

# 农银汇理行业领先混合型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	农银行业领先混合
基金主代码	000127
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 25 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	586,664,446.69 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过寻找受益于中国经济发展且在所属行业处于领先地位的上市公司，进一步优化投资组合，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”的领先企业选股策略，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	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	luzj@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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	23,801,680.36	255,077,110.42	123,468,265.12
本期利润	-63,312,495.64	320,523,456.15	147,247,607.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1072	0.6655	0.3935
本期加权平均净值利润率	-6.16%	39.72%	37.97%
本期基金份额净值增长率	-7.77%	49.28%	43.53%
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	484,593,580.83	400,798,660.70	141,496,129.81
期末可供分配基金份额利润	0.8260	0.8132	0.3153
期末基金资产净值	1,075,173,807.61	979,321,944.80	597,358,866.01
期末基金份额净值	1.8327	1.9870	1.3311
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	83.27%	98.70%	33.11%

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

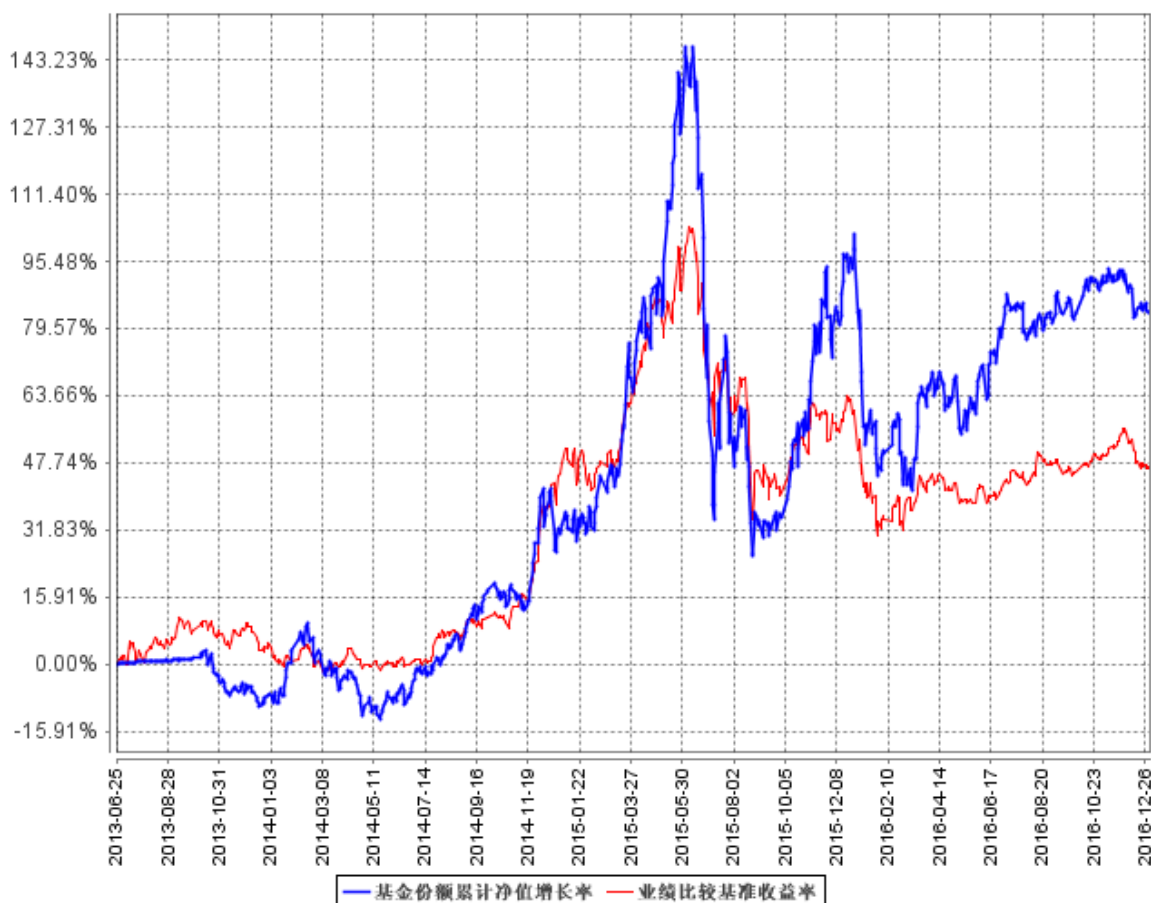
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.04%	0.85%	0.88%	0.55%	-0.84%	0.30%
过去六个月	3.22%	0.90%	3.85%	0.57%	-0.63%	0.33%
过去一年	-7.77%	1.72%	-7.71%	1.05%	-0.06%	0.67%

过去三年	97.62%	2.11%	40.11%	1.34%	57.51%	0.77%
自基金合同生效起至今	83.27%	1.96%	47.00%	1.29%	36.27%	0.67%

### 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

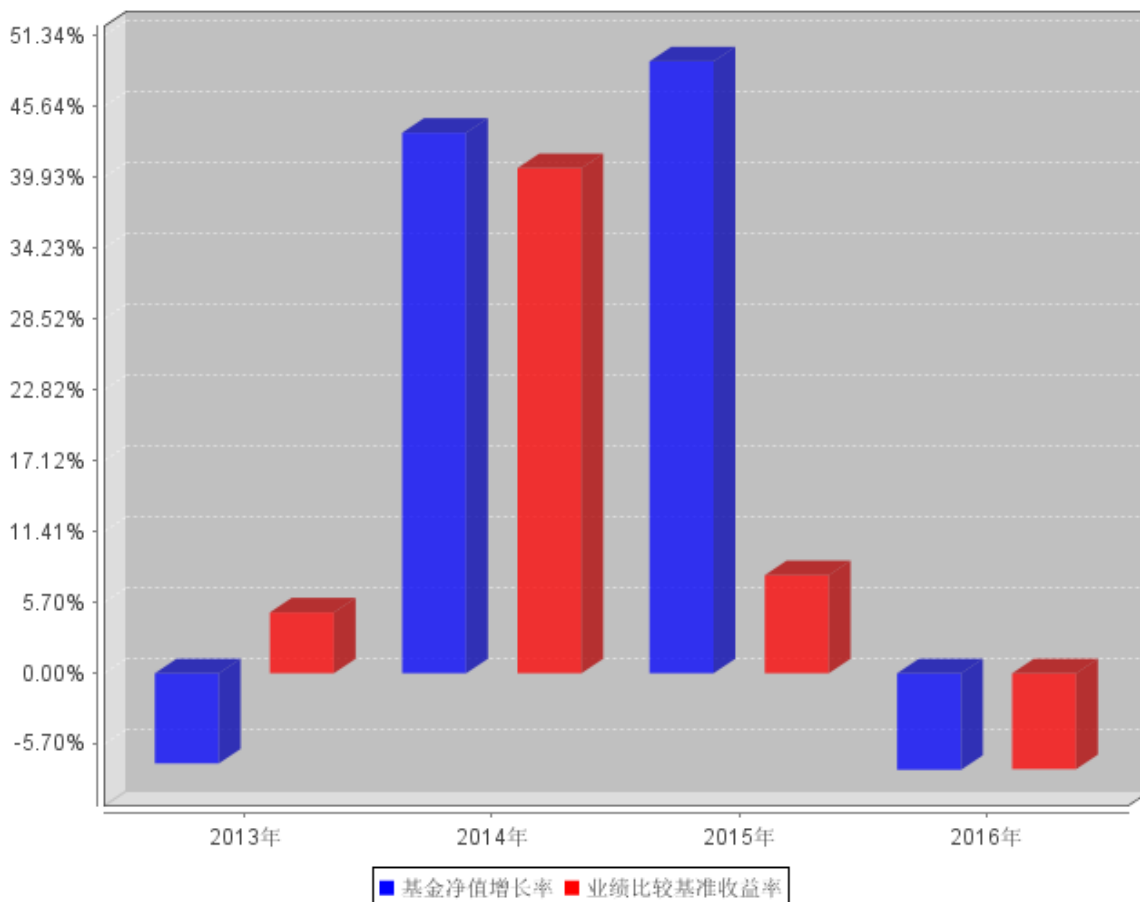
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金股票投资比例不低于基金资产的 60%，其中投资于行业领先类股票的比例不低于非现金基金资产投资的 80%；除股票以外的其它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%。本基金建仓期为基金合同生效日（2013 年 6 月 25 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



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		
赵谦	本基金基金经理	2015 年 6 月 6 日	2016 年 3 月 8 日	9	系统工程（金融工程）硕士。历任山东老虎资产管理公司研发部经理、国信证券经济研究所策略研究员、农银汇理基金管理有限公司策略研究员，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
张峰	本基金基金经理	2015 年 9 月 17 日	-	7	工学硕士。具有基金从业资格。历任南方基金管理有限公司研究员、投资经理助理。

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。

## 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 年全年市场出现了大幅波动的局面，开年市场由于熔断、汇率贬值等因素出现大跌，导致投资者开年出现大幅亏损，整体公募行业净值出现较大幅度下跌。在三月份市场逐步企稳之后，市场进入缓慢上升的趋势，其中二季度新能源汽车、有色小金属、养殖等行业表现优异，三季度市场进入小幅调整期，其中业绩驱动型的白马股涨幅较好，而四季度市场呈现了高开低走的局面。10 月份在相关地产调控信息出台后，市场迎来了一波上涨，其中中小市值个股上涨幅度更大；11 月份在保险举牌的带动下，大市值股票出现了更为明显的上涨，市场二八分化现象开始出现；而 12 月份，在债市大幅下跌的背景下，市场开始逐步担忧流动性的问题，导致 12 月份市场出现了较为明显的下跌。2016 年全年的操作中，开年由于仓位较高，导致净值遭遇较大幅度下跌。3 月份由于抄底及时，在反弹中净值出现了较快速的回升，此后在市场的波动中，仓位抉择相对较好，同时有效抓住了新能源汽车、有色小金属、军工信息化、PPP 等行情，全年业绩相对排名相对较好，但由于年初的亏损较大，导致最后未能实现正收益。

### 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-7.77%，业绩比较基准收益率为-7.71%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们相对谨慎乐观。预计 2017 年初，由于 16 年底市场经历了明显的回调，同时开年流动性相对改善，市场将会有一定的行情。但由于 2017 年整体的货币环境将趋于收紧，因此整体 2017 年估值收缩的压力较大。同时 IPO 的不断加速，导致新股供应量不断增加，对小股票相对较为不利，因为 2017 年我们将尽量回避依靠估值扩张才能上涨的行业。虽然 2017 年估值将会承压，但可喜的是经济的基本面出现了一定的改善迹象，经济在经历了较长时间的低迷之后，在一些领域出现了复苏的迹象，我们将积极寻找一些在经济小幅复苏的背景下，基本面有所改善的行业，尤其是一些竞争格局改善的行业，其行业龙头将会体现出超越行业发展的态势。我们将通过精挑这些行业龙头，通过寻找这些业绩高增长的股票来抵御潜在的估值下行压力。

## 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

2016 年度，基金托管人在农银汇理行业领先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

2016 年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理行业领先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

2016 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行业领先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(2017)第 20915 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	农银汇理行业领先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行业领先混合型证券投资基金(以下简称“农银汇理行业领先混合型基金”)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行业领先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:

	<p>(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;</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>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。</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	<p>我们认为, 上述农银汇理行业领先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行业领先混合型证券投资基金 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。</p>
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: 农银汇理行业领先混合型证券投资基金

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
----	-------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	73,065,141.93	138,156,430.50
结算备付金	8,363,207.27	6,654,135.08
存出保证金	1,094,078.59	1,558,285.81
交易性金融资产	890,964,545.40	844,682,500.82
其中：股票投资	890,964,545.40	844,682,500.82
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	53,500,000.00	-
应收证券清算款	50,551,630.50	-
应收利息	66,346.86	33,609.39
应收股利	-	-
应收申购款	3,540,532.01	24,855,328.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,081,145,482.56	1,015,940,290.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
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	-	22,531,439.24
应付赎回款	1,674,940.05	8,089,039.77
应付管理人报酬	1,369,426.19	1,114,091.18
应付托管费	228,237.68	185,681.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,595,832.96	4,597,890.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	103,238.07	100,203.57
负债合计	5,971,674.95	36,618,345.66
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	586,664,446.69	492,869,662.37
未分配利润	488,509,360.92	486,452,282.43
所有者权益合计	1,075,173,807.61	979,321,944.80
负债和所有者权益总计	1,081,145,482.56	1,015,940,290.46

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8327 元，基金份额总额 586,664,446.69 份。

## 7.2 利润表

会计主体：农银汇理行业领先混合型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-21,645,698.03	357,448,840.43
1. 利息收入	2,634,852.28	1,281,758.71
其中：存款利息收入	2,144,843.48	1,281,473.83
债券利息收入	-	284.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	490,008.80	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	61,944,199.54	285,524,853.37
其中：股票投资收益	59,735,540.98	282,401,188.17
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	179,905.52
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	2,208,658.56	2,943,759.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-87,114,176.00	65,446,345.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	889,426.15	5,195,882.62
<b>减：二、费用</b>	41,666,797.61	36,925,384.28
1. 管理人报酬	15,375,434.29	12,039,699.60
2. 托管费	2,562,572.41	2,006,616.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	23,299,557.28	22,490,110.26
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	429,233.63	388,957.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-63,312,495.64	320,523,456.15

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-63,312,495.64	320,523,456.15

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理行业领先混合型证券投资基金

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）	492,869,662.37	486,452,282.43	979,321,944.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-63,312,495.64	-63,312,495.64
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）	93,794,784.32	65,369,574.13	159,164,358.45
其中：1. 基金申购款	530,181,752.59	391,961,128.37	922,142,880.96
2. 基金赎回款	-436,386,968.27	-326,591,554.24	-762,978,522.51
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）	586,664,446.69	488,509,360.92	1,075,173,807.61
项目	上年度可比期间 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）	448,758,519.63	148,600,346.38	597,358,866.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	320,523,456.15	320,523,456.15
三、本期基金份额交易产	44,111,142.74	17,328,479.90	61,439,622.64





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、可分离债、中期票据、资产支持证券等债券类品种，短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具，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。本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，其中投资于行业领先类股票的比例不低于非现金基金资产投资的 80%；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： $75\% \times \text{沪深 300 指数} + 25\% \times \text{中证全债指数}$ 。

## 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》、《农银汇理行业领先混合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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

### 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税

收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，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
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1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,375,434.29	12,039,699.60
其中：支付销售机构的客户维护费	4,861,716.18	4,534,037.86

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 X 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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	2,562,572.41	2,006,616.63
----------------	--------------	--------------

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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1月1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
交通银行	73,065,141.93	1,215,692.19	138,156,430.50	1,041,944.83

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	2,369	54,866.04	54,866.04	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月	2017年1月	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-

		30 日	10 日							
300588	熙菱 信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

### 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
000711	京蓝科 技	2016 年 10 月 20 日	公告重 大事项	30.86	2017 年 3 月 13 日	29.29	2,479,751	74,377,673.18	76,525,115.86	-

### 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 813,975,718.34 元，属于第二层次的余额为 76,988,827.06 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 773,123,017.56 元，第二层次 71,559,483.26 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，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	890,964,545.40	82.41
	其中：股票	890,964,545.40	82.41

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	53,500,000.00	4.95
	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	81,428,349.20	7.53
7	其他各项资产	55,252,587.96	5.11
8	合计	1,081,145,482.56	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	79,378,265.00	7.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	447,627,063.90	41.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	62,634,530.23	5.83
F	批发和零售业	48,048,715.00	4.47
G	交通运输、仓储和邮政业	25,986,486.68	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.02
J	金融业	67,557,764.95	6.28
K	房地产业	76,525,115.86	7.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	82,926,993.92	7.71
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	-	-



S	综合	-	-
	合计	890,964,545.40	82.87

## 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	600593	大连圣亚	2,089,894	82,926,993.92	7.71
2	000711	京蓝科技	2,479,751	76,525,115.86	7.12
3	300456	耐威科技	1,383,500	70,461,655.00	6.55
4	603808	歌力思	2,038,707	65,422,107.63	6.08
5	000930	中粮生化	4,268,349	57,366,610.56	5.34
6	600436	片仔癀	1,050,100	48,084,079.00	4.47
7	002589	瑞康医药	1,480,700	48,048,715.00	4.47
8	603699	纽威股份	2,852,500	48,036,100.00	4.47
9	300197	铁汉生态	3,521,850	44,657,058.00	4.15
10	000998	隆平高科	2,011,500	43,106,445.00	4.01

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	300456	耐威科技	157,848,381.85	16.12
2	300197	铁汉生态	116,605,686.08	11.91
3	300237	美晨科技	103,931,307.42	10.61
4	002380	科远股份	96,593,122.50	9.86
5	002174	游族网络	91,027,187.35	9.29
6	002766	索菱股份	90,291,412.87	9.22
7	600593	大连圣亚	84,590,077.45	8.64

8	300440	运达科技	79,229,499.49	8.09
9	000018	神州长城	78,986,476.25	8.07
10	600919	江苏银行	77,473,629.07	7.91
11	300278	华昌达	75,097,937.96	7.67
12	300410	正业科技	75,017,354.39	7.66
13	000711	京蓝科技	74,377,673.18	7.59
14	603968	醋化股份	73,782,322.82	7.53
15	000851	高鸿股份	73,212,186.31	7.48
16	600110	诺德股份	72,896,029.59	7.44
17	603808	歌力思	72,520,064.42	7.41
18	000930	中粮生化	72,368,948.58	7.39
19	000700	模塑科技	71,258,823.59	7.28
20	002364	中恒电气	70,555,942.21	7.20
21	601198	东兴证券	69,588,822.23	7.11
22	601398	工商银行	68,307,891.00	6.98
23	601988	中国银行	67,001,709.00	6.84
24	601939	建设银行	66,891,043.64	6.83
25	002214	大立科技	66,777,094.56	6.82
26	002310	东方园林	65,609,235.22	6.70
27	300408	三环集团	65,585,738.40	6.70
28	300014	亿纬锂能	65,562,054.41	6.69
29	000421	南京公用	64,251,902.96	6.56
30	600459	贵研铂业	63,848,410.54	6.52
31	300284	苏交科	63,023,634.95	6.44
32	603885	吉祥航空	60,319,562.51	6.16
33	300431	暴风集团	59,616,467.84	6.09
34	600639	浦东金桥	58,138,395.78	5.94
35	002019	亿帆医药	57,277,637.84	5.85
36	000748	长城信息	56,400,779.13	5.76
37	300471	厚普股份	56,097,575.50	5.73
38	002667	鞍重股份	55,296,185.39	5.65
39	603788	宁波高发	55,165,839.37	5.63
40	300101	振芯科技	55,157,760.79	5.63
41	002151	北斗星通	54,495,350.28	5.56
42	600056	中国医药	53,630,278.85	5.48
43	002673	西部证券	52,259,804.97	5.34

44	002385	大北农	51,872,061.88	5.30
45	603699	纽威股份	51,262,514.73	5.23
46	002589	瑞康医药	50,955,112.84	5.20
47	002366	台海核电	49,551,331.17	5.06
48	000581	威孚高科	49,160,912.54	5.02
49	300496	中科创达	48,963,026.50	5.00
50	600436	片仔癀	48,576,128.59	4.96
51	603799	华友钴业	48,512,035.96	4.95
52	600711	盛屯矿业	48,475,780.70	4.95
53	601009	南京银行	46,749,215.15	4.77
54	300424	航新科技	44,874,138.33	4.58
55	000998	隆平高科	44,389,398.78	4.53
56	600547	山东黄金	43,302,706.86	4.42
57	000078	海王生物	42,313,200.88	4.32
58	600879	航天电子	42,300,448.16	4.32
59	002456	欧菲光	41,780,664.66	4.27
60	002340	格林美	41,230,922.59	4.21
61	002245	澳洋顺昌	41,184,622.30	4.21
62	002502	骅威文化	41,136,756.53	4.20
63	300267	尔康制药	40,614,886.88	4.15
64	002519	银河电子	40,310,947.38	4.12
65	002224	三力士	39,379,373.72	4.02
66	600233	圆通速递	38,490,400.06	3.93
67	603066	音飞储存	38,466,277.46	3.93
68	600598	北大荒	37,134,094.88	3.79
69	000411	英特集团	36,905,565.17	3.77
70	600115	东方航空	36,319,085.99	3.71
71	600489	中金黄金	35,503,505.41	3.63
72	601166	兴业银行	35,502,457.99	3.63
73	300457	赢合科技	35,288,914.24	3.60
74	603869	北部湾旅	35,228,632.42	3.60
75	600015	华夏银行	35,184,613.29	3.59
76	603686	龙马环卫	34,982,640.10	3.57
77	002428	云南锗业	34,929,785.36	3.57
78	300133	华策影视	34,819,956.60	3.56
79	000750	国海证券	34,258,789.45	3.50

80	600519	贵州茅台	34,068,023.46	3.48
81	002142	宁波银行	33,806,456.40	3.45
82	002643	万润股份	33,780,545.65	3.45
83	002588	史丹利	33,337,042.98	3.40
84	002137	麦达数字	33,267,363.16	3.40
85	002470	金正大	33,149,229.00	3.38
86	002699	美盛文化	33,066,510.92	3.38
87	600114	东睦股份	32,744,618.12	3.34
88	300409	道氏技术	32,702,262.22	3.34
89	300011	鼎汉技术	32,514,867.38	3.32
90	002103	广博股份	32,277,624.83	3.30
91	601688	华泰证券	32,213,956.92	3.29
92	600456	宝钛股份	32,195,736.15	3.29
93	000561	烽火电子	31,543,709.01	3.22
94	002157	正邦科技	31,101,972.53	3.18
95	002405	四维图新	31,004,273.71	3.17
96	600888	新疆众和	30,797,985.06	3.14
97	002049	紫光国芯	30,420,278.20	3.11
98	300153	科泰电源	30,276,124.13	3.09
99	603993	洛阳钼业	30,246,936.46	3.09
100	600713	南京医药	29,811,034.33	3.04
101	300473	德尔股份	29,688,268.29	3.03
102	600884	杉杉股份	29,354,035.04	3.00
103	300045	华力创通	29,347,944.89	3.00
104	002610	爱康科技	28,817,662.03	2.94
105	002074	国轩高科	28,641,401.50	2.92
106	002001	新和成	28,615,819.32	2.92
107	000783	长江证券	28,584,783.58	2.92
108	002217	合力泰	27,753,926.16	2.83
109	600373	中文传媒	27,441,336.04	2.80
110	600976	健民集团	27,392,822.40	2.80
111	002171	楚江新材	26,414,418.96	2.70
112	000903	云内动力	26,005,968.94	2.66
113	601618	中国中冶	25,449,136.00	2.60
114	002639	雪人股份	24,783,706.38	2.53
115	300310	宜通世纪	24,740,924.89	2.53

116	002303	美盈森	24,668,061.04	2.52
117	000858	五粮液	24,097,681.32	2.46
118	600136	当代明诚	24,076,512.92	2.46
119	601799	星宇股份	24,009,231.63	2.45
120	002281	光迅科技	23,901,031.95	2.44
121	300481	濮阳惠成	23,334,973.46	2.38
122	600158	中体产业	23,056,046.37	2.35
123	002712	思美传媒	22,908,775.10	2.34
124	002023	海特高新	22,787,715.18	2.33
125	600419	天润乳业	22,553,809.55	2.30
126	600259	广晟有色	22,347,673.35	2.28
127	600362	江西铜业	22,245,962.33	2.27
128	300437	清水源	22,066,018.82	2.25
129	002009	天奇股份	22,057,295.83	2.25
130	601668	中国建筑	22,017,386.00	2.25
131	002701	奥瑞金	21,983,238.40	2.24
132	600643	爱建集团	21,978,496.18	2.24
133	603017	中衡设计	21,954,399.56	2.24
134	600861	北京城乡	21,922,256.48	2.24
135	600395	盘江股份	21,809,728.15	2.23
136	600729	重庆百货	21,802,561.81	2.23
137	002120	韵达股份	21,622,662.69	2.21
138	600068	葛洲坝	21,178,662.53	2.16
139	000606	*ST 易桥	20,405,158.00	2.08
140	002721	金一文化	20,382,418.19	2.08
141	002558	世纪游轮	20,083,936.75	2.05
142	300395	菲利华	19,832,107.41	2.03
143	300232	洲明科技	19,769,678.85	2.02
144	300144	宋城演艺	19,639,181.72	2.01

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	002380	科远股份	136,670,709.92	13.96

2	300237	美晨科技	111,768,280.70	11.41
3	000018	神州长城	107,382,670.61	10.97
4	002224	三力士	100,417,140.46	10.25
5	300456	耐威科技	98,047,857.90	10.01
6	002174	游族网络	93,110,443.40	9.51
7	300278	华昌达	92,725,375.15	9.47
8	002766	索菱股份	91,176,706.16	9.31
9	600110	诺德股份	89,958,175.25	9.19
10	000851	高鸿股份	82,811,581.29	8.46
11	300410	正业科技	81,112,391.05	8.28
12	600919	江苏银行	80,613,772.01	8.23
13	300197	铁汉生态	79,161,935.88	8.08
14	300440	运达科技	77,909,831.20	7.96
15	300014	亿纬锂能	77,177,122.95	7.88
16	002310	东方园林	74,731,285.47	7.63
17	600459	贵研铂业	72,836,897.05	7.44
18	603968	醋化股份	71,642,267.09	7.32
19	000700	模塑科技	71,384,484.85	7.29
20	002364	中恒电气	69,623,239.05	7.11
21	000421	南京公用	69,518,997.57	7.10
22	002123	梦网荣信	68,457,930.00	6.99
23	601198	东兴证券	68,336,436.94	6.98
24	002214	大立科技	67,615,958.11	6.90
25	300101	振芯科技	67,567,727.26	6.90
26	000748	长城信息	65,712,650.93	6.71
27	002137	麦达数字	64,308,759.88	6.57
28	601398	工商银行	63,522,119.00	6.49
29	002519	银河电子	63,077,032.95	6.44
30	002151	北斗星通	61,744,583.00	6.30
31	600639	浦东金桥	60,927,919.37	6.22
32	600056	中国医药	60,610,883.46	6.19
33	601939	建设银行	59,901,656.52	6.12
34	600593	大连圣亚	58,818,125.68	6.01
35	601988	中国银行	58,813,832.00	6.01
36	603885	吉祥航空	58,645,337.10	5.99
37	300310	宜通世纪	58,385,223.50	5.96
38	002667	鞍重股份	57,863,628.14	5.91
39	300408	三环集团	56,305,496.75	5.75

40	603788	宁波高发	55,755,685.44	5.69
41	300431	暴风集团	55,504,626.62	5.67
42	300284	苏文科	51,401,462.63	5.25
43	002385	大北农	50,543,517.42	5.16
44	300153	科泰电源	50,160,288.00	5.12
45	601009	南京银行	49,981,438.50	5.10
46	000581	威孚高科	49,664,759.78	5.07
47	300496	中科创达	49,039,627.92	5.01
48	300471	厚普股份	48,739,395.14	4.98
49	300043	星辉娱乐	48,112,017.89	4.91
50	603799	华友钴业	47,824,669.52	4.88
51	002673	西部证券	47,301,273.00	4.83
52	002366	台海核电	47,200,292.20	4.82
53	002019	亿帆医药	46,500,190.78	4.75
54	600711	盛屯矿业	46,384,294.74	4.74
55	600547	山东黄金	45,978,973.10	4.69
56	300457	赢合科技	43,863,080.19	4.48
57	300424	航新科技	43,770,742.77	4.47
58	002502	骅威文化	43,729,179.34	4.47
59	600879	航天电子	43,073,753.32	4.40
60	300267	尔康制药	42,710,620.91	4.36
61	002245	澳洋顺昌	42,010,525.77	4.29
62	000078	海王生物	41,783,380.81	4.27
63	002456	欧菲光	41,276,541.03	4.21
64	002643	万润股份	41,007,166.64	4.19
65	002590	万安科技	40,799,006.08	4.17
66	600015	华夏银行	39,447,326.33	4.03
67	002340	格林美	38,516,680.48	3.93
68	000606	*ST 易桥	38,444,236.82	3.93
69	603686	龙马环卫	37,628,920.27	3.84
70	600456	宝钛股份	37,533,899.69	3.83
71	600489	中金黄金	36,655,776.25	3.74
72	002558	世纪游轮	36,555,874.23	3.73
73	300133	华策影视	35,783,296.99	3.65
74	002142	宁波银行	35,748,804.16	3.65
75	002428	云南锗业	34,417,525.97	3.51
76	300011	鼎汉技术	34,223,698.36	3.49
77	002699	美盛文化	34,107,702.14	3.48

78	600888	新疆众和	33,968,972.47	3.47
79	002074	国轩高科	33,722,679.99	3.44
80	603869	北部湾旅	33,717,820.11	3.44
81	601166	兴业银行	33,673,919.53	3.44
82	600519	贵州茅台	33,591,345.25	3.43
83	000561	烽火电子	33,436,723.04	3.41
84	002103	广博股份	32,814,324.32	3.35
85	600115	东方航空	32,691,246.20	3.34
86	000750	国海证券	32,501,644.62	3.32
87	300409	道氏技术	32,388,761.17	3.31
88	600114	东睦股份	32,048,970.99	3.27
89	300045	华力创通	31,500,157.51	3.22
90	002470	金正大	31,351,409.36	3.20
91	002588	史丹利	31,325,185.81	3.20
92	002049	紫光国芯	31,235,671.16	3.19
93	300473	德尔股份	30,731,169.79	3.14
94	002405	四维图新	30,336,504.81	3.10
95	002001	新和成	30,244,127.58	3.09
96	000411	英特集团	29,977,321.80	3.06
97	600373	中文传媒	29,262,707.63	2.99
98	600884	杉杉股份	29,098,427.54	2.97
99	002639	雪人股份	28,894,432.47	2.95
100	002157	正邦科技	28,876,067.09	2.95
101	603993	洛阳钼业	28,448,186.00	2.90
102	601799	星宇股份	27,940,231.60	2.85
103	002171	楚江新材	27,839,893.23	2.84
104	600713	南京医药	27,730,372.11	2.83
105	002610	爱康科技	27,535,372.96	2.81
106	002217	合力泰	27,502,027.10	2.81
107	600136	当代明诚	26,596,234.68	2.72
108	600158	中体产业	25,497,476.20	2.60
109	000903	云内动力	25,346,393.00	2.59
110	300481	濮阳惠成	25,278,035.23	2.58
111	002303	美盈森	25,051,882.78	2.56
112	300031	宝通科技	24,713,473.34	2.52
113	600976	健民集团	24,529,996.67	2.50
114	601618	中国中冶	24,281,683.00	2.48
115	600419	天润乳业	24,246,501.28	2.48



116	300503	昊志机电	23,709,610.36	2.42
117	002009	天奇股份	23,294,265.92	2.38
118	002587	奥拓电子	23,085,299.33	2.36
119	603017	中衡设计	23,035,015.11	2.35
120	002023	海特高新	22,911,008.96	2.34
121	002712	思美传媒	22,746,987.77	2.32
122	002127	南极电商	22,646,291.73	2.31
123	300437	清水源	22,230,126.68	2.27
124	600068	葛洲坝	22,213,063.66	2.27
125	300279	和晶科技	22,018,924.10	2.25
126	600259	广晟有色	21,534,832.73	2.20
127	002701	奥瑞金	21,348,534.36	2.18
128	600729	重庆百货	21,348,454.88	2.18
129	600362	江西铜业	21,273,218.25	2.17
130	601668	中国建筑	21,203,574.00	2.17
131	600861	北京城乡	20,842,523.00	2.13
132	002582	好想你	20,793,881.42	2.12
133	300215	电科院	20,639,311.89	2.11
134	300144	宋城演艺	19,948,472.80	2.04
135	600395	盘江股份	19,857,351.07	2.03
136	300232	洲明科技	19,645,162.00	2.01
137	000687	华讯方舟	19,614,481.81	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	7,714,551,970.27
卖出股票收入（成交）总额	7,640,891,290.67

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	1,094,078.59
2	应收证券清算款	50,551,630.50
3	应收股利	-
4	应收利息	66,346.86
5	应收申购款	3,540,532.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,252,587.96

#### 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	000711	京蓝科技	76,525,115.86	7.12	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
61,305	9,569.60	116,207,216.99	19.81%	470,457,229.70	80.19%

### 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	60,561.40	0.0103%

**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	0~10
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6月25日）基金份额总额	863,696,776.13
本报告期期初基金份额总额	492,869,662.37
本报告期基金总申购份额	530,181,752.59
减：本报告期基金总赎回份额	436,386,968.27
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	586,664,446.69

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未发生重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

**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 9.8 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	
中信证券		22,057,716,039.41	13.40%	1,916,354.78	13.40%	-
方正证券		21,930,957,052.85	12.58%	1,798,305.40	12.58%	-
国泰君安		21,589,541,293.58	10.35%	1,480,342.46	10.35%	-
广发证券		11,342,027,493.25	8.74%	1,249,823.41	8.74%	-
海通证券		21,313,153,142.99	8.55%	1,222,940.49	8.55%	-
中信建投		21,280,349,679.43	8.34%	1,192,391.56	8.34%	-
银河证券	1	992,701,696.24	6.47%	924,505.14	6.47%	-
东兴证券	2	733,581,994.86	4.78%	683,183.20	4.78%	-
长江证券	2	535,077,333.46	3.49%	498,314.90	3.49%	-
平安证券	1	522,795,135.19	3.41%	486,879.60	3.41%	-
中金公司	1	517,707,440.56	3.37%	482,142.94	3.37%	-
安信证券	2	484,785,787.36	3.16%	451,482.86	3.16%	-
华泰证券	2	478,050,881.20	3.11%	445,213.46	3.11%	-
国金证券	1	399,473,601.52	2.60%	372,034.14	2.60%	-
光大证券	1	386,507,712.87	2.52%	359,954.54	2.52%	-
中泰证券	1	192,342,726.38	1.25%	179,130.32	1.25%	-
川财证券	2	184,841,250.00	1.20%	172,142.65	1.20%	-
招商证券	2	184,096,829.20	1.20%	171,451.49	1.20%	-
华创证券	2	131,282,537.98	0.86%	122,264.04	0.86%	-
申万宏源	1	53,536,863.19	0.35%	49,860.41	0.35%	-
东方证券	1	40,947,156.05	0.27%	38,134.37	0.27%	-

民生证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	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、本基金本报告期内新增川财证券交易单元, 无剔除交易单元。

### 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
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	320,300,000.00	9.93%	-	-
国泰君安	-	-	105,000,000.00	3.25%	-	-
广发证券	-	-	219,000,000.00	6.79%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	831,600,000.00	25.78%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	917,700,000.00	28.45%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	117,800,000.00	3.65%	-	-
川财证券	-	-	424,600,000.00	13.16%	-	-
招商证券	-	-	290,200,000.00	9.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

## §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