农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

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

2.4信息披露方式

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。

§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

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。

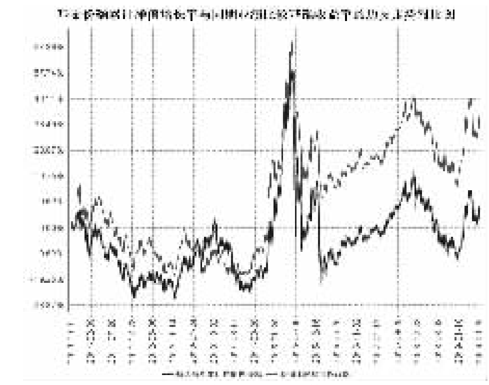
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30日。

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



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遵规守信情况的说明

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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	1,127,214.16
应收利息	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	-	-
资产总计	233,802,862.54	212,393,808.68
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	214,331,625.86	231,642,768.32
未分配利润	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	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	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	13,955,398.24	9,081,589.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	63,400.36	112,629.12
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,885,563.01	1,580,432.99
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	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)	49,417.46	39,127.09
减:二、费用	3,505,380.21	4,299,193.76
1. 管理人报酬	1,716,132.52	1,959,723.50
2. 托管费	286,021.94	326,620.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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。

6.4.6关联方关系

6.4.6.1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。

6.4.6.2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

6.4.7本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1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。

6.4.7.1.2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。

6.4.7.1.3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。

6.4.7.1.4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。

6.4.7.1.5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。

6.4.7.2关联方报酬

6.4.7.2.1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

6.4.7.2.2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。

6.4.7.2.3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。

6.4.7.3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。

6.4.7.4各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1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。

6.4.7.4.2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。

6.4.7.5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。

6.4.7.6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。

6.4.7.7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。

6.4.8期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1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										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

6.4.8.2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	-

6.4.8.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1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。

6.4.8.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

§7 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前十名股票投资明细

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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于农银汇理基金管理有限公司网站的半年报告正文。

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	-	-	-	-	-	-

§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。

农银汇理基金管理有限公司
2019年8月23日