

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金
基金简称	农银大盘蓝筹混合
基金主代码	660006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 1 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	214,331,625.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票，通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期取得基金资产的长期理性增值。
投资策略	本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。首先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析，对未来股票市场和债券市场的走势进行科学的分析，并以此为基础对大类资产配置进行确定。在“自下而上”的层面，本基金将严格执行备选股票库制度，在建立大盘蓝筹股票库的基础上，综合运用定性和定量的手段，筛选出具有良好基本面和发展前景的蓝筹股票进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	田青
	联系电话	021-61095588	010-67595096
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61095599	010-67595096
传真		021-61095556	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验	北京市西城区金融大街 25 号

	区银城路 9 号 50 层	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	许金超	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	12,867,871.09
本期利润	41,593,391.41
加权平均基金份额本期利润	0.1852
本期加权平均净值利润率	17.99%
本期基金份额净值增长率	19.84%
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	15,861,432.36
期末可供分配基金份额利润	0.0740
期末基金资产净值	230,193,058.22
期末基金份额净值	1.0740
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	7.40%

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6月30日。

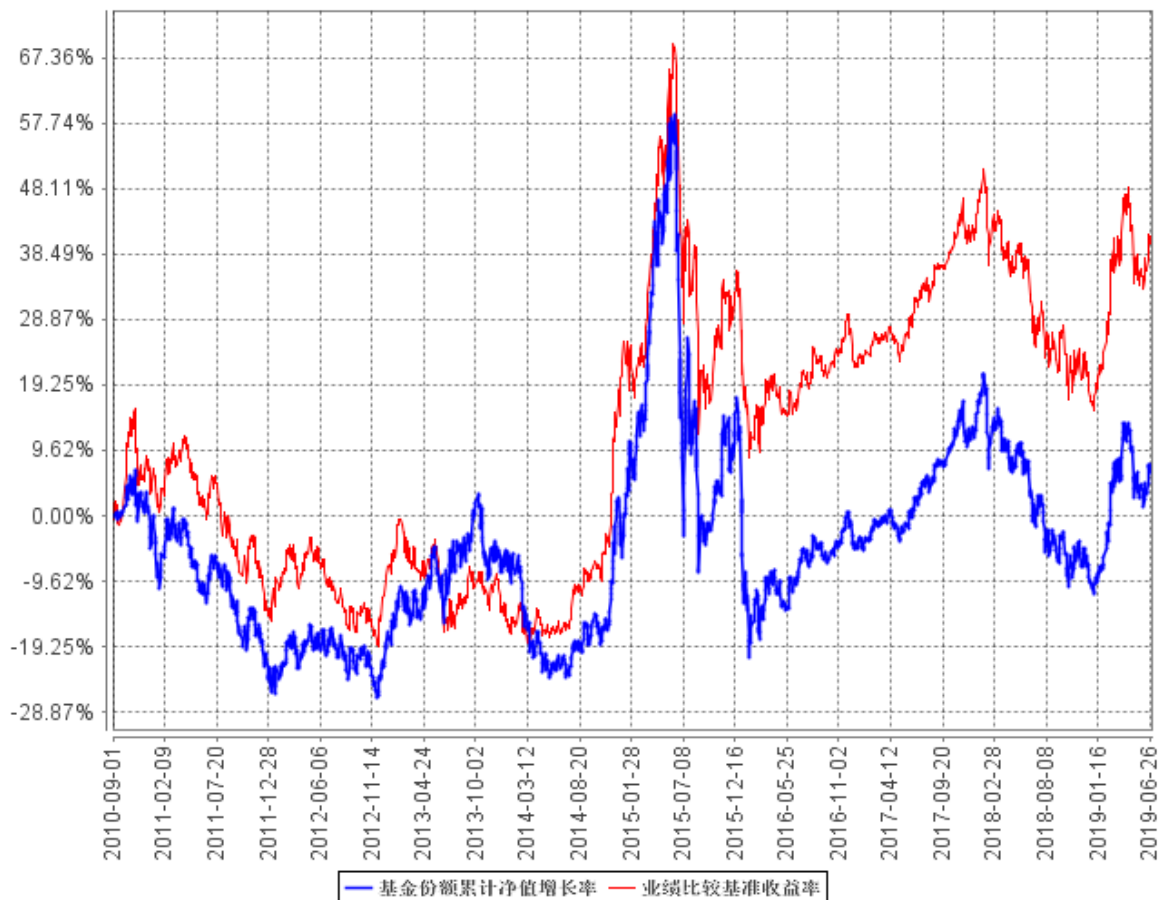
3.2 基金净值表现

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	3.24%	0.97%	4.19%	0.87%	-0.95%	0.10%
过去三个月	-1.21%	1.21%	-0.61%	1.14%	-0.60%	0.07%
过去六个月	19.84%	1.20%	20.63%	1.16%	-0.79%	0.04%
过去一年	5.58%	1.15%	8.93%	1.14%	-3.35%	0.01%
过去三年	17.13%	0.88%	19.70%	0.83%	-2.57%	0.05%
自基金合同生效起至今	7.40%	1.33%	40.94%	1.10%	-33.54%	0.23%

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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为基金合同生效日（2010 年 9 月 1 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	2015年12月2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

本季度内本基金操作主要从个股入手,按照选取合理估值并匹配成长的思路,寻找符合国家经济战略方向的股票以及业绩稳定的股票来进行相应配置,来获得较好的收益。从市场运行看 19 年上半年经济运行较平稳,在中美贸易战的环境下,经济取得了不错的数据,但整体上市场风格偏向大盘价值,投资者对稳定性的股票更加青睐。

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 1.0740 元;本报告期基金份额净值增长率为 19.84%,业绩比较基准收益率为 20.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济周期角度看,我国经济处于经济下行周期底部状态。目前看,上半年经济韧性交足,而下半年压力会稍大一些,主要是因为外部环境不好,欧美经济处于下行周期,下半年大概率下行。因此下半年风险大于机遇,谨慎选择。从市场方向选择来看,上半年风格偏向大盘加之股,下半年风格可能继续;但成长中技术发展良好的上市公司也将会有一定的机会,因此配置上偏向均衡更好。

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，报告期内本基金不需分配利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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	28,204,802.90	60,005,334.50
结算备付金		732,341.08	778,533.11
存出保证金		154,882.09	124,138.57
交易性金融资产	6.4.7.2	204,459,051.22	150,036,933.55
其中：股票投资		193,363,304.42	132,018,744.95
基金投资		-	-
债券投资		11,095,746.80	18,018,188.60
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		-	1,127,214.16
应收利息	6.4.7.5	224,812.56	296,937.16
应收股利		-	-
应收申购款		26,972.69	24,717.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		233,802,862.54	212,393,808.68
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		2,623,655.58	3,513,516.41
应付赎回款		185,067.77	71,254.01
应付管理人报酬		278,364.48	271,147.56
应付托管费		46,394.07	45,191.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	385,043.43	404,679.48
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	91,278.99	480,174.62
负债合计		3,609,804.32	4,785,963.33
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	214,331,625.86	231,642,768.32
未分配利润	6.4.7.10	15,861,432.36	-24,034,922.97
所有者权益合计		230,193,058.22	207,607,845.35
负债和所有者权益总计		233,802,862.54	212,393,808.68

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0740 元，基金份额总额 214,331,625.86 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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		45,098,771.62	-20,900,204.23
1.利息收入		419,472.23	416,156.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	164,934.86	103,525.95
债券利息收入		254,537.37	312,631.04
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）		15,904,361.61	10,774,651.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,955,398.24	9,081,589.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	63,400.36	112,629.12
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	1,885,563.01	1,580,432.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,725,520.32	-32,130,139.42
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	49,417.46	39,127.09
减：二、费用		3,505,380.21	4,299,193.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,716,132.52	1,959,723.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	286,021.94	326,620.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	1, 407, 153. 49	1, 879, 167. 52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0. 02	7. 56
7. 其他费用	6.4.7.20	96, 072. 24	133, 674. 55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41, 593, 391. 41	-25, 199, 397. 99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41, 593, 391. 41	-25, 199, 397. 99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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）	231, 642, 768. 32	-24, 034, 922. 97	207, 607, 845. 35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41, 593, 391. 41	41, 593, 391. 41
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）	-17, 311, 142. 46	-1, 697, 036. 08	-19, 008, 178. 54
其中：1.基金申购款	21, 087, 388. 94	813, 897. 98	21, 901, 286. 92
2. 基金赎回款	-38, 398, 531. 40	-2, 510, 934. 06	-40, 909, 465. 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）	214, 331, 625. 86	15, 861, 432. 36	230, 193, 058. 22
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)	242,858,280.50	30,432,521.48	273,290,801.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-25,199,397.99	-25,199,397.99
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)	-9,161,052.59	-1,203,229.40	-10,364,281.99
其中：1.基金申购款	36,903,088.32	4,865,909.86	41,768,998.18
2.基金赎回款	-46,064,140.91	-6,069,139.26	-52,133,280.17
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)	233,697,227.91	4,029,894.09	237,727,122.00

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：

_____施卫_____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金(原名为农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金,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[2010]第 807 号《关于同意农银汇理大盘蓝筹股票型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《农银汇理大盘蓝筹股票型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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,916,524,336.73 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(2010)第 230 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,917,182,128.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 657,791.91 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基

金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日更名为农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不低于股票资产的 80%，除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-40%，其中权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%。

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》、《农银汇理区间收益灵活配置混合型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需说明的重大会计差错更正。

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	28,204,802.90
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：	28,204,802.90

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	179,612,773.36	193,363,304.42	13,750,531.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,075,633.45	11,095,746.80
	银行间市场	-	-
	合计	11,075,633.45	11,095,746.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	190,688,406.81	204,459,051.22	13,770,644.41

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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	6,433.94
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	296.55
应收债券利息	218,019.34
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	62.73
合计	224,812.56

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	385,043.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	385,043.43

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	291.69
预提费用	90,987.30
合计	91,278.99

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	231,642,768.32	231,642,768.32
本期申购	21,087,388.94	21,087,388.94
本期赎回(以“-”号填列)	-38,398,531.40	-38,398,531.40
- 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	214,331,625.86	214,331,625.86

注：申购含红利再投、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	56,188,176.32	-80,223,099.29	-24,034,922.97
本期利润	12,867,871.09	28,725,520.32	41,593,391.41
本期基金份额交易产生的变动数	-5,097,024.80	3,399,988.72	-1,697,036.08
其中：基金申购款	5,735,827.14	-4,921,929.16	813,897.98
基金赎回款	-10,832,851.94	8,321,917.88	-2,510,934.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,959,022.61	-48,097,590.25	15,861,432.36

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	156,597.80

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	7,106.46
其他	1,230.60
合计	164,934.86

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	457,064,495.22
减：卖出股票成本总额	443,109,096.98
买卖股票差价收入	13,955,398.24

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	63,400.36
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	63,400.36

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	38,271,319.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,575,479.25
减：应收利息总额	632,440.07
买卖债券差价收入	63,400.36

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贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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投资收益。

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衍生工具收益。

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	1,885,563.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,885,563.01

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	28,725,520.32
——股票投资	28,777,003.91
——债券投资	-51,483.59
——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	28,725,520.32

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	37,418.66
转换费	11,998.80
合计	49,417.46

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、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中不低于赎回费总额的 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	1,407,153.49
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	1,407,153.49

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	61,234.52
银行汇划费	5,084.94
合计	96,072.24

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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无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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,716,132.52	1,959,723.50
其中：支付销售机构的客户维护费	605,858.10	563,264.44

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	286,021.94	326,620.63

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	28,204,802.90	156,597.80	33,638,289.42	94,809.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	总额	
601236	红塔 证券	2019年 6月26 日	2019 年7月 5日	新股流 通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信 出版	2019年 6月27 日	2019 年7月 5日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 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
600485	*ST 信威	2016 年12 月26 日	公 告 重 大 事 项	14.59	2019 年7 月12 日	13.86	32,868	498,816.15	479,544.12	-

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	2,999,000.00	-
合计	2,999,000.00	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	8,096,746.80	18,018,188.60
合计	8,096,746.80	18,018,188.60

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

6.4.13.3 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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	28,204,802.90	-	-	-	28,204,802.90
结算备付金	732,341.08	-	-	-	732,341.08
存出保证金	154,882.09	-	-	-	154,882.09
交易性金融资产	2,999,000.00	8,096,746.80	-	-193,363,304.42	204,459,051.22
应收利息	-	-	-	224,812.56	224,812.56
应收申购款	-	-	-	26,972.69	26,972.69
资产总计	32,091,026.07	8,096,746.80	-	-193,615,089.67	233,802,862.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,623,655.58	2,623,655.58
应付赎回款	-	-	-	185,067.77	185,067.77
应付管理人报酬	-	-	-	278,364.48	278,364.48
应付托管费	-	-	-	46,394.07	46,394.07
应付交易费用	-	-	-	385,043.43	385,043.43
其他负债	-	-	-	91,278.99	91,278.99
负债总计	-	-	-	3,609,804.32	3,609,804.32
利率敏感度缺口	32,091,026.07	8,096,746.80	-	-190,005,285.35	230,193,058.22
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	60,005,334.50	-	-	-	60,005,334.50
结算备付金	778,533.11	-	-	-	778,533.11
存出保证金	124,138.57	-	-	-	124,138.57
交易性金融资产	788,394.00	17,229,794.60	-	-132,018,744.95	150,036,933.55
应收证券清算款	-	-	-	1,127,214.16	1,127,214.16
应收利息	-	-	-	296,937.16	296,937.16
应收申购款	-	-	-	24,717.63	24,717.63
资产总计	61,696,400.18	17,229,794.60	-	-133,467,613.90	212,393,808.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,513,516.41	3,513,516.41
应付赎回款	-	-	-	71,254.01	71,254.01
应付管理人报酬	-	-	-	271,147.56	271,147.56
应付托管费	-	-	-	45,191.25	45,191.25
应付交易费用	-	-	-	404,679.48	404,679.48
其他负债	-	-	-	480,174.62	480,174.62
负债总计	-	-	-	4,785,963.33	4,785,963.33
利率敏感度缺口	61,696,400.18	17,229,794.60	-	-128,681,650.57	207,607,845.35

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
----	-----------	---------------------------------

		本期末(2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	市场利率上升 25 个基点	-56, 254. 25	-70, 199. 77
	市场利率下降 25 个基点	56, 254. 25	70, 199. 77

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	193, 363, 304. 42	84. 00	132, 018, 744. 95	63. 59
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	193, 363, 304. 42	84. 00	132, 018, 744. 95	63. 59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的
----	-----------	----------------

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	11,282,871.57	10,673,431.93
	业绩比较基准下降 5%	-11,282,871.57	-10,673,431.93

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	193,363,304.42	82.70
	其中：股票	193,363,304.42	82.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,095,746.80	4.75
	其中：债券	11,095,746.80	4.75
	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	28,937,143.98	12.38
8	其他各项资产	406,667.34	0.17
9	合计	233,802,862.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	2,045,116.60	0.89
B	采矿业	4,100,346.33	1.78
C	制造业	82,403,511.45	35.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,804,736.00	1.65
E	建筑业	5,353,009.42	2.33
F	批发和零售业	2,500,969.80	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	6,897,970.40	3.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,739,933.68	5.10
J	金融业	52,065,331.45	22.62
K	房地产业	8,221,290.40	3.57
L	租赁和商务服务业	5,480,545.20	2.38
M	科学研究和技术服务业	1,795,680.00	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	145,252.34	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,990,779.75	2.60
R	文化、体育和娱乐业	602,171.60	0.26
S	综合	216,660.00	0.09
	合计	193,363,304.42	84.00

7.2.2 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沪港通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	131,400	11,643,354.00	5.06
2	600519	贵州茅台	8,600	8,462,400.00	3.68
3	000858	五粮液	48,946	5,773,180.70	2.51
4	000568	泸州老窖	57,842	4,675,368.86	2.03
5	300015	爱尔眼科	140,255	4,343,697.35	1.89
6	601166	兴业银行	231,000	4,224,990.00	1.84
7	600036	招商银行	106,500	3,831,870.00	1.66
8	601888	中国国旅	38,100	3,377,565.00	1.47
9	601336	新华保险	48,300	2,657,949.00	1.15
10	000651	格力电器	47,586	2,617,230.00	1.14
11	600276	恒瑞医药	38,728	2,556,048.00	1.11
12	000001	平安银行	185,020	2,549,575.60	1.11
13	601988	中国银行	652,200	2,439,228.00	1.06
14	300136	信维通信	97,700	2,388,765.00	1.04
15	000333	美的集团	45,800	2,375,188.00	1.03
16	603345	安井食品	44,123	2,267,922.20	0.99
17	601398	工商银行	373,900	2,202,271.00	0.96
18	600009	上海机场	25,700	2,153,146.00	0.94
19	600048	保利地产	164,900	2,104,124.00	0.91
20	601668	中国建筑	360,200	2,071,150.00	0.90
21	600887	伊利股份	60,379	2,017,262.39	0.88
22	300523	辰安科技	36,000	1,938,960.00	0.84
23	600030	中信证券	77,900	1,854,799.00	0.81
24	600016	民生银行	276,900	1,758,315.00	0.76
25	601111	中国国航	183,600	1,757,052.00	0.76

26	000876	新希望	100,900	1,752,633.00	0.76
27	300759	康龙化成	50,000	1,709,000.00	0.74
28	601328	交通银行	272,000	1,664,640.00	0.72
29	300033	同花顺	16,700	1,642,612.00	0.71
30	002475	立讯精密	64,385	1,596,104.15	0.69
31	002202	金风科技	127,264	1,581,891.52	0.69
32	002230	科大讯飞	44,453	1,477,617.72	0.64
33	000063	中兴通讯	43,600	1,418,308.00	0.62
34	600763	通策医疗	16,000	1,417,440.00	0.62
35	600000	浦发银行	116,156	1,356,702.08	0.59
36	000002	万科 A	48,100	1,337,661.00	0.58
37	300498	温氏股份	36,800	1,319,648.00	0.57
38	300296	利亚德	160,000	1,252,800.00	0.54
39	002127	南极电商	110,000	1,236,400.00	0.54
40	600900	长江电力	65,300	1,168,870.00	0.51
41	600837	海通证券	80,100	1,136,619.00	0.49
42	601601	中国太保	31,100	1,135,461.00	0.49
43	300496	中科创达	38,800	1,128,304.00	0.49
44	600536	中国软件	21,000	1,127,070.00	0.49
45	300747	锐科激光	8,000	1,120,080.00	0.49
46	002415	海康威视	37,050	1,021,839.00	0.44
47	300078	思创医惠	94,100	960,761.00	0.42
48	600019	宝钢股份	145,468	945,542.00	0.41
49	600170	上海建工	244,492	919,289.92	0.40
50	300308	中际旭创	26,900	914,331.00	0.40
51	600104	上汽集团	34,700	884,850.00	0.38
52	601169	北京银行	146,540	866,051.40	0.38
53	603288	海天味业	8,000	840,000.00	0.36
54	000066	中国长城	80,000	822,400.00	0.36
55	600585	海螺水泥	19,800	821,700.00	0.36
56	601211	国泰君安	44,700	820,245.00	0.36
57	000725	京东方 A	234,700	807,368.00	0.35
58	002304	洋河股份	6,633	806,307.48	0.35
59	601229	上海银行	65,860	780,441.00	0.34
60	601766	中国中车	96,300	779,067.00	0.34
61	600031	三一重工	58,000	758,640.00	0.33
62	002714	牧原股份	12,340	725,468.60	0.32
63	600028	中国石化	132,500	724,775.00	0.31
64	300316	晶盛机电	57,100	724,599.00	0.31

65	000596	古井贡酒	6,100	722,911.00	0.31
66	601688	华泰证券	32,300	720,936.00	0.31
67	300059	东方财富	53,166	720,399.30	0.31
68	603363	傲农生物	35,000	670,600.00	0.29
69	000100	TCL 集团	200,200	666,666.00	0.29
70	601088	中国神华	32,700	666,426.00	0.29
71	600309	万华化学	15,520	664,100.80	0.29
72	002142	宁波银行	25,830	626,119.20	0.27
73	600690	青岛海尔	36,200	625,898.00	0.27
74	601818	光大银行	157,700	600,837.00	0.26
75	000069	华侨城 A	84,000	583,800.00	0.25
76	000338	潍柴动力	47,500	583,775.00	0.25
77	600383	金地集团	48,800	582,184.00	0.25
78	601012	隆基股份	25,142	581,031.62	0.25
79	600340	华夏幸福	17,800	579,746.00	0.25
80	300630	普利制药	10,000	576,200.00	0.25
81	600050	中国联通	92,200	567,952.00	0.25
82	601857	中国石油	80,200	551,776.00	0.24
83	002027	分众传媒	101,680	537,887.20	0.23
84	601989	中国重工	90,600	503,736.00	0.22
85	600919	江苏银行	68,600	498,036.00	0.22
86	001979	招商蛇口	23,500	491,150.00	0.21
87	601009	南京银行	58,756	485,324.56	0.21
88	600999	招商证券	28,300	483,647.00	0.21
89	601390	中国中铁	73,800	481,176.00	0.21
90	600485	*ST 信威	32,868	479,544.12	0.21
91	601006	大秦铁路	58,900	476,501.00	0.21
92	600015	华夏银行	60,880	468,776.00	0.20
93	601628	中国人寿	16,496	467,166.72	0.20
94	601377	兴业证券	68,700	463,038.00	0.20
95	600025	华能水电	113,100	460,317.00	0.20
96	002594	比亚迪	8,950	453,944.00	0.20
97	601186	中国铁建	45,600	453,720.00	0.20
98	601899	紫金矿业	119,900	452,023.00	0.20
99	000166	申万宏源	89,295	447,367.95	0.19
100	002146	荣盛发展	47,200	443,208.00	0.19
101	000661	长春高新	1,300	439,400.00	0.19
102	600570	恒生电子	6,386	435,205.90	0.19
103	000538	云南白药	5,200	433,784.00	0.19

104	002024	苏宁易购	36,900	423,612.00	0.18
105	603496	恒为科技	15,000	419,700.00	0.18
106	600011	华能国际	65,800	409,934.00	0.18
107	600111	北方稀土	31,800	408,312.00	0.18
108	600352	浙江龙盛	25,800	406,866.00	0.18
109	000776	广发证券	29,300	402,582.00	0.17
110	002371	北方华创	5,800	401,650.00	0.17
111	601669	中国电建	75,700	400,453.00	0.17
112	600704	物产中大	73,050	395,931.00	0.17
113	603858	步长制药	15,070	388,353.90	0.17
114	601933	永辉超市	37,900	386,959.00	0.17
115	000402	金融街	49,300	386,512.00	0.17
116	600958	东方证券	35,400	378,072.00	0.16
117	000425	徐工机械	82,600	368,396.00	0.16
118	601225	陕西煤业	39,600	365,904.00	0.16
119	601788	光大证券	31,400	358,588.00	0.16
120	000963	华东医药	13,800	358,248.00	0.16
121	002456	欧菲光	45,355	355,583.20	0.15
122	600566	济川药业	11,800	355,298.00	0.15
123	601155	新城控股	8,900	354,309.00	0.15
124	601872	招商轮船	80,400	350,544.00	0.15
125	300142	沃森生物	12,200	345,992.00	0.15
126	600436	片仔癀	3,000	345,600.00	0.15
127	002555	三七互娱	25,500	345,525.00	0.15
128	600100	同方股份	37,900	342,995.00	0.15
129	600406	国电南瑞	18,300	341,112.00	0.15
130	600741	华域汽车	15,600	336,960.00	0.15
131	600588	用友网络	12,271	329,844.48	0.14
132	002583	海能达	38,400	322,176.00	0.14
133	002736	国信证券	24,400	321,104.00	0.14
134	600660	福耀玻璃	13,900	315,947.00	0.14
135	600926	杭州银行	37,240	310,209.20	0.13
136	000157	中联重科	50,900	305,909.00	0.13
137	600010	宝钢股份	180,460	304,977.40	0.13
138	600547	山东黄金	7,400	304,658.00	0.13
139	000783	长江证券	38,300	299,123.00	0.13
140	600795	国电电力	116,700	296,418.00	0.13
141	002008	大族激光	8,467	291,095.46	0.13
142	601901	方正证券	40,800	290,088.00	0.13

143	603589	口子窖	4,500	289,890.00	0.13
144	600705	中航资本	53,300	288,886.00	0.13
145	600362	江西铜业	18,300	288,042.00	0.13
146	603993	洛阳钼业	70,000	277,200.00	0.12
147	601108	财通证券	24,900	273,402.00	0.12
148	600703	三安光电	24,164	272,569.92	0.12
149	600438	通威股份	19,200	269,952.00	0.12
150	600089	特变电工	36,792	266,742.00	0.12
151	601800	中国交建	23,300	263,756.00	0.11
152	600029	南方航空	34,100	263,252.00	0.11
153	600886	国投电力	33,600	261,072.00	0.11
154	002236	大华股份	17,800	258,456.00	0.11
155	601985	中国核电	46,200	256,872.00	0.11
156	600271	航天信息	11,100	255,855.00	0.11
157	002422	科伦药业	8,600	255,678.00	0.11
158	600167	联美控股	24,050	254,449.00	0.11
159	600196	复星医药	10,000	253,000.00	0.11
160	002007	华兰生物	8,290	252,762.10	0.11
161	002001	新和成	12,800	246,912.00	0.11
162	600606	绿地控股	36,100	246,563.00	0.11
163	000848	承德露露	29,500	245,735.00	0.11
164	300003	乐普医疗	10,600	244,012.00	0.11
165	601555	东吴证券	23,800	243,950.00	0.11
166	000895	双汇发展	9,800	243,922.00	0.11
167	600115	东方航空	38,800	243,276.00	0.11
168	000598	兴蓉环境	53,100	241,605.00	0.10
169	002311	海大集团	7,800	241,020.00	0.10
170	600694	大商股份	8,500	237,235.00	0.10
171	600061	国投资本	16,700	233,967.00	0.10
172	600109	国金证券	24,000	233,280.00	0.10
173	000031	大悦城	36,300	233,046.00	0.10
174	601717	郑煤机	40,500	231,255.00	0.10
175	600221	海航控股	113,900	231,217.00	0.10
176	002044	美年健康	18,460	229,642.40	0.10
177	600332	白云山	5,600	229,432.00	0.10
178	300124	汇川技术	9,897	226,740.27	0.10
179	002195	二三四五	58,110	226,047.90	0.10
180	000623	吉林敖东	13,700	224,543.00	0.10
181	000413	东旭光电	43,400	223,076.00	0.10

182	600967	内蒙一机	19,900	222,880.00	0.10
183	600522	中天科技	24,300	222,831.00	0.10
184	002701	奥瑞金	47,700	222,759.00	0.10
185	600487	亨通光电	13,160	220,561.60	0.10
186	002410	广联达	6,700	220,363.00	0.10
187	600177	雅戈尔	34,664	220,116.40	0.10
188	600018	上港集团	32,100	218,922.00	0.10
189	603019	中科曙光	6,200	217,620.00	0.09
190	600673	东阳光	27,600	216,660.00	0.09
191	000768	中航飞机	13,706	215,869.50	0.09
192	600637	东方明珠	20,400	215,016.00	0.09
193	601618	中国中冶	70,700	214,928.00	0.09
194	600580	卧龙电驱	25,400	213,614.00	0.09
195	300017	网宿科技	19,329	208,366.62	0.09
196	002352	顺丰控股	6,100	207,156.00	0.09
197	601607	上海医药	11,400	206,910.00	0.09
198	300122	智飞生物	4,800	206,880.00	0.09
199	300408	三环集团	10,400	202,280.00	0.09
200	600893	航发动力	8,900	202,119.00	0.09
201	300418	昆仑万维	15,700	202,059.00	0.09
202	002271	东方雨虹	8,900	201,674.00	0.09
203	600176	中国巨石	20,800	198,224.00	0.09
204	601877	正泰电器	8,500	196,265.00	0.09
205	600516	方大炭素	15,943	195,939.47	0.09
206	002463	沪电股份	14,200	193,404.00	0.08
207	601919	中远海控	38,300	192,266.00	0.08
208	600498	烽火通信	6,900	192,234.00	0.08
209	601727	上海电气	34,900	187,762.00	0.08
210	600867	通化东宝	12,100	186,340.00	0.08
211	600004	白云机场	10,200	185,640.00	0.08
212	000728	国元证券	19,988	183,289.96	0.08
213	601998	中信银行	30,300	180,891.00	0.08
214	002460	赣锋锂业	7,700	180,411.00	0.08
215	600809	山西汾酒	2,600	179,530.00	0.08
216	000423	东阿阿胶	4,500	179,190.00	0.08
217	600023	浙能电力	40,400	178,568.00	0.08
218	600489	中金黄金	17,094	175,555.38	0.08
219	002673	西部证券	17,280	174,182.40	0.08
220	002466	天齐锂业	6,800	171,904.00	0.07

221	600066	宇通客车	13,200	171,864.00	0.07
222	002241	歌尔股份	19,312	171,683.68	0.07
223	601018	宁波港	39,100	171,649.00	0.07
224	600068	葛洲坝	27,400	170,702.00	0.07
225	002179	中航光电	5,070	169,642.20	0.07
226	300144	宋城演艺	7,200	166,608.00	0.07
227	601997	贵阳银行	19,080	165,042.00	0.07
228	002081	金螳螂	15,950	164,444.50	0.07
229	300024	机器人	10,775	164,103.25	0.07
230	601198	东兴证券	13,700	162,756.00	0.07
231	600398	海澜之家	17,800	161,446.00	0.07
232	601021	春秋航空	3,583	161,235.00	0.07
233	600482	中国动力	6,800	160,616.00	0.07
234	600219	南山铝业	71,040	160,550.40	0.07
235	002602	世纪华通	14,696	160,480.32	0.07
236	000961	中南建设	18,400	159,344.00	0.07
237	601838	成都银行	17,900	158,057.00	0.07
238	601881	中国银河	12,800	156,800.00	0.07
239	600085	同仁堂	5,365	155,585.00	0.07
240	603156	养元饮品	4,180	154,994.40	0.07
241	600674	川投能源	17,400	154,860.00	0.07
242	000703	恒逸石化	11,300	154,358.00	0.07
243	600739	辽宁成大	10,600	154,124.00	0.07
244	000630	铜陵有色	62,500	153,750.00	0.07
245	002100	天康生物	18,900	153,090.00	0.07
246	000786	北新建材	8,400	152,292.00	0.07
247	002739	万达电影	8,200	151,208.00	0.07
248	002493	荣盛石化	12,500	150,750.00	0.07
249	600968	海油发展	42,249	149,983.95	0.07
250	600535	天士力	9,020	149,281.00	0.06
251	603986	兆易创新	1,700	147,390.00	0.06
252	600909	华安证券	22,500	147,150.00	0.06
253	300070	碧水源	18,646	145,252.34	0.06
254	002050	三花智控	13,750	145,062.50	0.06
255	600297	广汇汽车	32,380	144,414.80	0.06
256	000629	攀钢钒钛	42,500	144,075.00	0.06
257	601138	工业富联	11,800	142,190.00	0.06
258	600369	西南证券	27,946	138,053.24	0.06
259	603799	华友钴业	6,396	136,298.76	0.06

260	600663	陆家嘴	8,700	134,850.00	0.06
261	002624	完美世界	5,200	134,212.00	0.06
262	600208	新湖中宝	42,600	133,764.00	0.06
263	600118	中国卫星	5,900	133,045.00	0.06
264	002065	东华软件	18,500	129,315.00	0.06
265	603833	欧派家居	1,200	129,144.00	0.06
266	000625	长安汽车	19,300	127,959.00	0.06
267	600346	恒力石化	10,500	127,680.00	0.06
268	002508	老板电器	4,700	127,558.00	0.06
269	000656	金科股份	21,100	127,233.00	0.06
270	000627	天茂集团	19,600	127,204.00	0.06
271	000709	河钢股份	42,100	125,879.00	0.05
272	603160	汇顶科技	900	124,920.00	0.05
273	600153	建发股份	14,000	124,320.00	0.05
274	601992	金隅集团	33,000	124,080.00	0.05
275	601878	浙商证券	13,200	122,760.00	0.05
276	600583	海油工程	21,900	122,640.00	0.05
277	600760	中航沈飞	4,200	121,926.00	0.05
278	600027	华电国际	32,300	121,771.00	0.05
279	002032	苏泊尔	1,600	121,328.00	0.05
280	600038	中直股份	2,900	118,958.00	0.05
281	601117	中国化学	19,500	117,390.00	0.05
282	600977	中国电影	7,400	115,884.00	0.05
283	002153	石基信息	3,200	115,808.00	0.05
284	600688	上海石化	21,800	112,488.00	0.05
285	600415	小商品城	26,900	110,828.00	0.05
286	601216	君正集团	33,400	109,886.00	0.05
287	600816	安信信托	21,684	109,504.20	0.05
288	002558	巨人网络	6,000	109,020.00	0.05
289	000671	阳光城	16,000	103,680.00	0.05
290	002252	上海莱士	14,840	103,138.00	0.04
291	002831	裕同科技	5,280	101,217.60	0.04
292	601238	广汽集团	9,180	100,337.40	0.04
293	601319	中国人保	10,500	99,645.00	0.04
294	601633	长城汽车	11,900	98,413.00	0.04
295	002010	传化智联	12,900	97,137.00	0.04
296	002310	东方园林	16,000	96,000.00	0.04
297	600188	兖州煤业	8,800	95,656.00	0.04
298	601066	中信建投	4,400	92,752.00	0.04

299	300072	三聚环保	11,580	91,829.40	0.04
300	002294	信立泰	4,100	91,758.00	0.04
301	000898	鞍钢股份	23,790	90,164.10	0.04
302	002120	韵达股份	2,920	89,994.40	0.04
303	002601	龙蟠佰利	6,000	88,980.00	0.04
304	601898	中煤能源	18,100	86,880.00	0.04
305	603259	药明康德	1,000	86,680.00	0.04
306	300413	芒果超媒	2,100	86,205.00	0.04
307	601360	三六零	4,000	85,520.00	0.04
308	002773	康弘药业	2,530	83,287.60	0.04
309	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
310	000938	紫光股份	2,844	77,499.00	0.03
311	600372	中航电子	5,200	77,168.00	0.03
312	601228	广州港	18,400	76,912.00	0.03
313	002468	申通快递	3,000	74,820.00	0.03
314	002938	鹏鼎控股	2,500	73,400.00	0.03
315	000415	渤海租赁	18,400	72,128.00	0.03
316	600339	中油工程	16,600	70,052.00	0.03
317	600998	九州通	5,600	69,216.00	0.03
318	300251	光线传媒	8,700	59,160.00	0.03
319	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.03
320	601808	中海油服	5,900	56,817.00	0.02
321	002939	长城证券	3,400	56,746.00	0.02
322	601162	天风证券	5,100	55,284.00	0.02
323	300433	蓝思科技	7,849	54,707.53	0.02
324	002925	盈趣科技	1,400	54,614.00	0.02
325	600390	五矿资本	5,200	49,036.00	0.02
326	000408	藏格控股	5,900	48,793.00	0.02
327	601828	美凯龙	4,000	48,600.00	0.02
328	000553	安道麦 A	4,500	48,240.00	0.02
329	603260	合盛硅业	1,000	47,060.00	0.02
330	600233	圆通速递	3,600	44,388.00	0.02
331	002625	光启技术	4,340	40,318.60	0.02
332	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
333	603217	元利科技	584	39,268.16	0.02
334	601212	白银有色	8,600	37,754.00	0.02
335	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.02
336	601577	长沙银行	3,700	35,298.00	0.02
337	600733	北汽蓝谷	4,200	34,692.00	0.02

338	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
339	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
340	600299	安迪苏	2,900	30,073.00	0.01
341	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
342	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
343	000977	浪潮信息	40	954.40	0.00

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	002714	牧原股份	18,010,972.18	8.68
2	000876	新希望	14,093,306.00	6.79
3	002124	天邦股份	12,354,198.00	5.95
4	300498	温氏股份	11,646,880.05	5.61
5	000063	中兴通讯	11,083,953.00	5.34
6	002567	唐人神	10,985,790.75	5.29
7	601398	工商银行	9,596,799.00	4.62
8	601012	隆基股份	9,052,651.96	4.36
9	000568	泸州老窖	8,454,569.00	4.07
10	002157	正邦科技	7,801,939.00	3.76
11	002127	南极电商	6,693,359.00	3.22
12	601166	兴业银行	5,478,762.00	2.64
13	601336	新华保险	5,389,904.90	2.60
14	300759	康龙化成	5,341,192.48	2.57
15	601628	中国人寿	5,337,848.00	2.57
16	300033	同花顺	5,236,397.00	2.52
17	600536	中国软件	5,125,770.96	2.47
18	000858	五粮液	4,943,250.00	2.38
19	000001	平安银行	4,927,875.00	2.37
20	002456	欧菲光	4,862,071.00	2.34
21	002475	立讯精密	4,833,811.00	2.33
22	603019	中科曙光	4,833,661.60	2.33
23	002146	荣盛发展	4,350,169.98	2.10
24	600519	贵州茅台	4,330,502.50	2.09

25	600031	三一重工	4,216,208.00	2.03
26	002299	圣农发展	4,167,912.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（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	002714	牧原股份	17,565,683.38	8.46
2	000063	中兴通讯	15,272,093.00	7.36
3	000876	新希望	12,647,098.60	6.09
4	002124	天邦股份	12,308,925.01	5.93
5	601012	隆基股份	11,083,384.61	5.34
6	002567	唐人神	10,671,055.36	5.14
7	300498	温氏股份	10,031,911.00	4.83
8	601398	工商银行	9,821,927.00	4.73
9	002157	正邦科技	7,942,434.00	3.83
10	000001	平安银行	6,666,929.67	3.21
11	300630	普利制药	5,402,179.27	2.60
12	600536	中国软件	5,367,244.00	2.59
13	002456	欧菲光	5,266,048.00	2.54
14	601628	中国人寿	5,248,017.66	2.53
15	300033	同花顺	5,172,508.00	2.49
16	603019	中科曙光	5,143,801.00	2.48
17	002127	南极电商	5,102,056.45	2.46
18	600438	通威股份	5,091,686.22	2.45
19	000568	泸州老窖	4,814,392.84	2.32
20	601166	兴业银行	4,808,239.00	2.32
21	600031	三一重工	4,592,914.19	2.21
22	601336	新华保险	4,409,581.00	2.12
23	002146	荣盛发展	4,247,489.00	2.05
24	000002	万科 A	4,196,514.56	2.02
25	600276	恒瑞医药	4,192,452.50	2.02

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。

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	475,676,652.54
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	457,064,495.22
--------------	----------------

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	5,032,600.00	2.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,063,146.80	2.63
	其中：政策性金融债	6,063,146.80	2.63
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	11,095,746.80	4.82

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	108604	国开 1805	50,040	5,062,546.80	2.20
2	010303	03 国债(3)	30,000	3,034,200.00	1.32
3	019611	19 国债 01	20,000	1,998,400.00	0.87
4	108603	国开 1804	10,000	1,000,600.00	0.43

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

2018 年 10 月 18 日，新华人寿保险股份有限公司（以下简称“新华保险”）发布公告称，由于存在以下违法行为：欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或者备案的保险费率，中国银行保险监督管理委员会决定对新华保险处以罚款 110 万元的行政处罚。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。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	154,882.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	224,812.56
5	应收申购款	26,972.69

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	406,667.34

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
14,173	15,122.53	1,041,882.71	0.49%	213,289,743.15	99.51%

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	0.00	0.0000%

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
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（2010年9月1日）基金份额总额	3,917,182,128.64
本报告期期初基金份额总额	231,642,768.32
本报告期基金总申购份额	21,087,388.94
减：本报告期基金总赎回份额	38,398,531.40
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	214,331,625.86

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。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	
申万宏源	2	296,981,584.58	31.90%	276,579.35	31.90%	-
海通证券	2	182,193,692.28	19.57%	169,683.89	19.57%	-
安信证券	2	116,772,561.36	12.54%	108,752.36	12.54%	-
国金证券	2	114,799,252.99	12.33%	106,912.30	12.33%	-
广发证券	2	65,530,768.03	7.04%	61,029.02	7.04%	-

中信证券	2	54,916,214.82	5.90%	51,143.01	5.90%	-
东方证券	2	53,497,361.20	5.75%	49,819.04	5.75%	-
国泰君安	2	46,279,886.68	4.97%	43,098.14	4.97%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

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

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
申万宏源	8,048,029.20	11.92%	-	-	-	-
海通证券	20,459,070.10	30.30%	-	-	-	-
安信证券	7,268,020.60	10.76%	-	-	-	-
国金证券	11,115,985.74	16.46%	-	-	-	-
广发证券	7,002,850.00	10.37%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	13,569,106.10	20.09%	-	-	-	-
国泰君安	68,346.80	0.10%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	农银大盘蓝筹混合基金 2018 年 4 季度报告	证券时报	2019 年 1 月 21 日
2	农银大盘蓝筹混合基金 2018 年 年度报告	证券时报	2019 年 3 月 27 日
3	农银大盘蓝筹混合基金 2019 年 一季度报告	证券时报	2019 年 4 月 19 日
4	农银大盘蓝筹混合基金—招募说明书更新—2019 年第 1 号	证券时报	2019 年 4 月 15 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、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

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