

信息披露 Disclosure

农银汇理中证500指数证券投资基金

2014 年度报告摘要

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
银行存款	695,268.63	32,026.19
结算备付金	808,890.93	1,995,608.45
存出保证金	22,822.53	-
交易性金融资产	107,694,125.26	137,324,990.16
其中：股票投资	103,188,725.26	131,354,390.16
基金投资	-	-
债券投资	4,505,400.00	5,970,600.00
衍生金融资产	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融负债	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付职工薪酬	-	-
应交税费	-	-
应付利息	549,217.33	187,081.75
应付利润	144,076.55	115,075.28
应付股利	-	-
应付申购款	6,983.38	8,444.59
应付赎回款	-	-
应付交易税费	-	-
应付其他款项	-	-
资产总计	110,033,890.32	139,686,050.95
负债和所有者权益		
本期末		上年度末
负债		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
应付职工薪酬	-	-
应交税费	-	-
应付利息	444,469.74	430,095.13
应付股利	-	-
应付利润	-	-
应付申购款	-	-
应付赎回款	-	-
应付申购款	809,512.23	253,355.91
应付赎回款	66,162.89	90,135.22
应付托管费	13,232.58	18,027.03
应付交易费用	69,668.73	62,151.67
应付税费	-	-
应付其他款项	-	-
负债总计	1,404,446.14	853,764.96
所有者权益		
实收基金	102,820,785.93	134,100,832.32
未分配利润	5,810,660.23	4,731,453.67
所有者权益合计	108,631,444.18	138,832,285.99
负债和所有者权益总计	110,033,890.32	139,686,050.95

注：1. 重要提示及目录

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：2014年8月25日

1.1 重要提示

基金管理人的董事、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的责任。本基金报告已经二分之一以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金合同由托管人交通银行股份有限公司根据于2014年6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报告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

1.2 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

基金代码：660001

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

报告期末基金资产总额：102,820,785.93份

基金合同存续期：不定期

2.2 基金简介

2.3 基金产品说明

投资目标：本基金为被动型投资的指数基金，通过严格的的投资纪律和完全的量化方法，力争将基金净值对业经比较基准的年回报误差控制在5%以内，以实现对标的指数的有效跟踪。

投资策略：本基金将按照指数的成分股及权重配置进行投资并长期持有该指数的成份股。

业经比较基准：本基金的业绩比较基准为95%×中证500指数+5%×同期银行存款利率（税后）。

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。

2.4 基金管理人和基金托管人

项目

名称

农银汇理基金管理有限公司

交通银行股份有限公司

信息披露义务人

翟爱东

王涛

电子邮箱

hejiedong@abc-ca.com

联系电话

021-61095599

95559

客户服务电话

021-61095556

021-62701216

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告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

上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层

3.3 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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)

本期实现收益

5,286,355.95

本期利润

4,125,445.64

加权平均基金份额本期利润

0.0355

本期平均基金份额净值

3.40%

本期基金份额净值增长率

2.08%

3.1.2 期末数据和指标

报告期末(2014年6月30日)

5,810,660.23

期末可供分配基金份额利润

0.0365

期末基金资产净值

108,631,444.18

期末基金份额净值

0.9765

3.1.3 本期费用指标

报告期末(2014年6月30日)

5.65%

报告期末基金资产净值增长率

5.65%

3.22 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：1. 本期已实现收益指基金利息收入、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申购基金时产生的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3. 期末可供分配利润，即期末可供分配的未分配利润，根据《基金合同》规定，以期末可供分配利润为基

数，按基金合同规定的比例计提基金分红，余额归基金所有。

4. 本期报告期后一日，2014年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

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)

份额净值

1.0000

份额净值增长率

2.08%

3.2.2 期末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

报告期末(2014年6月30日)

1.0000

份额净值增长率

2.08%

3.2.3 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

报告期末(2014年6月30日)

0.0355

3.2.4 近6个月收益

报告期末(2014年6月30日)

1.0000

份额净值

2.08%

3.2.5 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

报告期末(2014年6月30日)

0.0355

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 本期主要会计数据

金额单位：人民币元

3.3.2 本期利润

4,125,445.64

本期利润

4,125,445.64

加权平均基金份额本期利润

0.0355

本期基金份额净值增长率

2.08%

3.3.3 期末基金资产净值

108,631,444.18

期末基金份额净值

0.9765

3.3.4 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额

报告期末(2014年6月30日)

0.0355

3.3.5 期末可供分配基金份额利润

4,125,445.64

期末可供分配基金份额利润

4,125,445.64

期末可供分配基金份额利润

4,125,445.64

3.3.6 基金净值表现

3.3.7 基金净值表现

3.3.8 基金净值表现

3.3.9 基金净值表现

3.3.10 基金净值表现

3.3.11 基金净值表现

3.3.12 基金净值表现

3.3.13 基金净值表现