

# 农银汇理现代农业加灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设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 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 农银现代农业加混合        |
| 基金主代码      | 001940           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 1 月 29 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 | 243,655,234.00 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过深入研究现代农业发展的新动向以及农业产业和新技术新业态相融合的发展新空间，精选优质上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）“现代农业加”主题的界定</p> <p>现代农业是运用现代科学技术、现代工业装备以及现代组织管理方法来经营的社会化、商品化农业，是国民经济中具有较强竞争力的现代产业。</p> <p>（2）行业配置策略</p> <p>根据“现代农业加”主题相关上市公司所提供的产品与服务类别不同，可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素，进行股票资产在“现代农业加”各细分子行业间的动态配置。</p> <p>（3）个股精选策略</p> <p>在细分子行业配置的基础上，本基金将定性研究方法和定量研究方法相结合，对“现代农业加”相关上市公司的投资价值进行综合评估，精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金债券投资管理将主要采取合理预计利率水平、灵活调整组合久期、科学配置投资品种、谨慎选择个券的策略。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析，以有利于资产增值为原则，加强风险控制，谨慎参与投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证大农业指数×65%+中证全债指数×35%。  |
| 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         |

### 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 | <a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a> |
| 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1月29日<br>(基金合同生效日)<br>-2016年12月<br>31日 | 2015年 | 2014年 |
|---------------|---|-------|-------|
| 本期已实现收益       | 12,903,269.77                               | -     | -     |
| 本期利润          | 12,028,231.94                               | -     | -     |

|                      |                |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0274         | -              | -              |
| 本期加权平均净值利润率          | 2.71%          | -              | -              |
| 本期基金份额净值增长率          | 0.93%          | -              | -              |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2016 年末</b> | <b>2015 年末</b> | <b>2014 年末</b> |
| 期末可供分配利润             | 2,255,106.40   | -              | -              |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0093         | -              | -              |
| 期末基金资产净值             | 245,910,340.40 | -              | -              |
| 期末基金份额净值             | 1.0093         | -              | -              |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2016 年末</b> | <b>2015 年末</b> | <b>2014 年末</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 0.93%          | -              | -              |

注：1、本基金的基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，至 2016 年 12 月 31 日不满一年。

2、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。

3、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。

4、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。

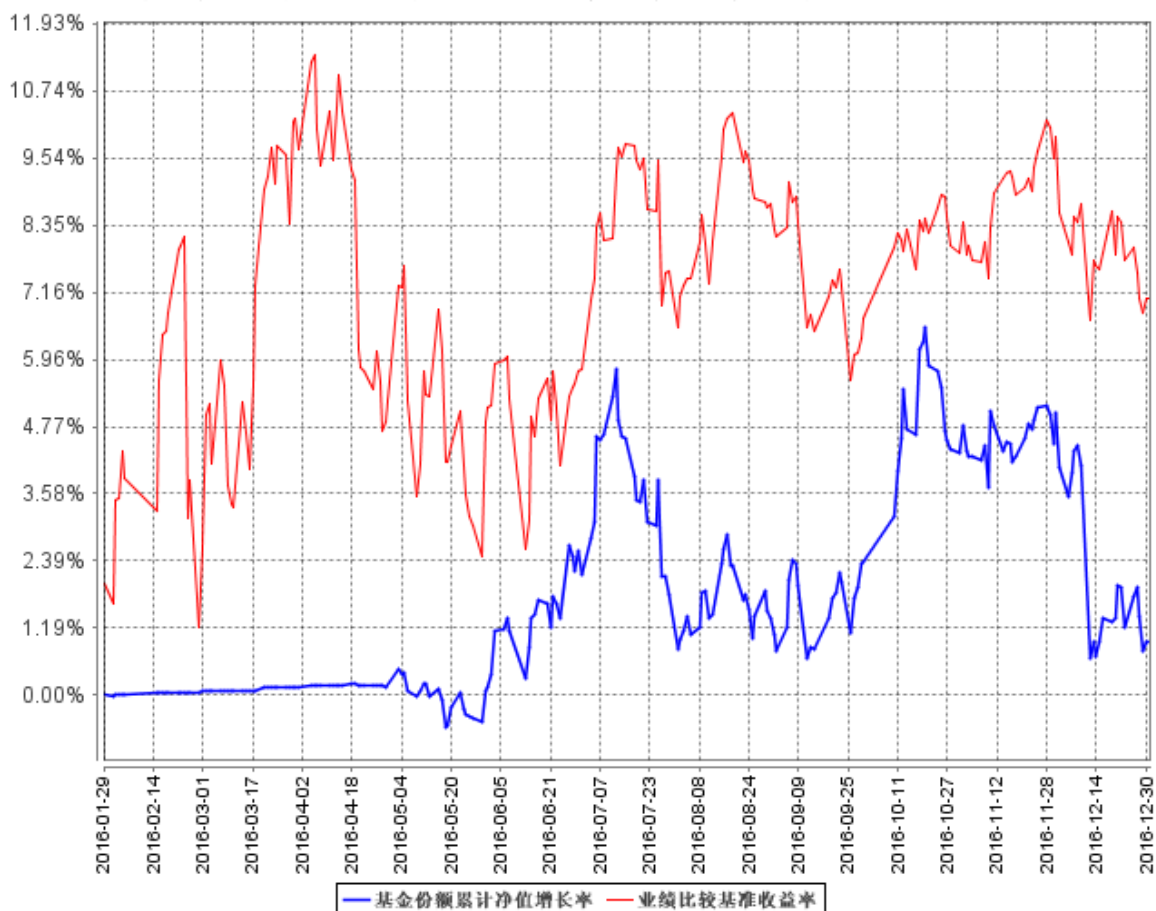
## 3.2 基金净值表现

### 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      | -1.42%   | 0.64%       | 0.31%      | 0.52%         | -1.73% | 0.12%  |
| 过去六个月      | -1.58%   | 0.58%       | 1.21%      | 0.57%         | -2.79% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 0.93%    | 0.46%       | 7.04%      | 0.89%         | -6.11% | -0.43% |

### 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

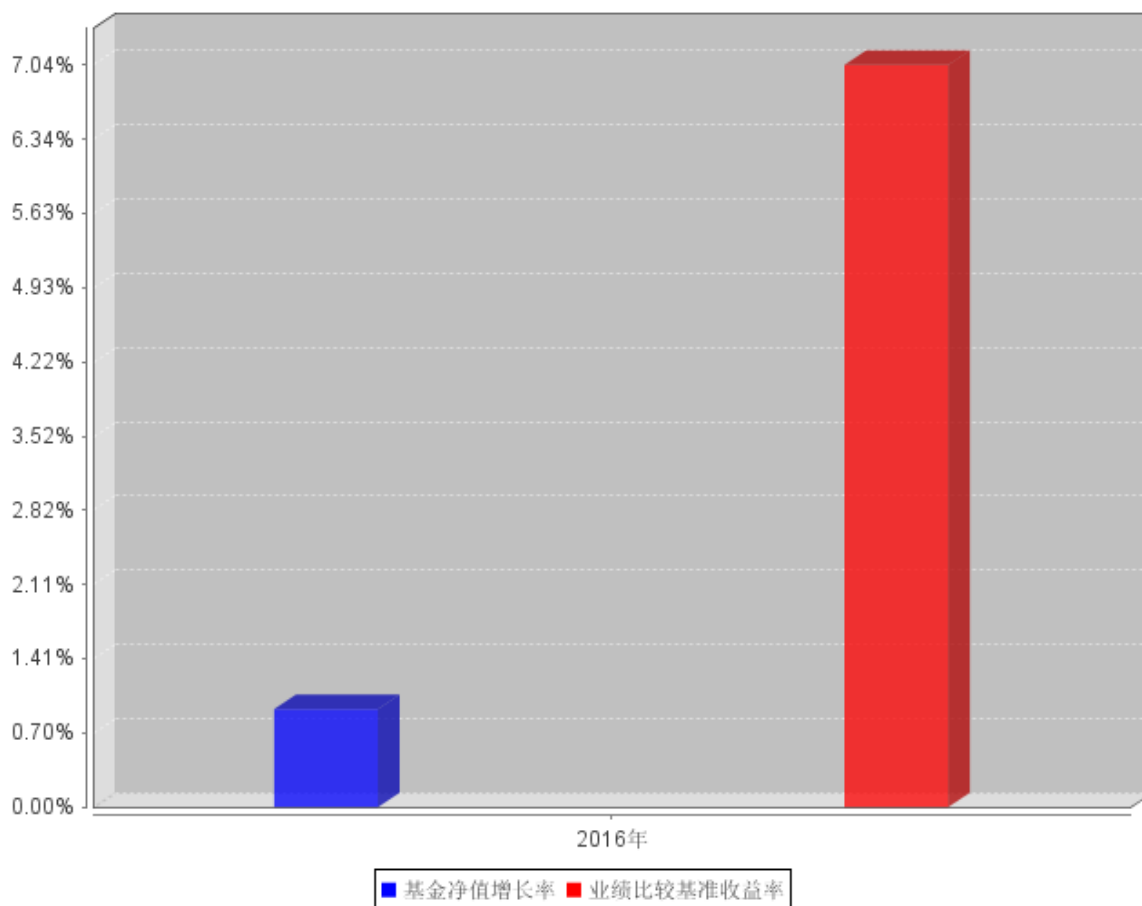
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金合同生效日为 2016 年 1 月 29 日，至 2016 年 12 月 31 日不满一年。
- 2、基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于本基金界定的“现代农业加”主题相关证券的比例不低于非现金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金建仓期为基金合同生效日（2016 年 1 月 29 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



### 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 |        |   |
| 郭世凯 | 本基金基金经理、公司投资部副总经理 | 2016 年 1 月 29 日 | -    | 8      | 金融学硕士。历任海通证券研究所分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员。现任农银汇理基金管理有限公司投资部副总经理、基金经理。            |
| 徐文卉 | 本基金基金经理助理         | 2016 年 3 月 2 日  | -    | 10     | 金融学硕士。历任信诚基金管理有限公司研究员、万家基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。 |

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日



期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

回顾 2016 年，A 股市场波动明显加剧。因汇率波动开年市场即迎来暴跌，后随着经济企稳预期强化，市场风险偏好回升，创业板 3 月强势反弹。但在经历急跌后市场心理普遍脆弱，成长和主题持续性较差。二季度开始，市场进入长时间的窄幅震荡格局，信用债违约事件发酵，债市风险释放对股市情绪产生负面冲击。在经济复苏预期边际减弱，市场缺乏明确投资主线背景下，主题投资热度提升，资金抱团取暖现象普遍。

2016 年下半年伴随外围经济体宽松预期未能兑现及银行理财监管新规趋严，股市出现大幅调整，市场结构转向低估值、高分红蓝筹。货币政策调整空间被压缩后，财政政策成为重要抓手，PPP 模式作为撬动宽财政的支点表现突出。四季度虽然海外有特朗普当选、意大利修宪公投失败等风险性事件发生，但对资本市场的影响并没有预想中的剧烈与持久，12 月由于去杠杆、钱荒、外围市场美联储加息等因素叠加给金融市场蒙上了“股债双杀”的阴霾。

整体来看，宏观经济处于弱复苏状态，任何变量的边际变化都将破坏经济复苏的强度和持续时间，存量经济时代下改革与转型，稳增长和调结构需要不断平衡，因此复苏过程的不确定性增强。我们在保持审慎乐观的基础上，战略上将坚持沿着确定性的行业景气为主线，结合短期市场波动进行布局，努力提升基金收益水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自基金合同生效以来至本报告期末，基金份额净值增长率为 0.93%，业绩比较基准收益率为 7.04%。

## 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，供给约束下的通胀压力会限制货币政策空间，利率上行背景下盈利具备持续改善能力的行业是未来的配置重点，方向选择上，延续改革和景气两条主线。需求相对低迷的背景下，2017 年的主题性机会主要来源于政策层面。2017 年是深化改革年，围绕中央经济工作会议强调的方向进行战略布局，如供给侧结构性改革、国有企业混合所有制改革等。行业景气层面，关注 PPI 向 CPI 传导过程中中游细分子行业的盈利改善机会。

我们判断，中长期来看，大类资产配置转移的长期逻辑仍然成立，短期我们密切关注经济复苏的进程。因此我们战略上将坚持沿着成长和改革的主线，同时高度关注市场风险偏好及微观结构上的变化方向，注重配置的性价比与业绩的预期差。综合考量增长、估值、筹码集中度、确定

性等衡量因素，在深入研究优秀上市公司的基础上进行配置。

#### 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

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，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。” 即本基金每年无应分配的利润金额。

2. 报告期内没有实施过利润分配。

3. 本报告期没有应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 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 20914 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 | 农银汇理现代农业加灵活配置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现代农业加灵活配置混合型证券投资    |

|              |  |     |
|--------------|--|-----|
|              | <p>资基金(以下简称“农银现代农业加混合型基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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。</p>  |     |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是农银现代农业加混合型基金 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> <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,上述农银现代农业加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,公允反映了农银现代农业加混合型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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：农银汇理现代农业加灵活配置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<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                         |
| 银行存款            | 90,931,948.28           |
| 结算备付金           | 879,165.26              |
| 存出保证金           | 147,399.73              |
| 交易性金融资产         | 155,273,322.65          |
| 其中：股票投资         | 155,273,322.65          |
| 基金投资            | -                       |
| 债券投资            | -                       |
| 资产支持证券投资        | -                       |
| 贵金属投资           | -                       |
| 衍生金融资产          | -                       |
| 买入返售金融资产        | -                       |
| 应收证券清算款         | 85,648.14               |
| 应收利息            | 17,900.51               |
| 应收股利            | -                       |
| 应收申购款           | 13,521.07               |
| 递延所得税资产         | -                       |
| 其他资产            | -                       |
| 资产总计            | 247,348,905.64          |
| 负 债 和 所 有 者 权 益 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |
| <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         | 229,507.74              |
| 应付赎回款           | 245,259.59              |
| 应付管理人报酬         | 322,833.03              |
| 应付托管费           | 53,805.51               |
| 应付销售服务费         | -                       |
| 应付交易费用          | 526,261.60              |
| 应交税费            | -                       |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 应付利息          | -              |
| 应付利润          | -              |
| 递延所得税负债       | -              |
| 其他负债          | 60,897.77      |
| 负债合计          | 1,438,565.24   |
| <b>所有者权益：</b> |                |
| 实收基金          | 243,655,234.00 |
| 未分配利润         | 2,255,106.40   |
| 所有者权益合计       | 245,910,340.40 |
| 负债和所有者权益总计    | 247,348,905.64 |

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 1 月 29 日，本报告期为 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0093 元，基金份额总额 243,655,234.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 本期   |
|-------------------|--|
|                   | 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>       | 21,451,117.29                              |
| 1. 利息收入           | 4,824,976.95                               |
| 其中：存款利息收入         | 4,775,609.34                               |
| 债券利息收入            | -  |
| 资产支持证券利息收入        | -  |
| 买入返售金融资产收入        | 49,367.61                                  |
| 其他利息收入            | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 16,618,051.47                              |
| 其中：股票投资收益         | 15,193,773.32                              |
| 基金投资收益            | -  |
| 债券投资收益            | -  |
| 资产支持证券投资收益        | -  |
| 贵金属投资收益           | -  |
| 衍生工具收益            | -  |
| 股利收益              | 1,424,278.15                               |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -875,037.83          |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 883,126.70           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>9,422,885.35</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 6,168,409.89         |
| 2. 托管费                     | 1,028,068.40         |
| 3. 销售服务费                   | -                    |
| 4. 交易费用                    | 1,851,639.22         |
| 5. 利息支出                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    |
| 6. 其他费用                    | 374,767.84           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>12,028,231.94</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>12,028,231.94</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                 | 本期<br>2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）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）                    | -  | -              | -               |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）           | -  | 12,028,231.94  | 12,028,231.94   |
| 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）  | 243,655,234.00                                   | -9,773,125.54  | 233,882,108.46  |
| 其中：1. 基金申购款                        | 645,138,028.99                                   | 374,209.44     | 645,512,238.43  |
| 2. 基金赎回款                           | -401,482,794.99                                  | -10,147,334.98 | -411,630,129.97 |
| 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) | 243,655,234.00 | 2,255,106.40 | 245,910,340.40 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2075 号《关于准予农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 631,675,317.73 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 111 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 631,812,396.34 份基金份额,其中认购资金利息折合 137,078.61 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《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市)的股票、债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、资产支持证券等)、货币市场工具(包括短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%,其中投资于本基金界定的“现代农业加”主题相关证券的比例不低于非现金资产的 80%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证大农业指数×65%+中证全债指数×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2017 年 3 月 28 日批准报出。

## 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》、《农银汇理现代农业加灵活配置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 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累

计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 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。

#### **7.4.6 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的转让收入免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称        | 与本基金的关系   |
|--------------|-----------|
| 农银汇理基金管理有限公司 | 本基金的管理人   |
| 中国建设银行股份有限公司 | 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 |

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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。

###### 7.4.8.1.2 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。

### 7.4.8.1.3 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。

### 7.4.8.1.4 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。

### 7.4.8.1.5 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。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>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  | 6,168,409.89                          | -                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,390,446.03                          | -                                |

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 1,028,068.40                          | -                                |

### 7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

## 7.4.8.3 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。

## 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**7.4.8.4.2 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。

**7.4.8.5 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<br>2016年1月29日(基金合同生效日)<br>至2016年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>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 |
| 中国建设银行 | 90,931,948.28                             | 1,516,556.55 | -                                | -      |

**7.4.8.6 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。

**7.4.8.7 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。

**7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.9.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002635 | 安洁科技 | 2016年11月8日  | 公告重大事项 | 36.40  | 2017年2月8日  | 33.50  | 118,700 | 3,973,602.60 | 4,320,680.00 | -  |
| 000903 | 云内动力 | 2016年12月22日 | 公告重大事项 | 8.76   | 2017年3月23日 | 9.64   | 433,400 | 3,712,904.00 | 3,796,584.00 | -  |
| 002159 | 三特索道 | 2016年12月29日 | 公告重大事项 | 32.00  | 2017年1月6日  | 31.60  | 58,900  | 1,824,047.80 | 1,884,800.00 | -  |



### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

### 7.4.10 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 145,271,258.65 元，属于第二层次的余额为 10,002,064.00 元，无属于第三层级的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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。

(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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 155,273,322.65 | 62.78            |
|    | 其中：股票             | 155,273,322.65 | 62.78            |
| 2  | 固定收益投资            | -              | -                |
|    | 其中：债券             | -              | -                |
|    | 资产支持证券            | -              | -                |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -                |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -                |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -                |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -                |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 91,811,113.54  | 37.12            |
| 7  | 其他各项资产            | 264,469.45     | 0.11             |
| 8  | 合计                | 247,348,905.64 | 100.00           |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 7,279,466.00   | 2.96         |
| C  | 制造业              | 122,075,022.65 | 49.64        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 18,497,654.00  | 7.52         |
| F  | 批发和零售业           | 2,576,530.00   | 1.05         |
| 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  | -              | -            |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,073,500.00   | 0.84         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,884,800.00   | 0.77         |
| 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        | 886,350.00     | 0.36         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 155,273,322.65 | 63.14        |

### 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  | 603703 | 盛洋科技 | 332,150 | 11,824,540.00 | 4.81   |
| 2  | 603808 | 歌力思  | 254,850 | 8,178,136.50  | 3.33   |
| 3  | 002103 | 广博股份 | 451,500 | 7,824,495.00  | 3.18   |
| 4  | 600771 | 广誉远  | 227,869 | 7,619,939.36  | 3.10   |
| 5  | 000930 | 中粮生化 | 532,000 | 7,150,080.00  | 2.91   |
| 6  | 300197 | 铁汉生态 | 557,800 | 7,072,904.00  | 2.88   |
| 7  | 002310 | 东方园林 | 470,100 | 6,651,915.00  | 2.71   |
| 8  | 002669 | 康达新材 | 204,800 | 6,359,040.00  | 2.59   |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 147,600 | 5,089,248.00  | 2.07   |
| 10 | 600146 | 商赢环球 | 146,800 | 4,969,180.00  | 2.02   |

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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 32,427,872.81 | 13.19           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 26,493,190.43 | 10.77           |
| 3  | 600199 | 金种子酒 | 20,559,042.52 | 8.36            |
| 4  | 600110 | 诺德股份 | 18,689,279.08 | 7.60            |
| 5  | 603703 | 盛洋科技 | 15,257,894.17 | 6.20            |
| 6  | 300326 | 凯利泰  | 14,615,240.58 | 5.94            |
| 7  | 002582 | 好想你  | 13,920,329.88 | 5.66            |
| 8  | 600702 | 沱牌舍得 | 13,329,738.67 | 5.42            |
| 9  | 603808 | 歌力思  | 13,051,744.52 | 5.31            |
| 10 | 600779 | 水井坊  | 11,789,846.53 | 4.79            |
| 11 | 002310 | 东方园林 | 11,755,847.26 | 4.78            |
| 12 | 300317 | 珈伟股份 | 11,473,333.90 | 4.67            |
| 13 | 600995 | 文山电力 | 11,002,210.48 | 4.47            |
| 14 | 300461 | 田中精机 | 10,800,632.91 | 4.39            |
| 15 | 002120 | 新海股份 | 10,307,278.50 | 4.19            |
| 16 | 601238 | 广汽集团 | 10,205,242.74 | 4.15            |
| 17 | 002304 | 洋河股份 | 10,030,822.07 | 4.08            |
| 18 | 002103 | 广博股份 | 9,762,953.56  | 3.97            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 19 | 002009 | 天奇股份 | 9,626,257.43 | 3.91 |
| 20 | 002165 | 红宝丽  | 9,519,418.89 | 3.87 |
| 21 | 000568 | 泸州老窖 | 9,340,056.00 | 3.80 |
| 22 | 002635 | 安洁科技 | 8,995,551.43 | 3.66 |
| 23 | 600068 | 葛洲坝  | 8,909,931.93 | 3.62 |
| 24 | 002734 | 利民股份 | 8,501,396.56 | 3.46 |
| 25 | 000799 | 酒鬼酒  | 8,453,873.71 | 3.44 |
| 26 | 600363 | 联创光电 | 8,250,261.00 | 3.35 |
| 27 | 600458 | 时代新材 | 8,219,217.12 | 3.34 |
| 28 | 300364 | 中文在线 | 8,070,168.52 | 3.28 |
| 29 | 000816 | 智慧农业 | 7,815,075.20 | 3.18 |
| 30 | 603788 | 宁波高发 | 7,538,947.40 | 3.07 |
| 31 | 000651 | 格力电器 | 7,469,987.00 | 3.04 |
| 32 | 300233 | 金城医药 | 7,251,161.00 | 2.95 |
| 33 | 603006 | 黎明股份 | 6,923,992.00 | 2.82 |
| 34 | 000930 | 中粮生化 | 6,878,486.00 | 2.80 |
| 35 | 600168 | 武汉控股 | 6,860,983.25 | 2.79 |
| 36 | 601800 | 中国交建 | 6,850,903.99 | 2.79 |
| 37 | 601618 | 中国中冶 | 6,735,303.00 | 2.74 |
| 38 | 300197 | 铁汉生态 | 6,681,780.50 | 2.72 |
| 39 | 601688 | 华泰证券 | 6,643,226.34 | 2.70 |
| 40 | 600771 | 广誉远  | 6,635,789.98 | 2.70 |
| 41 | 000625 | 长安汽车 | 6,327,398.26 | 2.57 |
| 42 | 002669 | 康达新材 | 6,034,682.00 | 2.45 |
| 43 | 300340 | 科恒股份 | 5,693,583.00 | 2.32 |
| 44 | 002035 | 华帝股份 | 5,605,015.66 | 2.28 |
| 45 | 002217 | 合力泰  | 5,571,287.99 | 2.27 |
| 46 | 600491 | 龙元建设 | 5,542,817.00 | 2.25 |
| 47 | 002548 | 金新农  | 5,520,506.62 | 2.24 |
| 48 | 300181 | 佐力药业 | 5,512,969.00 | 2.24 |
| 49 | 002662 | 京威股份 | 5,394,040.87 | 2.19 |
| 50 | 000779 | 三毛派神 | 5,383,243.57 | 2.19 |
| 51 | 002193 | 山东如意 | 5,346,411.00 | 2.17 |
| 52 | 300437 | 清水源  | 5,342,002.99 | 2.17 |
| 53 | 600512 | 腾达建设 | 5,341,634.00 | 2.17 |
| 54 | 002792 | 通宇通讯 | 5,102,978.05 | 2.08 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 55 | 600146 | 商赢环球 | 5,068,316.00 | 2.06 |
| 56 | 000422 | 湖北宜化 | 4,939,298.00 | 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 28,633,079.17 | 11.64          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 27,534,381.98 | 11.20          |
| 3  | 600199 | 金种子酒 | 21,643,449.70 | 8.80           |
| 4  | 600110 | 诺德股份 | 18,310,891.90 | 7.45           |
| 5  | 300326 | 凯利泰  | 16,292,902.72 | 6.63           |
| 6  | 002582 | 好想你  | 14,733,623.48 | 5.99           |
| 7  | 600995 | 文山电力 | 13,480,483.65 | 5.48           |
| 8  | 600702 | 沱牌舍得 | 13,166,079.63 | 5.35           |
| 9  | 600779 | 水井坊  | 11,767,984.70 | 4.79           |
| 10 | 002120 | 新海股份 | 11,625,847.48 | 4.73           |
| 11 | 300317 | 珈伟股份 | 11,458,083.00 | 4.66           |
| 12 | 002304 | 洋河股份 | 10,489,088.92 | 4.27           |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 9,713,797.23  | 3.95           |
| 14 | 000651 | 格力电器 | 9,493,441.43  | 3.86           |
| 15 | 601238 | 广汽集团 | 9,456,356.54  | 3.85           |
| 16 | 002165 | 红宝丽  | 9,234,772.58  | 3.76           |
| 17 | 600458 | 时代新材 | 9,184,181.66  | 3.73           |
| 18 | 002009 | 天奇股份 | 8,982,259.21  | 3.65           |
| 19 | 002734 | 利民股份 | 8,871,567.92  | 3.61           |
| 20 | 600068 | 葛洲坝  | 8,628,949.57  | 3.51           |
| 21 | 000799 | 酒鬼酒  | 8,477,365.88  | 3.45           |
| 22 | 000816 | 智慧农业 | 7,960,725.51  | 3.24           |
| 23 | 300364 | 中文在线 | 7,458,786.61  | 3.03           |
| 24 | 600363 | 联创光电 | 7,201,666.54  | 2.93           |
| 25 | 300233 | 金城医药 | 7,112,077.72  | 2.89           |
| 26 | 603788 | 宁波高发 | 7,008,286.60  | 2.85           |
| 27 | 600168 | 武汉控股 | 6,982,787.77  | 2.84           |
| 28 | 601618 | 中国中冶 | 6,881,707.64  | 2.80           |
| 29 | 603006 | 黎明股份 | 6,783,838.65  | 2.76           |
| 30 | 002035 | 华帝股份 | 6,723,984.56  | 2.73           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 601688 | 华泰证券 | 6,632,893.30 | 2.70 |
| 32 | 000625 | 长安汽车 | 6,350,282.26 | 2.58 |
| 33 | 601800 | 中国交建 | 6,264,852.00 | 2.55 |
| 34 | 300181 | 佐力药业 | 5,824,045.70 | 2.37 |
| 35 | 002548 | 金新农  | 5,765,862.00 | 2.34 |
| 36 | 002217 | 合力泰  | 5,719,425.44 | 2.33 |
| 37 | 002662 | 京威股份 | 5,319,221.61 | 2.16 |
| 38 | 600512 | 腾达建设 | 5,278,389.00 | 2.15 |
| 39 | 000779 | 三毛派神 | 5,204,619.90 | 2.12 |
| 40 | 300437 | 清水源  | 5,124,679.80 | 2.08 |
| 41 | 600491 | 龙元建设 | 5,000,102.00 | 2.03 |

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 | 702,740,554.77 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 561,785,967.61 |

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 147,399.73 |
| 2  | 应收证券清算款 | 85,648.14  |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 17,900.51  |
| 5  | 应收申购款   | 13,521.07  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 264,469.45 |

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 7,089        | 34,370.89     | 1,486,805.77 | 0.61%      | 242,168,428.23 | 99.39%     |

### 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<br>持有本基金 | 0.00      | 0.0000%  |

### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|  |                |
|--|----------------|
| 基金合同生效日（2016年1月29日）基金份额总额              | 631,812,396.34 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | -              |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                  | 13,325,632.65  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额                | 401,482,794.99 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -              |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 243,655,234.00 |
|-------------|----------------|

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 6 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 |    |
| 广发证券 | 2      | 353,797,594.97 | 27.98%       | 329,497.02 | 27.98%     | -  |
| 申万宏源 | 2      | 198,490,523.20 | 15.70%       | 184,850.88 | 15.70%     | -  |

|      |   |                |        |            |        |   |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 国信证券 | 2 | 192,772,410.62 | 15.24% | 179,528.55 | 15.24% | - |
| 国泰君安 | 2 | 157,667,438.85 | 12.47% | 146,832.06 | 12.47% | - |
| 银河证券 | 1 | 133,999,524.97 | 10.60% | 124,798.43 | 10.60% | - |
| 海通证券 | 2 | 123,770,958.91 | 9.79%  | 115,268.04 | 9.79%  | - |
| 国金证券 | 2 | 89,511,088.37  | 7.08%  | 83,362.56  | 7.08%  | - |
| 安信证券 | 2 | 14,516,982.49  | 1.15%  | 13,516.65  | 1.15%  | - |
| 中信证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 东方证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中金公司 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 红塔证券 | 1 | -              | -      | -          | -      | - |

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、上述交易单元均为本报告期内新增交易单元,本报告期内无剔除交易单元。

### 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 |
| 广发证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | -    | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -    | -            | 11,825,000.00 | 8.97%          | -    | -            |

|      |   |   |               |        |   |   |
|------|---|---|---------------|--------|---|---|
| 银河证券 | - | - | 60,000,000.00 | 45.51% | - | - |
| 海通证券 | - | - | -             | -      | - | - |
| 国金证券 | - | - | 60,000,000.00 | 45.51% | - | - |
| 安信证券 | - | - | -             | -      | - | - |
| 中信证券 | - | - | -             | -      | - | - |
| 东方证券 | - | - | -             | -      | - | - |
| 中金公司 | - | - | -             | -      | - | - |
| 红塔证券 | - | - | -             | -      | - | - |

### §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