

农银汇理中证 500 指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 26 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 2020 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.....	12
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 托管人对本中期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.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 市场中性策略执行情况.....	53
7.13 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59

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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 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	60,206,896.42 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，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% × 中证 500 指数 + 5% × 同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	2,397,393.90
本期利润	9,423,603.59
加权平均基金份额本期利润	0.1408
本期加权平均净值利润率	10.21%
本期基金份额净值增长率	10.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	29,038,957.47
期末可供分配基金份额利润	0.4823
期末基金资产净值	89,245,853.89
期末基金份额净值	1.4823
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.23%

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	8.13%	0.84%	8.04%	0.84%	0.09%	0.00%
过去三个月	15.69%	1.07%	15.47%	1.08%	0.22%	-0.01%
过去六个月	10.81%	1.69%	10.84%	1.70%	-0.03%	-0.01%
过去一年	17.05%	1.38%	17.62%	1.39%	-0.57%	-0.01%
过去三年	-5.08%	1.38%	-3.84%	1.39%	-1.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.23%	1.58%	49.11%	1.61%	-0.88%	-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。公司法定代表人为许金超先生。

截止 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 62 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、农银汇理金聚高等级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、农银汇理金汇债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理永益定期开放混合型证券投资基金、农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理量化智慧动力混合型证券投资基金、农银汇理金鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理睿选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金禄债券型证券投资基金、农银汇理永安

混合型证券投资基金、农银汇理稳进多因子股票型证券投资基金、农银汇理永盛定期开放混合型证券投资基金、农银汇理海棠三年定期开放混合型证券投资基金、农银汇理可转债债券型证券投资基金、农银汇理丰泽三年定期开放债券型证券投资基金、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银汇理金盈债券型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、农银汇理丰盈三年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理区间精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理彭博 1-3 年中国利率债指数证券投资基金、农银汇理金祺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、农银汇理创新医疗混合型证券投资基金、农银汇理策略趋势混合型证券投资基金、农银汇理中证国债及政策性金融债 1-5 年指数证券投资基金及农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

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	-	13	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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 0.0259%，日均偏离度为 0.0133%，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 1.4823 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.81%，业绩比较基准收益率为 10.84%。

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

本报告期，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

本报告期，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,422,684.33	4,146,066.22
结算备付金		2,918.07	32,372.60
存出保证金		10,533.69	7,092.20
交易性金融资产	6.4.7.2	84,807,156.17	98,860,143.39
其中：股票投资		84,807,156.17	97,359,243.39
基金投资		-	-
债券投资		-	1,500,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		304,602.87	246,662.67
应收利息	6.4.7.5	929.96	34,017.38
应收股利		-	-
应收申购款		74,171.35	30,625.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		90,622,996.44	103,356,980.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付赎回款		1,133,300.06	451,821.41
应付管理人报酬		54,770.30	63,829.71
应付托管费		10,954.05	12,765.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	36,716.46	56,282.74
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	141,401.68	190,796.89
负债合计		1,377,142.55	775,496.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,206,896.42	76,684,715.96
未分配利润	6.4.7.10	29,038,957.47	25,896,767.60
所有者权益合计		89,245,853.89	102,581,483.56
负债和所有者权益总计		90,622,996.44	103,356,980.29

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4823 元，基金份额总额 60,206,896.42 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		10,142,626.35	14,532,736.50
1.利息收入		24,675.25	40,480.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,582.38	19,267.31
债券利息收入		6,092.87	21,212.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,043,857.29	-2,432,535.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,412,619.04	-3,340,468.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,000.00	-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	629,238.25	914,733.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,026,209.69	16,834,116.23

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	47,884.12	90,675.33
减：二、费用		719,022.76	719,549.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	344,938.94	366,619.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,987.72	73,323.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	106,402.69	96,661.99
5. 利息支出		80.81	3,525.77
其中：卖出回购金融资产支出		80.81	3,525.77
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	198,612.60	179,418.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,423,603.59	13,813,187.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,423,603.59	13,813,187.36

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	76,684,715.96	25,896,767.60	102,581,483.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,423,603.59	9,423,603.59
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）	-16,477,819.54	-6,281,413.72	-22,759,233.26
其中：1. 基金申购款	17,961,771.57	6,626,667.16	24,588,438.73
2. 基金赎回款	-34,439,591.11	-12,908,080.88	-47,347,671.99
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)	60,206,896.42	29,038,957.47	89,245,853.89
项目	上年度可比期间 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

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 Celine Zhang 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

农银汇理中证 500 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可第[1207]号《关于核准农银汇理中证 500 指数证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 711,073,400.42 元,业经普华永道中天会计师

事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 453 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 711,358,644.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 285,243.88 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。其中:中证 500 指数成份股和备选股的投资比例不低于基金资产的 90%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-10%,权证投资范围为基金资产净值的 0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:95% X 中证 500 指数收益率+5% X 同期银行活期存款利率。

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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理中证 500 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 重要会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

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

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

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,422,684.33
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：	5,422,684.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,441,834.63	84,807,156.17	5,365,321.54

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	79,441,834.63	84,807,156.17	5,365,321.54

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	924.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.17
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.23
合计	929.96

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	36,716.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	36,716.46

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,894.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	139,507.60
合计	141,401.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,684,715.96	76,684,715.96
本期申购	17,961,771.57	17,961,771.57
本期赎回(以“-”号填列)	-34,439,591.11	-34,439,591.11
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	60,206,896.42	60,206,896.42

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	55,225,221.61	-29,328,454.01	25,896,767.60
本期利润	2,397,393.90	7,026,209.69	9,423,603.59
本期基金份额交易产生的变动数	-11,892,990.36	5,611,576.64	-6,281,413.72
其中：基金申购款	12,918,015.33	-6,291,348.17	6,626,667.16
基金赎回款	-24,811,005.69	11,902,924.81	-12,908,080.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,729,625.15	-16,690,667.68	29,038,957.47

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	18,205.59
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	297.30
其他	79.49
合计	18,582.38

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	42,414,739.94
减：卖出股票成本总额	40,002,120.90
买卖股票差价收入	2,412,619.04

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 2020年1月1日至2020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	2,000.00
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	2,000.00

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,561,150.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,498,000.00
减：应收利息总额	61,150.00
买卖债券差价收入	2,000.00

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	629,238.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	629,238.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	7,026,209.69
——股票投资	7,030,709.69
——债券投资	-4,500.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	7,026,209.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,084.62
转换费	4,799.50
合计	47,884.12

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	106,402.69
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	106,402.69

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	105.00
合计	198,612.60

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	344,938.94	366,619.48
其中：支付销售机构的客户维护费	154,751.44	161,043.47

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	68,987.72	73,323.89

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 × 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	5,422,684.33	18,205.59	4,236,255.77	18,446.89

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2020 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

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
601880	大连港	2020年6月22日	公告重大事项	1.72	2020年7月8日	1.89	55,090	125,340.50	94,754.80	-
002470	金正大	2020年6月30日	公告重大事项	2.27	2020年7月1日	2.16	28,800	171,219.39	65,376.00	-

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、三道防线”的风险管理组织体系。董事会及其下设的稽核及风险控制委员会是公司风险管理的最高层次，负责建立健全公司全面风险管理体系，审核公司基本风险管理制度、风险偏好、重大风险政策，对风险管理承担最终责任。公司管理层及其下设的风险管理委员会组成风险管理的第二层次，根据董事会要求具体组织和实施公司风险管理工作，

对风险管理承担直接责任。第一层次由各个部门组成，承担业务风险的直接管理责任。公司建立了层次明晰、权责统一、监管明确的三道内部控制防线，实现了业务经营部门、风险管理部门、审计部门的分工协作，前、中、后台的相互制约，以及对公司决策层、管理层、操作层的全面监督和控制。”

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	1,500,900.00
合计	-	1,500,900.00

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

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、以及组合在短期内变现能力的综合指标等进行持续的监测和分析，同时定期统计本基金投资者结构、申购赎回特征，进行压力测试，分析本基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配程度。

截止本报告期末及上年度末，本基金流动性风险可控。

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 2020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	5,422,684.33	-	-	-	5,422,684.33
结算备付金	2,918.07	-	-	-	2,918.07
存出保证金	10,533.69	-	-	-	10,533.69
交易性金融资产	-	-	-	84,807,156.17	84,807,156.17
应收证券清算款	-	-	-	304,602.87	304,602.87
应收利息	-	-	-	929.96	929.96
应收申购款	-	-	-	74,171.35	74,171.35
资产总计	5,436,136.09	-	-	85,186,860.35	90,622,996.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,133,300.06	1,133,300.06
应付管理人报酬	-	-	-	54,770.30	54,770.30
应付托管费	-	-	-	10,954.05	10,954.05

应付交易费用	-	-	-	36,716.46	36,716.46
其他负债	-	-	-	141,401.68	141,401.68
负债总计	-	-	-	1,377,142.55	1,377,142.55
利率敏感度缺口	5,436,136.09	-	-	-83,809,717.80	89,245,853.89
上年度末 2019 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	4,146,066.22	-	-	-	4,146,066.22
结算备付金	32,372.60	-	-	-	32,372.60
存出保证金	7,092.20	-	-	-	7,092.20
交易性金融资产	1,500,900.00	-	-	-97,359,243.39	98,860,143.39
应收证券清算款	-	-	-	246,662.67	246,662.67
应收利息	-	-	-	34,017.38	34,017.38
应收申购款	-	-	-	30,625.83	30,625.83
资产总计	5,686,431.02	-	-	-97,670,549.27	103,356,980.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,821.41	451,821.41
应付管理人报酬	-	-	-	63,829.71	63,829.71
应付托管费	-	-	-	12,765.98	12,765.98
应付交易费用	-	-	-	56,282.74	56,282.74
其他负债	-	-	-	190,796.89	190,796.89
负债总计	-	-	-	775,496.73	775,496.73
利率敏感度缺口	5,686,431.02	-	-	-96,895,052.54	102,581,483.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-	-178.71
	市场利率平行下降25个基点	-	178.71

本基金本报告期末和上年度末未持有利率敏感性资产，因此，市场利率的变动对本基金资产净值

无重大影响。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	84,807,156.17	95.03	97,359,243.39	94.91
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	84,807,156.17	95.03	97,359,243.39	94.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	4,448,617.68	5,103,382.08
业绩比较基准下降 5%	-4,448,617.68	-5,103,382.08	

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	84,807,156.17	93.58
	其中：股票	84,807,156.17	93.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,425,602.40	5.99
8	其他各项资产	390,237.87	0.43
9	合计	90,622,996.44	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	762,375.00	0.85
B	采矿业	1,988,484.06	2.23
C	制造业	49,466,440.23	55.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,937,108.80	2.17
E	建筑业	1,103,774.94	1.24
F	批发和零售业	4,722,608.24	5.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,784,856.48	2.00
H	住宿和餐饮业	283,270.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,507,025.08	10.65
J	金融业	4,332,364.03	4.85
K	房地产业	2,990,246.13	3.35
L	租赁和商务服务业	1,733,958.75	1.94
M	科学研究和技术服务业	615,081.25	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	812,579.80	0.91

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	84,124.80	0.09
Q	卫生和社会工作	623,456.00	0.70
R	文化、体育和娱乐业	1,328,009.00	1.49
S	综合	731,393.58	0.82
	合计	84,807,156.17	95.03

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	300253	卫宁健康	29,514	677,051.16	0.76
2	002127	南极电商	29,700	628,749.00	0.70
3	002821	凯莱英	2,400	583,200.00	0.65
4	600201	生物股份	19,490	542,601.60	0.61
5	002185	华天科技	37,900	512,787.00	0.57
6	600739	辽宁成大	26,400	499,752.00	0.56
7	300558	贝达药业	3,500	489,930.00	0.55
8	600529	山东药玻	8,200	475,600.00	0.53
9	002439	启明星辰	11,300	475,391.00	0.53
10	300088	长信科技	42,100	471,520.00	0.53
11	002385	大北农	50,700	461,877.00	0.52
12	300012	华测检测	23,000	454,480.00	0.51
13	002131	利欧股份	116,659	450,303.74	0.50
14	600079	人福医药	16,400	446,408.00	0.50
15	300285	国瓷材料	13,300	445,683.00	0.50
16	600521	华海药业	12,530	425,142.90	0.48
17	600298	安琪酵母	8,518	421,470.64	0.47
18	002465	海格通信	31,800	411,492.00	0.46
19	600143	金发科技	31,100	409,587.00	0.46
20	600161	天坛生物	9,014	408,604.62	0.46
21	603444	吉比特	700	384,307.00	0.43

22	002075	沙钢股份	30,500	381,250.00	0.43
23	300496	中科创达	4,900	380,730.00	0.43
24	000009	中国宝安	44,520	378,865.20	0.42
25	002223	鱼跃医疗	10,389	378,159.60	0.42
26	603517	绝味食品	5,300	374,922.00	0.42
27	300482	万孚生物	3,600	374,400.00	0.42
28	601099	太平洋	117,700	373,109.00	0.42
29	002212	南洋股份	14,000	372,120.00	0.42
30	002074	国轩高科	13,700	367,708.00	0.41
31	000636	风华高科	12,400	361,956.00	0.41
32	300595	欧普康视	5,200	360,568.00	0.40
33	002273	水晶光电	21,015	360,197.10	0.40
34	300207	欣旺达	19,000	359,100.00	0.40
35	603882	金域医学	4,000	358,000.00	0.40
36	601128	常熟银行	47,300	355,223.00	0.40
37	300418	昆仑万维	14,200	354,432.00	0.40
38	300315	掌趣科技	47,600	348,908.00	0.39
39	600426	华鲁恒升	19,615	346,793.20	0.39
40	002507	涪陵榨菜	9,500	342,095.00	0.38
41	000988	华工科技	13,900	339,577.00	0.38
42	300357	我武生物	5,400	336,150.00	0.38
43	603939	益丰药房	3,660	333,060.00	0.37
44	002340	格林美	66,072	328,377.84	0.37
45	002603	以岭药业	10,400	324,376.00	0.36
46	000975	银泰黄金	20,592	322,882.56	0.36
47	002414	高德红外	10,960	320,908.80	0.36
48	300168	万达信息	14,400	317,808.00	0.36
49	300271	华宇软件	11,200	315,952.00	0.35
50	300212	易华录	5,600	313,600.00	0.35
51	002373	千方科技	12,900	309,471.00	0.35
52	600885	宏发股份	7,680	308,121.60	0.35
53	000513	丽珠集团	6,398	307,167.98	0.34
54	600859	王府井	6,740	307,007.00	0.34
55	002353	杰瑞股份	9,900	306,900.00	0.34
56	600132	重庆啤酒	4,200	306,600.00	0.34
57	601799	星宇股份	2,400	304,800.00	0.34
58	600699	均胜电子	12,800	304,768.00	0.34
59	000547	航天发展	22,000	300,740.00	0.34
60	002156	通富微电	12,000	300,600.00	0.34

61	300024	机器人	21,600	295,272.00	0.33
62	300009	安科生物	16,470	294,813.00	0.33
63	002019	亿帆医药	12,800	294,016.00	0.33
64	002797	第一创业	42,300	292,716.00	0.33
65	002030	达安基因	10,630	289,986.40	0.32
66	002557	洽洽食品	5,291	286,719.29	0.32
67	000750	国海证券	66,030	286,570.20	0.32
68	603858	步长制药	9,900	285,615.00	0.32
69	300017	网宿科技	33,600	285,264.00	0.32
70	002174	游族网络	10,700	279,056.00	0.31
71	600801	华新水泥	11,736	278,260.56	0.31
72	600315	上海家化	5,800	277,820.00	0.31
73	002250	联化科技	12,744	277,819.20	0.31
74	002195	二三四五	98,830	277,712.30	0.31
75	000021	深科技	12,709	277,437.47	0.31
76	002138	顺络电子	11,100	276,945.00	0.31
77	300316	晶盛机电	11,100	274,614.00	0.31
78	600895	张江高科	13,400	272,958.00	0.31
79	600380	健康元	16,772	272,377.28	0.31
80	603233	大参林	3,352	272,249.44	0.31
81	000050	深天马 A	17,700	271,872.00	0.30
82	002152	广电运通	20,800	269,152.00	0.30
83	300058	蓝色光标	34,500	269,100.00	0.30
84	300070	碧水源	32,800	266,336.00	0.30
85	002572	索菲亚	11,000	265,870.00	0.30
86	300244	迪安诊断	7,520	265,456.00	0.30
87	000998	隆平高科	15,900	264,735.00	0.30
88	600486	扬农化工	3,200	264,000.00	0.30
89	000401	冀东水泥	16,300	261,452.00	0.29
90	600845	宝信软件	4,410	260,542.80	0.29
91	600667	太极实业	21,800	257,676.00	0.29
92	600410	华胜天成	18,929	257,434.40	0.29
93	002078	太阳纸业	26,900	256,088.00	0.29
94	600037	歌华有线	16,800	255,360.00	0.29
95	600535	天士力	15,700	254,654.00	0.29
96	300274	阳光电源	17,620	253,551.80	0.28
97	603338	浙江鼎力	3,340	253,071.80	0.28
98	000623	吉林敖东	16,042	252,340.66	0.28
99	002511	中顺洁柔	11,300	251,990.00	0.28

100	600155	华创阳安	21,000	251,790.00	0.28
101	002396	星网锐捷	7,100	250,843.00	0.28
102	600642	申能股份	42,400	250,584.00	0.28
103	002382	蓝帆医疗	8,300	249,913.00	0.28
104	002500	山西证券	38,060	248,912.40	0.28
105	002013	中航机电	31,300	247,270.00	0.28
106	002690	美亚光电	4,700	247,220.00	0.28
107	000630	铜陵有色	127,700	246,461.00	0.28
108	601233	桐昆股份	19,100	243,716.00	0.27
109	002926	华西证券	22,800	242,364.00	0.27
110	600126	杭钢股份	23,290	242,216.00	0.27
111	600879	航天电子	37,560	241,886.40	0.27
112	603707	健友股份	3,700	238,909.00	0.27
113	600153	建发股份	29,400	238,140.00	0.27
114	000739	普洛药业	10,200	237,558.00	0.27
115	603659	璞泰来	2,300	236,946.00	0.27
116	300010	立思辰	12,000	234,840.00	0.26
117	600884	杉杉股份	19,655	231,732.45	0.26
118	002281	光迅科技	7,049	231,630.14	0.26
119	600415	小商品城	47,000	228,890.00	0.26
120	600167	联美控股	15,830	227,002.20	0.25
121	600811	东方集团	51,330	226,878.60	0.25
122	600216	浙江医药	11,700	225,342.00	0.25
123	001914	招商积余	7,300	224,329.00	0.25
124	600804	鹏博士	24,700	221,806.00	0.25
125	300251	光线传媒	20,300	221,473.00	0.25
126	600728	佳都科技	24,200	220,462.00	0.25
127	002268	卫士通	10,140	216,387.60	0.24
128	300001	特锐德	10,300	215,682.00	0.24
129	300115	长盈精密	9,420	215,247.00	0.24
130	002028	思源电气	10,508	214,993.68	0.24
131	600909	华安证券	31,300	213,779.00	0.24
132	002294	信立泰	7,200	213,552.00	0.24
133	600779	水井坊	3,400	212,228.00	0.24
134	600511	国药股份	5,200	211,484.00	0.24
135	300002	神州泰岳	33,900	209,841.00	0.24
136	000581	威孚高科	10,100	208,868.00	0.23
137	600325	华发股份	29,358	207,267.48	0.23
138	000686	东北证券	24,300	205,335.00	0.23

139	600418	江淮汽车	23,000	203,090.00	0.23
140	601689	拓普集团	7,275	202,972.50	0.23
141	000997	新大陆	12,700	202,946.00	0.23
142	600528	中铁工业	23,000	202,860.00	0.23
143	002387	维信诺	14,200	202,776.00	0.23
144	600446	金证股份	10,400	201,760.00	0.23
145	600827	百联股份	13,900	200,855.00	0.23
146	603883	老百姓	2,000	200,080.00	0.22
147	600460	士兰微	13,617	199,897.56	0.22
148	000999	华润三九	6,800	198,492.00	0.22
149	600598	北大荒	12,300	198,030.00	0.22
150	002242	九阳股份	5,300	197,531.00	0.22
151	600959	江苏有线	51,800	194,768.00	0.22
152	600733	北汽蓝谷	30,200	194,186.00	0.22
153	002317	众生药业	11,300	193,908.00	0.22
154	601168	西部矿业	33,000	191,400.00	0.21
155	603806	福斯特	3,816	190,456.56	0.21
156	600256	广汇能源	70,400	190,080.00	0.21
157	603000	人民网	9,500	188,385.00	0.21
158	000878	云南铜业	17,600	186,736.00	0.21
159	600260	凯乐科技	13,800	186,576.00	0.21
160	300296	利亚德	30,700	186,349.00	0.21
161	000564	供销大集	41,500	186,335.00	0.21
162	002368	太极股份	4,250	185,682.50	0.21
163	300630	普利制药	2,500	184,875.00	0.21
164	600820	隧道股份	32,700	184,755.00	0.21
165	600704	物产中大	43,700	183,977.00	0.21
166	002670	国盛金控	20,104	183,951.60	0.21
167	002081	金螳螂	23,300	183,138.00	0.21
168	600839	四川长虹	63,800	183,106.00	0.21
169	300113	顺网科技	7,200	182,880.00	0.20
170	600497	驰宏锌锗	52,800	181,632.00	0.20
171	300166	东方国信	14,579	180,925.39	0.20
172	603605	珀莱雅	1,000	180,020.00	0.20
173	002124	天邦股份	14,000	179,900.00	0.20
174	002080	中材科技	11,600	179,800.00	0.20
175	600673	东阳光	26,018	179,784.38	0.20
176	600572	康恩贝	32,465	178,557.50	0.20
177	600008	首创股份	58,900	177,289.00	0.20

178	002221	东华能源	20,006	175,852.74	0.20
179	603866	桃李面包	3,440	175,061.60	0.20
180	300618	寒锐钴业	2,800	173,656.00	0.19
181	600549	厦门钨业	14,600	172,864.00	0.19
182	600718	东软集团	15,000	172,500.00	0.19
183	000158	常山北明	16,514	172,406.16	0.19
184	000800	一汽解放	16,000	171,840.00	0.19
185	601179	中国西电	35,500	171,820.00	0.19
186	002920	德赛西威	2,800	171,724.00	0.19
187	300026	红日药业	31,100	171,672.00	0.19
188	002217	合力泰	32,400	170,100.00	0.19
189	600875	东方电气	19,200	169,920.00	0.19
190	600171	上海贝岭	9,700	168,586.00	0.19
191	600021	上海电力	22,700	167,980.00	0.19
192	601966	玲珑轮胎	8,300	167,660.00	0.19
193	002831	裕同科技	6,060	166,710.60	0.19
194	000729	燕京啤酒	24,300	166,455.00	0.19
195	600060	海信视像	13,600	165,240.00	0.19
196	600567	山鹰纸业	55,800	164,610.00	0.18
197	000877	天山股份	10,840	163,684.00	0.18
198	600094	大名城	27,500	163,625.00	0.18
199	600881	亚泰集团	56,100	163,251.00	0.18
200	002399	海普瑞	6,500	162,760.00	0.18
201	600862	中航高科	9,600	162,432.00	0.18
202	000060	中金岭南	43,200	160,704.00	0.18
203	600645	中源协和	5,685	160,601.25	0.18
204	600160	巨化股份	23,300	160,537.00	0.18
205	002709	天赐材料	4,740	160,164.60	0.18
206	002056	横店东磁	14,200	159,750.00	0.18
207	000090	天健集团	22,686	156,760.26	0.18
208	600597	光明乳业	10,500	156,030.00	0.17
209	002458	益生股份	10,200	155,754.00	0.17
210	002429	兆驰股份	31,400	155,430.00	0.17
211	603228	景旺电子	4,394	154,624.86	0.17
212	300133	华策影视	21,300	154,425.00	0.17
213	600026	中远海能	23,900	154,394.00	0.17
214	603712	七一二	4,000	153,520.00	0.17
215	600754	锦江酒店	5,500	152,625.00	0.17
216	600580	卧龙电驱	13,500	151,740.00	0.17

217	600967	内蒙一机	14,600	151,694.00	0.17
218	603568	伟明环保	6,524	151,356.80	0.17
219	600273	嘉化能源	17,300	151,202.00	0.17
220	601005	重庆钢铁	101,300	150,937.00	0.17
221	600392	盛和资源	21,310	150,235.50	0.17
222	000629	攀钢钒钛	74,500	149,745.00	0.17
223	002648	卫星石化	9,200	149,684.00	0.17
224	002233	塔牌集团	12,400	149,172.00	0.17
225	600282	南钢股份	46,100	148,903.00	0.17
226	002203	海亮股份	17,000	148,750.00	0.17
227	600755	厦门国贸	22,468	148,288.80	0.17
228	000960	锡业股份	17,300	148,088.00	0.17
229	002085	万丰奥威	22,800	147,744.00	0.17
230	002004	华邦健康	27,365	147,223.70	0.16
231	002807	江阴银行	37,460	147,217.80	0.16
232	600039	四川路桥	38,400	146,688.00	0.16
233	600064	南京高科	15,000	145,800.00	0.16
234	600737	中粮糖业	18,500	143,930.00	0.16
235	601118	海南橡胶	29,600	143,856.00	0.16
236	000970	中科三环	14,700	143,766.00	0.16
237	600166	福田汽车	79,800	143,640.00	0.16
238	601975	招商南油	60,000	143,400.00	0.16
239	000598	兴蓉环境	31,100	143,060.00	0.16
240	600195	中牧股份	8,814	143,051.22	0.16
241	600566	济川药业	5,600	142,576.00	0.16
242	000690	宝新能源	30,200	142,544.00	0.16
243	300182	捷成股份	35,700	142,443.00	0.16
244	000778	新兴铸管	41,500	142,345.00	0.16
245	600563	法拉电子	2,300	142,140.00	0.16
246	300324	旋极信息	21,268	141,644.88	0.16
247	002110	三钢闽光	21,250	141,525.00	0.16
248	300474	景嘉微	2,100	141,330.00	0.16
249	600515	海航基础	27,000	140,400.00	0.16
250	600466	蓝光发展	26,000	140,140.00	0.16
251	603816	顾家家居	3,100	139,531.00	0.16
252	002925	盈趣科技	2,400	139,056.00	0.16
253	002506	协鑫集成	52,900	138,069.00	0.15
254	600373	中文传媒	11,700	137,826.00	0.15
255	002183	怡亚通	25,700	137,752.00	0.15

256	000402	金融街	20,700	137,448.00	0.15
257	000400	许继电气	10,400	137,280.00	0.15
258	002635	安洁科技	5,484	136,551.60	0.15
259	600435	北方导航	18,000	136,080.00	0.15
260	000681	视觉中国	7,300	135,926.00	0.15
261	002038	双鹭药业	10,600	135,786.00	0.15
262	002745	木林森	8,800	135,608.00	0.15
263	000089	深圳机场	17,700	135,582.00	0.15
264	002191	劲嘉股份	15,200	135,432.00	0.15
265	000967	盈峰环境	16,400	135,300.00	0.15
266	000738	航发控制	9,900	135,135.00	0.15
267	002092	中泰化学	29,700	134,541.00	0.15
268	002048	宁波华翔	8,700	134,328.00	0.15
269	002595	豪迈科技	6,900	134,274.00	0.15
270	601860	紫金银行	31,700	134,091.00	0.15
271	601106	中国一重	47,700	134,037.00	0.15
272	600808	马钢股份	51,700	133,386.00	0.15
273	600643	爱建集团	16,770	133,321.50	0.15
274	000983	西山煤电	35,350	132,562.50	0.15
275	000930	中粮科技	19,400	132,502.00	0.15
276	601333	广深铁路	58,800	132,300.00	0.15
277	601098	中南传媒	12,500	132,250.00	0.15
278	600120	浙江东方	19,241	132,185.67	0.15
279	000830	鲁西化工	17,700	132,042.00	0.15
280	600633	浙数文化	13,500	132,030.00	0.15
281	000039	中集集团	18,260	132,019.80	0.15
282	600376	首开股份	22,400	131,264.00	0.15
283	000825	太钢不锈	39,500	131,140.00	0.15
284	600729	重庆百货	4,197	131,030.34	0.15
285	600258	首旅酒店	8,500	130,645.00	0.15
286	600388	龙净环保	14,800	130,240.00	0.15
287	600649	城投控股	21,800	129,492.00	0.15
288	600675	中华企业	31,700	129,019.00	0.14
289	000415	渤海租赁	42,900	127,842.00	0.14
290	000563	陕国投 A	34,366	127,497.86	0.14
291	600056	中国医药	9,000	127,350.00	0.14
292	601866	中远海发	68,800	126,592.00	0.14
293	601718	际华集团	38,100	126,492.00	0.14
294	002372	伟星新材	10,860	126,301.80	0.14

295	300180	华峰超纤	14,700	125,832.00	0.14
296	002407	多氟多	11,800	125,552.00	0.14
297	000501	鄂武商 A	8,005	125,518.40	0.14
298	600776	东方通信	8,300	125,247.00	0.14
299	002815	崇达技术	6,100	123,403.00	0.14
300	002839	张家港行	21,300	122,688.00	0.14
301	002010	传化智联	22,500	122,400.00	0.14
302	600022	山东钢铁	94,850	122,356.50	0.14
303	002064	华峰氨纶	24,100	122,187.00	0.14
304	002640	跨境通	18,800	122,012.00	0.14
305	000012	南玻 A	24,195	121,458.90	0.14
306	603077	和邦生物	91,840	121,228.80	0.14
307	600500	中化国际	23,913	120,999.78	0.14
308	002583	海能达	15,900	120,681.00	0.14
309	000078	海王生物	28,800	120,672.00	0.14
310	000932	华菱钢铁	31,920	120,338.40	0.13
311	600062	华润双鹤	9,052	119,667.44	0.13
312	002375	亚厦股份	11,700	119,574.00	0.13
313	000883	湖北能源	33,800	118,976.00	0.13
314	600266	城建发展	23,340	118,333.80	0.13
315	601615	明阳智能	9,500	118,275.00	0.13
316	000959	首钢股份	27,400	117,820.00	0.13
317	000807	云铝股份	27,000	117,720.00	0.13
318	000685	中山公用	15,276	117,625.20	0.13
319	603486	科沃斯	3,880	117,214.80	0.13
320	600316	洪都航空	7,400	116,920.00	0.13
321	000301	东方盛虹	21,000	116,760.00	0.13
322	601699	潞安环能	20,700	115,299.00	0.13
323	002244	滨江集团	27,000	115,290.00	0.13
324	000559	万向钱潮	23,800	115,192.00	0.13
325	000027	深圳能源	24,720	114,700.80	0.13
326	601000	唐山港	51,326	114,456.98	0.13
327	002155	湖南黄金	14,500	114,260.00	0.13
328	000488	晨鸣纸业	23,100	114,114.00	0.13
329	000028	国药一致	2,532	113,965.32	0.13
330	000519	中兵红箭	12,029	113,313.18	0.13
331	000031	大悦城	22,200	112,998.00	0.13
332	600782	新钢股份	27,600	112,608.00	0.13
333	000528	柳工	17,820	112,444.20	0.13

334	002936	郑州银行	32,550	111,972.00	0.13
335	000987	越秀金控	9,500	110,770.00	0.12
336	002444	巨星科技	9,300	110,484.00	0.12
337	600908	无锡银行	22,400	109,984.00	0.12
338	600640	号百控股	5,500	109,725.00	0.12
339	002440	闰土股份	11,953	109,250.42	0.12
340	002625	光启技术	15,000	108,750.00	0.12
341	002266	浙富控股	27,830	107,702.10	0.12
342	600777	新潮能源	70,700	107,464.00	0.12
343	600073	上海梅林	11,300	107,237.00	0.12
344	000156	华数传媒	9,900	107,217.00	0.12
345	601717	郑煤机	18,000	106,020.00	0.12
346	300459	金科文化	30,547	105,387.15	0.12
347	002390	信邦制药	23,050	105,108.00	0.12
348	600312	平高电气	14,100	104,622.00	0.12
349	300072	三聚环保	24,400	104,432.00	0.12
350	601958	金铂股份	16,800	103,824.00	0.12
351	601608	中信重工	30,000	102,600.00	0.11
352	600291	西水股份	11,300	102,265.00	0.11
353	002701	奥瑞金	24,332	101,951.08	0.11
354	000046	泛海控股	27,000	101,790.00	0.11
355	002434	万里扬	11,700	101,556.00	0.11
356	002424	贵州百灵	12,200	101,260.00	0.11
357	600765	中航重机	9,800	100,156.00	0.11
358	600138	中青旅	10,125	99,933.75	0.11
359	000758	中色股份	23,900	99,902.00	0.11
360	600409	三友化工	21,400	99,724.00	0.11
361	000887	中鼎股份	12,700	99,695.00	0.11
362	600557	康缘药业	7,152	99,555.84	0.11
363	002505	大康农业	44,230	99,517.50	0.11
364	000008	神州高铁	33,700	99,078.00	0.11
365	000898	鞍钢股份	40,400	98,980.00	0.11
366	002563	森马服饰	14,000	98,700.00	0.11
367	600863	内蒙华电	40,100	98,646.00	0.11
368	002589	瑞康医药	18,390	98,570.40	0.11
369	600751	海航科技	31,200	97,656.00	0.11
370	601228	广州港	32,000	97,280.00	0.11
371	002002	鸿达兴业	26,829	96,852.69	0.11
372	000813	德展健康	15,600	96,720.00	0.11

373	600507	方大特钢	18,605	96,559.95	0.11
374	600158	中体产业	11,800	96,524.00	0.11
375	600970	中材国际	18,250	96,360.00	0.11
376	000712	锦龙股份	7,700	96,250.00	0.11
377	600835	上海机电	5,600	94,808.00	0.11
378	601880	大连港	55,090	94,754.80	0.11
379	601200	上海环境	7,860	94,320.00	0.11
380	600478	科力远	20,025	94,317.75	0.11
381	600639	浦东金桥	5,900	94,282.00	0.11
382	603885	吉祥航空	10,300	93,730.00	0.11
383	600259	广晟有色	3,100	93,000.00	0.10
384	000826	启迪环境	12,500	92,750.00	0.10
385	600545	卓郎智能	19,600	92,708.00	0.10
386	300134	大富科技	6,610	92,407.80	0.10
387	600717	天津港	20,880	92,289.60	0.10
388	600648	外高桥	6,500	91,910.00	0.10
389	002503	搜于特	32,140	90,313.40	0.10
390	601928	凤凰传媒	13,200	89,760.00	0.10
391	603198	迎驾贡酒	4,100	89,257.00	0.10
392	600125	铁龙物流	15,969	89,107.02	0.10
393	000732	泰禾集团	17,400	88,566.00	0.10
394	002249	大洋电机	24,500	88,445.00	0.10
395	601598	中国外运	27,200	87,856.00	0.10
396	600348	阳泉煤业	20,800	87,776.00	0.10
397	600823	世茂股份	19,400	86,718.00	0.10
398	000061	农产品	11,700	86,697.00	0.10
399	002665	首航高科	35,060	85,546.40	0.10
400	601611	中国核建	13,800	85,284.00	0.10
401	600329	中新药业	4,900	84,868.00	0.10
402	002302	西部建设	8,800	84,480.00	0.09
403	002867	周大生	3,800	84,246.00	0.09
404	300376	易事特	16,200	84,240.00	0.09
405	603377	东方时尚	5,080	84,124.80	0.09
406	600582	天地科技	28,600	83,798.00	0.09
407	002901	大博医疗	700	83,503.00	0.09
408	600307	酒钢宏兴	54,100	83,314.00	0.09
409	600748	上实发展	16,160	82,577.60	0.09
410	000990	诚志股份	6,500	82,485.00	0.09
411	600901	江苏租赁	15,700	81,797.00	0.09

412	000718	苏宁环球	26,200	80,958.00	0.09
413	603888	新华网	3,600	80,496.00	0.09
414	600017	日照港	32,300	80,427.00	0.09
415	600141	兴发集团	8,968	80,263.60	0.09
416	002419	天虹股份	8,400	80,220.00	0.09
417	601678	滨化股份	18,900	80,136.00	0.09
418	600664	哈药股份	25,990	80,049.20	0.09
419	000717	韶钢松山	20,900	79,420.00	0.09
420	002544	杰赛科技	6,000	78,900.00	0.09
421	000062	深圳华强	5,410	78,661.40	0.09
422	000869	张裕 A	2,300	78,545.00	0.09
423	000543	皖能电力	19,530	78,510.60	0.09
424	000848	承德露露	11,148	78,036.00	0.09
425	002093	国脉科技	8,800	77,880.00	0.09
426	002416	爱施德	10,820	77,687.60	0.09
427	002128	露天煤业	10,000	77,500.00	0.09
428	300257	开山股份	5,900	77,113.00	0.09
429	600277	亿利洁能	23,600	76,936.00	0.09
430	600869	智慧能源	19,100	76,400.00	0.09
431	002408	齐翔腾达	12,280	76,258.80	0.09
432	002653	海思科	2,800	74,508.00	0.08
433	002948	青岛银行	14,400	73,296.00	0.08
434	300197	铁汉生态	28,550	72,517.00	0.08
435	603328	依顿电子	6,900	71,967.00	0.08
436	000553	安道麦 A	7,900	71,258.00	0.08
437	603515	欧普照明	2,580	70,614.60	0.08
438	600565	迪马股份	25,200	70,308.00	0.08
439	000537	广宇发展	9,600	70,080.00	0.08
440	603650	彤程新材	3,000	69,810.00	0.08
441	603766	隆鑫通用	17,950	69,466.50	0.08
442	603983	丸美股份	800	68,824.00	0.08
443	603056	德邦股份	5,000	67,650.00	0.08
444	600787	中储股份	15,400	67,606.00	0.08
445	002491	通鼎互联	13,200	67,584.00	0.08
446	601019	山东出版	10,800	67,500.00	0.08
447	600350	山东高速	10,900	66,926.00	0.07
448	600339	中油工程	29,300	66,511.00	0.07
449	600053	九鼎投资	2,200	65,648.00	0.07
450	002470	金正大	28,800	65,376.00	0.07

451	600770	综艺股份	13,600	65,280.00	0.07
452	601869	长飞光纤	2,100	64,701.00	0.07
453	601139	深圳燃气	9,900	64,350.00	0.07
454	000600	建投能源	12,500	63,625.00	0.07
455	600338	西藏珠峰	6,340	63,400.00	0.07
456	002051	中工国际	8,656	63,015.68	0.07
457	603317	天味食品	1,105	61,415.90	0.07
458	603786	科博达	800	60,280.00	0.07
459	601016	节能风电	28,400	60,208.00	0.07
460	600657	信达地产	14,579	60,065.48	0.07
461	600694	大商股份	2,500	59,975.00	0.07
462	002285	世联行	21,363	59,602.77	0.07
463	002118	紫鑫药业	13,400	59,496.00	0.07
464	600985	淮北矿业	7,500	58,425.00	0.07
465	600428	中远海特	18,726	57,676.08	0.06
466	601801	皖新传媒	10,300	57,268.00	0.06
467	600707	彩虹股份	12,500	57,000.00	0.06
468	600575	淮河能源	27,100	56,639.00	0.06
469	600006	东风汽车	14,000	56,420.00	0.06
470	000937	冀中能源	18,500	55,870.00	0.06
471	600757	长江传媒	10,500	53,445.00	0.06
472	601865	福莱特	2,800	52,640.00	0.06
473	600996	贵广网络	7,300	52,049.00	0.06
474	600623	华谊集团	9,700	50,052.00	0.06
475	600874	创业环保	7,500	49,800.00	0.06
476	603556	海兴电力	3,360	48,518.40	0.05
477	002941	新疆交建	3,300	46,695.00	0.05
478	600058	五矿发展	7,400	44,696.00	0.05
479	000785	居然之家	5,200	41,184.00	0.05
480	601003	柳钢股份	9,100	40,313.00	0.05
481	603868	飞科电器	800	39,464.00	0.04
482	600903	贵州燃气	4,000	39,360.00	0.04
483	002946	新乳业	2,200	38,170.00	0.04
484	601127	小康股份	4,500	37,395.00	0.04
485	000025	特力 A	1,990	36,476.70	0.04
486	603355	莱克电气	1,400	34,846.00	0.04
487	600335	国机汽车	7,500	34,650.00	0.04
488	601969	海南矿业	7,000	34,160.00	0.04
489	002818	富森美	2,650	32,595.00	0.04

490	601512	中新集团	2,800	32,200.00	0.04
491	603379	三美股份	1,480	31,775.60	0.04
492	603225	新凤鸣	2,956	29,500.88	0.03
493	601811	新华文轩	2,800	28,476.00	0.03
494	002423	中粮资本	3,200	27,840.00	0.03
495	001872	招商港口	1,800	26,190.00	0.03
496	603025	大豪科技	3,233	23,503.91	0.03
497	600917	重庆燃气	3,200	22,848.00	0.03
498	601068	中铝国际	5,500	21,505.00	0.02
499	603256	宏和科技	1,700	19,448.00	0.02
500	002957	科瑞技术	700	16,730.00	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	002185	华天科技	543,745.00	0.53
2	300558	贝达药业	432,982.00	0.42
3	600529	山东药玻	408,387.00	0.40
4	000800	一汽解放	379,822.00	0.37
5	300357	我武生物	361,956.00	0.35
6	300212	易华录	338,245.00	0.33
7	300482	万孚生物	337,966.00	0.33
8	300271	华宇软件	324,696.00	0.32
9	300595	欧普康视	323,967.00	0.32
10	300496	中科创达	321,810.00	0.31
11	300017	网宿科技	315,012.00	0.31
12	002557	洽洽食品	298,618.59	0.29
13	300024	机器人	297,763.00	0.29
14	002156	通富微电	290,631.00	0.28
15	002138	顺络电子	283,896.00	0.28
16	600153	建发股份	283,860.00	0.28
17	300070	碧水源	282,370.00	0.28

18	600667	太极实业	265,632.00	0.26
19	000630	铜陵有色	252,899.00	0.25
20	002396	星网锐捷	243,536.00	0.24

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	300014	亿纬锂能	898,295.10	0.88
2	600745	闻泰科技	885,939.00	0.86
3	002371	北方华创	860,123.00	0.84
4	002384	东山精密	754,775.50	0.74
5	002129	中环股份	747,545.00	0.73
6	600584	长电科技	734,277.00	0.72
7	002463	沪电股份	684,339.52	0.67
8	002049	紫光国微	648,533.00	0.63
9	300383	光环新网	641,261.56	0.63
10	600763	通策医疗	639,784.00	0.62
11	300529	健帆生物	582,554.00	0.57
12	002812	恩捷股份	580,829.10	0.57
13	000066	中国长城	556,564.64	0.54
14	002065	东华软件	545,049.00	0.53
15	600536	中国软件	541,347.00	0.53
16	601100	恒立液压	464,351.00	0.45
17	002180	纳思达	417,882.00	0.41
18	600150	中国船舶	359,071.00	0.35
19	601872	招商轮船	351,826.00	0.34
20	300027	华谊兄弟	323,741.00	0.32

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	20,419,323.99
卖出股票收入（成交）总额	42,414,739.94

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	10,533.69
2	应收证券清算款	304,602.87
3	应收股利	-
4	应收利息	929.96
5	应收申购款	74,171.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	390,237.87

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.13.5.1 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。

7.13.5.2 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
6,593	9,131.94	494,996.43	0.82%	59,711,899.99	99.18%

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	38,981.19	0.0647%

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	76,684,715.96
本报告期基金总申购份额	17,961,771.57
减:本报告期基金总赎回份额	34,439,591.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	60,206,896.42

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

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门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	39,242,147.23	62.56%	36,546.60	62.56%	-
高华证券	2	23,483,144.20	37.44%	21,871.88	37.44%	-

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	1,001,600.00	100.00%	500,000.00	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	农银汇理中证 500 指数基金 2019 年第四季度报告	上海证券报	2020 年 1 月 21 日
2	农银汇理基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报	2020 年 3 月 13 日
3	农银汇理中证 500 指数基金 2019 年年度报告	上海证券报	2020 年 4 月 14 日
4	农银汇理中证 500 指数基金 2020 年一季度报告	上海证券报	2020 年 4 月 22 日
5	关于农银汇理基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	上海证券报	2020 年 5 月 29 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

无。

§ 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

2020 年 8 月 28 日