

农银汇理中证 500 指数证券投资基金

2016年年度报告摘要

2016年12月31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

重要提示
基金管理人承诺: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法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:农银汇理中证500指数
基金代码:860011

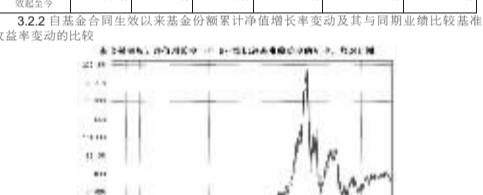
2.2 基金产品概况
基金定位为:本基金为被动化投资的指数基金,通过"严格的投资纪律约束和数量化的投资流程,力争将跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.35%以内,力求跟踪标的指数的有效投资。

2.3 基金管理人、基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文在中国证监会网站: http://www.abco.com.cn
基金年度报告备查地点: 上海市浦东新区世纪大道9号农银大厦50层。

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

3.2 基金净值表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金投资于标的指数成份股和备选成份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不超过基金资产的5%-10%。

3.3 基金业绩评价
基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算,未按按各自早期的基金业绩评价。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金业绩的回顾
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。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.3 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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.4 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.5 管理人内部合规管理制度的执行情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.6 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.7 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

4.8 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

相关基金(基金合同)、(招募说明书)等文件于估值日的约定及公司估值政策和程序进行估值。

7.1 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
基金代码:860011

7.2 基金产品概况
基金定位为:本基金为被动化投资的指数基金,通过"严格的投资纪律约束和数量化的投资流程,力争将跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.35%以内,力求跟踪标的指数的有效投资。

7.3 基金管理人、基金托管人
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

7.4 信息披露方式
基金年度报告全文在中国证监会网站: http://www.abco.com.cn
基金年度报告备查地点: 上海市浦东新区世纪大道9号农银大厦50层。

7.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
7.5.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

7.5.2 基金净值表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



7.5.3 基金业绩评价
基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算,未按按各自早期的基金业绩评价。

7.5.4 管理人报告
7.5.4.1 基金管理人及基金业绩的回顾
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。

7.5.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.3 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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.4 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.5 管理人内部合规管理制度的执行情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.6 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.7 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.8 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.9 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.5.4.10 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

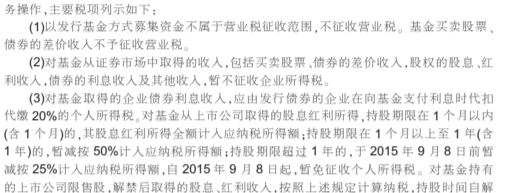
本报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.6 基金管理人、基金托管人
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

7.7 信息披露方式
基金年度报告全文在中国证监会网站: http://www.abco.com.cn
基金年度报告备查地点: 上海市浦东新区世纪大道9号农银大厦50层。

7.8 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
7.8.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

7.8.2 基金净值表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



7.8.3 基金业绩评价
基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算,未按按各自早期的基金业绩评价。

7.8.4 管理人报告
7.8.4.1 基金管理人及基金业绩的回顾
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。

7.8.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.3 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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.4 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.5 管理人内部合规管理制度的执行情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.6 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.7 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.8 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.9 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.10 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.11 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.8.4.12 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

本报告期内,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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.9 基金管理人、基金托管人
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

7.10 信息披露方式
基金年度报告全文在中国证监会网站: http://www.abco.com.cn
基金年度报告备查地点: 上海市浦东新区世纪大道9号农银大厦50层。

7.11 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
7.11.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

7.11.2 基金净值表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



7.11.3 基金业绩评价
基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算,未按按各自早期的基金业绩评价。

7.11.4 管理人报告
7.11.4.1 基金管理人及基金业绩的回顾
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。

7.11.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.3 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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.4 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.5 管理人内部合规管理制度的执行情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.6 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.7 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.8 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.9 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.10 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.11 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

7.11.4.12 报告期内基金投资组合运作情况
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管理制度》,有效控制了基金投资组合的流动性风险。

注:买入金额按买入成交金额(或成交净价以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

8.4.2 卖出金额按卖出成交金额(或成交净价以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing the cost of purchased securities and the total income from sold securities, including columns for security name, quantity, and amount.

8.4.4 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

Table showing the cost of purchased securities and the total income from sold securities, including columns for security name, quantity, and amount.

8.5 期末按品种分类的债券投资组合
8.5.1 报告期末本基金持有的债券投资组合和比例

8.5.2 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债券投资明细
8.5.3 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债券投资明细

8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.6.1 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债券投资明细

8.7 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债券投资明细
8.7.1 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债券投资明细

8.8 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债券投资明细
8.8.1 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债券投资明细

8.9 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债券投资明细
8.9.1 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债券投资明细

8.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.10.1 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债券投资明细

8.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.11.1 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债券投资明细

8.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.12.1 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债券投资明细

8.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
8.13.1 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债券投资明细

8.14 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债券投资明细
8.14.1 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债券投资明细

8.15 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债券投资明细
8.15.1 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债券投资明细

8.16 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债券投资明细
8.16.1 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债券投资明细

8.17 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债券投资明细
8.17.1 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债券投资明细