

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 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	81,989,202.97 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		许金超	彭纯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-3,020,928.87
本期利润	13,813,187.36
加权平均基金份额本期利润	0.1778
本期加权平均净值利润率	13.91%
本期基金份额净值增长率	17.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	21,844,423.54
期末可供分配基金份额利润	0.2664
期末基金资产净值	103,833,626.51
期末基金份额净值	1.2664
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	26.64%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即06月30日。

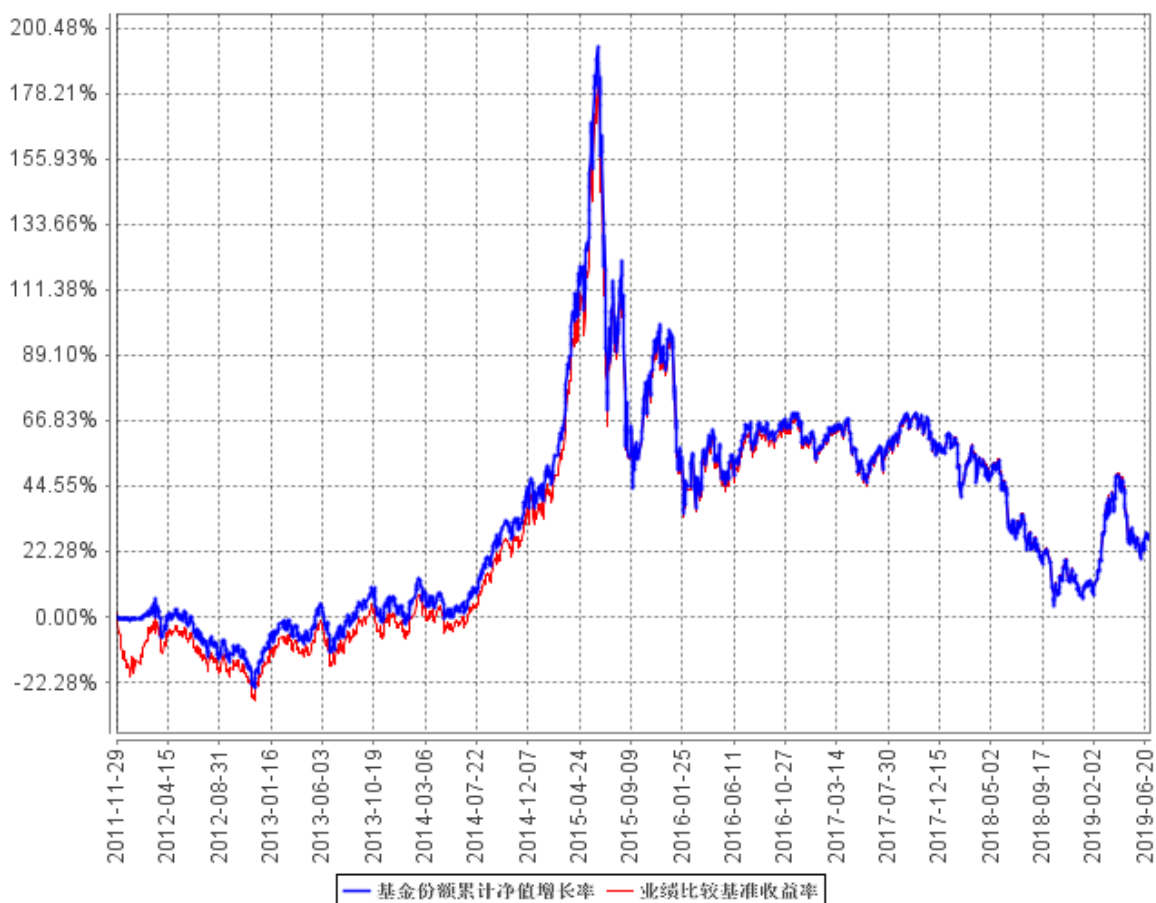
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.77%	1.32%	0.75%	1.32%	0.02%	0.00%
过去三个月	-9.84%	1.72%	-10.21%	1.72%	0.37%	0.00%
过去六个月	17.70%	1.69%	17.87%	1.70%	-0.17%	-0.01%
过去一年	-4.48%	1.59%	-4.70%	1.60%	0.22%	-0.01%
过去三年	-19.52%	1.23%	-18.01%	1.25%	-1.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	26.64%	1.61%	26.77%	1.64%	-0.13%	-0.03%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币壹拾柒亿伍仟万零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。公司法定代表人为董事长许金超先生。

截止 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 50 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理永安

混合型证券投资基金、农银汇理稳进多因子股票型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金及农银汇理可转债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金基金经理	2014年2月10日	-	12	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了基金日常操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.0296%，日均偏离度为 0.0180%。报告期内基金跟踪误差来源主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 替代股票的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2664 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.70%，业绩比较基准收益率为 17.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期本基金不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2019 年上半年度，基金托管人在农银汇理中证 500 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019 年上半年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理中证 500 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019 年上半年度，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理中证 500 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,236,255.77	6,374,635.75
结算备付金		49,991.94	38,979.36
存出保证金		15,650.52	6,710.53
交易性金融资产	6.4.7.2	99,937,150.14	70,692,340.87
其中：股票投资		98,438,350.14	70,692,340.87
基金投资		-	-
债券投资		1,498,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		56,738.96	-
应收利息	6.4.7.5	16,470.40	1,253.14
应收股利		-	-
应收申购款		12,147.82	16,830.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,324,405.55	77,130,750.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,534,521.62
应付赎回款		252,785.48	139,397.40
应付管理人报酬		62,821.74	48,843.68
应付托管费		12,564.35	9,768.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,540.01	40,075.05
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,067.46	450,467.69
负债合计		490,779.04	2,223,074.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	81,989,202.97	69,618,201.87
未分配利润	6.4.7.10	21,844,423.54	5,289,474.52
所有者权益合计		103,833,626.51	74,907,676.39
负债和所有者权益总计		104,324,405.55	77,130,750.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2664 元，基金份额总额 81,989,202.97 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		14,532,736.50	-13,984,287.72
1.利息收入		40,480.18	20,984.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,267.31	20,984.54
债券利息收入		21,212.87	-
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）		-2,432,535.24	425,319.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,340,468.66	-135,908.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-6,800.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	914,733.42	561,228.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,834,116.23	-14,454,787.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	90,675.33	24,195.06
减：二、费用		719,549.14	641,506.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	366,619.48	323,164.51

2. 托管费	6.4.10.2.2	73,323.89	64,632.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	96,661.99	55,343.94
5. 利息支出		3,525.77	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,525.77	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	179,418.01	198,365.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,813,187.36	-14,625,794.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,813,187.36	-14,625,794.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理中证 500 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,618,201.87	5,289,474.52	74,907,676.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,813,187.36	13,813,187.36
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）	12,371,001.10	2,741,761.66	15,112,762.76
其中：1.基金申购款	44,383,132.08	13,782,913.42	58,166,045.50
2.基金赎回款	-32,012,130.98	-11,041,151.76	-43,053,282.74
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）	81,989,202.97	21,844,423.54	103,833,626.51
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	54,566,834.83	31,520,319.33	86,087,154.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,625,794.21	-14,625,794.21
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）	6,513,133.14	3,007,749.43	9,520,882.57
其中：1.基金申购款	20,371,864.05	10,189,765.92	30,561,629.97
2.基金赎回款	-13,858,730.91	-7,182,016.49	-21,040,747.40
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）	61,079,967.97	19,902,274.55	80,982,242.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 施卫 </u>	<u> 刘志勇 </u>	<u> 丁煜琼 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理中证 500 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可第[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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：95% X 中证 500 指数收益率+5% X 同期银行活期存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,236,255.77
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,236,255.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	107,378,769.28	98,438,350.14	-8,940,419.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,496,400.00	1,498,800.00	2,400.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,496,400.00	1,498,800.00	2,400.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	108,875,169.28	99,937,150.14	-8,938,019.14	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	780.15
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	20.25
应收债券利息	15,663.70
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.30
合计	16,470.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	41,540.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,540.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	779.45
预提费用	120,288.01
合计	121,067.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,618,201.87	69,618,201.87
本期申购	44,383,132.08	44,383,132.08
本期赎回(以“-”号填列)	-32,012,130.98	-32,012,130.98
- 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	81,989,202.97	81,989,202.97

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,101,981.77	-48,812,507.25	5,289,474.52
本期利润	-3,020,928.87	16,834,116.23	13,813,187.36
本期基金份额交易产生的变动数	9,579,271.50	-6,837,509.84	2,741,761.66
其中：基金申购款	34,304,067.41	-20,521,153.99	13,782,913.42
基金赎回款	-24,724,795.91	13,683,644.15	-11,041,151.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,660,324.40	-38,815,900.86	21,844,423.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	18,446.89
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	728.49
其他	91.93
合计	19,267.31

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	27,349,069.31
减：卖出股票成本总额	30,689,537.97
买卖股票差价收入	-3,340,468.66

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

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,800.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-6,800.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,151,200.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,006,800.00
减：应收利息总额	151,200.00
买卖债券差价收入	-6,800.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	914,733.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	914,733.42

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,834,116.23
——股票投资	16,831,716.23
——债券投资	2,400.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	16,834,116.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	76,332.50
转换费	14,342.83
合计	90,675.33

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费

的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	96,661.99
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	96,661.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	40,535.23
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	130.00
合计	179,418.01

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司（“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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	366,619.48	323,164.51
其中：支付销售机构的客	161,043.47	143,346.48

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人农银汇理的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.75%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,323.89	64,632.89

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	4,236,255.77	18,446.89	5,516,122.23	20,587.45

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。通过事前制定科学合理的制度和业务流程、事中有效的执行和管控、事后全面的检查和改进，将风险管理贯穿于基金投资运作的整个环节，有效防范和化解基金面临的市场风险、信用风险、流动性风险及投资合规性风险。

本基金管理人建立了“三层架构、二道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设

的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了管理和控制各类单项风险的二道防线机制，明确了相应防线的责任主体和职责。督察长及其指导下的监察稽核部对公司的风险管理进行监督检查。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，导致基金资产损失的可能性。

本基金管理人建立了内部评级体系、存款银行名单和交易对手库，对投资债券进行内部评级，对存款银行、交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,498,800.00	-
合计	1,498,800.00	-

注：未评级的债券投资包括国债、央行票据和政策性银行金融债

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理措施，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率风险进行监测和分析，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,236,255.77	-	-	-	4,236,255.77
结算备付金	49,991.94	-	-	-	49,991.94
存出保证金	15,650.52	-	-	-	15,650.52
交易性金融资产	1,498,800.00	-	-	98,438,350.14	99,937,150.14
应收证券清算款	-	-	-	56,738.96	56,738.96
应收利息	-	-	-	16,470.40	16,470.40
应收申购款	-	-	-	12,147.82	12,147.82
资产总计	5,800,698.23	-	-	98,523,707.32	104,324,405.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	252,785.48	252,785.48
应付管理人报酬	-	-	-	62,821.74	62,821.74
应付托管费	-	-	-	12,564.35	12,564.35
应付交易费用	-	-	-	41,540.01	41,540.01
其他负债	-	-	-	121,067.46	121,067.46
负债总计	-	-	-	490,779.04	490,779.04

利率敏感度缺口	5,800,698.23	-	-	-98,032,928.28	103,833,626.51
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,374,635.75	-	-	-	6,374,635.75
结算备付金	38,979.36	-	-	-	38,979.36
存出保证金	6,710.53	-	-	-	6,710.53
交易性金融资产	-	-	-	-70,692,340.87	70,692,340.87
应收利息	-	-	-	1,253.14	1,253.14
应收申购款	-	-	-	16,830.89	16,830.89
资产总计	6,420,325.64	-	-	-70,710,424.90	77,130,750.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,534,521.62	1,534,521.62
应付赎回款	-	-	-	139,397.40	139,397.40
应付管理人报酬	-	-	-	48,843.68	48,843.68
应付托管费	-	-	-	9,768.71	9,768.71
应付交易费用	-	-	-	40,075.05	40,075.05
其他负债	-	-	-	450,467.69	450,467.69
负债总计	-	-	-	2,223,074.15	2,223,074.15
利率敏感度缺口	6,420,325.64	-	-	-68,487,350.75	74,907,676.39

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行变化		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响		
	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 25 个基点	-2,084.98	-
	市场利率平行下降 25 个基点	2,084.98	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监测，定期对基金所面临的价格风险进行度量和分析，及时对风险进行管理和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	98,438,350.14	94.80	70,692,340.87	94.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	98,438,350.14	94.80	70,692,340.87	94.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其它变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	5,149,763.95	3,705,016.11
业绩比较基准下降 5%	-5,149,763.95	-3,705,016.11	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	98,438,350.14	94.36
	其中：股票	98,438,350.14	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,498,800.00	1.44
	其中：债券	1,498,800.00	1.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,286,247.71	4.11
8	其他各项资产	101,007.70	0.10
9	合计	104,324,405.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,090,231.00	1.05
B	采矿业	3,494,257.60	3.37
C	制造业	54,924,758.50	52.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,128,992.74	3.01
E	建筑业	1,754,192.16	1.69
F	批发和零售业	5,228,976.61	5.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,280,486.95	3.16
H	住宿和餐饮业	379,316.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,445,835.25	9.10
J	金融业	4,422,588.84	4.26
K	房地产业	4,576,398.39	4.41
L	租赁和商务服务业	1,357,019.55	1.31
M	科学研究和技术服务业	136,489.35	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	879,069.90	0.85

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	331,804.40	0.32
Q	卫生和社会工作	606,297.60	0.58
R	文化、体育和娱乐业	2,056,192.00	1.98
S	综合	1,345,443.30	1.30
	合计	98,438,350.14	94.80

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	40,400	650,440.00	0.63
2	000860	顺鑫农业	13,370	623,710.50	0.60
3	600872	中炬高新	14,400	616,752.00	0.59
4	002157	正邦科技	30,500	508,130.00	0.49
5	002049	紫光国微	10,900	480,799.00	0.46
6	300253	卫宁健康	33,388	473,441.84	0.46
7	600201	生物股份	29,890	468,974.10	0.45
8	000066	中国长城	45,272	465,396.16	0.45
9	002195	二三四五	118,730	461,859.70	0.44
10	600739	辽宁成大	31,500	458,010.00	0.44
11	300450	先导智能	13,600	456,960.00	0.44
12	600763	通策医疗	5,000	442,950.00	0.43
13	002439	启明星辰	16,200	435,780.00	0.42
14	600426	华鲁恒升	29,315	435,620.90	0.42
15	002506	协鑫集成	65,100	434,868.00	0.42
16	002507	涪陵榨菜	14,200	433,100.00	0.42
17	000401	冀东水泥	24,300	427,923.00	0.41
18	002127	南极电商	37,900	425,996.00	0.41
19	002463	沪电股份	31,008	422,328.96	0.41
20	600642	申能股份	70,200	421,902.00	0.41
21	002129	中环股份	43,000	419,680.00	0.40

22	600183	生益科技	27,310	411,015.50	0.40
23	600895	张江高科	19,900	408,348.00	0.39
24	600536	中国软件	7,600	407,892.00	0.39
25	000975	银泰资源	30,592	403,508.48	0.39
26	600298	安琪酵母	12,718	402,270.34	0.39
27	002340	格林美	85,372	402,102.12	0.39
28	300383	光环新网	23,846	399,897.42	0.39
29	002465	海格通信	41,500	395,910.00	0.38
30	000623	吉林敖东	23,900	391,721.00	0.38
31	000750	国海证券	75,900	381,777.00	0.37
32	002223	鱼跃医疗	15,489	381,339.18	0.37
33	002268	卫士通	15,140	370,173.00	0.36
34	002384	东山精密	24,750	360,607.50	0.35
35	603369	今世缘	12,900	359,781.00	0.35
36	002075	沙钢股份	45,400	355,936.00	0.34
37	600801	华新水泥	17,536	355,104.00	0.34
38	002926	华西证券	33,700	353,850.00	0.34
39	002500	山西证券	43,600	353,160.00	0.34
40	002821	凯莱英	3,600	353,088.00	0.34
41	002385	大北农	65,500	346,495.00	0.33
42	600879	航天电子	55,960	344,713.60	0.33
43	000998	隆平高科	23,700	343,176.00	0.33
44	002797	第一创业	54,000	342,360.00	0.33
45	600325	华发股份	43,558	340,187.98	0.33
46	600161	天坛生物	13,414	338,703.50	0.33
47	600460	士兰微	20,217	335,602.20	0.32
48	600497	驰宏锌锗	65,500	332,740.00	0.32
49	600528	中铁工业	28,600	330,902.00	0.32
50	000723	美锦能源	31,600	330,220.00	0.32
51	000988	华工科技	20,700	327,474.00	0.32
52	002373	千方科技	19,100	326,610.00	0.31
53	601128	常熟银行	42,300	326,556.00	0.31
54	600745	闻泰科技	9,800	325,556.00	0.31
55	002371	北方华创	4,700	325,475.00	0.31
56	002299	圣农发展	12,800	324,096.00	0.31
57	600848	上海临港	10,400	323,752.00	0.31
58	600779	水井坊	6,300	320,166.00	0.31
59	000778	新兴铸管	71,800	318,792.00	0.31
60	000686	东北证券	36,100	318,041.00	0.31

61	000997	新大陆	18,800	317,532.00	0.31
62	600584	长电科技	24,700	317,395.00	0.31
63	000009	中国宝安	55,300	315,763.00	0.30
64	600699	均胜电子	14,700	313,992.00	0.30
65	601168	西部矿业	49,000	312,620.00	0.30
66	600549	厦门钨业	21,800	311,958.00	0.30
67	002572	索菲亚	16,600	308,096.00	0.30
68	002092	中泰化学	38,600	307,256.00	0.30
69	600572	康恩贝	47,965	306,976.00	0.30
70	600820	隧道股份	48,500	306,035.00	0.29
71	600909	华安证券	46,600	304,764.00	0.29
72	600410	华胜天成	28,329	303,970.17	0.29
73	600673	东阳光	38,718	303,936.30	0.29
74	601005	重庆钢铁	150,800	303,108.00	0.29
75	000060	中金岭南	64,300	301,567.00	0.29
76	600875	东方电气	28,300	300,546.00	0.29
77	600392	盛和资源	27,110	299,836.60	0.29
78	600376	首开股份	33,200	296,476.00	0.29
79	000999	华润三九	10,100	296,334.00	0.29
80	300168	万达信息	22,600	293,122.00	0.28
81	000039	中集集团	27,360	292,204.80	0.28
82	000690	宝新能源	44,800	288,512.00	0.28
83	000830	鲁西化工	26,400	287,232.00	0.28
84	600718	东软集团	22,400	287,168.00	0.28
85	000960	锡业股份	25,700	287,069.00	0.28
86	600166	福田汽车	120,100	284,637.00	0.27
87	600811	东方集团	76,430	284,319.60	0.27
88	002353	杰瑞股份	12,300	284,130.00	0.27
89	600959	江苏有线	63,400	282,130.00	0.27
90	600022	山东钢铁	168,850	281,979.50	0.27
91	600755	厦门国贸	32,668	281,924.84	0.27
92	601333	广深铁路	87,200	281,656.00	0.27
93	002372	伟星新材	16,160	281,184.00	0.27
94	002191	劲嘉股份	22,600	280,466.00	0.27
95	000581	威孚高科	15,100	280,256.00	0.27
96	600839	四川长虹	95,000	280,250.00	0.27
97	600885	宏发股份	11,480	278,964.00	0.27
98	600567	山鹰纸业	82,500	278,025.00	0.27
99	601866	中远海发	102,000	277,440.00	0.27

100	600804	鹏博士	36,800	276,736.00	0.27
101	002281	光迅科技	10,449	276,689.52	0.27
102	000547	航天发展	28,900	276,284.00	0.27
103	002387	维信诺	21,100	275,355.00	0.27
104	603939	益丰药房	3,900	272,961.00	0.26
105	002078	太阳纸业	40,000	272,400.00	0.26
106	600521	华海药业	19,300	272,130.00	0.26
107	601872	招商轮船	62,400	272,064.00	0.26
108	600881	亚泰集团	83,500	271,375.00	0.26
109	002916	深南电路	2,660	271,107.20	0.26
110	002074	国轩高科	20,500	268,755.00	0.26
111	600315	上海家化	8,600	267,890.00	0.26
112	002217	合力泰	48,100	265,993.00	0.26
113	600486	扬农化工	4,800	262,560.00	0.25
114	600808	马钢股份	76,700	261,547.00	0.25
115	603077	和邦生物	136,240	258,856.00	0.25
116	600037	歌华有线	25,200	258,300.00	0.25
117	600094	大名城	41,000	257,890.00	0.25
118	600260	凯乐科技	12,900	257,742.00	0.25
119	300009	安科生物	16,200	257,580.00	0.25
120	002273	水晶光电	22,150	256,497.00	0.25
121	600079	人福医药	24,400	256,200.00	0.25
122	002221	东华能源	29,706	255,768.66	0.25
123	603000	人民网	14,200	253,186.00	0.24
124	600160	巨化股份	35,300	250,983.00	0.24
125	002670	国盛金控	19,904	250,790.40	0.24
126	002038	双鹭药业	10,600	249,736.00	0.24
127	000970	中科三环	21,900	248,565.00	0.24
128	600845	宝信软件	8,710	248,060.80	0.24
129	002002	鸿达兴业	39,929	247,160.51	0.24
130	300027	华谊兄弟	50,300	246,973.00	0.24
131	002085	万丰奥威	33,800	246,064.00	0.24
132	000983	西山煤电	40,500	245,430.00	0.24
133	300274	阳光电源	26,220	245,157.00	0.24
134	300315	掌趣科技	70,900	244,605.00	0.24
135	601699	潞安环能	30,800	244,552.00	0.24
136	600967	内蒙一机	21,700	243,040.00	0.23
137	000513	丽珠集团	7,283	242,014.09	0.23
138	600435	北方导航	26,800	240,932.00	0.23

139	000729	燕京啤酒	36,200	240,368.00	0.23
140	600643	爱建集团	25,070	240,170.60	0.23
141	600143	金发科技	48,900	239,610.00	0.23
142	300088	长信科技	47,300	239,338.00	0.23
143	600282	南钢股份	68,300	239,050.00	0.23
144	002607	中公教育	17,400	238,902.00	0.23
145	600466	蓝光发展	38,400	238,848.00	0.23
146	600737	中粮糖业	27,500	238,700.00	0.23
147	600388	龙净环保	19,200	237,888.00	0.23
148	600064	南京高科	22,200	237,762.00	0.23
149	002589	瑞康医药	30,990	235,214.10	0.23
150	002110	三钢闽光	25,250	234,825.00	0.23
151	000089	深圳机场	26,400	234,696.00	0.23
152	600863	内蒙华电	74,700	234,558.00	0.23
153	600171	上海贝岭	14,400	234,000.00	0.23
154	601098	中南传媒	18,500	233,840.00	0.23
155	600266	北京城建	29,000	233,740.00	0.23
156	600021	上海电力	26,900	233,492.00	0.22
157	300166	东方国信	18,979	233,251.91	0.22
158	000878	云南铜业	21,900	232,797.00	0.22
159	002174	游族网络	13,700	231,256.00	0.22
160	603444	吉比特	1,100	230,956.00	0.22
161	300001	特锐德	12,800	230,656.00	0.22
162	603517	绝味食品	5,900	229,569.00	0.22
163	002131	利欧股份	119,659	228,548.69	0.22
164	600026	中远海能	35,200	228,448.00	0.22
165	002690	美亚光电	7,000	228,200.00	0.22
166	002019	亿帆医药	18,600	227,850.00	0.22
167	300207	欣旺达	19,700	226,944.00	0.22
168	601118	海南橡胶	44,000	226,600.00	0.22
169	600258	首旅酒店	12,600	226,548.00	0.22
170	000563	陕国投 A	50,966	226,289.04	0.22
171	000636	风华高科	18,400	222,640.00	0.21
172	600373	中文传媒	17,700	222,312.00	0.21
173	601106	中国一重	70,500	221,370.00	0.21
174	002440	闰土股份	17,753	221,202.38	0.21
175	601718	际华集团	56,500	220,915.00	0.21
176	002155	湖南黄金	21,700	218,519.00	0.21
177	000883	湖北能源	50,200	217,868.00	0.21

178	000826	启迪桑德	18,400	216,936.00	0.21
179	600380	健康元	24,872	215,142.80	0.21
180	002233	塔牌集团	18,400	214,912.00	0.21
181	000930	中粮生化	28,500	214,320.00	0.21
182	601100	恒立液压	6,800	213,384.00	0.21
183	002152	广电运通	31,000	212,350.00	0.20
184	000559	万向钱潮	35,400	211,692.00	0.20
185	000732	泰禾集团	12,800	211,200.00	0.20
186	002250	联化科技	19,044	211,197.96	0.20
187	600649	城投控股	32,500	210,275.00	0.20
188	000598	兴蓉环境	46,100	209,755.00	0.20
189	601000	唐山港	76,226	209,621.50	0.20
190	300316	晶盛机电	16,500	209,385.00	0.20
191	000681	视觉中国	10,800	209,304.00	0.20
192	601966	玲珑轮胎	12,300	209,100.00	0.20
193	000932	华菱钢铁	43,420	207,113.40	0.20
194	600008	首创股份	58,500	205,920.00	0.20
195	600782	新钢股份	41,000	205,000.00	0.20
196	300182	捷成股份	46,300	204,183.00	0.20
197	600039	四川路桥	55,700	202,748.00	0.20
198	601231	环旭电子	16,800	202,440.00	0.19
199	600827	百联股份	20,600	202,086.00	0.19
200	600500	中化国际	27,010	201,764.70	0.19
201	002399	海普瑞	9,600	201,504.00	0.19
202	600648	外高桥	9,600	201,408.00	0.19
203	600515	海航基础	40,200	198,990.00	0.19
204	002583	海能达	23,700	198,843.00	0.19
205	002004	华邦健康	40,765	198,117.90	0.19
206	000738	航发控制	14,700	196,980.00	0.19
207	600748	上实发展	23,760	196,970.40	0.19
208	600598	北大荒	18,300	196,359.00	0.19
209	601179	中国西电	52,700	194,990.00	0.19
210	000031	大悦城	30,300	194,526.00	0.19
211	000685	中山公用	22,776	194,507.04	0.19
212	000758	中色股份	35,400	194,346.00	0.19
213	002266	浙富控股	40,730	193,467.50	0.19
214	601608	中信重工	44,600	192,672.00	0.19
215	002368	太极股份	6,350	192,405.00	0.19
216	603501	韦尔股份	3,500	192,185.00	0.19

217	600138	中青旅	15,025	190,667.25	0.18
218	300418	昆仑万维	14,800	190,476.00	0.18
219	600729	重庆百货	6,297	190,421.28	0.18
220	000027	深圳能源	30,600	189,720.00	0.18
221	000008	神州高铁	50,100	188,877.00	0.18
222	300058	蓝色光标	44,200	188,734.00	0.18
223	000807	云铝股份	40,200	188,538.00	0.18
224	600633	浙数文化	20,100	187,935.00	0.18
225	601678	滨化股份	27,800	187,928.00	0.18
226	000877	天山股份	16,140	187,546.80	0.18
227	600167	联美控股	17,630	186,525.40	0.18
228	600056	中国医药	13,800	186,162.00	0.18
229	300133	华策影视	27,600	185,748.00	0.18
230	600120	浙江东方	14,578	185,723.72	0.18
231	603228	景旺电子	4,624	185,006.24	0.18
232	000488	晨鸣纸业	34,400	184,384.00	0.18
233	002414	高德红外	9,594	184,204.80	0.18
234	603885	吉祥航空	14,000	183,400.00	0.18
235	002183	怡亚通	38,200	182,214.00	0.18
236	600507	方大特钢	18,600	181,908.00	0.18
237	600777	新潮能源	87,400	181,792.00	0.18
238	600511	国药股份	7,900	181,463.00	0.17
239	000887	中鼎股份	18,800	180,292.00	0.17
240	600409	三友化工	31,800	179,988.00	0.17
241	600155	华创阳安	13,400	179,962.00	0.17
242	600348	阳泉煤业	30,900	179,529.00	0.17
243	002603	以岭药业	15,500	179,490.00	0.17
244	600216	浙江医药	17,500	179,200.00	0.17
245	600158	中体产业	17,500	179,025.00	0.17
246	600823	世茂股份	38,600	177,946.00	0.17
247	000528	柳工	26,520	176,623.20	0.17
248	002408	齐翔腾达	22,780	176,545.00	0.17
249	000813	德展健康	23,100	176,022.00	0.17
250	600418	江淮汽车	34,100	175,956.00	0.17
251	603883	老百姓	3,000	175,440.00	0.17
252	600060	海信电器	20,200	174,124.00	0.17
253	002812	恩捷股份	3,700	172,975.00	0.17
254	600970	中材国际	26,850	172,645.50	0.17
255	600525	长园集团	27,180	171,777.60	0.17

256	600277	亿利洁能	35,200	171,424.00	0.17
257	600062	华润双鹤	13,552	170,890.72	0.16
258	000301	东方盛虹	31,100	170,739.00	0.16
259	002701	奥瑞金	36,332	169,670.44	0.16
260	601880	大连港	79,590	169,526.70	0.16
261	300010	立思辰	18,000	169,020.00	0.16
262	600597	光明乳业	15,700	168,775.00	0.16
263	600580	卧龙电驱	20,000	168,200.00	0.16
264	601958	金铂股份	25,100	168,170.00	0.16
265	002407	多氟多	14,200	168,128.00	0.16
266	300113	顺网科技	10,700	167,776.00	0.16
267	002640	跨境通	20,000	166,600.00	0.16
268	000090	天健集团	33,686	166,408.84	0.16
269	600478	科力远	29,725	166,162.75	0.16
270	002244	滨江集团	40,000	166,000.00	0.16
271	600717	天津港	25,800	165,636.00	0.16
272	002212	南洋股份	12,000	164,400.00	0.16
273	002242	九阳股份	7,900	164,399.00	0.16
274	600307	酒钢宏兴	80,500	163,415.00	0.16
275	300244	迪安诊断	9,620	163,347.60	0.16
276	000156	华数传媒	14,700	161,847.00	0.16
277	300026	红日药业	46,900	161,805.00	0.16
278	601200	上海环境	11,860	161,414.60	0.16
279	600664	哈药股份	38,890	161,004.60	0.16
280	600312	平高电气	20,900	160,721.00	0.15
281	002419	天虹股份	12,300	160,638.00	0.15
282	300002	神州泰岳	40,300	160,394.00	0.15
283	002056	横店东磁	21,100	160,360.00	0.15
284	000028	国药一致	3,832	160,292.56	0.15
285	603659	璞泰来	3,400	159,868.00	0.15
286	600557	康缘药业	10,752	159,774.72	0.15
287	002128	露天煤业	18,400	159,160.00	0.15
288	600316	洪都航空	11,100	158,841.00	0.15
289	002426	胜利精密	61,900	158,464.00	0.15
290	601928	凤凰传媒	19,600	158,172.00	0.15
291	002491	通鼎互联	19,500	157,755.00	0.15
292	600259	广晟有色	3,900	157,170.00	0.15
293	601611	中国核建	20,200	157,156.00	0.15
294	600759	洲际油气	40,693	157,074.98	0.15

295	600073	上海梅林	17,000	156,400.00	0.15
296	002030	达安基因	14,436	154,898.28	0.15
297	002665	首航节能	45,660	154,787.40	0.15
298	002470	金正大	42,300	153,972.00	0.15
299	300134	大富科技	9,910	153,902.30	0.15
300	000021	深科技	18,909	153,730.17	0.15
301	600884	杉杉股份	14,400	153,360.00	0.15
302	002064	华峰氨纶	30,500	153,110.00	0.15
303	601717	郑煤机	26,800	153,028.00	0.15
304	600754	锦江股份	6,200	152,768.00	0.15
305	300324	旋极信息	26,368	152,670.72	0.15
306	300197	铁汉生态	42,250	151,677.50	0.15
307	600125	铁龙物流	23,469	151,375.05	0.15
308	600859	王府井	9,940	150,988.60	0.15
309	600017	日照港	47,900	150,885.00	0.15
310	600267	海正药业	15,000	150,000.00	0.14
311	000078	海王生物	43,000	149,640.00	0.14
312	002176	江特电机	30,700	149,509.00	0.14
313	000712	锦龙股份	11,600	148,944.00	0.14
314	600582	天地科技	43,000	148,350.00	0.14
315	600575	皖江物流	50,500	147,965.00	0.14
316	002051	中工国际	12,856	147,458.32	0.14
317	600751	海航科技	46,300	147,234.00	0.14
318	300115	长盈精密	14,020	147,069.80	0.14
319	603816	顾家家居	4,600	146,832.00	0.14
320	000727	华东科技	69,900	146,091.00	0.14
321	002302	西部建设	13,100	145,934.00	0.14
322	002358	森源电气	14,300	145,145.00	0.14
323	000959	首钢股份	41,200	145,024.00	0.14
324	600563	法拉电子	3,500	144,095.00	0.14
325	002317	众生药业	16,900	143,819.00	0.14
326	002285	世联行	31,863	143,702.13	0.14
327	002280	联络互动	39,200	143,472.00	0.14
328	603866	桃李面包	3,440	143,276.00	0.14
329	002424	贵州百灵	14,500	143,260.00	0.14
330	600291	西水股份	14,200	142,852.00	0.14
331	000400	许继电气	15,700	142,242.00	0.14
332	600499	科达洁能	32,400	141,912.00	0.14
333	600565	迪马股份	37,900	141,367.00	0.14

334	600901	江苏租赁	23,100	140,679.00	0.14
335	002505	大康农业	71,230	140,323.10	0.14
336	000158	常山北明	25,714	139,369.88	0.13
337	600317	营口港	50,400	139,104.00	0.13
338	000717	韶钢松山	31,400	139,102.00	0.13
339	000519	中兵红箭	17,929	138,591.17	0.13
340	000926	福星股份	20,000	138,400.00	0.13
341	600835	上海机电	8,300	137,780.00	0.13
342	002444	巨星科技	13,800	137,724.00	0.13
343	002028	思源电气	13,808	137,527.68	0.13
344	600993	马应龙	7,770	137,140.50	0.13
345	002390	信邦制药	25,950	136,756.50	0.13
346	600645	中源协和	7,885	136,489.35	0.13
347	000718	苏宁环球	39,400	136,324.00	0.13
348	600770	综艺股份	20,300	135,604.00	0.13
349	600141	兴发集团	13,168	135,367.04	0.13
350	600908	无锡银行	24,000	135,360.00	0.13
351	002573	清新环境	16,808	135,304.40	0.13
352	601326	秦港股份	37,100	134,673.00	0.13
353	002249	大洋电机	30,800	133,672.00	0.13
354	000980	众泰汽车	31,600	133,036.00	0.13
355	600151	航天机电	25,800	132,870.00	0.13
356	600611	大众交通	28,450	132,292.50	0.13
357	000006	深振业 A	24,272	132,282.40	0.13
358	000012	南玻 A	31,795	132,267.20	0.13
359	002807	江阴银行	28,260	132,256.80	0.13
360	000543	皖能电力	27,930	131,550.30	0.13
361	002839	张家港行	23,200	130,616.00	0.13
362	600765	中航重机	14,100	130,143.00	0.13
363	600458	时代新材	12,500	129,875.00	0.13
364	002831	裕同科技	6,760	129,589.20	0.12
365	600787	中储股份	22,600	129,498.00	0.12
366	002332	仙琚制药	19,025	128,609.00	0.12
367	600862	中航高科	14,300	128,557.00	0.12
368	300055	万邦达	18,000	128,340.00	0.12
369	603712	七一二	6,000	127,380.00	0.12
370	000848	承德露露	15,216	126,749.28	0.12
371	300308	中际旭创	3,720	126,442.80	0.12
372	002366	台海核电	13,500	126,360.00	0.12

373	601019	山东出版	16,100	125,258.00	0.12
374	603515	欧普照明	3,880	125,130.00	0.12
375	000600	建投能源	18,600	124,620.00	0.12
376	600169	太原重工	46,600	124,422.00	0.12
377	002048	宁波华翔	11,400	123,348.00	0.12
378	600338	西藏珠峰	7,040	123,059.20	0.12
379	600393	粤泰股份	26,300	122,295.00	0.12
380	000564	供销大集	46,800	122,148.00	0.12
381	002431	棕榈股份	30,850	121,857.50	0.12
382	002093	国脉科技	13,100	121,699.00	0.12
383	002672	东江环保	10,725	121,621.50	0.12
384	002635	安洁科技	8,984	121,194.16	0.12
385	601311	骆驼股份	11,100	120,435.00	0.12
386	603233	大参林	2,660	119,700.00	0.12
387	300287	飞利信	29,800	118,306.00	0.11
388	300376	易事特	23,900	117,827.00	0.11
389	300297	蓝盾股份	19,500	117,585.00	0.11
390	002254	泰和新材	11,092	117,353.36	0.11
391	002745	木林森	10,000	117,200.00	0.11
392	600978	宜华生活	30,780	115,732.80	0.11
393	002544	杰赛科技	8,900	115,700.00	0.11
394	300159	新研股份	23,200	115,536.00	0.11
395	601689	拓普集团	7,500	114,900.00	0.11
396	601016	节能风电	42,800	113,848.00	0.11
397	000869	张裕 A	3,500	112,420.00	0.11
398	603766	隆鑫通用	26,650	111,663.50	0.11
399	600640	号百控股	8,300	111,054.00	0.11
400	603198	迎驾贡酒	6,200	111,042.00	0.11
401	600006	东风汽车	20,800	110,864.00	0.11
402	600623	华谊集团	14,500	110,780.00	0.11
403	300266	兴源环境	24,350	110,549.00	0.11
404	002503	搜于特	40,140	110,385.00	0.11
405	300199	翰宇药业	12,000	110,040.00	0.11
406	600195	中牧股份	7,796	107,974.60	0.10
407	000062	深圳华强	8,110	107,781.90	0.10
408	600757	长江传媒	15,800	107,598.00	0.10
409	000501	鄂武商 A	10,005	107,553.75	0.10
410	600639	浦东金桥	6,600	106,722.00	0.10
411	000990	诚志股份	6,500	106,665.00	0.10

412	002709	天赐材料	4,400	106,480.00	0.10
413	000937	冀中能源	27,500	106,150.00	0.10
414	600694	大商股份	3,800	106,058.00	0.10
415	600750	江中药业	8,141	105,914.41	0.10
416	603888	新华网	5,300	105,788.00	0.10
417	600329	中新药业	7,400	105,746.00	0.10
418	603056	德邦股份	7,500	105,600.00	0.10
419	600545	卓郎智能	14,800	105,228.00	0.10
420	600869	智慧能源	23,100	104,412.00	0.10
421	000426	兴业矿业	19,362	103,973.94	0.10
422	002382	蓝帆医疗	7,500	103,650.00	0.10
423	600416	湘电股份	17,200	103,544.00	0.10
424	603568	伟明环保	4,795	103,188.40	0.10
425	002375	亚厦股份	17,400	102,834.00	0.10
426	603806	福斯特	2,740	100,640.20	0.10
427	000537	广宇发展	14,500	100,340.00	0.10
428	002815	崇达技术	6,400	99,776.00	0.10
429	601001	大同煤业	21,700	99,169.00	0.10
430	300257	开山股份	8,900	98,612.00	0.09
431	002707	众信旅游	16,100	97,727.00	0.09
432	601127	小康股份	7,300	95,630.00	0.09
433	000061	农产品	17,600	95,392.00	0.09
434	002489	浙江永强	28,292	94,495.28	0.09
435	002434	万里扬	13,900	94,381.00	0.09
436	000829	天音控股	16,200	94,284.00	0.09
437	002920	德赛西威	4,200	94,080.00	0.09
438	600058	五矿发展	11,100	93,795.00	0.09
439	600874	创业环保	11,300	93,677.00	0.09
440	002509	天广中茂	45,300	93,318.00	0.09
441	600707	彩虹股份	18,600	93,186.00	0.09
442	601801	皖新传媒	15,500	93,155.00	0.09
443	603377	东方时尚	6,080	92,902.40	0.09
444	002948	青岛银行	14,300	91,949.00	0.09
445	600657	信达地产	22,179	91,377.48	0.09
446	600971	恒源煤电	15,620	91,377.00	0.09
447	002681	奋达科技	21,418	90,812.32	0.09
448	000536	华映科技	35,900	90,468.00	0.09
449	002437	誉衡药业	22,850	90,257.50	0.09
450	002512	达华智能	19,900	89,948.00	0.09

451	002118	紫鑫药业	13,300	89,642.00	0.09
452	002517	恺英网络	28,000	89,320.00	0.09
453	002251	步步高	11,060	88,148.20	0.08
454	000541	佛山照明	16,758	87,811.92	0.08
455	300459	金科文化	15,400	87,626.00	0.08
456	600098	广州发展	14,200	87,472.00	0.08
457	600996	贵广网络	8,100	87,318.00	0.08
458	000766	通化金马	12,600	85,680.00	0.08
459	601139	深圳燃气	14,900	84,781.00	0.08
460	600350	山东高速	17,500	84,000.00	0.08
461	600428	中远海特	22,326	82,606.20	0.08
462	002936	郑州银行	16,000	81,280.00	0.08
463	000552	靖远煤电	29,700	80,487.00	0.08
464	603328	依顿电子	7,800	80,106.00	0.08
465	601869	长飞光纤	2,100	78,750.00	0.08
466	600335	国机汽车	11,300	78,196.00	0.08
467	601615	明阳智能	7,200	78,048.00	0.08
468	002344	海宁皮城	16,700	77,822.00	0.07
469	002482	广田集团	16,000	77,760.00	0.07
470	601003	柳钢股份	13,300	77,007.00	0.07
471	600053	九鼎投资	3,300	76,890.00	0.07
472	600903	贵州燃气	5,900	76,877.00	0.07
473	002818	富森美	5,850	75,055.50	0.07
474	601777	力帆股份	17,100	73,359.00	0.07
475	000587	金洲慈航	27,600	71,208.00	0.07
476	603556	海兴电力	5,060	69,929.20	0.07
477	600939	重庆建工	14,100	68,949.00	0.07
478	000987	越秀金控	7,100	64,042.00	0.06
479	000025	特力 A	2,990	60,457.80	0.06
480	600126	杭钢股份	13,190	60,146.40	0.06
481	002416	爱施德	9,620	60,125.00	0.06
482	601969	海南矿业	10,100	59,388.00	0.06
483	600985	淮北矿业	5,100	57,834.00	0.06
484	002699	美盛文化	9,420	56,520.00	0.05
485	601068	中铝国际	8,000	55,200.00	0.05
486	603225	新风鸣	4,356	54,406.44	0.05
487	600280	中央商场	14,800	53,132.00	0.05
488	601811	新华文轩	4,200	51,282.00	0.05
489	603486	科沃斯	1,580	47,795.00	0.05

490	603868	飞科电器	1,200	46,980.00	0.05
491	002941	新疆交建	1,800	46,800.00	0.05
492	603355	莱克电气	2,100	45,192.00	0.04
493	000761	本钢板材	9,900	42,570.00	0.04
494	603650	彤程新材	1,700	37,128.00	0.04
495	002946	新乳业	2,400	36,336.00	0.03
496	600917	重庆燃气	4,800	33,408.00	0.03
497	603025	大豪科技	2,833	29,009.92	0.03
498	603569	长久物流	2,020	23,411.80	0.02
499	603877	太平鸟	1,500	23,280.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	657,050.00	0.88
2	002157	正邦科技	555,858.00	0.74
3	300383	光环新网	450,893.00	0.60
4	600739	辽宁成大	433,805.00	0.58
5	600763	通策医疗	422,122.00	0.56
6	002075	沙钢股份	390,525.00	0.52
7	600745	闻泰科技	353,261.00	0.47
8	600497	驰宏锌锗	349,358.00	0.47
9	002926	华西证券	349,168.00	0.47
10	600549	厦门钨业	343,892.00	0.46
11	601598	中国外运	343,860.00	0.46
12	000333	美的集团	338,601.00	0.45
13	002797	第一创业	336,720.00	0.45
14	002821	凯莱英	321,804.00	0.43
15	002572	索菲亚	309,484.00	0.41
16	600909	华安证券	294,474.00	0.39
17	601333	广深铁路	285,654.00	0.38

18	002387	维信诺	285,048.00	0.38
19	002217	合力泰	283,651.00	0.38
20	300009	安科生物	271,535.00	0.36

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	674,223.00	0.90
2	002410	广联达	597,045.00	0.80
3	000656	金科股份	528,985.00	0.71
4	300146	汤臣倍健	511,466.00	0.68
5	600600	青岛啤酒	500,824.00	0.67
6	600256	广汇能源	444,674.20	0.59
7	300383	光环新网	403,648.44	0.54
8	000596	古井贡酒	391,235.00	0.52
9	300413	芒果超媒	361,773.00	0.48
10	000333	美的集团	352,432.50	0.47
11	000418	小天鹅 A	338,601.00	0.45
12	603899	晨光文具	332,881.00	0.44
13	002013	中航机电	301,270.04	0.40
14	600655	豫园股份	289,754.00	0.39
15	601598	中国外运	236,594.00	0.32
16	000667	美好置业	207,798.00	0.28
17	600366	宁波韵升	197,925.00	0.26
18	600779	水井坊	196,819.00	0.26
19	600503	华丽家族	188,285.00	0.25
20	002563	森马服饰	169,605.00	0.23

注：卖出金额按卖出的成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	41,603,831.01
卖出股票收入（成交）总额	27,349,069.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,498,800.00	1.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,498,800.00	1.44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	15,000	1,498,800.00	1.44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

2019 年 4 月 23 日，中炬高新技术实业(集团)股份有限公司发布公告称，由于未及时披露关联交易的事项，被上海证券交易所给出了监管关注的监管措施。

2018 年 9 月 29 日，江西正邦科技股份有限公司发布公告称，因其未按时披露定期报告且修正公告披露不及时，被深圳证券交易所给出了监管关注的监管措施。

2018 年 8 月 24 日，紫光国芯微电子股份有限公司公告：由于公司未按规定及时对关联交易事项履行审议程序和信息披露义务，被深圳证券交易所给出了监管关注的监管措施。

其余七名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,650.52
2	应收证券清算款	56,738.96
3	应收股利	-
4	应收利息	16,470.40
5	应收申购款	12,147.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,007.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,192	10,008.45	494,996.43	0.60%	81,494,206.54	99.40%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	13,078.70	0.0160%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 29 日）基金份额总额	711,358,644.30
本报告期期初基金份额总额	69,618,201.87
本报告期基金总申购份额	44,383,132.08
减:本报告期基金总赎回份额	32,012,130.98
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	81,989,202.97

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，根据基金管理人农银汇理基金管理有限公司董事会有关决议，自 2019 年 3 月 4 日起，许金超先生任职公司董事长并代任公司总经理职位；自 2019 年 5 月 7 日起，施卫先生任职公司总经理职位，同日起董事长许金超先生不再代为履行总经理职务。基金管理人分别于 2019 年 3 月 6 日、2019 年 5 月 9 日在指定媒体以及公司网站上刊登了上述高级管理人员变更的公告并按照监管要求进行了备案。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	37,262,717.68	54.58%	34,703.43	54.57%	-
高华证券	2	31,012,980.64	45.42%	28,885.09	45.43%	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。

(3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

(4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	5,503,200.00	100.00%	13,800,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银中证 500 基金—招募说明书更新—2018 年第 2 号	上海证券报	2019 年 1 月 12 日
2	农银中证 500 基金 2018 年 4 季度报告	上海证券报	2019 年 1 月 21 日
3	农银中证 500 基金 2018 年年度报告	上海证券报	2019 年 3 月 27 日
4	农银中证 500 基金 2019 年 1 季度报告	上海证券报	2019 年 4 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

12.3 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

2019 年 8 月 23 日