

农银汇理中证500指数证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息	
财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2014)第20568号

6.2 审计报告的基本内容

6.2 审计报告的基本内容	
审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	农银汇理中证500指数证券投资基金基金业协会人。
引言段	我们审计了后附的农银汇理中证500指数证券投资基金(以下简称“农银汇理中证500指数基金”)2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表和所有者权益变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人的责任。本基金的基金管理人根据法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同,真实、准确、完整地反映了本基金2013年度的经营成果及年末的财务状况。
(1)按照企业会计准则的规定编制的财务报表,并使其实现公允反映;	(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报;
被审计者的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们计划和实施审计工作,以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。在审计过程中,我们实施了包括核查会计记录等在内的审计程序,但并不对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价财务报表编制的恰当性和对会计政策的合理性,以及对财务报表的总体印象。
(3)对基金收益的实现和分配,由执行份额的基金管理人向基金份额持有人支付红利时,将按基金合同规定的比例向基金份额持有人支付红利收入;红利收入按除息日的基金份额净值折算成现金支付。	(4)对于基金持有的企业债券利息收入,由执行份额的基金管理人向基金份额持有人支付红利时,将按基金合同规定的比例向基金份额持有人支付红利收入;对于基金持有的企业债券利息收入,将按基金合同规定的比例向基金份额持有人支付红利收入。
风险提示段	本基金为股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.1 基金基本情况

基金简称	农银汇理中证500指数证券投资基金
基金代码	160601
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	134,106,832.32份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金资产说明

投资目标	本基金为被动投资的指数基金,通过严格的投資纪律力争跟踪误差最小化,并力求在扣除相关费用后获得与标的指数相似的回报。
投资策略	本基金将把资产配置于所选的成分股及其权重配比进行投资组合构建的指数组合的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×中证500指数+5%×银行活期存款利率(税前)
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
姓名	翟爱东	董宇波
信息披露负责人	联系电话 021-61095588	95559
电子邮件	hejulog@abc.com.cn	peitom@bankcomm.com
客户服务电话	021-61095599	95559
传真	021-61095566	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	http://www.abc.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2013年12月31日	2012年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日
资产:				
银行存款	32,028.19	10,433,938.21		
结算备付金	1,995,698.45	1,825,789.62		
衍生工具保证金	22,822.53	500,000.00		
应收利息	137,324,990.16	222,717,987.22		
其中:股票投资	131,354,390.16	222,717,987.22		
贵金属投资	-	-		
债权投资	5,970,600.00	-		
资产总计	138,832,285.99	234,719,503.31	706,459,906.40	
负债:				
应付赎回款	1,0353	0.8945	0.9931	
负债总计	1,0353	0.8945	0.9931	
所有者权益:				
基金份额净值增长率	3.53%	-10.55%	-0.69%	
基金份额净值	1.0353	-0.8945	0.9931	

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,本期期间内已实现收益加上本期公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期期间内已实现收益加上本期公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期期间内已实现收益加上本期公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期期间内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12月31日。

3.2 基金净值增长情况

3.3 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.4 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.5 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.6 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.7 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.8 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.9 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.10 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.11 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.12 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.13 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.14 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.15 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.16 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.17 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.18 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.19 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.20 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.21 基金份额净值增长率及同期回报基准收益率的比较

3.22 基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期回报基准收益率的比较

3.23 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.24 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.25 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.26 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.27 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.28 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.29 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.30 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.31 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.32 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.33 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.34 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.35 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.36 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.37 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.38 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.39 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.40 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.41 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.42 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.43 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.44 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.45 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.46 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.47 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.48 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.49 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.50 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.51 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.52 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.53 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.54 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.55 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.56 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.57 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.58 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.59 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.60 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.61 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.62 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期回报基准收益率的比较

3.63 基金合同生效以来