

农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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 2016 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	农银信息传媒股票
基金主代码	001319
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,162,064,507.93 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信息传媒主题相关的优质上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>信息传媒产业根据所提供的产品与服务类别不同，可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素，进行股票资产在信息传媒产业各细分子行业间的动态配置。</p> <p>（2）个股精选策略</p> <p>在细分子行业配置的基础上，本基金将定性研究方法和定量研究方法相结合，对信息传媒相关上市公司的投资价值进行综合评估，精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析，以有利于资产增值为原则，加强风险控制，谨慎参与</p>

	投资。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数×80%+中证全债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105799
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105798

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	2016 年	2015 年 6 月 24 日 (基金合同生效日)– 2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-428,018,619.44	-494,059,408.03	-
本期利润	-763,576,447.23	-176,325,417.61	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2252	-0.0434	-
本期加权平均净值利润率	-28.85%	-4.64%	-
本期基金份额净值增长率	-23.01%	-3.23%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-806,426,793.98	-402,528,573.65	-
期末可供分配基金份额利润	-0.2550	-0.1148	-
期末基金资产净值	2,355,637,713.95	3,392,617,653.07	-
期末基金份额净值	0.7450	0.9677	-

3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-25.50%	-3.23%	-

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。

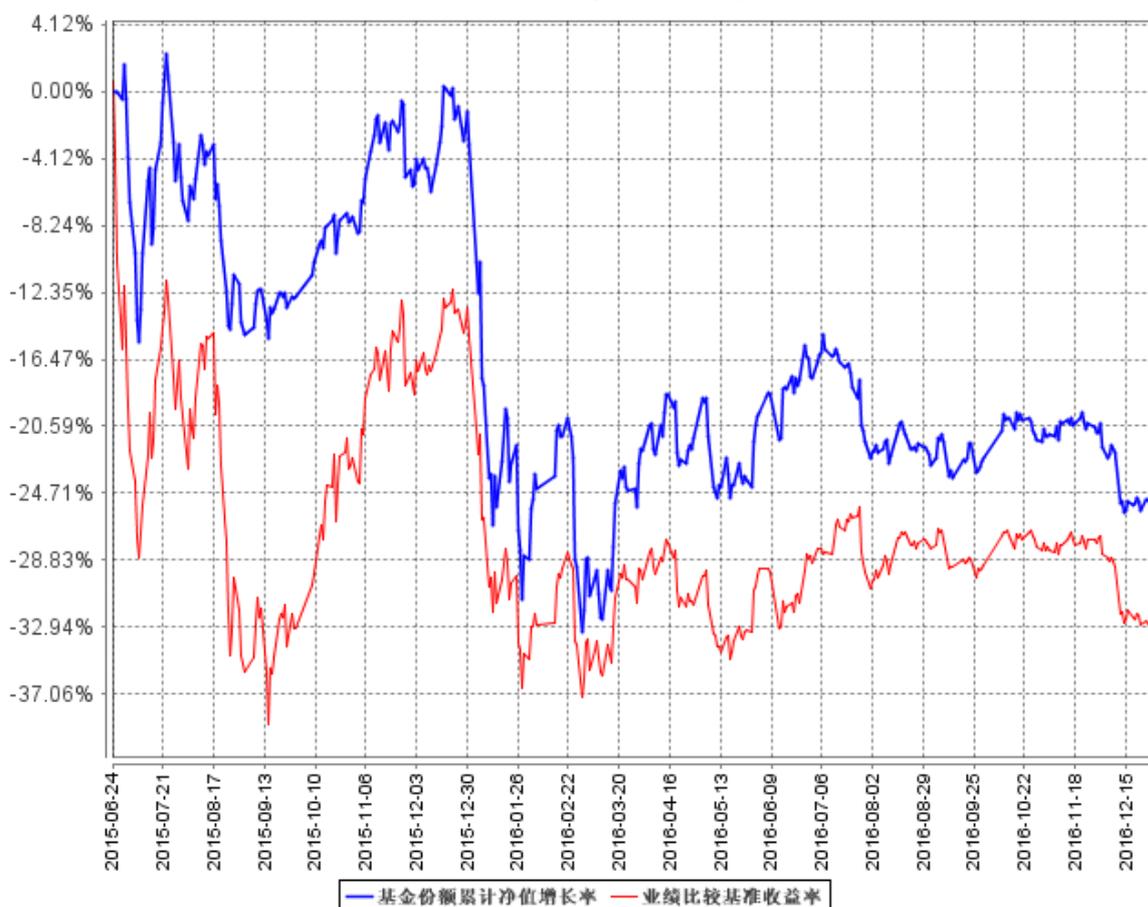
3.2 基金净值表现

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	-3.82%	0.83%	-5.32%	0.79%	1.50%	0.04%
过去六个月	-9.71%	0.88%	-6.04%	0.85%	-3.67%	0.03%
过去一年	-23.01%	1.89%	-21.01%	1.61%	-2.00%	0.28%
自基金合同生效起至今	-25.50%	1.84%	-32.89%	2.10%	7.39%	-0.26%

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

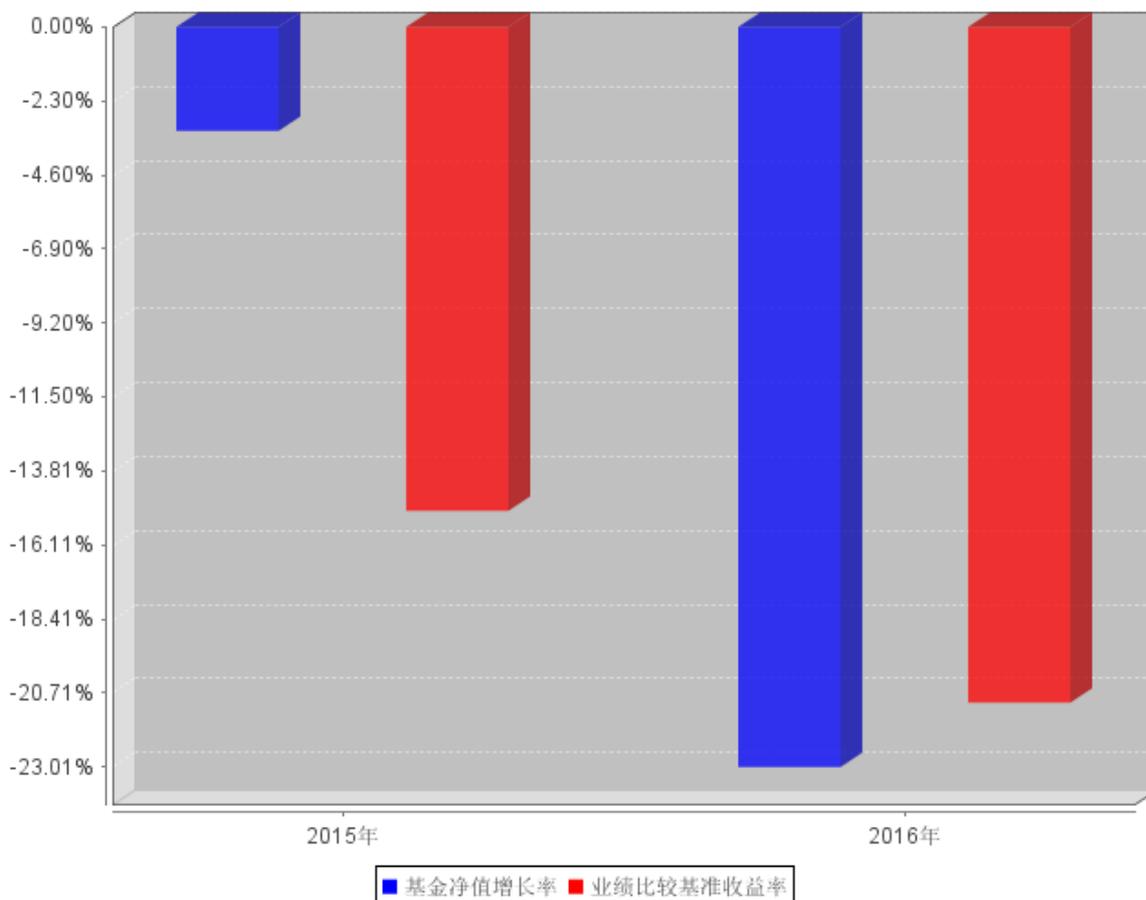
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的信息传媒产业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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



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%，中铝资本控股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 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 37 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、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、农银汇理纯债一年定期开放债券型证券投资基金、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、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金及农银汇理日日鑫交易型货币市场基金。

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	2015 年 6 月 24 日	-	9	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。
赵诣	本基金基金经理助理	2016 年 3 月 2 日	-	4	硕士。历任申银万国证券研究所机械行业分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。

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。

3、农银汇理基金管理有限公司于 2017 年 3 月 21 日发布公告，张燕女士、赵诣先生自 2017 年 3 月 21 日起担任本基金基金经理，凌晨先生自 2017 年 3 月 21 日起不再担任本基金基金经理。

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

本基金的业绩在 2016 年初受到了熔断较大的影响之后，在上半年积极把握了新能源汽车和半导体的结构性机会，一度取得了较好的业绩。但下半年没有把握住地产、白酒、周期品的蓝筹机会，尽管也抓住了个别的战机，但最后全年业绩表现一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为-23.01%，业绩比较基准收益率为-21.01%。

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 年是中国和全球宏观经济见底复苏的一年，从年初到年尾，我们看到了 PPI 从跌幅收窄到转正，黑色系价格的暴涨和不少化工品翻倍的涨幅。也正因为此，进入 2016 年 10 月货币政策也逐渐从宽松开始转向偏紧的状态。2017 年我认为是利率上行和经济复苏的一个博弈，这里会出现多个象限的组合，从大概率上经济在 2017 年上半年就会见到小周期的顶部，之后会迎来配置从周期向成长的转向，因此 2017 年我们应该可以看到阿尔法的行情。

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及其适用性的情况、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收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”，即本基金本年无应分配利润。

2. 报告期内没有实施过利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未实施的利润。

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

本报告期内，本基金托管人在对农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，农银汇理信息传媒主题股票型证券

投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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(2017)第 20969 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	农银汇理信息传媒主题股票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信息传媒主题股票型证券投资基金(以下简称“农银汇理信息传媒股票型基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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信息传媒股票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。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。 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。 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。	
审计意见段	我们认为，上述农银汇理信息传媒股票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信息传媒股票型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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	都晓燕
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	2017 年 3 月 28 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	168,802,038.04	429,559,458.74
结算备付金	5,020,807.78	16,562,688.90
存出保证金	1,374,860.49	3,832,692.57
交易性金融资产	2,035,708,031.47	2,973,229,451.87
其中：股票投资	2,035,708,031.47	2,973,229,451.87
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	199,500,499.25	-

应收证券清算款	-	7,779,272.33
应收利息	116,501.55	119,506.54
应收股利	-	-
应收申购款	42,709.10	284,803.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,410,565,447.68	3,431,367,874.93
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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	47,021,962.23	19,135,672.02
应付赎回款	1,186,857.62	6,686,338.53
应付管理人报酬	3,072,995.72	4,494,873.07
应付托管费	512,165.94	749,145.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,731,521.21	7,569,339.33
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	402,231.01	114,853.41
负债合计	54,927,733.73	38,750,221.86
所有者权益:		
实收基金	3,162,064,507.93	3,505,771,710.30
未分配利润	-806,426,793.98	-113,154,057.23
所有者权益合计	2,355,637,713.95	3,392,617,653.07
负债和所有者权益总计	2,410,565,447.68	3,431,367,874.93

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7450 元，基金份额总额 3,162,064,507.93 份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 日(基 金合同生效日)至
-----	---	--

		2015 年 12 月 31 日
一、收入	-686,723,272.60	-114,740,182.69
1. 利息收入	2,874,843.14	7,791,818.09
其中：存款利息收入	2,739,548.04	7,791,818.09
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	135,295.10	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-354,651,542.13	-443,609,777.09
其中：股票投资收益	-365,771,183.76	-445,772,992.15
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	11,119,641.63	2,163,215.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-335,557,827.79	317,733,990.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	611,254.18	3,343,785.89
减：二、费用	76,853,174.63	61,585,234.92
1. 管理人报酬	39,746,073.28	29,530,074.70
2. 托管费	6,624,345.53	4,921,679.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	30,064,120.30	26,847,232.72
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	418,635.52	286,248.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-763,576,447.23	-176,325,417.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-763,576,447.23	-176,325,417.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,505,771,710.30	-113,154,057.23	3,392,617,653.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-763,576,447.23	-763,576,447.23
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）	-343,707,202.37	70,303,710.48	-273,403,491.89
其中：1. 基金申购款	162,265,054.21	-36,802,630.99	125,462,423.22
2. 基金赎回款	-505,972,256.58	107,106,341.47	-398,865,915.11
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）	3,162,064,507.93	-806,426,793.98	2,355,637,713.95
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 日（基金合同生效日）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）	4,569,455,478.45	-	4,569,455,478.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-176,325,417.61	-176,325,417.61
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）	-1,063,683,768.15	63,171,360.38	-1,000,512,407.77
其中：1. 基金申购款	89,821,590.69	-4,605,300.25	85,216,290.44
2. 基金赎回款	-1,153,505,358.84	67,776,660.63	-1,085,728,698.21
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）	3,505,771,710.30	-113,154,057.23	3,392,617,653.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

_____ 许金超 _____	_____ 刘志勇 _____	_____ 高利民 _____
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

农银汇理信息传媒主题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[2015]第 785 号《关于准予农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金注册的批复》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《农银汇理信息传媒主题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 4,568,289,201.53 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 514 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,569,455,478.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,166,276.92 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理信息传媒主题股票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,包括国内依法发行或上市 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)、债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、资产支持证券等)、货币市场工具(包括短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中投资于本基金界定的信息传媒产业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证 TMT 产业主题指数×80%+中证全债指数×20%。

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》、《农银汇理信息传媒主题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、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金在本报告期间无须说明的重大会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生会计估计变更。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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》、 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》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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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
中国工商银行股份有限公司	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
中铝资本控股有限公司	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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	39,746,073.28	29,530,074.70
其中：支付销售机构的客户维护费	22,075,054.87	16,599,923.09

注：支付基金管理人 农银汇理基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,624,345.53	4,921,679.12

注：支付基金托管人中国工商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。

7.4.7.2.3 销售服务费

本基金本期无销售服务费。

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。

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

本基金本期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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。

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 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年6月24日(基金合同生效日)至 2015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
中国工商银行	168,802,038.04	2,545,422.19	429,559,458.74	7,660,929.27

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.8 期末（2016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
300223	北京君正	2016年12月19日	公告重大事项	48.40	-	-	1,401,268	51,507,443.42	67,821,371.20	-
600576	万家文化	2016年11月28日	公告重大事项	18.38	2017年1月12日	20.22	2,565,926	63,641,611.25	47,161,719.88	-

002335	科华恒盛	2016 年 12 月 16 日	公告重 大事项	42.90	-	-	1,084,886	51,245,675.63	46,541,609.40	-
002462	嘉事堂	2016 年 9 月 28 日	公告重 大事项	42.53	2017 年 1 月 12 日	38.98	622,309	25,638,455.06	26,466,801.77	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	公告重 大事项	11.42	-	-	50	616.30	571.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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 2016 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 1,847,715,958.22 元，属于第二层次的余额为 187,992,073.25 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,693,194,146.59 元，第二层次 280,035,305.28 元，无属于第三层次的余额)。

(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)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 2016 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(2015 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	2,035,708,031.47	84.45

	其中：股票	2,035,708,031.47	84.45
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	199,500,499.25	8.28
	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	173,822,845.82	7.21
7	其他各项资产	1,534,071.14	0.06
8	合计	2,410,565,447.68	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,608.20	0.00
C	制造业	1,427,257,321.56	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	44,197,224.00	1.88
F	批发和零售业	148,088,356.93	6.29
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	199,422,048.99	8.47
J	金融业	542.44	0.00
K	房地产业	22,635,146.56	0.96
L	租赁和商务服务业	62,391,802.48	2.65
M	科学研究和技术服务业	29,264,736.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	102,443,479.08	4.35
S	综合	4,765.23	0.00
	合计	2,035,708,031.47	86.42

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港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。

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	300115	长盈精密	4,227,845	110,177,640.70	4.68
2	002582	好想你	2,133,553	75,122,401.13	3.19
3	002281	光迅科技	945,651	74,233,603.50	3.15
4	002439	启明星辰	3,327,000	69,168,330.00	2.94
5	300223	北京君正	1,401,268	67,821,371.20	2.88
6	600285	羚锐制药	5,036,600	64,267,016.00	2.73
7	002127	南极电商	5,434,826	62,391,802.48	2.65
8	002640	跨境通	3,373,666	61,738,087.80	2.62
9	002611	东方精工	3,551,560	59,630,692.40	2.53
10	300458	全志科技	639,239	58,445,621.77	2.48

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	600050	中国联通	302,432,950.82	8.91
2	600259	广晟有色	223,929,196.73	6.60
3	600547	山东黄金	158,802,143.08	4.68
4	300014	亿纬锂能	132,518,652.42	3.91

5	300115	长盈精密	118,145,083.19	3.48
6	600549	厦门钨业	115,292,986.02	3.40
7	002456	欧菲光	115,098,011.24	3.39
8	002797	第一创业	109,911,606.00	3.24
9	002292	奥飞娱乐	104,521,779.91	3.08
10	600570	恒生电子	102,512,160.66	3.02
11	300316	晶盛机电	96,965,124.89	2.86
12	300458	全志科技	95,522,015.08	2.82
13	300097	智云股份	94,006,989.03	2.77
14	300433	蓝思科技	93,389,129.78	2.75
15	600158	中体产业	87,436,490.16	2.58
16	600688	上海石化	85,132,412.98	2.51
17	002428	云南锗业	85,091,884.28	2.51
18	300221	银禧科技	83,027,557.55	2.45
19	300160	秀强股份	82,004,580.67	2.42
20	600198	大唐电信	81,175,025.09	2.39
21	300431	暴风集团	80,868,706.60	2.38
22	300364	中文在线	80,674,215.46	2.38
23	300100	双林股份	80,320,477.45	2.37
24	600028	中国石化	78,832,918.00	2.32
25	300078	思创医惠	78,405,787.44	2.31
26	002439	启明星辰	78,214,174.50	2.31
27	002643	万润股份	76,250,595.30	2.25
28	002640	跨境通	76,184,144.42	2.25
29	002131	利欧股份	74,757,978.45	2.20
30	000768	中航飞机	74,330,489.51	2.19
31	600983	惠而浦	73,555,921.95	2.17
32	300144	宋城演艺	72,961,202.42	2.15
33	002582	好想你	71,117,596.55	2.10
34	600476	湘邮科技	69,303,879.35	2.04
35	002217	合力泰	68,862,201.97	2.03

注：买入金额按买入的成交金额（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	600259	广晟有色	263,278,451.55	7.76
2	600050	中国联通	250,114,637.77	7.37
3	600547	山东黄金	200,859,779.11	5.92
4	300014	亿纬锂能	158,625,487.97	4.68
5	002456	欧菲光	125,563,196.87	3.70
6	600570	恒生电子	107,289,882.92	3.16
7	300097	智云股份	101,487,114.64	2.99
8	002797	第一创业	99,739,878.02	2.94
9	002292	奥飞娱乐	98,802,237.48	2.91
10	002667	鞍重股份	95,196,722.69	2.81
11	300160	秀强股份	91,954,452.30	2.71
12	600136	当代明诚	90,967,743.75	2.68
13	603023	威帝股份	90,611,951.82	2.67
14	002127	南极电商	88,438,800.35	2.61
15	300038	梅泰诺	87,157,678.30	2.57
16	300316	晶盛机电	85,343,278.38	2.52
17	600688	上海石化	84,883,902.44	2.50
18	002343	慈文传媒	81,749,696.93	2.41
19	002428	云南锗业	81,656,215.04	2.41
20	600158	中体产业	79,571,578.77	2.35
21	600028	中国石化	79,175,272.00	2.33
22	300144	宋城演艺	78,785,085.44	2.32
23	600198	大唐电信	78,091,131.80	2.30
24	300221	银禧科技	78,011,350.75	2.30
25	600285	羚锐制药	77,223,263.01	2.28
26	002643	万润股份	75,405,211.18	2.22
27	300100	双林股份	74,583,657.97	2.20
28	300078	思创医惠	74,552,654.53	2.20
29	000768	中航飞机	73,092,974.40	2.15
30	002425	凯撒文化	72,933,167.60	2.15
31	300058	蓝色光标	72,858,575.20	2.15
32	601998	中信银行	72,571,319.24	2.14
33	300431	暴风集团	70,101,003.78	2.07
34	600983	惠而浦	70,092,599.32	2.07
35	002108	沧州明珠	67,940,079.78	2.00

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	9,732,478,552.58
卖出股票收入（成交）总额	9,968,670,961.43

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投资。

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	1,374,860.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	116,501.55
5	应收申购款	42,709.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,534,071.14

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	300223	北京君正	67,821,371.20	2.88	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
61,379	51,517.04	27,512,327.99	0.87%	3,134,552,179.94	99.13%

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	247,080.57	0.0078%

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（2015年6月24日）基金份额总额	4,569,455,478.45
本报告期期初基金份额总额	3,505,771,710.30
本报告期基金总申购份额	162,265,054.21
减：本报告期基金总赎回份额	505,972,256.58
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	3,162,064,507.93

§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无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

报告期内基金投资策略没有改变。

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 10 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。本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
安信证券		24,055,088,798.08	20.58%	3,776,504.94	20.58%	-
长江证券		23,632,038,508.55	18.44%	3,382,513.29	18.44%	-
兴业证券		22,668,752,454.55	13.55%	2,485,414.30	13.55%	-
申万宏源		22,608,045,941.34	13.24%	2,428,872.14	13.24%	-
中信证券		21,744,059,593.59	8.85%	1,624,241.47	8.85%	-
银河证券		21,532,495,114.41	7.78%	1,427,203.10	7.78%	-
国泰君安		21,397,546,701.78	7.09%	1,301,537.30	7.09%	-
东方证券		21,006,780,106.01	5.11%	937,615.09	5.11%	-
华泰证券	2	552,854,332.86	2.81%	514,869.91	2.81%	-

东北证券	2	396,603,626.70	2.01%	369,363.37	2.01%	-
西南证券	2	106,884,336.14	0.54%	99,542.18	0.54%	-

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。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

经农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会决议通过，并经中国证券监督管理委员会（证监许可[2016]1197号）批准，中铝资本控股有限公司受让中国铝业股份有限

公司持有的本公司 15%的股权。本次股权转让完成后，本公司注册资本及其余股东的出资比例不变，且本公司的《公司章程》已进行了相应修改。

上述股东变更及修改《公司章程》的工商变更手续于 2016 年 8 月 1 日在上海市工商行政管理局办理完毕。本公司于 2016 年 8 月 6 日在公司网站及有关媒体发布了关于上述股东变更的公告。

农银汇理基金管理有限公司
2017 年 3 月 30 日