

农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 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.....	38
7.8 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.....	38
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38

§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.3 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.....	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金
基金简称	农银深证 100 指数
基金主代码	660014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 9 月 4 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,715,156.72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数增强的投资策略，在被动复制指数的基础上结合主动管理的增强手段，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 7.75% 以内，日平均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，以期获得超越标的指数的业绩水平。
投资策略	深证 100 指数是综合反映深圳证券交易所上市股票整体走势的宽基指数。本基金通过对深证 100 指数的有效复制和适当增强，力争为投资者提供一个能够分享深圳证券交易所上市股票系统性收益，并获得一定程度的超额收益的良好投资工具。
业绩比较基准	95% × 深证 100 价格指数收益率 + 5% × 商业银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的基金产品。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	张建春
	联系电话	021-61095588	(010)63639180
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		021-61095599	95595
传真		021-61095556	(010)63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	于进	唐双宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 – 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,855,300.41
本期利润	-4,942,264.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1790
本期加权平均净值利润率	-15.18%
本期基金份额净值增长率	-17.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,103,678.49
期末可供分配基金份额利润	0.2202
期末基金资产净值	33,818,835.21
期末基金份额净值	1.2202
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	30.80%

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 06 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.64%	1.39%	1.55%	1.23%	1.09%	0.16%
过去三个月	0.56%	1.39%	-0.14%	1.22%	0.70%	0.17%
过去六个月	-17.94%	2.30%	-14.76%	2.05%	-3.18%	0.25%
过去一年	-34.34%	2.69%	-25.11%	2.43%	-9.23%	0.26%
过去三年	26.04%	1.98%	42.77%	1.84%	-16.73%	0.14%
自基金合同生效起至今	30.80%	1.85%	38.81%	1.76%	-8.01%	0.09%

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



注：本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选股的比例不低于股票投资的 80%，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（2012 年 9 月 4 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。

§ 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 2016 年 6 月 30 日, 公司共管理 32 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和农银汇理纯债一年定期开放债券型证券投资基金。

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		
宋永安	本基金基金经理	2012年9月4日	-	8	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

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,本基金未违反法律法规及基金合同的规定,也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

中国证监会上海监管局对公司内部控制及风险管理情况进行了专项现场检查,于 2015 年就公司内部控制提出了相应整改意见并采取责令改正的行政监管措施。公司以此次现场检查为契机,认真落实上海监管局各项整改意见,进一步提升公司整体内部控制水平。

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。

4.3.2 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

本报告期内,根据定量和定性的分析采取了审慎的基金操作。本基金为指数增强基金,跟踪指数收益同时通过增强操作来获得超额收益。

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-17.94%,同期业绩比较基准收益率为-14.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

16 年,从经济上看,我国经济处于底部调整阶段,经济转型是必然的方向,但是新生的增长动力上不能替代原来的增长方式,所以整体经济上不会有大的起色。投资方向上主要选择几个方面,一选择业绩反转的公司,从估值合理的白马股入手选择有安全边际的公司;二是业绩较确定消费股(如医药、白酒),业绩增长比较确定,估值也较合理;三是国家推动经济转型的方向,如新能

源汽车、核电、智慧城市、半导体等有可能由较好的投资机，但整体上新主题会比较有机会。

深证 100 基金通过定量的方法进行风险管理，通过定性和定量的手段进行个股的选择和行业的配置，以期获得超越基准的收益。

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

根据基金合同的要求，报告期内本基金不需分配利润。

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

本基金在报告期内从 2016 年 2 月 16 日到 6 月 30 日连续 60 个工作日以上出现规模低于 5000 万元，根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，予以披露，且基金管理人已向中国证监会报告并提出了解决方案。

§ 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 年上半年，中国光大银行股份有限公司在农银汇理深证 100 指数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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对农银汇理深证 100 指数型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016 年上半年，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——农银汇理深证 100 指数型基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——农银汇理深证 100 指数型基金管理有限公司编制的《农银汇理深证 100 指数型证券投资基金 2016 年半年度报告》进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,685,067.31	2,164,709.29
结算备付金		1,475.40	237,887.84
存出保证金		41,748.00	63,723.96
交易性金融资产	6.4.7.2	32,571,079.48	33,790,381.08
其中：股票投资		31,571,179.48	32,390,241.08
基金投资		-	-
债券投资		999,900.00	1,400,140.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,757,240.06
应收利息	6.4.7.5	19,553.60	81,242.52
应收股利		-	-
应收申购款		18,846.36	29,650.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		34,337,770.15	42,124,834.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	500,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		84,822.77	6,881,217.69
应付管理人报酬		27,493.02	31,223.81
应付托管费		4,123.95	4,683.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,783.68	117,759.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	399,711.52	375,934.22
负债合计		518,934.94	7,910,818.68
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	27,715,156.72	23,008,710.72
未分配利润	6.4.7.10	6,103,678.49	11,205,305.49
所有者权益合计		33,818,835.21	34,214,016.21
负债和所有者权益总计		34,337,770.15	42,124,834.89

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2202 元，基金份额总额 27,715,156.72 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-4,434,750.91	21,335,320.67
1.利息收入		22,302.71	44,851.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,284.78	13,279.10
债券利息收入		11,017.93	31,572.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,414,113.90	28,263,268.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,642,077.62	28,045,834.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-17,321.30	-9,975.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	245,285.02	227,409.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,086,963.63	-7,146,330.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	44,023.91	173,531.01
减：二、费用		507,513.13	1,057,888.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	166,749.71	275,149.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,012.43	41,272.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	101,024.43	521,607.74
5. 利息支出		274.48	2,478.37
其中：卖出回购金融资产支出		274.48	2,478.37
6. 其他费用	6.4.7.20	214,452.08	217,380.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,942,264.04	20,277,432.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,942,264.04	20,277,432.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	23,008,710.72	11,205,305.49	34,214,016.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,942,264.04	-4,942,264.04
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）	4,706,446.00	-159,362.96	4,547,083.04
其中：1.基金申购款	36,662,078.89	4,014,908.96	40,676,987.85
2.基金赎回款	-31,955,632.89	-4,174,271.92	-36,129,904.81
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）	27,715,156.72	6,103,678.49	33,818,835.21
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	57,966,053.86	18,509,154.97	76,475,208.83

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,277,432.37	20,277,432.37
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)	-33,454,653.48	-17,745,279.48	-51,199,932.96
其中: 1.基金申购款	65,568,653.72	36,164,417.14	101,733,070.86
2.基金赎回款	-99,023,307.20	-53,909,696.62	-152,933,003.82
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)	24,511,400.38	21,041,307.86	45,552,708.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金(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 302 号《关于核准农银汇理深证 100 指数增强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《农银汇理深证 100 指数增强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 413,593,230.18 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(2012)第 328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 413,666,247.37 份基金份额,其中认购资金利息折合 73,017.19 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理深证 100 指数增强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后上市的股票)、债券、银行存款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的相关规定。其中:股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%,投资于深证 100 价格指数成分股及其备选股的比例不低于股票投资的 80%,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:95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 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》、《农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,685,067.31
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,685,067.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,818,553.09	31,571,179.48	752,626.39
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	999,900.00	-397.10
	银行间市场	-	-
	合计	999,900.00	-397.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	31,818,850.19	32,571,079.48	752,229.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	303.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.63
应收债券利息	19,232.88
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	16.83
合计	19,553.60

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,783.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,783.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	259.44
预提费用	99,452.08
指数使用费	50,000.00
合计	399,711.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,008,710.72	23,008,710.72
本期申购	36,662,078.89	36,662,078.89
本期赎回(以“-”号填列)	-31,955,632.89	-31,955,632.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	27,715,156.72	27,715,156.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,374,966.82	-11,169,661.33	11,205,305.49
本期利润	-2,855,300.41	-2,086,963.63	-4,942,264.04
本期基金份额交易产生的变动数	4,034,190.23	-4,193,553.19	-159,362.96
其中：基金申购款	33,994,879.22	-29,979,970.26	4,014,908.96
基金赎回款	-29,960,688.99	25,786,417.07	-4,174,271.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,553,856.64	-17,450,178.15	6,103,678.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	8,288.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	872.22
其他	2,123.74
合计	11,284.78

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	31,922,637.52
减：卖出股票成本总额	34,564,715.14
买卖股票差价收入	-2,642,077.62

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股）	-17,321.30

及债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	0.00
债券投资收益——申购差价收入	0.00
合计	-17,321.30

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,546,332.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,456,694.20
减：应收利息总额	106,959.80
买卖债券差价收入	-17,321.30

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期末无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本期末无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	245,285.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	245,285.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,086,963.63
——股票投资	-2,103,185.63
——债券投资	16,222.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-2,086,963.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	42,879.36
转换费	1,144.55
合计	44,023.91

注：1. 本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	101,024.43
银行间市场交易费用	-
合计	101,024.43

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	74,589.06
指数使用费	100,000.00
账户服务费	6,000.00
清算所账户服务费	9,000.00
合计	214,452.08

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国光大银行股份有限公司	本基金的托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	166,749.71	275,149.07
其中：支付销售机构的客户维护费	40,640.97	91,690.32

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 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,012.43	41,272.36

注：支付基金托管人 中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	1,685,067.31	8,288.82	3,199,954.27	9,570.11

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
000002	万科A	2015年12月18日	公告重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	85,000	1,229,077.06	1,547,000.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	公告重大事项	22.07	-	-	49,648	968,165.94	1,095,731.36	-
000728	国元证券	2016年6月8日	公告重大事项	16.72	2016年7月8日	17.37	16,300	287,476.04	272,536.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	公告重大事项	12.44	-	-	21,400	281,957.59	266,216.00	-
002065	东华软件	2015年12月21日	公告重大事项	18.72	2016年7月4日	22.59	9,200	195,855.63	172,224.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	公告重大事项	8.29	-	-	19,200	175,151.47	159,168.00	-
000629	*ST钒钛	2016年5月26日	公告重大事项	2.39	-	-	52,720	160,065.51	126,000.80	-
002682	龙洲股份	2016年4月	公告重大	12.69	2016年7月	13.96	30	326.06	380.70	-

		6 日	事项		20 日				
--	--	-----	----	--	------	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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后上市的其他股票）、债券、银行存款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的相关规定。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险，并通过设定相应的风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统，有效的控制和跟踪上述各类风险。

本基金的基金管理人的风险管理机构由董事会稽核及风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部以及各个业务部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放于本基金的托管人 - 中国光大银行，本基金认为与中国光大银行相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金为增强指数基金，其主要资产都将用于投资股票。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本基金股票投资比例范围为基金资产的

90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选股的比例不低于股票投资的 80%，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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	31,571,179.48	93.35	32,390,241.08	94.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,571,179.48	93.35	32,390,241.08	94.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其它变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,848,575.05	1,822,821.74
业绩比较基准下降 5%	-1,848,575.05	-1,822,821.74	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	31,571,179.48	91.94
	其中：股票	31,571,179.48	91.94

2	固定收益投资	999,900.00	2.91
	其中：债券	999,900.00	2.91
	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	1,686,542.71	4.91
7	其他各项资产	80,147.96	0.23
8	合计	34,337,770.15	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	161,541.20	0.48
B	采矿业	126,000.80	0.37
C	制造业	16,058,671.73	47.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,076.00	0.76
E	建筑业	181,331.94	0.54
F	批发和零售业	627,708.00	1.86
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	4,301,465.33	12.72
J	金融业	4,762,521.63	14.08
K	房地产业	2,864,707.25	8.47
L	租赁和商务服务业	384,032.06	1.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	802,907.76	2.37
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	799,385.98	2.36
S	综合	244,449.10	0.72
	合计	31,570,798.78	93.35

7.2.2 期末积极投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	380.70	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	380.70	0.00

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000002	万科A	85,000	1,547,000.00	4.57
2	000651	格力电器	49,648	1,095,731.36	3.24

3	000333	美的集团	42,610	1,010,709.20	2.99
4	000001	平安银行	104,751	911,333.70	2.69
5	000858	五粮液	24,500	796,985.00	2.36
6	000725	京东方 A	326,700	754,677.00	2.23
7	300104	乐视网	13,380	707,935.80	2.09
8	000776	广发证券	40,215	674,003.40	1.99
9	002024	苏宁云商	57,800	627,708.00	1.86
10	300059	东方财富	27,886	619,069.20	1.83
11	002450	康得新	34,145	583,879.50	1.73
12	002415	海康威视	26,250	563,325.00	1.67
13	002304	洋河股份	7,280	523,577.60	1.55
14	000783	长江证券	44,800	519,680.00	1.54
15	002594	比亚迪	7,250	442,322.50	1.31
16	000063	中兴通讯	30,660	439,664.40	1.30
17	300017	网宿科技	6,357	427,190.40	1.26
18	002736	国信证券	24,200	417,450.00	1.23
19	001979	招商蛇口	27,949	398,273.25	1.18
20	000423	东阿阿胶	7,400	390,942.00	1.16
21	000625	长安汽车	28,360	387,681.20	1.15
22	000166	申万宏源	45,975	386,649.75	1.14
23	000100	TCL 集团	117,350	386,081.50	1.14
24	002230	科大讯飞	11,680	383,688.00	1.13
25	000503	海虹控股	9,500	381,995.00	1.13
26	300024	机器人	14,748	374,451.72	1.11
27	000538	云南白药	5,812	373,711.60	1.11
28	002673	西部证券	13,948	360,695.28	1.07
29	002142	宁波银行	23,700	350,286.00	1.04
30	002241	歌尔股份	11,600	332,688.00	0.98
31	002202	金风科技	21,802	329,864.26	0.98
32	000768	中航飞机	15,900	313,071.00	0.93
33	000839	中信国安	14,587	310,848.97	0.92
34	002456	欧菲光	10,200	300,900.00	0.89
35	000402	金融街	30,800	299,376.00	0.89
36	300070	碧水源	19,997	297,555.36	0.88
37	000069	华侨城 A	45,700	292,480.00	0.86
38	300027	华谊兄弟	21,089	285,545.06	0.84
39	000568	泸州老窖	9,400	279,180.00	0.83
40	000728	国元证券	16,300	272,536.00	0.81
41	000895	双汇发展	12,900	269,352.00	0.80

42	002405	四维图新	10,946	269,271.60	0.80
43	002465	海格通信	21,400	266,216.00	0.79
44	002500	山西证券	15,800	261,648.00	0.77
45	000157	中联重科	63,100	260,603.00	0.77
46	002008	大族激光	11,300	258,092.00	0.76
47	000917	电广传媒	15,600	257,868.00	0.76
48	300124	汇川技术	13,199	256,060.60	0.76
49	000559	万向钱潮	16,336	254,841.60	0.75
50	000686	东北证券	19,700	254,327.00	0.75
51	002236	大华股份	19,197	251,480.70	0.74
52	000623	吉林敖东	9,802	244,559.90	0.72
53	000009	中国宝安	17,843	244,449.10	0.72
54	000413	东旭光电	28,400	243,956.00	0.72
55	000338	潍柴动力	30,740	240,079.40	0.71
56	300168	万达信息	9,150	237,808.50	0.70
57	002475	立讯精密	11,625	228,431.25	0.68
58	000876	新希望	27,400	227,968.00	0.67
59	000793	华闻传媒	22,709	224,364.92	0.66
60	002385	大北农	27,350	220,441.00	0.65
61	000750	国海证券	29,350	216,896.50	0.64
62	000630	铜陵有色	84,800	215,392.00	0.64
63	000826	启迪桑德	6,968	212,872.40	0.63
64	000540	中天城投	33,300	207,459.00	0.61
65	000061	农产品	16,900	205,504.00	0.61
66	300315	掌趣科技	19,130	200,673.70	0.59
67	000060	中金岭南	18,475	192,694.25	0.57
68	002030	达安基因	6,862	190,763.60	0.56
69	000977	浪潮信息	8,130	190,648.50	0.56
70	300253	卫宁健康	7,460	184,262.00	0.54
71	002081	金螳螂	18,097	181,331.94	0.54
72	000425	徐工机械	59,088	180,809.28	0.53
73	300058	蓝色光标	18,386	178,528.06	0.53
74	002292	奥飞娱乐	5,855	175,357.25	0.52
75	000792	盐湖股份	8,303	175,193.30	0.52
76	000970	中科三环	11,964	173,597.64	0.51
77	002065	东华软件	9,200	172,224.00	0.51
78	000709	河钢股份	62,000	171,740.00	0.51
79	300498	温氏股份	4,460	161,541.20	0.48
80	000046	泛海控股	15,800	159,738.00	0.47

81	002129	中环股份	19,200	159,168.00	0.47
82	000738	中航动控	6,000	158,400.00	0.47
83	000581	威孚高科	7,700	155,232.00	0.46
84	000039	中集集团	10,900	154,453.00	0.46
85	300002	神州泰岳	13,969	148,630.16	0.44
86	300251	光线传媒	12,600	145,656.00	0.43
87	002739	万达院线	1,800	143,820.00	0.43
88	002276	万马股份	7,014	138,947.34	0.41
89	000031	中粮地产	14,700	138,621.00	0.41
90	000712	锦龙股份	6,600	137,016.00	0.41
91	000598	兴蓉环境	25,700	135,696.00	0.40
92	000778	新兴铸管	29,150	135,256.00	0.40
93	002353	杰瑞股份	6,876	132,569.28	0.39
94	000629	*ST 钒钛	52,720	126,000.80	0.37
95	000800	一汽轿车	11,200	121,856.00	0.36
96	000883	湖北能源	26,000	120,380.00	0.36
97	000878	云南铜业	11,800	120,124.00	0.36
98	000831	*ST 五稀	8,900	117,302.00	0.35
99	002146	荣盛发展	17,000	114,240.00	0.34
100	000825	太钢不锈	30,900	97,644.00	0.29

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002682	龙洲股份	30	380.70	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000651	格力电器	1,432,605.00	4.19
2	000001	平安银行	1,016,465.00	2.97
3	000333	美的集团	898,555.00	2.63

4	000858	五 粮 液	879,969.29	2.57
5	000725	京东方 A	874,426.00	2.56
6	001979	招商蛇口	784,071.00	2.29
7	000839	中信国安	749,549.00	2.19
8	002024	苏宁云商	722,408.00	2.11
9	300059	东方财富	679,545.51	1.99
10	002304	洋河股份	654,862.55	1.91
11	000776	广发证券	648,987.04	1.90
12	002456	欧菲光	639,031.00	1.87
13	002292	奥飞娱乐	556,359.00	1.63
14	002415	海康威视	543,539.00	1.59
15	000540	中天城投	538,752.00	1.57
16	000063	中兴通讯	506,601.00	1.48
17	000100	TCL 集团	493,913.00	1.44
18	002736	国信证券	487,165.00	1.42
19	000793	华闻传媒	485,784.00	1.42
20	000625	长安汽车	484,026.00	1.41

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。

7.4.2 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	000651	格力电器	1,267,279.60	3.70
2	000839	中信国安	923,560.75	2.70
3	000333	美的集团	907,428.00	2.65
4	000858	五 粮 液	866,270.88	2.53
5	000001	平安银行	850,314.00	2.49
6	000725	京东方 A	802,158.00	2.34
7	002456	欧菲光	627,684.00	1.83
8	002024	苏宁云商	617,095.00	1.80
9	300059	东方财富	589,971.00	1.72
10	001979	招商蛇口	582,256.70	1.70
11	000793	华闻传媒	561,418.33	1.64
12	000776	广发证券	542,503.00	1.59
13	002292	奥飞娱乐	507,279.00	1.48
14	002415	海康威视	486,071.00	1.42

15	002304	洋河股份	480,445.00	1.40
16	000783	长江证券	428,488.00	1.25
17	000063	中兴通讯	425,060.00	1.24
18	300024	机器人	424,213.00	1.24
19	000100	TCL 集团	423,405.00	1.24
20	601398	工商银行	422,400.00	1.23

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。

7.4.3 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	35,848,839.17
卖出股票收入（成交）总额	31,922,637.52

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	999,900.00	2.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	999,900.00	2.96

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019518	15 国债 18	10,000	999,900.00	2.96

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

2015 年 9 月 12 日，广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”，股票代码：000776）发布公告（编号：2015-141），称其收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚事先告知书》。《行政处罚事先告知书》指出因广发证券涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，中国证监会拟决定给予广发证券责令整改、警告及罚款的处分。

对广发证券股票投资决策程序的说明：该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库，由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断、按照相关投资决策流程投资了该股票。

其余九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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	41,748.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,553.60
5	应收申购款	18,846.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,147.96

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资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	000002	万科A	1,547,000.00	4.57	公告重大事项
2	000651	格力电器	1,095,731.36	3.24	公告重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五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	002682	龙洲股份	380.70	0.00	公告重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
2,920	9,491.49	8,827,542.34	31.85%	18,887,614.38	68.15%

8.2 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	0.00	0.0000%

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年9月4日）基金份额总额	413,666,247.37
本报告期期初基金份额总额	23,008,710.72
本报告期基金总申购份额	36,662,078.89
减：本报告期基金总赎回份额	31,955,632.89
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	27,715,156.72

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

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未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
银河证券	2	67,743,328.69	100.00%	63,089.43	100.00%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请,集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后,研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价,做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 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
银河证券	2,379,605.10	100.00%	1,600,000.00	100.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2015 年年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告-20160107	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	农银汇理基金管理有限公司关于参与深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
5	农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日

6	农银汇理基金管理有限公司关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 12 日
7	农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金 2015 年年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
8	农银深证 100 指数—招募说明书更新—2016 年第 1 号-20160413	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 15 日
9	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
10	农银汇理基金管理有限公司关于参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
11	农银汇理基金管理有限公司关于参加陆金所认（申）购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
12	农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
13	农银汇理基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于继续参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
15	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
16	关于中国交通银行股份有限公司开展网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理深证 100 指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《农银汇理深证 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2016 年 8 月 26 日