

农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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

送出日期：2016 年 3 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	农银高增长混合
基金主代码	000039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 26 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	286,278,598.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过寻找某种程度上被市场低估的，同时又有较强的持续稳定增长潜力股票，优化投资组合，在严格控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
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。具体投资策略分为两个层次：首先是“自上而下”的大类资产配置，决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是“自下而上”的 GARP 选股策略，该策略是对资产配置策略方案的具体实现，是本基金的核心投资策略。
业绩比较基准	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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	汤嵩彦
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城路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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013年3月26日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	-4,364,570.49	100,995,589.51	26,815,059.62
本期利润	24,932,594.86	85,163,225.73	60,927,967.46
加权平均基金份额本期利润	0.0829	0.2313	0.0930
本期加权平均净值利润率	4.05%	19.66%	8.99%
本期基金份额净值增长率	61.54%	30.32%	8.36%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	185,781,199.70	111,236,099.26	41,092,012.75
期末可供分配基金份额利润	0.6490	0.4122	0.0836
期末基金资产净值	653,091,275.30	381,103,193.84	532,705,697.25
期末基金份额净值	2.2813	1.4122	1.0836
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	128.13%	41.22%	8.36%

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12月31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
过去三个月	32.62%	2.22%	13.07%	1.25%	19.55%	0.97%
过去六个月	0.38%	3.20%	-10.80%	2.01%	11.18%	1.19%
过去一年	61.54%	3.09%	7.91%	1.86%	53.63%	1.23%
自基金合同生效起至今	128.13%	2.16%	38.95%	1.36%	89.18%	0.80%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

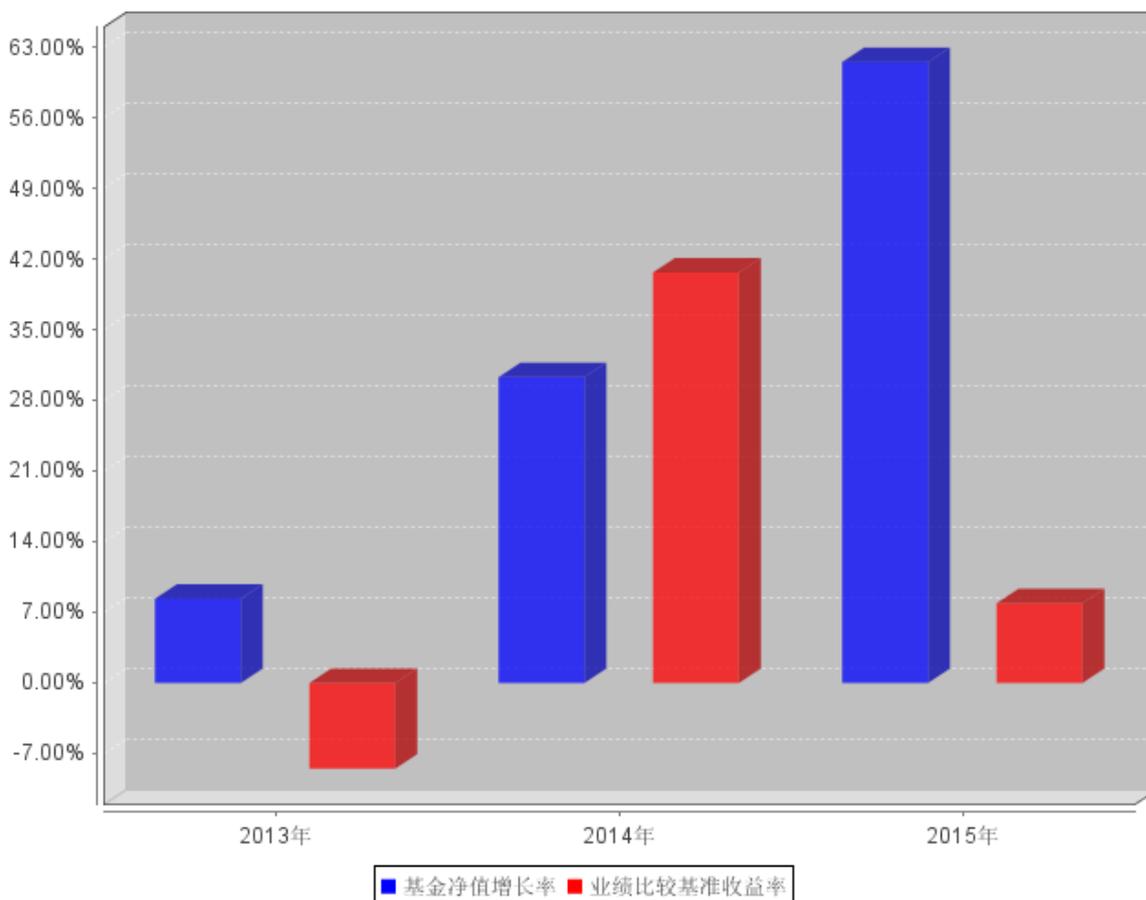


本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—40%。权证投资比例范围为基金资产净值的 0%—3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2013 年 3 月 26 日起六个月，建仓

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

§ 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贰亿零壹元，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%，中国铝业股份有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海

市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2015 年 12 月 31 日，公司共管理 27 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、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、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和农银汇理天天利货币市场基金。

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		
凌晨	本基金基金经理、公司研究部副总经理	2013 年 11 月 7 日	-	8	硕士。历任国信证券研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、高级研究员。现任农银汇理基金管理有限公司研究部副总经理、基金经理。
顾旭俊	本基金基金助理	2015 年 4 月 7 日	-	6	复旦大学学士，具有基金从

					业资格。 历任申银万国证券研究所有限 公司研究员、上海尚雅投资管理 有限公司研究员。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》、《特定客户资产管理业务公平交易管理办法》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告风险管理委员会。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2016 年市场先扬后抑，上半年市场在降息的背景之下大幅上涨，而在 6~8 月市场则出现较大幅度调整。本基金在上半积极把握了市场的机会，取得了较好收益，而在之后对于回调幅度缺乏足够的估计导致回撤较大，之后在四季度积极把握反弹机会挽回了一定收益。从全年来看投资人依然取得了相对合理的回报，但中间的波动和回撤是未来需要改进的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为 61.54%，业绩比较基准收益率为 7.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年市场形势相对复杂。“8.11”汇改之后，RMB 汇率和中国经济基本面成为市场关注的焦点，甚至产生了波及全球的外溢效应。目前在岸和离岸汇率保持在 6.5 附近，但不排除在二季度继续贬值的可能性，而汇率贬值会对市场风险偏好产生压力。而从货币政策上看，自 2015 年 12 月中旬以来央行目前货币政策的态度较为暧昧，一季度天量信贷也不利于持续放松政策的展开。此外，美联储加息和供给侧改革等也是未来一年非常重要的考量因素。2016 年我们会更加重视股票的基本面以及时机，在此基础上努力为客户创造价值。

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）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 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、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

1. 本基金基金合同约定“在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”即本基金报告期无应分配利润金额。

2. 本基金报告期内没有实施利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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

2015 年度，基金托管人在农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年度，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、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(2016)第 20961 号

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	农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金(原农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金,以下简称“农银汇理低估值高增长混合型基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)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农银汇理低估值高增长混合型基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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。
注册会计师的责任段	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。

	<p>中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述农银汇理低估值高增长混合型基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了农银汇理低估值高增长混合型基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈玲 张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	72,846,018.20	63,800,110.08
结算备付金	8,965,879.69	3,028,272.03
存出保证金	1,366,913.02	643,555.72
交易性金融资产	563,109,851.36	298,680,770.88
其中：股票投资	563,109,851.36	298,680,770.88
基金投资	-	-
债券投资	-	-

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	15,958,138.33	20,585,308.56
应收利息	25,520.62	16,823.73
应收股利	-	-
应收申购款	642,139.46	1,052,030.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	662,914,460.68	387,806,871.45
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014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	-	-
应付赎回款	4,715,442.94	3,410,360.59
应付管理人报酬	844,775.19	568,982.53
应付托管费	140,795.89	94,830.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,034,976.22	2,357,931.39
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	87,195.14	271,572.67
负债合计	9,823,185.38	6,703,677.61
所有者权益:		
实收基金	286,278,598.39	269,867,094.58
未分配利润	366,812,676.91	111,236,099.26
所有者权益合计	653,091,275.30	381,103,193.84
负债和所有者权益总计	662,914,460.68	387,806,871.45

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.2813 元，基金份额总额 286,278,598.39 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	56,583,440.85	105,123,405.75
1. 利息收入	941,978.41	1,159,869.66
其中：存款利息收入	941,978.41	1,157,528.91
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,340.75
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	23,768,136.48	118,110,451.35
其中：股票投资收益	22,963,008.21	116,183,586.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	805,128.27	1,926,864.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	29,297,165.35	-15,832,363.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,576,160.61	1,685,448.52
减：二、费用	31,650,845.99	19,960,180.02
1. 管理人报酬	9,153,163.24	6,500,383.39
2. 托管费	1,525,527.31	1,083,397.26
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,568,267.36	11,997,454.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	403,888.08	378,945.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	24,932,594.86	85,163,225.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	24,932,594.86	85,163,225.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	269,867,094.58	111,236,099.26	381,103,193.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,932,594.86	24,932,594.86
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）	16,411,503.81	230,643,982.79	247,055,486.60
其中：1. 基金申购款	1,034,888,726.20	1,363,222,201.09	2,398,110,927.29
2. 基金赎回款	-1,018,477,222.39	-1,132,578,218.30	-2,151,055,440.69
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）	286,278,598.39	366,812,676.91	653,091,275.30
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	491,613,684.50	41,092,012.75	532,705,697.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	85,163,225.73	85,163,225.73
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）	-221,746,589.92	-15,019,139.22	-236,765,729.14
其中：1. 基金申购款	927,150,806.19	226,545,240.46	1,153,696,046.65
2. 基金赎回款	-1,148,897,396.11	-241,564,379.68	-1,390,461,775.79
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）	269,867,094.58	111,236,099.26	381,103,193.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>许金超</u>	<u>王梅华</u>	<u>于意</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金(原名为“农银汇理低估值高增长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[2012]第 1590 号《关于核准农银汇理低估值高增长混合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《农银汇理低估值高增长混合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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 971,232,843.53 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(2013)第 165 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 971,415,105.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 182,261.67 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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》,农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为农银汇理低估值高增长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《农银汇理低估值高增长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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、权证等权益类品种,国债、金融债、央票、公司债、企业债、可转债、中期票据、短期融资券、回购、存款、资产支持证券等固定收益类品种,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-40%。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:75% X 沪深 300 指数+25%X 中证全债指数。

7.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券

的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司	本基金的管理人
交通银行股份有限公司	本基金的托管人
中国农业银行股份有限公司	本基金管理人的股东
东方汇理资产管理公司	本基金管理人的股东
中国铝业股份有限公司	本基金管理人的股东

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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。

7.4.7.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.7.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.7.1.4 权证交易

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权证交易。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,153,163.24	6,500,383.39
其中：支付销售机构的客户维护费	3,125,613.82	2,035,093.40

注：支付基金管理人农银汇理基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,525,527.31	1,083,397.26

注：支付基金托管人交通银行的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无应支付关联方的销售服务费。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

	月 31 日	31 日
基金合同生效日（ 2013 年 3 月 26 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	4,941,682.32	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,941,682.32	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7262%	-

7.4.7.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.7.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	72,846,018.20	816,846.69	63,800,110.08	984,797.80

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.8 期末（ 2015 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.8.2 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
002612	朗姿	2015 年 12 月 22 日	公告重	75.46	-	-	220,795	12,070,602.67	16,661,190.70	-

	股份		大事项							
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	公告重大事项	56.68	-	-	252,227	13,684,993.76	14,296,226.36	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 31 日	公告重大事项	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	215,797	13,348,533.75	14,028,962.97	-
000971	高升控股	2015 年 9 月 21 日	公告重大事项	34.97	2015 年 12 月 31 日	26.39	278,390	6,365,357.19	9,735,298.30	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 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。

7.4.8.3.2 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。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 508,388,173.03 元，属于第二层次的余额为 54,721,678.33 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 211,424,923.96 元，第二层次 87,255,846.92 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	563,109,851.36	84.94
	其中：股票	563,109,851.36	84.94
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	81,811,897.89	12.34
7	其他各项资产	17,992,711.43	2.71
8	合计	662,914,460.68	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	21,920,989.20	3.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	374,063,123.69	57.28
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	37,010,900.00	5.67
G	交通运输、仓储和邮政业	21,844,596.00	3.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,916,489.00	2.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,221,280.50	3.25
L	租赁和商务服务业	12,934,413.00	1.98
M	科学研究和技术服务业	14,028,962.97	2.15
N	水利、环境和公共设施管理业	6,554,240.00	1.00
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	18,316,190.00	2.80
S	综合	16,298,667.00	2.50
	合计	563,109,851.36	86.22

8.3 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	002667	鞍重股份	401,900	30,062,120.00	4.60
2	300230	永利股份	801,584	29,955,194.08	4.59
3	603006	联明股份	360,836	22,711,017.84	3.48
4	002425	凯撒股份	737,479	21,379,516.21	3.27
5	300031	宝通科技	626,000	19,656,400.00	3.01
6	002127	新民科技	1,039,075	19,451,484.00	2.98
7	002612	朗姿股份	220,795	16,661,190.70	2.55
8	600770	综艺股份	892,100	16,298,667.00	2.50
9	002675	东诚药业	258,174	14,460,325.74	2.21
10	300038	梅泰诺	252,227	14,296,226.36	2.19

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300075	数字政通	91,187,994.92	23.93
2	300253	卫宁软件	82,969,347.43	21.77
3	002657	中科金财	79,758,653.36	20.93
4	300022	吉峰农机	77,514,103.25	20.34
5	600576	万家文化	71,879,309.01	18.86
6	600048	保利地产	66,474,629.49	17.44
7	300222	科大智能	62,164,962.12	16.31
8	300231	银信科技	61,868,022.33	16.23
9	600391	成发科技	61,611,619.42	16.17
10	300016	北陆药业	60,660,411.69	15.92
11	600571	信雅达	58,511,946.00	15.35
12	600080	金花股份	58,298,915.14	15.30
13	300038	梅泰诺	53,196,310.31	13.96
14	300347	泰格医药	52,837,085.25	13.86
15	002381	双箭股份	49,592,902.03	13.01
16	300342	天银机电	49,058,770.28	12.87
17	601989	中国重工	47,471,430.95	12.46

18	600865	百大集团	47,440,656.72	12.45
19	002208	合肥城建	46,142,563.39	12.11
20	300147	香雪制药	46,080,433.83	12.09
21	300336	新文化	45,886,173.98	12.04
22	002373	千方科技	43,926,927.09	11.53
23	300033	同花顺	43,754,375.60	11.48
24	002127	新民科技	43,535,074.84	11.42
25	601688	华泰证券	40,984,398.12	10.75
26	002171	楚江新材	39,866,351.96	10.46
27	002439	启明星辰	39,855,739.00	10.46
28	000801	四川九洲	39,255,204.96	10.30
29	002298	中电鑫龙	39,162,498.82	10.28
30	002318	久立特材	38,994,875.96	10.23
31	002425	凯撒股份	38,793,840.33	10.18
32	000620	新华联	38,626,586.31	10.14
33	600570	恒生电子	38,178,115.00	10.02
34	600223	鲁商置业	38,094,022.33	10.00
35	300013	新宁物流	38,074,985.50	9.99
36	300059	东方财富	37,477,161.19	9.83
37	002445	中南重工	37,116,820.90	9.74
38	300018	中元华电	36,740,113.50	9.64
39	300295	三六五网	36,651,939.56	9.62
40	600517	置信电气	35,877,465.75	9.41
41	300086	康芝药业	35,829,455.27	9.40
42	603308	应流股份	35,734,134.50	9.38
43	002157	正邦科技	35,357,189.65	9.28
44	300109	新开源	34,343,875.15	9.01
45	300104	乐视网	34,277,681.61	8.99
46	002019	亿帆鑫富	33,927,473.62	8.90
47	002469	三维工程	33,145,675.57	8.70
48	002380	科远股份	33,142,077.74	8.70
49	300085	银之杰	33,137,580.10	8.70
50	300279	和晶科技	32,988,938.60	8.66
51	601599	鹿港科技	32,963,389.00	8.65
52	300165	天瑞仪器	31,699,077.57	8.32
53	300299	富春通信	30,759,411.84	8.07

54	000910	大亚科技	30,324,261.81	7.96
55	002072	凯瑞德	30,181,802.04	7.92
56	002667	鞍重股份	29,759,241.00	7.81
57	300397	天和防务	28,709,391.91	7.53
58	002462	嘉事堂	28,454,274.60	7.47
59	002668	奥马电器	28,250,810.00	7.41
60	002612	朗姿股份	27,695,225.50	7.27
61	600884	杉杉股份	26,818,929.00	7.04
62	600446	金证股份	26,791,071.15	7.03
63	600096	云天化	26,714,356.15	7.01
64	300230	永利股份	26,673,033.57	7.00
65	300101	振芯科技	26,644,850.88	6.99
66	002651	利君股份	26,583,178.00	6.98
67	601618	中国中冶	26,580,648.31	6.97
68	600547	山东黄金	26,542,710.69	6.96
69	002329	皇氏集团	26,431,652.69	6.94
70	002048	宁波华翔	26,308,748.16	6.90
71	600581	八一钢铁	25,993,593.65	6.82
72	601918	国投新集	25,394,532.19	6.66
73	300302	同有科技	25,374,614.40	6.66
74	300377	赢时胜	24,952,410.39	6.55
75	002291	星期六	24,908,538.67	6.54
76	002175	东方网络	24,901,070.20	6.53
77	000939	凯迪生态	24,806,271.93	6.51
78	300113	顺网科技	24,690,771.13	6.48
79	300248	新开普	24,307,706.00	6.38
80	601788	光大证券	24,175,322.64	6.34
81	002407	多氟多	23,700,393.33	6.22
82	600029	南方航空	23,634,511.34	6.20
83	300418	昆仑万维	23,419,710.28	6.15
84	002285	世联行	23,403,778.77	6.14
85	300097	智云股份	23,110,336.00	6.06
86	002444	巨星科技	23,069,153.89	6.05
87	603111	康尼机电	23,064,677.89	6.05
88	300364	中文在线	22,990,346.13	6.03
89	002284	亚太股份	22,985,101.10	6.03

90	601107	四川成渝	22,950,222.32	6.02
91	300152	科融环境	22,561,772.70	5.92
92	603766	隆鑫通用	22,499,663.18	5.90
93	000768	中航飞机	22,486,569.00	5.90
94	600118	中国卫星	22,471,196.24	5.90
95	000651	格力电器	22,381,629.16	5.87
96	300056	三维丝	22,323,034.94	5.86
97	000035	中国天楹	22,305,508.00	5.85
98	002123	荣信股份	22,299,895.46	5.85
99	002673	西部证券	22,251,353.02	5.84
100	002172	澳洋科技	21,998,038.38	5.77
101	000890	法尔胜	21,912,135.00	5.75
102	603006	黎明股份	21,911,030.01	5.75
103	300160	秀强股份	21,788,603.60	5.72
104	600030	中信证券	21,714,403.10	5.70
105	300089	文化长城	21,307,177.60	5.59
106	002074	国轩高科	21,280,219.77	5.58
107	002405	四维图新	21,195,202.84	5.56
108	600409	三友化工	21,180,721.50	5.56
109	603066	音飞储存	21,155,083.45	5.55
110	600115	东方航空	21,025,017.86	5.52
111	002256	彩虹精化	20,984,951.68	5.51
112	300238	冠昊生物	20,822,738.44	5.46
113	300380	安硕信息	20,803,657.68	5.46
114	002321	华英农业	20,729,437.60	5.44
115	300202	聚龙股份	20,717,934.74	5.44
116	000513	丽珠集团	20,661,479.32	5.42
117	601021	春秋航空	20,619,654.19	5.41
118	300028	金亚科技	20,609,784.07	5.41
119	300334	津膜科技	20,601,188.00	5.41
120	002345	潮宏基	20,434,595.50	5.36
121	600079	人福医药	20,301,806.82	5.33
122	002108	沧州明珠	20,289,373.57	5.32
123	600999	招商证券	20,223,458.48	5.31
124	002303	美盈森	20,157,014.95	5.29
125	300244	迪安诊断	20,140,581.95	5.28

126	000547	航天发展	19,925,899.12	5.23
127	600366	宁波韵升	19,830,139.62	5.20
128	002290	禾盛新材	19,780,159.96	5.19
129	000599	青岛双星	19,718,238.16	5.17
130	600136	道博股份	19,686,428.44	5.17
131	002389	南洋科技	19,646,576.00	5.16
132	603368	柳州医药	19,519,907.60	5.12
133	600647	同达创业	19,476,288.30	5.11
134	002178	延华智能	19,448,618.00	5.10
135	300025	华星创业	19,430,559.90	5.10
136	002113	天润控股	19,298,541.50	5.06
137	300031	宝通科技	19,112,405.55	5.02
138	600519	贵州茅台	18,910,259.80	4.96
139	000971	高升控股	18,848,436.81	4.95
140	002253	川大智胜	18,777,296.35	4.93
141	601009	南京银行	18,498,537.32	4.85
142	002538	司尔特	18,479,842.12	4.85
143	002308	威创股份	18,417,631.07	4.83
144	002480	新筑股份	18,273,379.15	4.79
145	300292	吴通控股	17,860,392.32	4.69
146	002516	旷达科技	17,786,843.14	4.67
147	600180	瑞茂通	17,034,009.42	4.47
148	601377	兴业证券	16,846,614.00	4.42
149	002551	尚荣医疗	16,805,563.62	4.41
150	600834	申通地铁	16,792,184.00	4.41
151	002224	三力士	16,779,168.63	4.40
152	300274	阳光电源	16,520,677.00	4.33
153	300250	初灵信息	16,474,946.80	4.32
154	601398	工商银行	16,300,135.00	4.28
155	002477	雏鹰农牧	16,183,248.30	4.25
156	002467	二六三	15,938,747.40	4.18
157	600240	华业资本	15,829,939.40	4.15
158	000877	天山股份	15,564,347.00	4.08
159	300140	启源装备	15,480,923.02	4.06
160	000728	国元证券	15,443,609.20	4.05
161	300004	南风股份	15,421,579.88	4.05

162	600340	华夏幸福	15,418,547.00	4.05
163	600098	广州发展	15,345,487.31	4.03
164	300431	暴风科技	15,281,460.60	4.01
165	600969	郴电国际	15,181,257.10	3.98
166	300287	飞利信	15,117,907.65	3.97
167	002589	瑞康医药	15,080,822.00	3.96
168	000027	深圳能源	14,948,005.55	3.92
169	300119	瑞普生物	14,826,645.10	3.89
170	300171	东富龙	14,751,858.40	3.87
171	601799	星宇股份	14,749,076.05	3.87
172	300150	世纪瑞尔	14,748,889.47	3.87
173	002502	骅威股份	14,730,741.57	3.87
174	000031	中粮地产	14,663,546.96	3.85
175	600587	新华医疗	14,625,748.51	3.84
176	300153	科泰电源	14,602,093.78	3.83
177	002070	众和股份	14,597,404.00	3.83
178	002249	大洋电机	14,513,077.80	3.81
179	000961	中南建设	14,480,065.09	3.80
180	600449	宁夏建材	14,475,943.26	3.80
181	002658	雪迪龙	14,378,787.80	3.77
182	600744	华银电力	14,374,728.99	3.77
183	002153	石基信息	14,309,113.91	3.75
184	002081	金螳螂	14,305,848.07	3.75
185	600398	海澜之家	14,300,922.91	3.75
186	600663	陆家嘴	14,270,691.52	3.74
187	002205	国统股份	14,241,517.82	3.74
188	000697	炼石有色	14,232,119.75	3.73
189	000906	物产中拓	14,115,817.89	3.70
190	002634	棒杰股份	14,065,308.77	3.69
191	000633	合金投资	14,022,253.62	3.68
192	600285	羚锐制药	14,012,967.25	3.68
193	000046	泛海控股	13,822,153.00	3.63
194	000733	振华科技	13,751,592.06	3.61
195	300043	互动娱乐	13,725,877.47	3.60
196	002458	益生股份	13,651,004.40	3.58
197	002766	索菱股份	13,636,941.80	3.58

198	600770	综艺股份	13,607,130.00	3.57
199	002311	海大集团	13,425,938.60	3.52
200	600645	中源协和	13,348,533.75	3.50
201	002675	东诚药业	13,308,115.24	3.49
202	000002	万科A	13,217,447.92	3.47
203	300198	纳川股份	13,142,296.15	3.45
204	000558	莱茵体育	13,081,981.00	3.43
205	000807	云铝股份	13,078,370.73	3.43
206	002466	天齐锂业	13,071,088.57	3.43
207	603799	华友钴业	13,007,159.00	3.41
208	600306	商业城	12,984,263.50	3.41
209	600650	锦江投资	12,973,823.20	3.40
210	300166	东方国信	12,972,652.00	3.40
211	600038	中直股份	12,970,651.13	3.40
212	300170	汉得信息	12,968,894.95	3.40
213	300058	蓝色光标	12,936,680.13	3.39
214	300339	润和软件	12,899,927.11	3.38
215	002137	麦达数字	12,872,074.91	3.38
216	000060	中金岭南	12,833,161.69	3.37
217	002351	漫步者	12,814,928.21	3.36
218	002590	万安科技	12,811,989.00	3.36
219	600738	兰州民百	12,779,895.92	3.35
220	600687	刚泰控股	12,750,860.79	3.35
221	600624	复旦复华	12,687,624.28	3.33
222	600422	昆药集团	12,638,066.20	3.32
223	600266	北京城建	12,607,661.02	3.31
224	002517	泰亚股份	12,590,030.56	3.30
225	600480	凌云股份	12,586,294.03	3.30
226	002400	省广股份	12,572,091.28	3.30
227	600850	华东电脑	12,509,540.00	3.28
228	002146	荣盛发展	12,462,898.85	3.27
229	600105	永鼎股份	12,459,309.73	3.27
230	600805	悦达投资	12,425,108.02	3.26
231	000100	TCL 集团	12,421,489.10	3.26
232	002343	禾欣股份	12,415,898.40	3.26
233	002084	海鸥卫浴	12,379,555.72	3.25

234	300366	创意信息	12,278,626.32	3.22
235	600958	东方证券	12,247,849.26	3.21
236	600588	用友网络	12,159,002.39	3.19
237	002142	宁波银行	12,152,416.12	3.19
238	601998	中信银行	12,143,739.60	3.19
239	300284	苏交科	12,121,358.32	3.18
240	300324	旋极信息	12,117,076.64	3.18
241	000673	当代东方	12,057,490.68	3.16
242	002325	洪涛股份	11,997,877.75	3.15
243	600617	国新能源	11,828,781.15	3.10
244	601992	金隅股份	11,735,562.75	3.08
245	002368	太极股份	11,478,081.84	3.01
246	002179	中航光电	11,441,883.70	3.00
247	000671	阳光城	11,437,600.44	3.00
248	300359	全通教育	11,406,930.77	2.99
249	601336	新华保险	11,402,308.79	2.99
250	002173	千足珍珠	11,359,813.00	2.98
251	002354	天神娱乐	11,355,077.00	2.98
252	000822	山东海化	11,347,838.16	2.98
253	300078	思创医惠	11,271,324.78	2.96
254	600837	海通证券	11,196,287.50	2.94
255	002669	康达新材	11,191,249.90	2.94
256	002162	悦心健康	11,173,357.00	2.93
257	000625	长安汽车	11,125,112.57	2.92
258	002756	永兴特钢	11,086,390.70	2.91
259	300285	国瓷材料	11,061,046.27	2.90
260	002714	牧原股份	11,038,565.32	2.90
261	300487	蓝晓科技	10,985,265.00	2.88
262	300486	东杰智能	10,877,485.50	2.85
263	002594	比亚迪	10,869,280.00	2.85
264	000523	广州浪奇	10,841,506.65	2.84
265	600760	中航黑豹	10,718,169.17	2.81
266	601169	北京银行	10,647,428.00	2.79
267	601628	中国人寿	10,644,402.86	2.79
268	600377	宁沪高速	10,617,400.40	2.79
269	600208	新潮中宝	10,478,664.44	2.75

270	600155	宝硕股份	10,453,740.41	2.74
271	000950	建峰化工	10,425,005.72	2.74
272	600060	海信电器	10,412,933.77	2.73
273	603023	威帝股份	10,387,402.36	2.73
274	300048	合康变频	10,385,482.90	2.73
275	600109	国金证券	10,293,682.00	2.70
276	300144	宋城演艺	10,289,745.00	2.70
277	002020	京新药业	10,130,421.98	2.66
278	000568	泸州老窖	10,012,028.00	2.63
279	601318	中国平安	9,957,402.00	2.61
280	300468	四方精创	9,922,902.62	2.60
281	000829	天音控股	9,799,514.73	2.57
282	600358	国旅联合	9,778,832.00	2.57
283	300442	普丽盛	9,778,230.00	2.57
284	300312	邦讯技术	9,725,884.00	2.55
285	300399	京天利	9,708,731.00	2.55
286	000008	神州高铁	9,570,728.56	2.51
287	600655	豫园商城	9,464,026.98	2.48
288	601800	中国交建	9,430,390.89	2.47
289	300226	上海钢联	9,384,555.19	2.46
290	300036	超图软件	9,383,479.53	2.46
291	300010	立思辰	9,296,043.26	2.44
292	603898	好莱客	9,276,822.50	2.43
293	600737	中粮屯河	9,100,988.50	2.39
294	002188	新嘉联	9,077,763.40	2.38
295	000601	韶能股份	8,844,486.37	2.32
296	002573	清新环境	8,445,486.00	2.22
297	600418	江淮汽车	8,421,623.09	2.21
298	300070	碧水源	8,382,555.16	2.20
299	600352	浙江龙盛	8,327,198.98	2.19
300	300213	佳讯飞鸿	8,319,211.89	2.18
301	300262	巴安水务	8,206,614.00	2.15
302	600536	中国软件	8,071,124.27	2.12
303	002568	百润股份	8,036,353.48	2.11
304	600168	武汉控股	8,032,372.98	2.11
305	600703	三安光电	7,966,738.14	2.09

306	002125	湘潭电化	7,885,524.21	2.07
307	000918	嘉凯城	7,812,838.00	2.05
308	600820	隧道股份	7,752,002.78	2.03
309	600376	首开股份	7,653,200.00	2.01
310	002063	远光软件	7,651,232.21	2.01
311	600502	安徽水利	7,625,728.00	2.00
312	000516	国际医学	7,625,509.86	2.00

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。

8.4.2 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	300075	数字政通	89,627,700.43	23.52
2	002439	启明星辰	79,206,724.06	20.78
3	600576	万家文化	76,777,539.05	20.15
4	600048	保利地产	74,046,516.17	19.43
5	002657	中科金财	71,808,239.70	18.84
6	300253	卫宁软件	65,257,305.70	17.12
7	300231	银信科技	60,541,715.31	15.89
8	600391	成发科技	59,602,664.71	15.64
9	600571	信雅达	58,878,890.27	15.45
10	300059	东方财富	56,753,715.69	14.89
11	300336	新文化	52,221,219.18	13.70
12	300222	科大智能	47,959,135.44	12.58
13	002298	中电鑫龙	47,338,191.54	12.42
14	300147	香雪制药	47,331,660.37	12.42
15	300016	北陆药业	46,621,284.54	12.23
16	300295	三六五网	46,461,711.18	12.19
17	002445	中南重工	46,373,898.28	12.17
18	002381	双箭股份	45,687,672.96	11.99
19	300022	吉峰农机	45,642,737.37	11.98
20	601989	中国重工	45,425,916.00	11.92
21	601599	鹿港科技	43,765,063.62	11.48
22	300299	富春通信	43,698,993.64	11.47
23	300038	梅泰诺	43,156,286.03	11.32
24	300347	泰格医药	42,470,274.46	11.14
25	600446	金证股份	41,951,358.85	11.01

26	002373	千方科技	40,947,683.18	10.74
27	002329	皇氏集团	40,653,291.75	10.67
28	300342	天银机电	39,614,482.56	10.39
29	300086	康芝药业	39,257,350.07	10.30
30	300377	赢时胜	38,992,805.66	10.23
31	601688	华泰证券	38,887,009.84	10.20
32	600080	金花股份	38,870,461.85	10.20
33	002318	久立特材	38,408,590.53	10.08
34	600865	百大集团	38,306,508.85	10.05
35	300109	新开源	37,272,345.67	9.78
36	000801	四川九洲	36,363,791.78	9.54
37	600223	鲁商置业	35,802,950.22	9.39
38	300078	思创医惠	35,716,407.96	9.37
39	000910	大亚科技	35,288,339.78	9.26
40	002469	三维工程	35,283,230.04	9.26
41	300302	同有科技	35,015,081.58	9.19
42	300104	乐视网	34,560,475.80	9.07
43	600517	置信电气	34,519,329.82	9.06
44	002668	奥马电器	34,054,887.15	8.94
45	300033	同花顺	33,708,658.69	8.85
46	300279	和晶科技	33,488,886.97	8.79
47	002157	正邦科技	33,267,863.72	8.73
48	002651	利君股份	32,304,194.54	8.48
49	300380	安硕信息	31,890,079.80	8.37
50	300028	金亚科技	31,506,435.24	8.27
51	002208	合肥城建	30,930,263.89	8.12
52	000620	新华联	30,827,568.42	8.09
53	300248	新开普	30,301,993.91	7.95
54	603308	应流股份	29,718,842.16	7.80
55	601318	中国平安	28,244,877.69	7.41
56	600581	八一钢铁	28,137,678.31	7.38
57	603111	康尼机电	28,074,657.10	7.37
58	002407	多氟多	28,053,913.72	7.36
59	600570	恒生电子	27,627,889.19	7.25
60	002462	嘉事堂	27,342,440.99	7.17
61	300397	天和防务	27,292,829.71	7.16
62	002127	新民科技	27,291,436.36	7.16
63	600136	道博股份	27,211,575.51	7.14

64	002673	西部证券	27,126,210.95	7.12
65	300244	迪安诊断	26,828,243.13	7.04
66	002070	众和股份	26,555,424.40	6.97
67	002284	亚太股份	26,292,341.49	6.90
68	002425	凯撒股份	26,011,562.46	6.83
69	600884	杉杉股份	25,901,396.92	6.80
70	002048	宁波华翔	25,398,383.27	6.66
71	300013	新宁物流	25,321,340.52	6.64
72	601618	中国中冶	25,288,916.00	6.64
73	300085	银之杰	24,972,618.58	6.55
74	000939	凯迪生态	24,960,308.18	6.55
75	300113	顺网科技	24,950,918.49	6.55
76	601107	四川成渝	24,813,418.15	6.51
77	601788	光大证券	24,787,047.43	6.50
78	002171	楚江新材	24,313,815.24	6.38
79	300226	上海钢联	24,292,187.91	6.37
80	300165	天瑞仪器	24,097,425.50	6.32
81	300101	振芯科技	24,000,728.32	6.30
82	300418	昆仑万维	23,993,812.20	6.30
83	002380	科远股份	23,993,299.01	6.30
84	000890	法尔胜	23,680,099.00	6.21
85	300081	恒信移动	23,566,990.71	6.18
86	600547	山东黄金	23,403,790.15	6.14
87	601998	中信银行	23,160,256.63	6.08
88	000651	格力电器	22,935,991.89	6.02
89	601918	国投新集	22,818,171.00	5.99
90	002172	澳洋科技	22,763,674.80	5.97
91	300160	秀强股份	22,665,087.88	5.95
92	300025	华星创业	22,446,739.36	5.89
93	300238	冠昊生物	22,357,851.90	5.87
94	000961	中南建设	22,316,100.62	5.86
95	002113	天润控股	22,056,615.54	5.79
96	600366	宁波韵升	22,029,446.95	5.78
97	000035	中国天楹	22,003,707.59	5.77
98	000768	中航飞机	21,935,688.98	5.76
99	600519	贵州茅台	21,808,877.40	5.72
100	601021	春秋航空	21,756,961.95	5.71
101	600030	中信证券	21,642,286.98	5.68

102	002285	世联行	21,602,756.56	5.67
103	002405	四维图新	21,477,223.43	5.64
104	300056	三维丝	21,474,375.08	5.63
105	600096	云天化	21,044,629.44	5.52
106	603766	隆鑫通用	21,021,995.12	5.52
107	600409	三友化工	20,993,735.38	5.51
108	002256	彩虹精化	20,943,454.86	5.50
109	002074	国轩高科	20,881,544.96	5.48
110	002019	亿帆鑫富	20,657,925.71	5.42
111	002108	沧州明珠	20,657,665.56	5.42
112	600647	同达创业	20,626,216.77	5.41
113	000547	航天发展	20,563,421.01	5.40
114	002253	川大智胜	20,431,659.97	5.36
115	002573	清新环境	20,311,612.25	5.33
116	002389	南洋科技	20,295,147.25	5.33
117	601009	南京银行	20,293,640.62	5.32
118	002321	华英农业	20,232,000.14	5.31
119	002303	美盈森	20,151,303.72	5.29
120	600999	招商证券	20,136,032.15	5.28
121	000513	丽珠集团	20,132,401.75	5.28
122	600118	中国卫星	20,122,787.50	5.28
123	600834	申通地铁	20,106,913.18	5.28
124	002308	威创股份	19,847,632.45	5.21
125	601988	中国银行	19,700,523.97	5.17
126	300202	聚龙股份	19,625,130.70	5.15
127	300324	旋极信息	19,572,255.74	5.14
128	603368	柳州医药	19,556,091.93	5.13
129	002480	新筑股份	19,256,660.08	5.05
130	002178	延华智能	19,232,507.81	5.05
131	603066	音飞储存	19,184,938.67	5.03
132	002354	天神娱乐	19,029,594.60	4.99
133	300043	互动娱乐	18,951,971.45	4.97
134	002551	尚荣医疗	18,948,145.10	4.97
135	002175	东方网络	18,788,490.87	4.93
136	300152	科融环境	18,696,204.00	4.91
137	002072	凯瑞德	18,578,643.98	4.87
138	300250	初灵信息	18,501,326.68	4.85
139	002343	禾欣股份	18,345,568.18	4.81

140	300364	中文在线	18,304,875.00	4.80
141	300292	吴通控股	18,280,088.08	4.80
142	002589	瑞康医药	17,797,452.83	4.67
143	000599	青岛双星	17,768,211.20	4.66
144	002290	禾盛新材	17,707,568.72	4.65
145	002516	旷达科技	17,545,326.05	4.60
146	601628	中国人寿	17,533,001.22	4.60
147	000877	天山股份	17,491,047.41	4.59
148	300097	智云股份	17,176,554.79	4.51
149	600180	瑞茂通	16,792,953.12	4.41
150	002634	棒杰股份	16,509,618.14	4.33
151	600240	华业资本	16,501,864.68	4.33
152	300287	飞利信	16,468,478.39	4.32
153	300140	启源装备	16,438,103.61	4.31
154	002612	朗姿股份	16,378,359.75	4.30
155	600285	羚锐制药	16,376,720.66	4.30
156	002538	司尔特	16,306,448.22	4.28
157	601398	工商银行	16,138,894.82	4.23
158	002291	星期六	16,118,761.76	4.23
159	300285	国瓷材料	15,945,798.37	4.18
160	300153	科泰电源	15,757,306.76	4.13
161	601377	兴业证券	15,690,048.00	4.12
162	000971	高升控股	15,533,190.78	4.08
163	600105	永鼎股份	15,474,336.00	4.06
164	000024	招商地产	15,369,683.12	4.03
165	600340	华夏幸福	15,240,127.63	4.00
166	600449	宁夏建材	15,138,332.62	3.97
167	600398	海澜之家	15,115,782.60	3.97
168	002081	金螳螂	14,969,953.43	3.93
169	300334	津膜科技	14,801,591.83	3.88
170	600168	武汉控股	14,702,745.29	3.86
171	000027	深圳能源	14,634,120.05	3.84
172	000728	国元证券	14,625,762.61	3.84
173	002345	潮宏基	14,515,603.14	3.81
174	300274	阳光电源	14,339,356.84	3.76
175	002669	康达新材	14,325,872.19	3.76
176	002249	大洋电机	14,144,025.71	3.71
177	002009	天奇股份	14,032,818.21	3.68

178	002756	永兴特钢	13,999,198.60	3.67
179	300018	中元华电	13,980,654.00	3.67
180	300170	汉得信息	13,925,953.75	3.65
181	002311	海大集团	13,906,726.91	3.65
182	300366	创意信息	13,894,669.32	3.65
183	002444	巨星科技	13,885,135.60	3.64
184	002153	石基信息	13,884,838.04	3.64
185	000733	振华科技	13,876,300.83	3.64
186	002142	宁波银行	13,857,924.14	3.64
187	000002	万科A	13,829,453.18	3.63
188	002766	索菱股份	13,791,313.14	3.62
189	300010	立思辰	13,790,966.29	3.62
190	002466	天齐锂业	13,762,080.75	3.61
191	002205	国统股份	13,699,306.29	3.59
192	300004	南风股份	13,693,476.59	3.59
193	000697	炼石有色	13,639,331.44	3.58
194	002137	麦达数字	13,624,010.75	3.57
195	000100	TCL 集团	13,593,228.16	3.57
196	000046	泛海控股	13,569,452.88	3.56
197	600744	华银电力	13,527,192.00	3.55
198	600687	刚泰控股	13,517,689.78	3.55
199	300284	苏交科	13,419,391.47	3.52
200	000031	中粮地产	13,386,384.35	3.51
201	300198	纳川股份	13,109,233.31	3.44
202	300119	瑞普生物	13,005,190.11	3.41
203	300150	世纪瑞尔	12,971,116.50	3.40
204	300359	全通教育	12,969,315.92	3.40
205	002084	海鸥卫浴	12,784,489.30	3.35
206	002173	千足珍珠	12,769,166.36	3.35
207	000829	天音控股	12,728,033.93	3.34
208	000633	合金投资	12,676,535.43	3.33
209	601799	星宇股份	12,668,631.23	3.32
210	002714	牧原股份	12,662,285.23	3.32
211	002502	骅威股份	12,564,695.42	3.30
212	002517	泰亚股份	12,511,762.56	3.28
213	600266	北京城建	12,433,085.75	3.26
214	300399	京天利	12,422,240.79	3.26
215	300171	东富龙	12,397,086.66	3.25

216	600098	广州发展	12,388,046.00	3.25
217	002658	雪迪龙	12,377,270.94	3.25
218	002020	京新药业	12,336,664.00	3.24
219	300166	东方国信	12,333,460.83	3.24
220	002325	洪涛股份	12,246,036.93	3.21
221	300036	超图软件	12,244,664.36	3.21
222	600624	复旦复华	12,210,793.20	3.20
223	600958	东方证券	12,204,150.68	3.20
224	600115	东方航空	12,182,132.00	3.20
225	600587	新华医疗	12,175,553.00	3.19
226	000625	长安汽车	12,175,331.68	3.19
227	300431	暴风科技	12,150,511.54	3.19
228	600588	用友网络	12,147,495.96	3.19
229	002467	二六三	12,121,657.74	3.18
230	600760	中航黑豹	12,078,084.50	3.17
231	601992	金隅股份	12,024,984.14	3.16
232	600418	江淮汽车	11,918,583.50	3.13
233	600650	锦江投资	11,891,559.00	3.12
234	600850	华东电脑	11,882,454.41	3.12
235	002184	海得控制	11,867,224.97	3.11
236	600029	南方航空	11,842,849.56	3.11
237	002179	中航光电	11,838,887.35	3.11
238	002400	省广股份	11,838,343.42	3.11
239	600969	郴电国际	11,836,763.05	3.11
240	600422	昆药集团	11,766,561.64	3.09
241	002351	漫步者	11,748,432.96	3.08
242	603799	华友钴业	11,706,720.80	3.07
243	000950	建峰化工	11,701,351.60	3.07
244	600000	浦发银行	11,678,646.40	3.06
245	002146	荣盛发展	11,644,458.00	3.06
246	600805	悦达投资	11,631,978.54	3.05
247	600480	凌云股份	11,595,334.19	3.04
248	600377	宁沪高速	11,533,143.99	3.03
249	002368	太极股份	11,440,432.54	3.00
250	601336	新华保险	11,343,699.77	2.98
251	600155	宝硕股份	11,285,815.05	2.96
252	600399	抚顺特钢	11,198,115.70	2.94
253	000523	广州浪奇	11,180,977.87	2.93

254	000906	物产中拓	11,072,784.55	2.91
255	002590	万安科技	11,072,409.75	2.91
256	600038	中直股份	10,858,919.12	2.85
257	600737	中粮屯河	10,810,739.00	2.84
258	002123	荣信股份	10,809,971.84	2.84
259	300144	宋城演艺	10,781,185.42	2.83
260	300487	蓝晓科技	10,680,255.00	2.80
261	300486	东杰智能	10,631,330.00	2.79
262	000558	莱茵体育	10,542,099.00	2.77
263	600663	陆家嘴	10,527,654.81	2.76
264	600060	海信电器	10,461,365.50	2.75
265	002496	辉丰股份	10,389,517.37	2.73
266	000008	神州高铁	10,296,909.05	2.70
267	300089	文化长城	10,277,228.66	2.70
268	002594	比亚迪	10,238,270.00	2.69
269	601169	北京银行	10,189,748.66	2.67
270	600208	新湖中宝	10,058,286.58	2.64
271	600837	海通证券	10,002,412.65	2.62
272	000671	阳光城	9,957,391.63	2.61
273	601166	兴业银行	9,916,347.85	2.60
274	300048	合康变频	9,849,024.00	2.58
275	600109	国金证券	9,738,622.36	2.56
276	002162	悦心健康	9,626,760.26	2.53
277	300312	邦讯技术	9,525,202.00	2.50
278	600388	龙净环保	9,518,919.16	2.50
279	000673	当代东方	9,514,671.00	2.50
280	603898	好莱客	9,514,581.28	2.50
281	300468	四方精创	9,447,528.69	2.48
282	002224	三力士	9,213,120.00	2.42
283	601800	中国交建	9,039,778.47	2.37
284	600617	国新能源	8,998,162.50	2.36
285	002022	科华生物	8,940,217.08	2.35
286	600358	国旅联合	8,925,828.00	2.34
287	002568	百润股份	8,831,428.76	2.32
288	002095	生意宝	8,774,892.00	2.30
289	000601	韶能股份	8,662,136.88	2.27
290	002438	江苏神通	8,555,339.10	2.24
291	300070	碧水源	8,264,856.97	2.17

292	600016	民生银行	8,254,834.80	2.17
293	300155	安居宝	8,233,003.66	2.16
294	002477	雏鹰农牧	8,230,409.25	2.16
295	600703	三安光电	8,179,437.20	2.15
296	000516	国际医学	8,155,918.40	2.14
297	002390	信邦制药	8,026,694.74	2.11
298	600352	浙江龙盛	8,006,821.05	2.10
299	600820	隧道股份	7,936,209.16	2.08
300	601000	唐山港	7,891,686.55	2.07
301	000918	嘉凯城	7,886,247.86	2.07
302	300442	普丽盛	7,867,405.30	2.06
303	002063	远光软件	7,857,174.00	2.06
304	300262	巴安水务	7,711,219.19	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。

8.4.3 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	6,899,996,218.48
卖出股票收入（成交）总额	6,687,827,311.56

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	1,366,913.02
2	应收证券清算款	15,958,138.33
3	应收股利	-
4	应收利息	25,520.62
5	应收申购款	642,139.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,992,711.43

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002612	朗姿股份	16,661,190.70	2.55	公告重大事项
2	300038	梅泰诺	14,296,226.36	2.19	公告重大事项

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
31,087	9,208.95	29,971,218.92	10.47%	256,307,379.47	89.53%

9.2 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	9,364.64	0.0033%

9.3 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月26日）基金份额总额	971,415,105.20
本报告期期初基金份额总额	269,867,094.58
本报告期基金总申购份额	1,034,888,726.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,018,477,222.39
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	286,278,598.39

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人农银汇理基金管理有限公司（下称农银汇理）于2015年4月29日发布公告，Laurent Tournier(杜明华)先生因任职到期不再担任农银汇理副总经理；于2015年5月28日发布公告，由许金超先生任农银汇理总经理，施卫先生不再代为履行总经理职务；于2015年10月10日发布公告，于进先生担任农银汇理的法定代表人、董事长，刁钦义先生不再担任农银汇理的法定代表人、董事长。

本报告期内，交通银行股份有限公司(以下简称“本行”)因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 7 万元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚情况。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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
长江证券		22,920,544,100.13	21.49%	2,684,296.66	21.47%	-
中信证券		22,194,539,818.81	16.15%	2,027,598.28	16.22%	-
招商证券		21,566,725,384.74	11.53%	1,432,654.09	11.46%	-
方正证券		21,563,046,930.73	11.50%	1,446,568.21	11.57%	-
银河证券		11,000,424,444.81	7.36%	928,292.97	7.43%	-
平安证券	1	804,849,095.43	5.92%	742,903.23	5.94%	-
华创证券	2	757,272,717.78	5.57%	699,006.56	5.59%	-
中信建投	2	668,412,406.40	4.92%	612,781.14	4.90%	-
华泰证券	2	644,841,438.28	4.75%	587,064.36	4.70%	-
光大证券	1	542,227,975.22	3.99%	493,645.62	3.95%	-
海通证券	2	262,001,300.46	1.93%	238,528.40	1.91%	-
广发证券	1	224,403,770.47	1.65%	208,988.05	1.67%	-
东方证券	1	180,384,102.74	1.33%	164,223.99	1.31%	-
安信证券	2	147,087,812.84	1.08%	133,908.86	1.07%	-
东兴证券	2	90,565,078.85	0.67%	82,450.49	0.66%	-
申万宏源	1	13,885,202.33	0.10%	12,641.36	0.10%	-
国泰君安	2	6,611,950.02	0.05%	6,019.45	0.05%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：

- (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。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

11.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2015 年 7 月 30 日，农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）发布《农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称的公告》（以下简称“公告”），公告指出“本公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和旗下各股票型基金《基金合同》的相关规定，经对相关风险进行审慎、充分评估，且经与相关基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2015 年 8 月 7 日起将‘农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金’变更为‘农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金’，但不变更基金的股票投资比例和基金代码。”

由于本次基金更名不改变基金投资范围，对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。因此，按照基金合同的约定，不需要召开持有人大会。

农银汇理基金管理有限公司
2016 年 3 月 29 日