.00	0.12
358	002276	万马股份	11,980	103,267.60	0.12
359	600073	上海梅林	12,700	103,124.00	0.12
360	600277	亿利洁能	15,900	102,396.00	0.12
361	000572	海马汽车	22,300	102,134.00	0.12
362	002690	美亚光电	5,300	102,131.00	0.12
363	002242	九阳股份	6,000	101,820.00	0.12
364	000158	常山北明	12,814	101,743.16	0.12
365	002073	软控股份	12,700	101,600.00	0.12
366	600687	刚泰控股	8,600	101,566.00	0.12
367	002332	仙琚制药	12,425	101,512.25	0.12
368	600971	恒源煤电	9,700	101,171.00	0.12
369	002503	搜于特	18,140	100,495.60	0.12
370	000061	农产品	13,100	100,346.00	0.12
371	600058	五矿发展	8,300	100,264.00	0.12
372	603816	顾家家居	1,700	100,249.00	0.12
373	002317	众生药业	7,900	100,172.00	0.12
374	600580	卧龙电气	12,500	100,125.00	0.12
375	600754	锦江股份	3,100	100,099.00	0.12
376	603377	东方时尚	2,500	99,950.00	0.12
377	002261	拓维信息	12,900	99,846.00	0.12
378	600284	浦东建设	10,700	99,510.00	0.12
379	002063	远光软件	9,351	99,401.13	0.12

380	600773	西藏城投	8,500	99,280.00	0.12
381	600300	维维股份	22,700	99,199.00	0.12
382	600869	智慧能源	17,200	98,728.00	0.11
383	601002	晋亿实业	9,200	98,716.00	0.11
384	000062	深圳华强	4,200	98,658.00	0.11
385	603515	欧普照明	2,300	98,532.00	0.11
386	601001	大同煤业	16,200	98,010.00	0.11
387	600422	昆药集团	10,700	97,905.00	0.11
388	000829	天音控股	10,300	97,850.00	0.11
389	000680	山推股份	19,200	97,728.00	0.11
390	300202	聚龙股份	5,400	96,930.00	0.11
391	300273	和佳股份	10,680	96,760.80	0.11
392	600578	京能电力	26,100	96,570.00	0.11
393	002254	泰和新材	8,292	96,518.88	0.11
394	002642	荣之联	7,350	96,358.50	0.11
395	002699	美盛文化	5,320	96,345.20	0.11
396	300010	立思辰	8,600	96,062.00	0.11
397	600536	中国软件	5,800	95,990.00	0.11
398	002681	奋达科技	8,600	95,976.00	0.11
399	000669	金鸿控股	6,550	95,957.50	0.11
400	002482	广田集团	11,900	95,438.00	0.11
401	000049	德赛电池	2,400	95,016.00	0.11
402	002345	潮宏基	8,804	94,643.00	0.11
403	002544	杰赛科技	6,000	94,380.00	0.11
404	600458	时代新材	9,300	93,651.00	0.11
405	600759	洲际油气	21,893	93,264.18	0.11
406	600428	中远海特	16,600	93,126.00	0.11
407	600623	华谊集团	10,900	92,977.00	0.11
408	300039	上海凯宝	14,540	92,474.40	0.11
409	600289	ST 信通	9,300	92,442.00	0.11
410	300257	开山股份	6,600	92,400.00	0.11
411	300032	金龙机电	6,600	91,674.00	0.11
412	601777	力帆股份	12,500	90,750.00	0.11
413	600006	东风汽车	15,500	90,675.00	0.11
414	600335	国机汽车	8,000	89,920.00	0.10
415	300291	华录百纳	7,900	89,665.00	0.10
416	002479	富春环保	9,220	89,526.20	0.10
417	002005	德豪润达	20,500	89,380.00	0.10
418	600750	江中药业	3,466	88,313.68	0.10

419	002707	众信旅游	8,100	88,209.00	0.10
420	000777	中核科技	5,920	88,208.00	0.10
421	000652	泰达股份	20,000	88,200.00	0.10
422	600395	盘江股份	12,800	87,936.00	0.10
423	600059	古越龙山	9,350	87,796.50	0.10
424	002041	登海种业	6,800	87,380.00	0.10
425	600280	中央商场	11,100	87,357.00	0.10
426	002011	盾安环境	10,700	86,028.00	0.10
427	002344	海宁皮城	10,800	85,644.00	0.10
428	603658	安图生物	1,600	85,152.00	0.10
429	600517	置信电气	13,100	84,757.00	0.10
430	600639	浦东金桥	5,000	84,750.00	0.10
431	001696	宗申动力	13,400	84,688.00	0.10
432	000990	诚志股份	4,900	84,574.00	0.10
433	000897	津滨发展	25,000	84,500.00	0.10
434	603328	依顿电子	5,800	83,230.00	0.10
435	603198	迎驾贡酒	4,700	82,673.00	0.10
436	600657	信达地产	14,779	82,466.82	0.10
437	600329	中新药业	5,500	81,785.00	0.10
438	600195	中牧股份	4,140	81,599.40	0.09
439	600757	长江传媒	11,700	81,315.00	0.09
440	300147	香雪制药	8,950	80,281.50	0.09
441	002269	美邦服饰	24,350	80,111.50	0.09
442	603556	海兴电力	2,200	80,080.00	0.09
443	603355	莱克电气	1,600	78,848.00	0.09
444	600862	中航高科	8,100	78,408.00	0.09
445	600880	博瑞传播	14,800	77,996.00	0.09
446	002342	巨力索具	13,000	77,870.00	0.09
447	000552	靖远煤电	22,100	77,792.00	0.09
448	600894	广日股份	8,300	77,605.00	0.09
449	600628	新世界	7,500	76,275.00	0.09
450	002588	史丹利	11,220	75,061.80	0.09
451	002118	紫鑫药业	9,900	74,448.00	0.09
452	002093	国脉科技	7,800	74,022.00	0.09
453	000099	中信海直	8,200	73,964.00	0.09
454	002190	成飞集成	3,400	73,576.00	0.09
455	603444	吉比特	400	73,572.00	0.09
456	300043	星辉娱乐	12,000	73,440.00	0.09
457	000662	天夏智慧	4,900	72,863.00	0.08

458	600184	光电股份	3,928	71,960.96	0.08
459	603888	新华网	3,000	70,950.00	0.08
460	000816	智慧农业	22,000	70,620.00	0.08
461	601127	小康股份	3,500	70,385.00	0.08
462	002392	北京利尔	13,800	69,552.00	0.08
463	600748	上实发展	10,760	68,971.60	0.08
464	002325	洪涛股份	14,414	68,754.78	0.08
465	600776	东方通信	9,500	68,685.00	0.08
466	603868	飞科电器	900	68,175.00	0.08
467	600640	号百控股	4,600	67,252.00	0.08
468	600292	远达环保	7,510	67,214.50	0.08
469	600743	华远地产	18,121	66,322.86	0.08
470	601020	华钰矿业	3,100	63,612.00	0.07
471	002414	高德红外	3,763	63,256.03	0.07
472	600481	双良节能	15,700	62,957.00	0.07
473	600996	贵广网络	6,200	61,380.00	0.07
474	600053	九鼎投资	2,500	59,725.00	0.07
475	002551	尚荣医疗	6,434	58,935.44	0.07
476	603568	伟明环保	2,700	56,835.00	0.07
477	002416	爱施德	6,000	56,820.00	0.07
478	000761	本钢板材	10,600	55,120.00	0.06
479	603806	福斯特	1,600	54,560.00	0.06
480	600826	兰生股份	4,100	53,997.00	0.06
481	603228	景旺电子	1,000	53,770.00	0.06
482	603225	新凤鸣	1,500	53,700.00	0.06
483	000536	华映科技	10,700	52,858.00	0.06
484	603169	兰石重装	6,200	52,018.00	0.06
485	600126	杭钢股份	7,500	51,525.00	0.06
486	000987	越秀金控	5,200	51,220.00	0.06
487	600618	氯碱化工	4,400	47,652.00	0.06
488	603001	奥康国际	3,100	44,857.00	0.05
489	603528	多伦科技	4,800	42,384.00	0.05
490	000025	特力 A	1,100	42,361.00	0.05
491	601811	新华文轩	3,100	41,633.00	0.05
492	600917	重庆燃气	3,500	38,990.00	0.05
493	601969	海南矿业	4,400	38,940.00	0.05
494	601128	常熟银行	4,700	33,511.00	0.04
495	002815	崇达技术	1,000	31,560.00	0.04
496	603877	太平鸟	1,100	29,821.00	0.03

497	600939	重庆建工	4,000	29,680.00	0.03
498	603025	大豪科技	1,000	29,420.00	0.03
499	603569	长久物流	1,200	29,028.00	0.03
500	002818	富森美	900	27,279.00	0.03

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	300156	神雾环保	13,100	316,496.00	0.37
2	002168	深圳惠程	17,220	236,947.20	0.28
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	300136	信维通信	502,390.00	0.59
2	600487	亨通光电	464,738.00	0.54
3	600642	申能股份	409,716.00	0.48
4	000066	中国长城	402,633.00	0.47
5	600522	中天科技	375,772.00	0.44
6	002049	紫光国芯	367,685.00	0.43
7	600004	白云机场	349,206.00	0.41
8	000778	新兴铸管	334,898.00	0.39
9	603799	华友钴业	327,894.00	0.38
10	600438	通威股份	323,913.00	0.38
11	000009	中国宝安	323,080.00	0.38
12	600256	广汇能源	317,791.00	0.37
13	000039	中集集团	316,987.45	0.37
14	002670	国盛金控	310,279.12	0.36
15	600839	四川长虹	309,658.00	0.36

16	002583	海能达	298,871.00	0.35
17	000977	浪潮信息	293,628.00	0.34
18	300002	神州泰岳	269,581.00	0.31
19	600885	宏发股份	268,036.00	0.31
20	300058	蓝色光标	267,370.00	0.31

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	300136	信维通信	1,259,971.49	1.47
2	600487	亨通光电	1,176,618.57	1.37
3	601012	隆基股份	939,289.25	1.09
4	002460	赣锋锂业	922,575.34	1.07
5	600522	中天科技	787,936.68	0.92
6	603799	华友钴业	565,072.00	0.66
7	002572	索菲亚	522,331.00	0.61
8	002508	老板电器	514,944.19	0.60
9	600219	南山铝业	499,182.00	0.58
10	600682	南京新百	445,574.00	0.52
11	300296	利亚德	440,327.00	0.51
12	600436	片仔癀	417,146.00	0.49
13	002217	合力泰	365,585.00	0.43
14	600699	均胜电子	364,959.00	0.42
15	300122	智飞生物	343,002.00	0.40
16	600809	山西汾酒	319,467.00	0.37
17	000887	中鼎股份	310,334.40	0.36
18	600528	中铁工业	272,194.00	0.32
19	002602	世纪华通	265,163.00	0.31
20	000959	首钢股份	258,536.00	0.30

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	44,933,269.85
卖出股票收入（成交）总额	41,552,993.26

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

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

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	5,416.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,046.24
5	应收申购款	51,550.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,013.66

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	300156	神雾环保	316,496.00	0.37	公告重大事项
2	002168	深圳惠程	236,947.20	0.28	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
7,464	7,310.67	494,224.14	0.91%	54,072,610.69	99.09%

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	53,836,226.85
本报告期基金总申购份额	35,567,977.09
减:本报告期基金总赎回份额	34,837,369.11
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	54,566,834.83

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		271,817,987.25	83.59%	66,887.32	83.59%	-

高华证券	214,094,638.63	16.41%	13,126.70	16.41%	-
------	----------------	--------	-----------	--------	---

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	1,496,850.00	97.21%	1,300,000.00	100.00%	-	-
高华证券	42,959.00	2.79%	-	-	-	-

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—2016 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 17 日
2	农银汇理基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低保留份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 17 日
3	农银汇理中证 500 基金 2016 年四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
4	农银汇理基金管理有限公司关于开通在中信证券股份有限公司等定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 24 日
5	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
6	农银汇理中证 500 基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基	2017 年 3 月 30 日

		金管理人网站	
7	关于中国工商银行继续开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
8	关于广发证券开展网上、手机委托系统基金申购手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 4 月 7 日
9	关于交通银行开展手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
10	农银汇理中证 500 基金 2017 年一季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 4 月 24 日
11	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加两家代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 12 日
12	农银汇理基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 16 日
13	关于农银汇理电话服务系统暂停基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 28 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日
15	关于交通银行继续开展手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 7 月 4 日
16	农银中证 500 基金一招募说明书更新—2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 7 月 11 日
17	农银汇理中证 500 基金 2017 年二季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 7 月 20 日
18	农银汇理基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在新兰德证券投资咨询有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低保留份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 8 月 14 日
19	农银汇理中证 500 基金 2017 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 8 月 28 日
20	农银汇理中证 500 基金 2017 年三	中国证券报、上海证	2017 年 10 月 25 日

	季度报告	券报、证券时报、基金管理人网站	
21	关于调整旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低保留份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 11 月 9 日
22	关于农银汇理基金管理有限公司旗下产品实施增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）公司住所已于 2017 年 6 月 13 日变更为：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层；上述变更已完成工商变更登记。

本公司已于 2017 年 6 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述公司住所变更的公告。

§ 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

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

2018 年 3 月 29 日