

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	11
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）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金
基金简称	农银大盘蓝筹混合
基金主代码	660006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 1 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	298,914,529.47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票，通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期取得基金资产的长期理性增值。
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。首先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析，对未来股票市场和债券市场的走势进行科学的分析，并以此为基础对大类资产配置进行确定。在“自下而上”的层面，本基金将严格执行备选股票库制度，在建立大盘蓝筹股票库的基础上，综合运用定性和定量的手段，筛选出具有良好基本面和发展前景的蓝筹股票进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	田青
	联系电话	021-61095588	010-67595096
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61095599	010-67595096

传真	021-61095556	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	于进	王洪章

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、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	-69,802,959.36
本期利润	-56,639,409.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1889
本期加权平均净值利润率	-21.30%
本期基金份额净值增长率	-17.57%
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	-24,831,087.38
期末可供分配基金份额利润	-0.0831
期末基金资产净值	274,083,442.09
期末基金份额净值	0.9169
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	-8.31%

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 6 月 30 日。

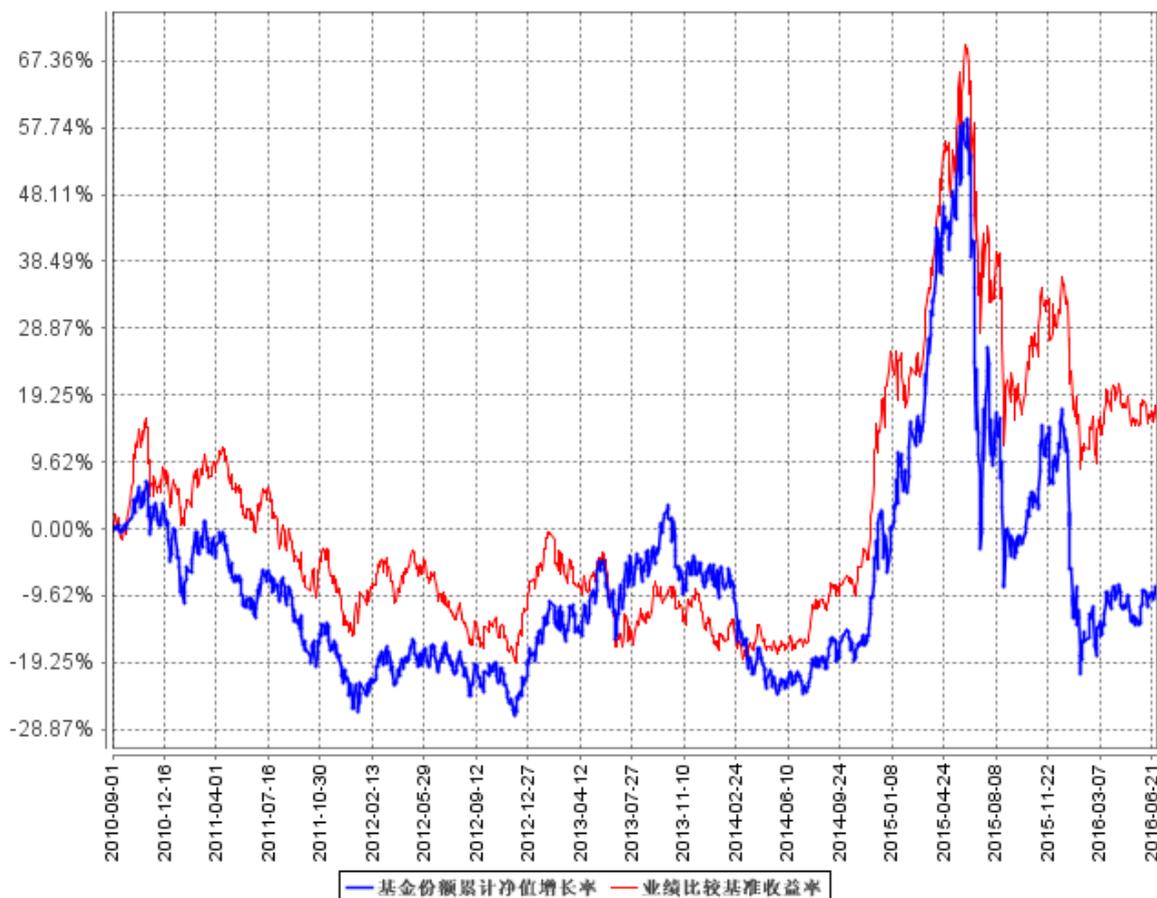
3.2 基金净值表现

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	3.13%	0.88%	-0.17%	0.74%	3.30%	0.14%
过去三个月	1.33%	0.92%	-1.35%	0.76%	2.68%	0.16%
过去六个月	-17.57%	1.93%	-11.14%	1.38%	-6.43%	0.55%
过去一年	-25.42%	2.28%	-20.73%	1.73%	-4.69%	0.55%
过去三年	4.36%	1.81%	39.88%	1.38%	-35.52%	0.43%
自基金合同生效起至今	-8.31%	1.51%	17.75%	1.22%	-26.06%	0.29%

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 60%—95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的 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%，其中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（2010 年 9 月 1 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		
赵谦	本基金基金经理	2014 年 10 月 11 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。
宋永安	本基金基金经理	2015 年 12 月 2 日	-	9	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

本季度内本基金操作主要从个股入手，按照产业发展思路，寻找符合国家经济战略方向的股票以及业绩稳定的白酒医药等消费股来进行配置，来获得较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金份额净值增长率为-17.57%，同期业绩比较基准收益率为-11.14%。

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，但整体上新的主题会比较有机会。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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	57,534,155.02	52,714,310.73
结算备付金		485,395.72	6,032,114.03
存出保证金		207,222.10	755,663.65
交易性金融资产	6.4.7.2	217,730,765.96	266,657,249.89
其中：股票投资		198,092,063.36	266,657,249.89
基金投资		-	-

债券投资		19,638,702.60	-
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		278,462.91	4,941,064.11
应收利息	6.4.7.5	320,254.70	11,202.42
应收股利		-	-
应收申购款		35,892.13	387,512.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		276,592,148.54	331,499,116.90
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		-	-
应付证券清算款		1,085,066.84	3,288,725.64
应付赎回款		321,530.30	1,042,210.23
应付管理人报酬		333,087.66	418,994.00
应付托管费		55,514.59	69,832.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	333,092.26	1,924,143.17
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	380,414.80	331,189.61
负债合计		2,508,706.45	7,075,094.98
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	298,914,529.47	291,656,788.04
未分配利润	6.4.7.10	-24,831,087.38	32,767,233.88
所有者权益合计		274,083,442.09	324,424,021.92
负债和所有者权益总计		276,592,148.54	331,499,116.90

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9169 元，基金份额总额 298,914,529.47 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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		-52,407,100.27	311,855,040.87
1.利息收入		435,970.61	440,572.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	183,816.85	440,539.22
债券利息收入		252,153.76	32.82
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）		-66,040,276.18	406,676,339.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-67,722,113.79	404,527,166.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-28,148.79	-
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	1,709,986.40	2,149,172.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,163,550.03	-95,556,861.26
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	33,655.27	294,990.80
减：二、费用		4,232,309.06	17,700,054.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,983,917.54	5,734,498.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	330,652.90	955,749.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,777,379.87	10,830,644.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	140,358.75	179,161.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-56,639,409.33	294,154,986.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-56,639,409.33	294,154,986.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

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)	291,656,788.04	32,767,233.88	324,424,021.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-56,639,409.33	-56,639,409.33
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)	7,257,741.43	-958,911.93	6,298,829.50
其中：1.基金申购款	43,904,337.01	-4,989,201.18	38,915,135.83
2.基金赎回款	-36,646,595.58	4,030,289.25	-32,616,306.33
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)	298,914,529.47	-24,831,087.38	274,083,442.09
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	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)	1,036,835,837.94	-47,476,177.52	989,359,660.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	294,154,986.83	294,154,986.83
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)	-706,374,280.53	-170,841,065.09	-877,215,345.62
其中：1.基金申购款	177,372,593.49	51,773,999.15	229,146,592.64
2.基金赎回款	-883,746,874.02	-222,615,064.24	-1,106,361,938.26
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)	330,461,557.41	75,837,744.22	406,299,301.63

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：

<u>许金超</u>	<u>刘志勇</u>	<u>高利民</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金(原名为“农银汇理大盘蓝筹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[2010]第 807 号《关于同意农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金募集的批复》核准，由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,916,524,336.73 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(2010)第 230 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,917,182,128.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 657,791.91 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 公告后更名为农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不低于股票资产的 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%，其中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：沪深 300 指数 X 75%+中证全债指数 X 25%。

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”)、中国证监会公告[2010]5号《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》、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证券监督管理委员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2016年上半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等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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需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需说明的重大会计差错更正。

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，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。

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	57,534,155.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	57,534,155.02

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	188,150,061.74	198,092,063.36	9,942,001.62	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	19,676,577.41	19,638,702.60	-37,874.81
	银行间市场	-	-	-

	合计	19,676,577.41	19,638,702.60	-37,874.81
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	207,826,639.15	217,730,765.96	9,904,126.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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	10,137.47
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	196.56
应收债券利息	309,836.77
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	83.88
合计	320,254.70

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	333,092.26

银行间市场应付交易费用	-
合计	333,092.26

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	1,127.46
预提费用	129,287.34
合计	380,414.80

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	291,656,788.04	291,656,788.04
本期申购	43,904,337.01	43,904,337.01
本期赎回(以“-”号填列)	-36,646,595.58	-36,646,595.58
- 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	298,914,529.47	298,914,529.47

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	108,278,545.61	-75,511,311.73	32,767,233.88
本期利润	-69,802,959.36	13,163,550.03	-56,639,409.33
本期基金份额交易产生的变动数	2,471,446.55	-3,430,358.48	-958,911.93
其中：基金申购款	8,928,193.54	-13,917,394.72	-4,989,201.18
基金赎回款	-6,456,746.99	10,487,036.24	4,030,289.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,947,032.80	-65,778,120.18	-24,831,087.38

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	168,904.90
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	11,245.88
其他	3,666.07
合计	183,816.85

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	589,560,628.36
减：卖出股票成本总额	657,282,742.15
买卖股票差价收入	-67,722,113.79

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（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-28,148.79
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-28,148.79

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	26,233,813.23

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,825,142.59
减：应收利息总额	436,819.43
买卖债券差价收入	-28,148.79

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内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	1,709,986.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,709,986.40

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	13,163,550.03
——股票投资	13,201,424.84
——债券投资	-37,874.81
——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	13,163,550.03

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	31,270.25
转换费	2,385.02
合计	33,655.27

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	1,777,379.87
银行间市场交易费用	-
合计	1,777,379.87

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	29,835.26
信息披露费	99,452.08
账户服务费	6,000.00
银行汇划费	5,071.41
合计	140,358.75

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
中国建设银行股份有限公司	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。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,983,917.54	5,734,498.10
其中：支付销售机构的客户维护费	512,258.62	1,443,328.85

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 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	330,652.90	955,749.68

注：支付基金托管人中国建设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。

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无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。

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
中国建设银行	57,534,155.02	168,904.90	56,128,212.64	386,940.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,117	14,498.66	14,498.66	-

			日							
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,142	9,695.58	9,695.58	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	899	9,034.95	9,034.95	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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21日	公告重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	154,100	2,389,887.06	2,804,620.00	-
000651	格力电器	2016年2月22日	公告重大事项	22.07	-	-	21,386	416,982.29	471,989.02	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	公告重大事项	4.90	-	-	95,000	492,151.52	465,500.00	-
600649	城投控股	2016年6月20日	公告重大事项	14.36	-	-	28,700	384,957.36	412,132.00	-
002465	海格通信	2016年6月9日	公告重大事项	12.44	-	-	33,000	411,747.41	410,520.00	-
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	22,692	593,285.49	379,410.24	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	公告重大事项	2.76	-	-	77,600	215,648.29	214,176.00	-
002129	中环股份	2016年4月	公告重大	8.29	-	-	25,400	192,990.93	210,566.00	-

		25 日	事项							
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	公告重大事项	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	3,579	12,419.13	74,872.68	-
002712	思美传媒	2016 年 4 月 11 日	公告重大事项	35.76	2016 年 8 月 17 日	41.82	198	3,211.60	7,080.48	-

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。

6.4.12.3.2 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。

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、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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银行 - 中国建设银行，本基金认为与中国建设银行相关的信用风险不重大。本基金在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。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。由于本基金主要投资于股票等权益类资产，生息资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	57,534,155.02	-	-	-	57,534,155.02
结算备付金	485,395.72	-	-	-	485,395.72
存出保证金	207,222.10	-	-	-	207,222.10
交易性金融资产	9,755,975.50	5,411,017.10	4,471,710.00	198,092,063.36	217,730,765.96
应收证券清算款	-	-	-	278,462.91	278,462.91
应收利息	-	-	-	320,254.70	320,254.70
应收申购款	0.00	-	-	35,892.13	35,892.13
资产总计	67,982,748.34	5,411,017.10	4,471,710.00	198,726,673.10	276,592,148.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,085,066.84	1,085,066.84
应付赎回款	-	-	-	321,530.30	321,530.30
应付管理人报酬	-	-	-	333,087.66	333,087.66
应付托管费	-	-	-	55,514.59	55,514.59
应付交易费用	-	-	-	333,092.26	333,092.26
其他负债	-	-	-	380,414.80	380,414.80
负债总计	0.00	0.00	0.00	2,508,706.45	2,508,706.45
利率敏感度缺口	67,982,748.34	5,411,017.10	4,471,710.00	196,217,966.65	274,083,442.09
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	52,714,310.73	-	-	-	52,714,310.73
结算备付金	6,032,114.03	-	-	-	6,032,114.03
存出保证金	755,663.65	-	-	-	755,663.65
交易性金融资产	-	-	-	266,657,249.89	266,657,249.89
应收证券清算款	-	-	-	4,941,064.11	4,941,064.11
应收利息	-	-	-	11,202.42	11,202.42
应收申购款	0.00	-	-	387,512.07	387,512.07
资产总计	59,502,088.41	0.00	0.00	271,997,028.49	331,499,116.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,288,725.64	3,288,725.64
应付赎回款	-	-	-	1,042,210.23	1,042,210.23

应付管理人报酬	-	-	-	418,994.00	418,994.00
应付托管费	-	-	-	69,832.33	69,832.33
应付交易费用	-	-	-	1,924,143.17	1,924,143.17
其他负债	-	-	-	331,189.61	331,189.61
负债总计	0.00	0.00	0.00	7,075,094.98	7,075,094.98
利率敏感度缺口	59,502,088.41	0.00	0.00	264,921,933.51	324,424,021.92

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末和上年度末未持有利率敏感性资产，因此，市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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 60%-95%，其中投资于大盘蓝筹股票的比例不低于股票资产的 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%，其中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	198,092,063.36	72.27	266,657,249.89	82.19
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	217,730,765.96	79.44	266,657,249.89	82.19

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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）
	上升5%	15,715,359.80	17,304,449.68
下降5%	-15,715,359.80	-17,304,449.68	

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	198,092,063.36	71.62
	其中：股票	198,092,063.36	71.62
2	固定收益投资	19,638,702.60	7.10
	其中：债券	19,638,702.60	7.10
	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	58,019,550.74	20.98
7	其他各项资产	841,831.84	0.30
8	合计	276,592,148.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	167,433.00	0.06
B	采矿业	5,713,838.56	2.08
C	制造业	75,602,970.45	27.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,531,596.00	2.38
E	建筑业	5,417,252.48	1.98
F	批发和零售业	4,264,286.80	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	4,989,270.02	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,747,008.70	6.11
J	金融业	59,114,454.32	21.57
K	房地产业	8,962,199.00	3.27
L	租赁和商务服务业	2,558,231.37	0.93
M	科学研究和技术服务业	522,700.30	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,359,438.48	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	277,628.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	5,031,426.88	1.84
S	综合	832,329.00	0.30
	合计	198,092,063.36	72.27

7.2.2 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。

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

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	601318	中国平安	208,300	6,673,932.00	2.44
2	600519	贵州茅台	14,700	4,291,224.00	1.57
3	600016	民生银行	454,600	4,059,578.00	1.48
4	601166	兴业银行	257,500	3,924,300.00	1.43
5	601398	工商银行	857,800	3,808,632.00	1.39
6	600036	招商银行	198,400	3,472,000.00	1.27
7	601328	交通银行	528,400	2,974,892.00	1.09
8	000002	万科A	154,100	2,804,620.00	1.02
9	600485	信威集团	152,500	2,720,600.00	0.99
10	601988	中国银行	843,000	2,706,030.00	0.99
11	600000	浦发银行	166,320	2,589,602.40	0.94
12	600079	人福医药	150,000	2,515,500.00	0.92
13	600030	中信证券	151,400	2,457,222.00	0.90
14	600837	海通证券	155,600	2,399,352.00	0.88
15	300431	暴风集团	30,000	2,175,000.00	0.79
16	601169	北京银行	195,000	2,022,150.00	0.74
17	600887	伊利股份	116,579	1,943,371.93	0.71
18	601601	中国太保	60,400	1,633,216.00	0.60
19	601766	中国中车	176,300	1,616,671.00	0.59
20	600900	长江电力	126,900	1,584,981.00	0.58
21	601668	中国建筑	288,500	1,534,820.00	0.56
22	000333	美的集团	61,500	1,458,780.00	0.53
23	002739	万达院线	18,000	1,438,200.00	0.52
24	000876	新希望	160,000	1,331,200.00	0.49
25	600104	上汽集团	63,600	1,290,444.00	0.47
26	600056	中国医药	80,000	1,268,800.00	0.46
27	600745	中茵股份	47,000	1,261,480.00	0.46
28	002023	海特高新	72,700	1,259,891.00	0.46
29	300426	唐德影视	18,000	1,227,600.00	0.45
30	600893	中航动力	35,000	1,212,750.00	0.44
31	600518	康美药业	79,235	1,203,579.65	0.44
32	601688	华泰证券	62,900	1,190,068.00	0.43
33	000858	五粮液	36,546	1,188,841.38	0.43
34	601818	光大银行	306,215	1,151,368.40	0.42
35	000001	平安银行	132,120	1,149,444.00	0.42
36	601989	中国重工	176,600	1,117,878.00	0.41
37	600276	恒瑞医药	27,120	1,087,783.20	0.40
38	002551	尚荣医疗	46,300	1,082,494.00	0.39
39	002268	卫士通	30,000	1,072,200.00	0.39

40	600048	保利地产	124,100	1,070,983.00	0.39
41	002230	科大讯飞	32,369	1,063,321.65	0.39
42	000725	京东方 A	457,000	1,055,670.00	0.39
43	600015	华夏银行	102,700	1,015,703.00	0.37
44	002405	四维图新	40,000	984,000.00	0.36
45	300219	鸿利光电	63,000	981,540.00	0.36
46	000555	神州信息	30,000	971,700.00	0.35
47	600028	中国石化	202,100	953,912.00	0.35
48	000776	广发证券	56,900	953,644.00	0.35
49	000799	酒鬼酒	40,000	952,000.00	0.35
50	300104	乐视网	17,800	941,798.00	0.34
51	300325	德威新材	50,000	930,000.00	0.34
52	600999	招商证券	55,800	920,700.00	0.34
53	300059	东方财富	41,062	911,576.40	0.33
54	600562	国睿科技	25,000	857,250.00	0.31
55	600958	东方证券	50,800	853,948.00	0.31
56	300043	互动娱乐	60,000	850,200.00	0.31
57	002450	康得新	49,303	843,081.30	0.31
58	002304	洋河股份	11,633	836,645.36	0.31
59	002736	国信证券	47,300	815,925.00	0.30
60	600285	羚锐制药	74,800	807,092.00	0.29
61	300168	万达信息	30,000	779,700.00	0.28
62	002024	苏宁云商	71,600	777,576.00	0.28
63	300178	腾邦国际	40,000	768,000.00	0.28
64	002456	欧菲光	25,902	764,109.00	0.28
65	002415	海康威视	35,200	755,392.00	0.28
66	600180	瑞茂通	49,968	755,016.48	0.28
67	601390	中国中铁	107,500	749,275.00	0.27
68	000783	长江证券	63,800	740,080.00	0.27
69	601006	大秦铁路	114,400	736,736.00	0.27
70	002339	积成电子	40,000	729,600.00	0.27
71	002594	比亚迪	11,950	729,069.50	0.27
72	000166	申万宏源	85,700	720,737.00	0.26
73	002673	西部证券	26,900	695,634.00	0.25
74	600111	北方稀土	51,700	688,127.00	0.25
75	002436	兴森科技	30,000	683,700.00	0.25
76	601857	中国石油	93,400	675,282.00	0.25
77	601628	中国人寿	31,996	666,156.72	0.24
78	601377	兴业证券	90,100	665,839.00	0.24

79	600795	国电电力	226,700	664,231.00	0.24
80	601186	中国铁建	66,400	661,344.00	0.24
81	000043	中航地产	80,000	660,000.00	0.24
82	601009	南京银行	69,840	655,797.60	0.24
83	000063	中兴通讯	45,400	651,036.00	0.24
84	001979	招商蛇口	45,600	649,800.00	0.24
85	601336	新华保险	15,973	645,309.20	0.24
86	000538	云南白药	10,000	643,000.00	0.23
87	600570	恒生电子	9,512	635,116.24	0.23
88	600050	XD 中国联	163,100	621,411.00	0.23
89	601899	紫金矿业	182,400	614,688.00	0.22
90	600637	东方明珠	25,300	614,031.00	0.22
91	601985	中国核电	89,800	613,334.00	0.22
92	300017	网宿科技	9,123	613,065.60	0.22
93	600011	华能国际	80,800	607,616.00	0.22
94	601901	方正证券	79,200	606,672.00	0.22
95	000625	长安汽车	43,400	593,278.00	0.22
96	300137	先河环保	40,000	591,600.00	0.22
97	002312	三泰控股	30,000	568,500.00	0.21
98	300418	昆仑万维	20,000	565,400.00	0.21
99	300433	蓝思科技	20,100	565,212.00	0.21
100	300352	北信源	30,000	560,100.00	0.20
101	600585	海螺水泥	38,500	559,790.00	0.20
102	000503	海虹控股	13,800	554,898.00	0.20
103	002142	宁波银行	37,500	554,250.00	0.20
104	601555	东吴证券	40,400	541,360.00	0.20
105	600010	包钢股份	187,900	537,394.00	0.20
106	601088	中国神华	38,100	536,067.00	0.20
107	601099	太平洋	87,400	535,762.00	0.20
108	000423	东阿阿胶	10,100	533,583.00	0.19
109	600547	山东黄金	13,700	533,067.00	0.19
110	300024	机器人	20,975	532,555.25	0.19
111	002548	金新农	30,000	526,800.00	0.19
112	600690	青岛海尔	58,900	523,032.00	0.19
113	601211	国泰君安	29,300	521,247.00	0.19
114	600100	同方股份	34,200	511,632.00	0.19
115	600271	航天信息	21,400	509,320.00	0.19
116	600705	中航资本	86,400	508,032.00	0.19
117	300027	华谊兄弟	37,473	507,384.42	0.19

118	300384	三联虹普	10,050	505,515.00	0.18
119	002241	歌尔股份	17,606	504,940.08	0.18
120	600066	宇通客车	25,500	504,900.00	0.18
121	600703	三安光电	24,500	489,265.00	0.18
122	600009	上海机场	18,500	481,925.00	0.18
123	600029	南方航空	67,500	476,550.00	0.17
124	000651	格力电器	21,386	471,989.02	0.17
125	601198	东兴证券	19,300	471,692.00	0.17
126	600109	国金证券	34,900	470,452.00	0.17
127	600019	宝钢股份	95,000	465,500.00	0.17
128	000100	TCL 集团	140,900	463,561.00	0.17
129	000568	泸州老窖	15,500	460,350.00	0.17
130	002202	金风科技	30,050	454,656.50	0.17
131	601669	中国电建	79,400	453,374.00	0.17
132	600383	金地集团	43,300	448,588.00	0.16
133	600535	天士力	12,500	447,000.00	0.16
134	600978	宜华生活	40,000	445,600.00	0.16
135	300070	碧水源	29,846	444,108.48	0.16
136	600886	国投电力	65,300	430,980.00	0.16
137	600115	东方航空	65,200	430,972.00	0.16
138	603008	喜临门	25,000	429,750.00	0.16
139	601727	上海电气	56,800	429,408.00	0.16
140	600089	特变电工	50,000	426,000.00	0.16
141	000768	中航飞机	21,306	419,515.14	0.15
142	000009	中国宝安	30,600	419,220.00	0.15
143	600196	复星医药	22,000	418,440.00	0.15
144	600340	华夏幸福	17,000	414,460.00	0.15
145	601888	中国国旅	9,400	413,412.00	0.15
146	600649	城投控股	28,700	412,132.00	0.15
147	002465	海格通信	33,000	410,520.00	0.15
148	300376	易事特	15,000	409,350.00	0.15
149	600177	雅戈尔	29,500	406,805.00	0.15
150	000069	华侨城 A	63,100	403,840.00	0.15
151	601607	上海医药	22,200	400,710.00	0.15
152	600023	浙能电力	78,500	399,565.00	0.15
153	002252	上海莱士	10,600	399,408.00	0.15
154	000895	双汇发展	19,000	396,720.00	0.14
155	600804	鹏博士	21,757	396,630.11	0.14
156	600369	西南证券	54,346	394,551.96	0.14

157	600153	建发股份	32,700	392,400.00	0.14
158	300315	掌趣科技	37,300	391,277.00	0.14
159	000793	华闻传媒	39,400	389,272.00	0.14
160	600118	中国卫星	11,400	383,040.00	0.14
161	601788	光大证券	22,500	381,150.00	0.14
162	600867	通化东宝	18,360	379,868.40	0.14
163	600061	国投安信	21,300	379,566.00	0.14
164	000728	国元证券	22,692	379,410.24	0.14
165	600660	福耀玻璃	27,000	378,000.00	0.14
166	600352	浙江龙盛	43,800	377,556.00	0.14
167	600489	中金黄金	33,394	375,348.56	0.14
168	600406	国电南瑞	28,000	374,360.00	0.14
169	601919	中国远洋	73,400	372,872.00	0.14
170	600208	新湖中宝	87,500	370,125.00	0.14
171	002008	大族激光	16,167	369,254.28	0.13
172	600446	金证股份	10,250	368,487.50	0.13
173	600031	三一重工	73,200	367,464.00	0.13
174	600739	辽宁成大	23,500	365,895.00	0.13
175	002236	大华股份	27,900	365,490.00	0.13
176	601018	宁波港	73,800	365,310.00	0.13
177	000338	潍柴动力	46,600	363,946.00	0.13
178	000917	电广传媒	21,800	360,354.00	0.13
179	002500	山西证券	21,760	360,345.60	0.13
180	600221	海南航空	113,600	360,112.00	0.13
181	600309	万华化学	20,800	359,840.00	0.13
182	002475	立讯精密	18,100	355,665.00	0.13
183	300124	汇川技术	18,297	354,961.80	0.13
184	000686	东北证券	27,120	350,119.20	0.13
185	600718	东软集团	19,100	349,912.00	0.13
186	002183	怡亚通	24,400	349,408.00	0.13
187	600674	川投能源	42,300	349,398.00	0.13
188	000157	中联重科	84,500	348,985.00	0.13
189	601618	中国中冶	93,700	345,753.00	0.13
190	000559	万向钱潮	22,100	344,760.00	0.13
191	000623	吉林敖东	13,800	344,310.00	0.13
192	600741	华域汽车	24,300	340,443.00	0.12
193	000540	中天城投	54,100	337,043.00	0.12
194	601998	中信银行	58,900	333,963.00	0.12
195	601111	XD 中国国	49,200	332,592.00	0.12

196	600362	江西铜业	24,300	327,564.00	0.12
197	000630	铜陵有色	128,700	326,898.00	0.12
198	002385	大北农	40,350	325,221.00	0.12
199	600415	小商品城	52,300	323,214.00	0.12
200	601933	永辉超市	78,200	322,966.00	0.12
201	600663	陆家嘴	14,100	320,775.00	0.12
202	600018	上港集团	62,400	318,240.00	0.12
203	000963	华东医药	4,700	316,780.00	0.12
204	600839	四川长虹	71,000	313,820.00	0.11
205	600085	同仁堂	10,465	311,752.35	0.11
206	000060	中金岭南	29,800	310,814.00	0.11
207	603993	洛阳钼业	74,700	310,005.00	0.11
208	601800	XD 中国交	29,400	309,582.00	0.11
209	600068	XD 葛洲坝	53,100	309,042.00	0.11
210	002081	金螳螂	30,550	306,111.00	0.11
211	300003	乐普医疗	16,756	305,629.44	0.11
212	000046	泛海控股	30,000	303,300.00	0.11
213	002292	奥飞娱乐	10,100	302,495.00	0.11
214	000792	盐湖股份	14,300	301,730.00	0.11
215	000826	启迪桑德	9,800	299,390.00	0.11
216	000750	国海证券	40,500	299,295.00	0.11
217	000413	东旭光电	34,500	296,355.00	0.11
218	600150	中国船舶	13,300	296,058.00	0.11
219	600583	海油工程	42,500	293,675.00	0.11
220	600398	海澜之家	25,900	292,670.00	0.11
221	600816	安信信托	17,000	286,790.00	0.10
222	600157	永泰能源	71,700	282,498.00	0.10
223	002007	华兰生物	8,960	281,344.00	0.10
224	601958	金钼股份	34,400	280,360.00	0.10
225	000402	金融街	28,700	278,964.00	0.10
226	300015	爱尔眼科	7,600	277,628.00	0.10
227	600588	用友网络	14,099	276,058.42	0.10
228	300144	宋城演艺	11,000	274,010.00	0.10
229	300146	汤臣倍健	20,000	270,800.00	0.10
230	000977	浪潮信息	11,500	269,675.00	0.10
231	600895	张江高科	14,900	269,392.00	0.10
232	600060	海信电器	15,078	266,579.04	0.10
233	600074	保千里	17,700	264,084.00	0.10
234	601106	中国一重	50,400	262,584.00	0.10

235	300058	蓝色光标	26,859	260,800.89	0.10
236	300233	金城医药	10,000	258,900.00	0.09
237	600688	上海石化	42,100	256,810.00	0.09
238	002152	广电运通	15,600	256,464.00	0.09
239	002422	科伦药业	16,600	255,806.00	0.09
240	601333	广深铁路	65,200	254,932.00	0.09
241	600332	白云山	10,300	253,792.00	0.09
242	600820	隧道股份	30,200	253,378.00	0.09
243	600642	申能股份	43,800	251,412.00	0.09
244	000425	徐工机械	81,700	250,002.00	0.09
245	601098	中南传媒	13,800	249,918.00	0.09
246	600256	广汇能源	60,200	246,820.00	0.09
247	300002	神州泰岳	23,000	244,720.00	0.09
248	002470	金正大	30,200	243,110.00	0.09
249	601866	中海集运	61,000	241,560.00	0.09
250	600376	首开股份	21,600	240,192.00	0.09
251	601258	庞大集团	87,200	239,800.00	0.09
252	000738	中航动控	8,832	233,164.80	0.09
253	600027	华电国际	47,100	233,145.00	0.09
254	600252	中恒集团	53,600	232,624.00	0.08
255	600737	中粮屯河	19,700	227,535.00	0.08
256	601718	际华集团	29,700	226,908.00	0.08
257	000709	河钢股份	81,700	226,309.00	0.08
258	600875	东方电气	23,000	225,860.00	0.08
259	601991	大唐发电	57,800	224,842.00	0.08
260	600873	梅花生物	35,900	222,939.00	0.08
261	600373	中文传媒	10,600	219,950.00	0.08
262	601021	春秋航空	4,583	219,709.02	0.08
263	600005	武钢股份	77,600	214,176.00	0.08
264	000035	中国天楹	30,000	212,100.00	0.08
265	002129	中环股份	25,400	210,566.00	0.08
266	600170	上海建工	54,860	210,113.80	0.08
267	601117	中国化学	37,900	209,587.00	0.08
268	300133	华策影视	13,378	208,295.46	0.08
269	600704	物产中大	22,100	206,856.00	0.08
270	000729	燕京啤酒	27,100	205,689.00	0.08
271	000039	中集集团	14,200	201,214.00	0.07
272	601179	中国西电	39,500	200,265.00	0.07
273	601225	陕西煤业	38,600	199,562.00	0.07

274	000061	农产品	16,300	198,208.00	0.07
275	600372	中航电子	10,100	196,647.00	0.07
276	601633	长城汽车	23,200	195,808.00	0.07
277	300251	光线传媒	16,900	195,364.00	0.07
278	000778	新兴铸管	42,000	194,880.00	0.07
279	002027	分众传媒	11,800	194,818.00	0.07
280	601872	招商轮船	40,900	191,412.00	0.07
281	601992	金隅股份	24,100	186,775.00	0.07
282	600038	中直股份	4,500	186,660.00	0.07
283	601898	中煤能源	35,300	182,148.00	0.07
284	000999	华润三九	7,500	181,650.00	0.07
285	601216	君正集团	24,300	181,521.00	0.07
286	002195	二三四五	14,704	180,712.16	0.07
287	600008	首创股份	46,400	180,496.00	0.07
288	600827	百联股份	14,800	178,784.00	0.07
289	000712	锦龙股份	8,600	178,536.00	0.07
290	603000	人民网	10,600	176,066.00	0.06
291	000883	湖北能源	37,500	173,625.00	0.06
292	000800	一汽轿车	15,600	169,728.00	0.06
293	600021	上海电力	16,500	169,455.00	0.06
294	002146	荣盛发展	25,100	168,672.00	0.06
295	600863	内蒙华电	55,800	168,516.00	0.06
296	002153	石基信息	6,200	163,556.00	0.06
297	002294	信立泰	6,000	163,200.00	0.06
298	600959	江苏有线	11,500	160,540.00	0.06
299	300085	银之杰	5,300	158,470.00	0.06
300	600600	青岛啤酒	5,400	156,978.00	0.06
301	601928	凤凰传媒	14,700	154,938.00	0.06
302	000156	华数传媒	8,300	153,965.00	0.06
303	600666	奥瑞德	4,400	152,944.00	0.06
304	000027	深圳能源	22,900	146,102.00	0.05
305	600582	天地科技	31,800	143,100.00	0.05
306	600648	外高桥	7,200	141,912.00	0.05
307	601808	中海油服	11,400	138,510.00	0.05
308	000825	太钢不锈	43,800	138,408.00	0.05
309	000898	鞍钢股份	35,500	135,965.00	0.05
310	601608	中信重工	25,000	134,250.00	0.05
311	002399	海普瑞	7,360	128,505.60	0.05
312	601118	海南橡胶	22,700	126,893.00	0.05

313	600317	营口港	37,300	125,328.00	0.05
314	600783	鲁信创投	5,700	123,177.00	0.04
315	600098	广州发展	15,700	122,774.00	0.04
316	600685	中船防务	4,700	119,192.00	0.04
317	600578	京能电力	26,700	114,276.00	0.04
318	600998	九州通	6,300	110,313.00	0.04
319	300236	上海新阳	2,000	101,180.00	0.04
320	600188	XD 兖州煤	8,400	91,896.00	0.03
321	300516	久之洋	474	83,030.58	0.03
322	600022	山东钢铁	32,400	76,788.00	0.03
323	600606	绿地控股	7,000	75,740.00	0.03
324	601611	中国核建	3,579	74,872.68	0.03
325	002568	百润股份	3,400	74,800.00	0.03
326	603885	吉祥航空	2,600	68,250.00	0.02
327	603131	上海沪工	1,069	64,888.30	0.02
328	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02
329	000531	穗恒运 A	5,000	61,100.00	0.02
330	300326	凯利泰	2,400	59,976.00	0.02
331	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
332	601799	星宇股份	1,000	45,820.00	0.02
333	601127	小康股份	1,884	44,971.08	0.02
334	300100	双林股份	1,000	43,810.00	0.02
335	603598	引力传媒	1,800	43,290.00	0.02
336	603799	华友钴业	1,000	37,200.00	0.01
337	601016	节能风电	3,600	35,748.00	0.01
338	002032	苏泊尔	1,000	34,450.00	0.01
339	002234	民和股份	1,000	29,410.00	0.01
340	600976	健民集团	1,000	26,850.00	0.01
341	300518	盛讯达	565	26,470.25	0.01
342	300031	宝通科技	1,000	25,520.00	0.01
343	600693	东百集团	3,706	24,904.32	0.01
344	002035	华帝股份	1,000	24,480.00	0.01
345	300409	道氏技术	500	23,925.00	0.01
346	300068	南都电源	1,000	21,860.00	0.01
347	002802	洪汇新材	1,428	21,534.24	0.01
348	000909	数源科技	1,000	20,540.00	0.01
349	600195	中牧股份	1,000	18,300.00	0.01
350	002242	九阳股份	1,000	18,180.00	0.01
351	603909	合诚股份	935	17,185.30	0.01

352	300113	顺网科技	452	17,157.92	0.01
353	603958	哈森股份	1,069	15,500.50	0.01
354	002247	帝龙新材	1,000	14,870.00	0.01
355	601966	玲珑轮胎	1,117	14,498.66	0.01
356	601012	隆基股份	1,000	13,050.00	0.00
357	002245	澳洋顺昌	1,000	12,770.00	0.00
358	000673	当代东方	1,000	12,530.00	0.00
359	002502	骅威文化	500	12,300.00	0.00
360	600257	大湖股份	1,000	11,130.00	0.00
361	000890	法尔胜	1,000	10,590.00	0.00
362	603016	新宏泰	1,142	9,695.58	0.00
363	002174	游族网络	300	9,600.00	0.00
364	300520	科大国创	899	9,034.95	0.00
365	002340	格林美	1,000	8,770.00	0.00
366	300457	赢合科技	100	7,741.00	0.00
367	002712	思美传媒	198	7,080.48	0.00
368	300440	运达科技	200	6,742.00	0.00
369	300467	迅游科技	100	6,188.00	0.00
370	300310	宜通世纪	160	6,110.40	0.00
371	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
372	600990	四创电子	56	4,854.64	0.00
373	300279	和晶科技	100	4,749.00	0.00
374	300390	天华超净	250	4,315.00	0.00
375	002074	国轩高科	100	3,947.00	0.00
376	002640	跨境通	200	3,524.00	0.00
377	603006	联明股份	100	2,483.00	0.00
378	000733	振华科技	100	2,250.00	0.00
379	002410	广联达	87	1,244.10	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	600485	信威集团	18,471,739.03	5.69
2	300058	蓝色光标	10,863,787.42	3.35
3	601328	交通银行	9,937,844.00	3.06

4	601398	工商银行	9,385,460.92	2.89
5	600519	贵州茅台	9,136,311.50	2.82
6	300144	宋城演艺	8,131,595.20	2.51
7	601988	中国银行	7,987,071.28	2.46
8	600016	民生银行	7,976,227.76	2.46
9	601166	兴业银行	7,404,848.00	2.28
10	600115	东方航空	7,178,636.00	2.21
11	300496	中科创达	6,952,814.28	2.14
12	300100	双林股份	6,500,604.10	2.00
13	601318	中国平安	6,343,438.00	1.96
14	000860	顺鑫农业	6,020,871.00	1.86
15	300327	中颖电子	5,739,976.50	1.77
16	002224	三力士	5,575,112.44	1.72
17	600000	浦发银行	5,435,614.00	1.68
18	002292	奥飞娱乐	5,409,685.00	1.67
19	300310	宜通世纪	5,184,464.44	1.60
20	603006	黎明股份	5,027,999.77	1.55

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	300104	乐视网	18,386,642.02	5.67
2	300058	蓝色光标	15,899,486.96	4.90
3	002292	奥飞娱乐	13,385,769.24	4.13
4	002230	科大讯飞	12,490,419.21	3.85
5	300017	网宿科技	12,489,335.78	3.85
6	600485	信威集团	11,287,074.68	3.48
7	002224	三力士	10,879,130.24	3.35
8	002123	荣信股份	9,719,406.53	3.00
9	600518	康美药业	9,501,456.75	2.93
10	002410	广联达	8,333,935.90	2.57
11	300133	华策影视	8,284,173.16	2.55
12	300144	宋城演艺	8,197,645.56	2.53
13	600804	鹏博士	8,058,111.97	2.48
14	300100	双林股份	7,354,596.56	2.27

15	601328	交通银行	7,264,348.09	2.24
16	002241	歌尔股份	6,935,297.92	2.14
17	601021	春秋航空	6,874,461.27	2.12
18	300496	中科创达	6,624,180.86	2.04
19	600298	安琪酵母	6,568,337.34	2.02
20	600570	恒生电子	6,258,433.34	1.93

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	575,516,130.78
卖出股票收入（成交）总额	589,560,628.36

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	14,236,702.60	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,402,000.00	1.97
	其中：政策性金融债	5,402,000.00	1.97
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	19,638,702.60	7.17

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	019529	16 国债 01	97,550	9,755,975.50	3.56
2	018002	国开 1302	50,000	5,402,000.00	1.97
3	010107	21 国债(7)	27,000	2,918,160.00	1.06
4	010303	03 国债(3)	15,000	1,553,550.00	0.57

5	010213	02 国债(13)	90	9,017.10	0.00
---	--------	-----------	----	----------	------

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

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。

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	207,222.10
2	应收证券清算款	278,462.91
3	应收股利	-
4	应收利息	320,254.70
5	应收申购款	35,892.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	841,831.84

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

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	2,804,620.00	1.02	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
17,885	16,713.14	7,738,191.48	2.59%	291,176,337.99	97.41%

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（2010年9月1日）基金份额总额	3,917,182,128.64
本报告期期初基金份额总额	291,656,788.04
本报告期基金总申购份额	43,904,337.01
减：本报告期基金总赎回份额	36,646,595.58
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	298,914,529.47

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	1	392,296,919.40	33.69%	365,348.92	-	-
海通证券	2	238,548,013.91	20.49%	222,160.28	-	-
中信证券	2	234,563,089.61	20.14%	218,448.75	-	-
国金证券	2	115,621,812.77	9.93%	107,679.05	-	-
广发证券	2	108,841,408.65	9.35%	101,364.30	-	-
国泰君安	2	33,238,010.79	2.85%	30,954.54	-	-
中金公司	2	32,453,657.91	2.79%	30,220.06	-	-
安信证券	2	8,877,653.54	0.76%	8,267.88	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	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	47,762,147.00	66.99%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	13,477,990.80	18.90%	-	-	-	-
广发证券	6,409,348.80	8.99%	-	-	-	-
国泰君安	2,112,697.50	2.96%	-	-	-	-
中金公司	1,536,529.70	2.16%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	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	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	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
5	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
6	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 8 日
7	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 12 日
8	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 29 日
9	关于工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 31 日
10	农银大盘蓝筹混合一招募说明书更新—2016 年第 1 号	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 13 日
11	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	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
13	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日

	活动的公告		
14	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
15	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
16	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
17	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
18	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	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 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、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理大盘蓝筹混合型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