

农银汇理中证500指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告期截止日期:2014年6月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事及监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责任。

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2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，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。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银中证500指数
交易代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月29日
报告期末基金份额总额	102,820,783.95份

本基金为被动管理的指数基金，通过严格的的投资纪律和数量化的风险管理，力争将基金净值对行业比较基准的跟踪误差控制在4%以内，日平均跟踪偏离度控制在0.35%以内，以实现对标的指数的有效追踪。

本基金把投资于按照标的指数成分股及其权重配置进行投资和拟合标的指数的业务特征。

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。

基金管理人 农银汇理基金管理有限公司

交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)

1,399,245.55

2,394,007.30

0.0221

108,631,444.18

1,0565

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)和除利息费用后的余额。本期利润即为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所属基金的业绩指标并不代表持有人的各类费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 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。

3.2.1 本期报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 收益率差③ ①-③ ②-④

过去三个月 2.58% 1.00% 2.11% 1.01% 0.47% -0.01%

3.2.2 本期报告期基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 收益率差③ ①-③ ②-④

过去三个月 2.58% 0.87% 2.28% 0.87% 0.30% 0.00%

3.3 本基金报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 收益率差③ ①-③ ②-④

过去三个月 2.58% 0.87% 2.28% 0.87% 0.30% 0.00%

3.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 1,093,246.00 1.01

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 餐饮和住宿业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融、房地产 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

合计 1,093,246.00 1.01

3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600570 恒生电子 26,659 783,774.60 0.72

2 600587 新华医疗 7,456 555,844.80 0.51

3 002190 成飞集成 9,310 549,296.00 0.51

4 600557 康健药业 18,793 539,359.10 0.50

5 600418 江淮汽车 52,000 530,400.00 0.49

6 000559 万向钱潮 51,540 529,831.20 0.49

7 600879 航天电子 44,930 529,275.40 0.49

8 000998 隆基股份 18,750 515,250.00 0.47

9 600312 平高电气 36,900 514,386.00 0.47

10 002022 中华企业 21,200 488,660.00 0.45

3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002252 上海莱士 9,680 612,744.00 0.56

2 021671 东方锆业 23,800 271,082.00 0.25

3 026265 勐腊光大 14,800 209,420.00 0.19

3.7 报告期末按权证品种的证券投资基金组合

序号 权证品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 4,505,400.00 4.15

2 央行票据 - -

3 金融债券 - -

4 中-政策性金融债 - -

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 4,505,400.00 4.15

3.8 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股票投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 019314 13国债14 30,000 3,000,900.00 2.76

2 019322 13国债22 15,000 1,504,500.00 1.38

3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的十名资产支持证券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 019314 13国债14 30,000 3,000,900.00 2.76

2 019322 13国债22 15,000 1,504,500.00 1.38

3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 权证代码 名称 金额(元)

1 000002 中国500指数增强 45,328.54

2 000003 中国500指数增强 541,217.33

3 000004 中国500指数增强 144,076.55

4 000005 中国500指数增强 6,983.38

5 000006 中国500指数增强 745,605.80

3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600418 江淮汽车 530,400.00 0.49

2 000879 航天电子 35,859,799.11 3.26

3 000559 万向钱潮 39,047,901.18 3.45

4 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

5 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

6 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

7 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

8 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

9 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

10 000557 康健药业 102,820,783.95 9.38

3.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 金额(元)

1 019314 13国债14 46,149,442.30 41.90

2 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

3 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

4 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

5 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

6 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

7 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

8 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

9 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

10 019322 13国债22 2,103,600.00 1.88

3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细