

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57

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	57
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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	66

§ 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	287,270,301.61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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	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
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-61,231,723.11	277,923,917.55	147,542,272.13
本期利润	-45,095,667.71	253,189,161.23	-7,517,324.07
加权平均基金份额本期利润	-0.1524	0.5479	-0.0055
本期加权平均净值利润率	-16.53%	46.36%	-0.66%
本期基金份额净值增长率	-14.09%	16.57%	1.22%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-12,768,886.20	32,767,233.88	-47,476,177.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0444	0.1123	-0.0458
期末基金资产净值	274,501,415.41	324,424,021.92	989,359,660.42
期末基金份额净值	0.9556	1.1123	0.9542
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-4.44%	11.23%	-4.58%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

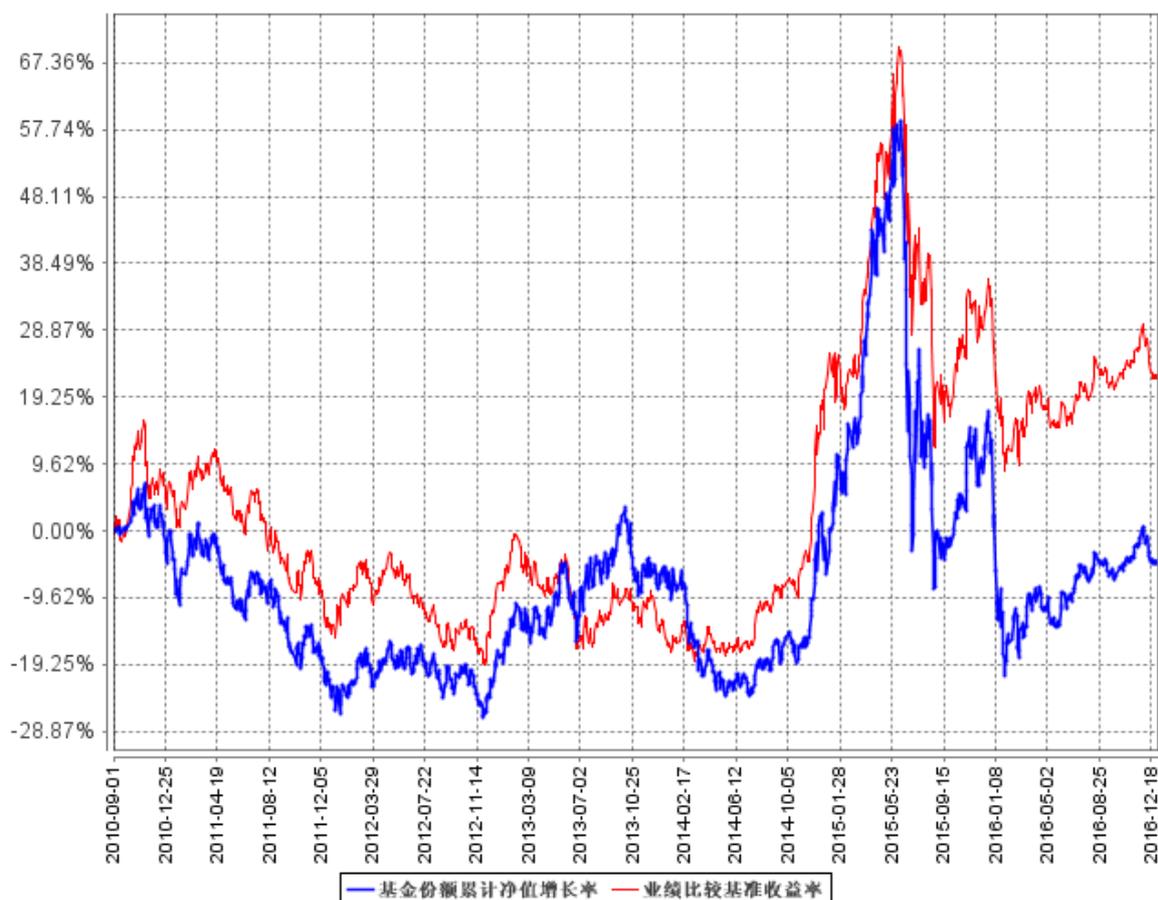
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.01%	0.56%	0.88%	0.55%	1.13%	0.01%
过去六个月	4.22%	0.58%	3.85%	0.57%	0.37%	0.01%
过去一年	-14.09%	1.41%	-7.71%	1.05%	-6.38%	0.36%
过去三年	1.37%	1.75%	40.11%	1.34%	-38.74%	0.41%
过去五年	23.22%	1.55%	41.39%	1.22%	-18.17%	0.33%
自基金合同生效起至今	-4.44%	1.46%	22.28%	1.18%	-26.72%	0.28%

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

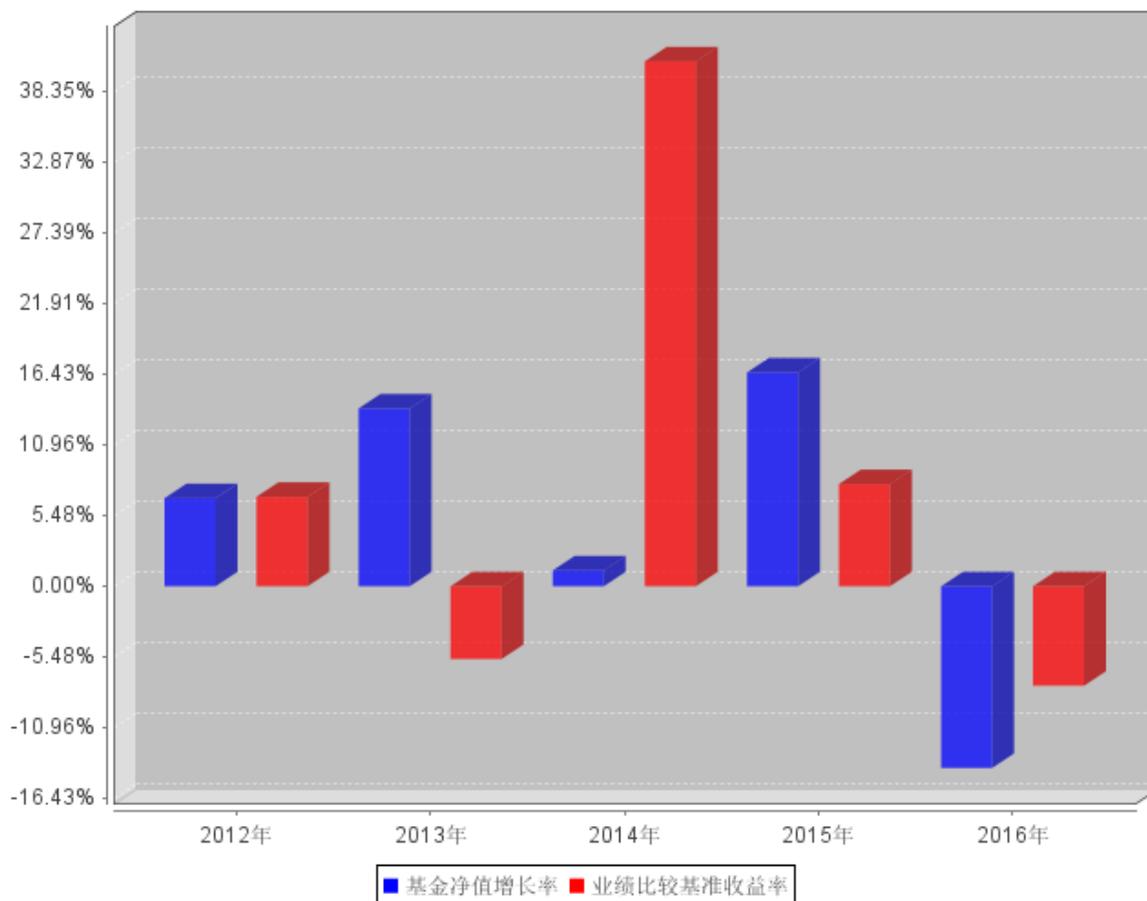
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.2.3 过去五年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

过去五年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



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 37 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证

券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理纯债一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金及农银汇理日日鑫交易型货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》、《特定客户资产管理业务公平交易管理办法》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告风险管理委员会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度内本基金操作主要从个股入手，配置业绩较好的股票，获得了一定效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为-14.09%，业绩比较基准收益率为-7.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年我国经济继处于一个经济补库存周期的尾部,经济动力依然存在,因此上半年经济压力不大,但后半年在房地产、汽车等行业下滑的背景下,压力会逐步显现。从整体格局来看,技术上的经济增长动力是缺乏的,从而只能是周期上的波动。借助上半年的增长,政府会加大去产能、去杠杆、去库存、降成本、补短板。如此一来,股市没有大的趋势性机会,只有结构性和局部性机会,因此抓住时机,选准板块至关重要。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司建立了比较完善的监察稽核制度和组织结构。公司督察长组织指导对基金包括本基金的监察稽核工作,监察稽核部具体监督检查基金运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况,并向公司总经理报告。公司风险管理委员会批准适用本基金的风险管理措施,定期回顾执行情况,并由风险控制部实施日常监控。督察长及监察稽核部对其他部门及人员执行业务进行稽核审计,督促其合规运作、加强风险控制。督察长定期编制监察稽核报告,提交总经理和董事会成员收阅。报告期内,公司监察稽核体系运行顺利,本基金没有出现违反法律规定的事项,有效的保证了本基金的合规运作。

本报告期内,本基金的监察稽核主要工作情况如下:

(1) 全面开展基金运作稽核工作,防范内幕交易,确保基金投资的独立性、公平性及合规性
主要措施有:严格执行集中交易制度,确保研究、投资决策和交易隔离;严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序。通过以上措施,保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求。

(2) 修订内部管理制度,完善投资业务流程

根据监管机关的规定,更新公司内部投资管理制度,不断加强内部流程控制,动态作出各项合规提示,防范投资风险。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高合规与稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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(2016)第 20901 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	农银汇理大盘蓝筹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大盘蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“农银汇理大盘蓝筹混合型基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是农银汇理大盘蓝筹混合型基金 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: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编

	制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述 农银汇理大盘蓝筹混合型基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 农银汇理大盘蓝筹混合型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度 的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈玲 都晓燕
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理大盘蓝筹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	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	37,064,087.43	52,714,310.73
结算备付金		225,288.75	6,032,114.03

存出保证金		64,011.74	755,663.65
交易性金融资产	7.4.7.2	237,918,218.54	266,657,249.89
其中：股票投资		218,104,857.84	266,657,249.89
基金投资		-	-
债券投资		19,813,360.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		57,497.95	4,941,064.11
应收利息	7.4.7.5	451,268.80	11,202.42
应收股利		-	-
应收申购款		130,270.86	387,512.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		275,910,644.07	331,499,116.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,288,725.64
应付赎回款		513,307.16	1,042,210.23
应付管理人报酬		354,450.79	418,994.00
应付托管费		59,075.12	69,832.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	170,697.50	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	7.4.7.8	311,698.09	331,189.61
负债合计		1,409,228.66	7,075,094.98
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	287,270,301.61	291,656,788.04
未分配利润	7.4.7.10	-12,768,886.20	32,767,233.88
所有者权益合计		274,501,415.41	324,424,021.92
负债和所有者权益总计		275,910,644.07	331,499,116.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9556 元，基金份额总额 287,270,301.61 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-37,542,017.08	280,145,373.36
1. 利息收入		956,532.69	742,805.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	364,227.36	742,662.45
债券利息收入		589,468.48	143.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,836.85	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-54,690,626.70	303,760,948.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-58,461,347.58	301,379,951.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-45,419.25	90,768.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,816,140.13	2,290,228.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,136,055.40	-24,734,756.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	56,021.53	376,375.19
减：二、费用		7,553,650.63	26,956,212.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,088,693.33	8,258,897.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	681,448.81	1,376,482.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,509,241.94	16,993,728.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	274,266.55	327,103.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,095,667.71	253,189,161.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,095,667.71	253,189,161.23

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-45,095,667.71	-45,095,667.71
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）	-4,386,486.43	-440,452.37	-4,826,938.80
其中：1. 基金申购款	63,369,342.90	-5,826,427.62	57,542,915.28
2. 基金赎回款	-67,755,829.33	5,385,975.25	-62,369,854.08
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）	287,270,301.61	-12,768,886.20	274,501,415.41
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	253,189,161.23	253,189,161.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-745,179,049.90	-172,945,749.83	-918,124,799.73
其中：1. 基金申购款	246,702,018.94	58,671,883.20	305,373,902.14
2. 基金赎回款	-991,881,068.84	-231,617,633.03	-1,223,498,701.87
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）	291,656,788.04	32,767,233.88	324,424,021.92

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：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 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 日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%。

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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

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和债券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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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和债券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。当本基金依法 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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，其公允价值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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收

入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	37,064,087.43	52,714,310.73
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	37,064,087.43	52,714,310.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	204,946,788.21	218,104,857.84	13,158,069.63

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	20,094,798.15	19,813,360.70	-281,437.45
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,094,798.15	19,813,360.70	-281,437.45
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	225,041,586.36	237,918,218.54	12,876,632.18	
项目	上年度末 2015年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	269,916,673.11	266,657,249.89	-3,259,423.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	269,916,673.11	266,657,249.89	-3,259,423.22	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	7,013.37	8,147.74
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	101.30	2,714.50

应收债券利息	444,125.31	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	0.08
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	28.80	340.10
合计	451,268.80	11,202.42

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	170,697.50	1,924,143.17
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	170,697.50	1,924,143.17

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	1,698.09	1,189.61
预提费用	60,000.00	80,000.00
合计	311,698.09	331,189.61

7.4.7.9 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12月31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	63,369,342.90	63,369,342.90
本期赎回(以“-”号填列)	-67,755,829.33	-67,755,829.33
- 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	287,270,301.61	287,270,301.61

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-61,231,723.11	16,136,055.40	-45,095,667.71
本期基金份额交易产生的变动数	755,280.33	-1,195,732.70	-440,452.37
其中：基金申购款	11,889,331.73	-17,715,759.35	-5,826,427.62
基金赎回款	-11,134,051.40	16,520,026.65	5,385,975.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,802,102.83	-60,570,989.03	-12,768,886.20

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	344,270.43	652,792.48
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	15,459.77	74,717.70
其他	4,497.16	15,152.27
合计	364,227.36	742,662.45

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	828,539,783.66	5,889,204,301.46
减：卖出股票成本总额	887,001,131.24	5,587,824,349.72
买卖股票差价收入	-58,461,347.58	301,379,951.74

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31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	-45,419.25	90,768.75
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	-45,419.25	90,768.75

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	47,054,971.31	484,912.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	46,259,983.45	394,000.00
减：应收利息总额	840,407.11	143.35
买卖债券差价收入	-45,419.25	90,768.75

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,816,140.13	2,290,228.20
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,816,140.13	2,290,228.20

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	16,136,055.40	-24,734,756.32
——股票投资	16,417,492.85	-24,734,756.32
——债券投资	-281,437.45	-
——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	16,136,055.40	-24,734,756.32
----	---------------	----------------

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	51,934.93	298,119.44
转换费	4,086.60	78,255.75
合计	56,021.53	376,375.19

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,509,241.94	16,993,728.05
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,509,241.94	16,993,728.05

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	80,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
账户服务费	6,000.00	18,000.00
银行汇划费	8,216.55	29,103.71
其他	50.00	-
合计	274,266.55	327,103.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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、权证交易、债券交易和债券回购交易。本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,088,693.33	8,258,897.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,054,573.60	2,093,427.54

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	681,448.81	1,376,482.92

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。

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	37,064,087.43	344,270.43	52,714,310.73	652,792.48

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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内无利润分配事项。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	19,340	77,360.00	77,360.00	-
300583	赛托	2016年	2017年	新股流	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-

	生物	12月29日	1月6日	通受限						
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	2,035	43,345.50	43,345.50	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,453	21,257.39	21,257.39	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,395	19,683.45	19,683.45	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	1,445	15,085.80	15,085.80	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	613	14,197.08	14,197.08	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.12.2 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
600173	卧龙地产	2016年12月22日	公告重大事项	11.48	-	-	74,500	656,248.00	855,260.00	-
000166	申万宏源	2016年12月21日	公告重大事项	6.25	2017年1月26日	6.29	116,595	659,111.85	728,718.75	-
300104	乐视网	2016年12月7日	公告重大事项	35.80	2017年1月16日	36.88	19,800	900,628.00	708,840.00	-
600400	红豆股份	2016年12月29日	公告重大事项	8.56	-	-	72,100	604,585.00	617,176.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	公告重大事项	11.42	-	-	53,900	624,594.80	615,538.00	-
600649	城投控股	2016年12月6日	公告重大事项	20.34	-	-	29,900	408,573.36	608,166.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	公告重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	36,500	589,797.00	567,210.00	-
600303	曙光股份	2016年12月15日	公告重大事项	9.02	2017年1月17日	9.92	59,300	607,546.00	534,886.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	公告重大事项	13.79	-	-	37,600	493,487.00	518,504.00	-
601727	上海电气	2016年8月31日	公告重大事项	8.42	-	-	56,800	459,946.47	478,256.00	-
600406	国电南瑞	2016年12月29日	公告重大事项	16.63	-	-	28,200	350,301.28	468,966.00	-

300150	世纪瑞尔	2016 年 11 月 8 日	公告重大事项	9.97	2017 年 3 月 21 日	10.97	45,900	459,210.75	457,623.00	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	公告重大事项	14.60	-	-	28,300	498,816.15	413,180.00	-
000750	国海证券	2016 年 12 月 15 日	公告重大事项	6.97	2017 年 1 月 20 日	6.27	57,200	355,856.15	398,684.00	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	公告重大事项	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	56,200	353,125.00	389,466.00	-
000821	京山轻机	2016 年 12 月 5 日	公告重大事项	16.24	-	-	18,200	280,912.59	295,568.00	-
600654	中安消	2016 年 12 月 14 日	公告重大事项	17.43	-	-	14,900	275,213.00	259,707.00	-
600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	公告重大事项	10.79	2017 年 3 月 28 日	10.90	24,000	256,785.00	258,960.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	公告重大事项	8.27	-	-	25,400	192,990.93	210,058.00	-
002151	北斗星通	2016 年 11 月 16 日	公告重大事项	31.90	2017 年 1 月 12 日	31.00	4,900	153,750.25	156,310.00	-
000531	穗恒运 A	2016 年 8 月 29 日	公告重大事项	11.47	2017 年 1 月 9 日	11.80	5,000	65,172.76	57,350.00	-
300100	双林股份	2016 年 11 月 7 日	公告重大事项	34.00	2017 年 1 月 25 日	30.60	1,000	36,074.16	34,000.00	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。截至 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资及其他信用产品。

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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	37,064,087.43	-	-	-	37,064,087.43
结算备付金	225,288.75	-	-	-	225,288.75
存出保证金	64,011.74	-	-	-	64,011.74
交易性金融资产	9,763,998.20	5,040,210.00	5,009,152.50	218,104,857.84	237,918,218.54
应收证券清算款	-	-	-	57,497.95	57,497.95
应收利息	-	-	-	451,268.80	451,268.80

应收申购款	-	-	-	130,270.86	130,270.86
资产总计	47,117,386.12	5,040,210.00	5,009,152.50	218,743,895.45	275,910,644.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	513,307.16	513,307.16
应付管理人报酬	-	-	-	354,450.79	354,450.79
应付托管费	-	-	-	59,075.12	59,075.12
应付交易费用	-	-	-	170,697.50	170,697.50
其他负债	-	-	-	311,698.09	311,698.09
负债总计	-	-	-	1,409,228.66	1,409,228.66
利率敏感度缺口	47,117,386.12	5,040,210.00	5,009,152.50	217,334,666.79	274,501,415.41
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	-	-	-	387,512.07	387,512.07
资产总计	59,502,088.41	-	-	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	-	-	-	7,075,094.98	7,075,094.98
利率敏感度缺口	59,502,088.41	-	-	264,921,933.51	324,424,021.92

注：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。

7.4.13.4.1.2 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债券资产，因此，市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	218,104,857.84	79.45	266,657,249.89	82.19
其他	-	-	-	-
合计	218,104,857.84	79.45	266,657,249.89	82.19

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5 %	17,692,737.91	17,304,449.68
业绩比较基准下降 5 %	-17,692,737.91	-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。

7.4.14 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的金融工具中属于第一层次的余额为 208,114,491.99 元，属于第二层次的余额为 29,803,726.55 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 239,551,266.91 元，第二层次的余额为 27,105,982.98 元，无属于三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	218,104,857.84	79.05
	其中：股票	218,104,857.84	79.05
2	固定收益投资	19,813,360.70	7.18
	其中：债券	19,813,360.70	7.18
	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	37,289,376.18	13.52
7	其他各项资产	703,049.35	0.25
8	合计	275,910,644.07	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	3,335,437.00	1.22
B	采矿业	7,600,488.46	2.77
C	制造业	78,798,269.94	28.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,525,268.66	2.01
E	建筑业	9,066,615.04	3.30
F	批发和零售业	8,638,944.00	3.15
G	交通运输、仓储和邮政业	5,376,455.10	1.96
H	住宿和餐饮业	91,326.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,359,355.17	4.87

J	金融业	64,024,522.81	23.32
K	房地产业	12,048,940.01	4.39
L	租赁和商务服务业	4,266,105.83	1.55
M	科学研究和技术服务业	670,725.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,405,303.92	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	233,220.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	2,834,769.30	1.03
S	综合	829,111.60	0.30
	合计	218,104,857.84	79.45

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	209,900	7,436,757.00	2.71
2	601166	兴业银行	258,500	4,172,190.00	1.52
3	600016	民生银行	458,200	4,160,456.00	1.52
4	601398	工商银行	892,100	3,934,161.00	1.43
5	600519	贵州茅台	10,700	3,575,405.00	1.30
6	600036	招商银行	199,900	3,518,240.00	1.28
7	601328	交通银行	532,500	3,072,525.00	1.12
8	601988	中国银行	849,600	2,922,624.00	1.06
9	600000	浦发银行	167,620	2,717,120.20	0.99
10	000002	万科 A	131,900	2,710,545.00	0.99
11	601668	中国建筑	290,700	2,575,602.00	0.94
12	600837	海通证券	156,800	2,469,600.00	0.90
13	000333	美的集团	87,200	2,456,424.00	0.89
14	600030	中信证券	152,500	2,449,150.00	0.89
15	601169	北京银行	235,800	2,301,408.00	0.84

16	000651	格力电器	93,286	2,296,701.32	0.84
17	600887	伊利股份	117,479	2,067,630.40	0.75
18	000858	五粮液	56,846	1,960,050.08	0.71
19	601766	中国中车	177,700	1,736,129.00	0.63
20	600028	中国石化	320,900	1,736,069.00	0.63
21	601601	中国太保	60,900	1,691,193.00	0.62
22	601211	国泰君安	88,700	1,648,933.00	0.60
23	600900	长江电力	127,900	1,619,214.00	0.59
24	000001	平安银行	166,420	1,514,422.00	0.55
25	600104	上汽集团	64,100	1,503,145.00	0.55
26	000725	京东方 A	460,600	1,317,316.00	0.48
27	601390	中国中铁	144,500	1,280,270.00	0.47
28	601989	中国重工	177,900	1,261,311.00	0.46
29	600048	保利地产	137,900	1,259,027.00	0.46
30	600276	恒瑞医药	27,320	1,243,060.00	0.45
31	601818	光大银行	308,600	1,206,626.00	0.44
32	600050	中国联通	164,300	1,201,033.00	0.44
33	601688	华泰证券	63,300	1,130,538.00	0.41
34	600015	华夏银行	103,500	1,122,975.00	0.41
35	601186	中国铁建	89,200	1,066,832.00	0.39
36	600527	江南高纤	150,000	1,062,000.00	0.39
37	600518	康美药业	57,535	1,026,999.75	0.37
38	000776	广发证券	57,400	967,764.00	0.35
39	600958	东方证券	60,300	936,459.00	0.34
40	600256	广汇能源	196,800	919,056.00	0.33
41	000910	大亚圣象	47,900	914,890.00	0.33
42	002450	康得新	47,803	913,515.33	0.33
43	600297	广汇汽车	102,600	878,256.00	0.32
44	600173	卧龙地产	74,500	855,260.00	0.31
45	002415	海康威视	35,500	845,255.00	0.31
46	600685	中船防务	28,100	834,570.00	0.30
47	002304	洋河股份	11,733	828,349.80	0.30
48	002024	苏宁云商	72,200	826,690.00	0.30
49	601006	大秦铁路	115,200	815,616.00	0.30
50	601628	中国人寿	32,296	778,010.64	0.28
51	600691	阳煤化工	200,000	768,000.00	0.28
52	601009	南京银行	70,540	764,653.60	0.28
53	000538	云南白药	10,000	761,500.00	0.28
54	001979	招商蛇口	46,000	753,940.00	0.27

55	000728	国元证券	37,792	752,060.80	0.27
56	601857	中国石油	94,100	748,095.00	0.27
57	002103	广博股份	43,000	745,190.00	0.27
58	002007	华兰生物	20,760	742,170.00	0.27
59	002736	国信证券	47,700	741,735.00	0.27
60	002299	圣农发展	34,900	740,578.00	0.27
61	000967	盈峰环境	52,900	739,542.00	0.27
62	000063	中兴通讯	46,100	735,295.00	0.27
63	000166	申万宏源	116,595	728,718.75	0.27
64	600795	国电电力	228,500	724,345.00	0.26
65	600999	招商证券	44,300	723,419.00	0.26
66	600648	外高桥	36,600	722,484.00	0.26
67	601899	紫金矿业	214,400	716,096.00	0.26
68	300104	乐视网	19,800	708,840.00	0.26
69	601336	新华保险	16,173	708,053.94	0.26
70	300059	东方财富	41,362	700,258.66	0.26
71	600409	三友化工	74,200	696,738.00	0.25
72	601377	兴业证券	90,800	694,620.00	0.25
73	601099	太平洋	132,050	680,057.50	0.25
74	300008	天海防务	27,500	670,725.00	0.24
75	000796	凯撒旅游	43,700	662,055.00	0.24
76	600549	厦门钨业	30,000	660,600.00	0.24
77	600585	海螺水泥	38,800	658,048.00	0.24
78	000783	长江证券	64,300	657,789.00	0.24
79	300144	宋城演艺	31,300	655,422.00	0.24
80	002188	巴士在线	22,100	648,635.00	0.24
81	601985	中国核电	90,500	638,930.00	0.23
82	600111	北方稀土	52,000	638,040.00	0.23
83	300070	碧水源	36,346	636,781.92	0.23
84	002142	宁波银行	37,800	628,992.00	0.23
85	000863	三湘印象	73,549	624,431.01	0.23
86	601088	中国神华	38,400	621,312.00	0.23
87	600400	红豆股份	72,100	617,176.00	0.22
88	002321	华英农业	57,500	615,825.00	0.22
89	600655	豫园商城	53,900	615,538.00	0.22
90	000043	中航地产	50,000	613,000.00	0.22
91	300198	纳川股份	91,700	610,722.00	0.22
92	600337	美克家居	43,100	610,296.00	0.22
93	600649	城投控股	29,900	608,166.00	0.22

94	600019	宝钢股份	95,600	607,060.00	0.22
95	601901	方正证券	79,800	606,480.00	0.22
96	601788	光大证券	37,900	606,021.00	0.22
97	600057	象屿股份	52,300	601,450.00	0.22
98	002172	澳洋科技	58,500	598,455.00	0.22
99	600637	东方明珠	25,500	594,150.00	0.22
100	002091	江苏国泰	44,600	591,396.00	0.22
101	300040	九洲电气	51,600	591,336.00	0.22
102	000503	海虹控股	13,900	584,495.00	0.21
103	600690	青岛海尔	59,100	583,908.00	0.21
104	600094	大名城	65,600	583,840.00	0.21
105	601669	中国电建	80,000	580,800.00	0.21
106	600203	福日电子	49,300	578,782.00	0.21
107	600089	特变电工	62,900	574,277.00	0.21
108	600729	重庆百货	24,500	574,035.00	0.21
109	002182	云海金属	30,800	573,188.00	0.21
110	600022	山东钢铁	229,000	572,500.00	0.21
111	600891	秋林集团	61,400	572,248.00	0.21
112	600600	青岛啤酒	19,400	571,136.00	0.21
113	002477	雏鹰农牧	113,600	570,272.00	0.21
114	600461	洪城水业	74,900	569,989.00	0.21
115	000768	中航飞机	26,806	569,895.56	0.21
116	002491	通鼎互联	36,500	567,210.00	0.21
117	300054	鼎龙股份	25,900	565,915.00	0.21
118	600383	金地集团	43,600	565,056.00	0.21
119	000625	长安汽车	37,800	564,732.00	0.21
120	600846	同济科技	61,200	563,652.00	0.21
121	002673	西部证券	27,100	562,867.00	0.21
122	600479	千金药业	35,600	561,412.00	0.20
123	600960	渤海活塞	63,100	559,066.00	0.20
124	600597	光明乳业	42,700	557,662.00	0.20
125	600755	厦门国贸	67,800	555,960.00	0.20
126	600216	浙江医药	43,600	552,848.00	0.20
127	600602	云赛智联	57,700	549,881.00	0.20
128	002458	益生股份	15,900	546,960.00	0.20
129	600458	时代新材	38,600	546,190.00	0.20
130	000795	英洛华	86,000	544,380.00	0.20
131	000423	东阿阿胶	10,100	544,087.00	0.20
132	601555	东吴证券	40,700	540,089.00	0.20

133	600303	曙光股份	59,300	534,886.00	0.19
134	300048	合康新能	65,000	534,300.00	0.19
135	600109	国金证券	41,000	534,230.00	0.19
136	600705	中航资本	87,000	532,440.00	0.19
137	300072	三聚环保	11,500	532,335.00	0.19
138	002517	恺英网络	15,800	530,248.00	0.19
139	600703	三安光电	39,500	528,905.00	0.19
140	600010	宝钢股份	189,300	528,147.00	0.19
141	600886	国投电力	78,900	526,263.00	0.19
142	600547	山东黄金	14,400	525,744.00	0.19
143	002594	比亚迪	10,550	524,124.00	0.19
144	600535	天士力	12,600	522,774.00	0.19
145	002400	省广股份	37,600	518,504.00	0.19
146	002202	金风科技	30,250	517,577.50	0.19
147	600660	福耀玻璃	27,200	506,736.00	0.18
148	000070	特发信息	20,000	505,800.00	0.18
149	002456	欧菲光	14,702	503,984.56	0.18
150	600066	宇通客车	25,700	503,463.00	0.18
151	002234	民和股份	23,200	500,656.00	0.18
152	600009	上海机场	18,700	495,924.00	0.18
153	002445	中南文化	33,000	495,330.00	0.18
154	300017	网宿科技	9,223	494,445.03	0.18
155	600893	中航动力	15,100	494,374.00	0.18
156	002739	万达院线	9,100	492,037.00	0.18
157	600068	葛洲坝	53,500	491,665.00	0.18
158	000839	中信国安	53,200	488,376.00	0.18
159	600804	鹏博士	21,857	479,324.01	0.17
160	002230	科大讯飞	17,669	478,653.21	0.17
161	601727	上海电气	56,800	478,256.00	0.17
162	600100	同方股份	34,500	477,825.00	0.17
163	600029	南方航空	68,000	477,360.00	0.17
164	002241	歌尔股份	17,806	472,215.12	0.17
165	600406	国电南瑞	28,200	468,966.00	0.17
166	000338	潍柴动力	46,900	467,124.00	0.17
167	000100	TCL 集团	140,900	464,970.00	0.17
168	300150	世纪瑞尔	45,900	457,623.00	0.17
169	600415	小商品城	52,700	455,855.00	0.17
170	600570	恒生电子	9,612	453,109.68	0.17
171	300024	机器人	21,175	452,721.50	0.16

172	600309	万华化学	21,000	452,130.00	0.16
173	600196	复星医药	19,500	451,230.00	0.16
174	601800	中国交建	29,600	449,624.00	0.16
175	600031	三一重工	73,700	449,570.00	0.16
176	000568	泸州老窖	13,600	448,800.00	0.16
177	002252	上海莱士	19,240	444,251.60	0.16
178	000069	华侨城 A	63,600	442,020.00	0.16
179	000793	华闻传媒	39,100	441,439.00	0.16
180	601618	中国中冶	94,400	439,904.00	0.16
181	601607	上海医药	22,400	438,144.00	0.16
182	000009	中国宝安	41,710	432,115.60	0.16
183	000623	吉林敖东	13,900	430,761.00	0.16
184	600023	浙能电力	79,100	429,513.00	0.16
185	601198	东兴证券	21,400	429,284.00	0.16
186	600271	航天信息	21,500	428,925.00	0.16
187	002065	东华软件	18,300	426,390.00	0.16
188	600739	辽宁成大	23,700	425,652.00	0.16
189	600867	通化东宝	19,260	422,371.80	0.15
190	600221	海南航空	127,400	415,324.00	0.15
191	600177	雅戈尔	29,700	415,206.00	0.15
192	600485	信威集团	28,300	413,180.00	0.15
193	601888	中国国旅	9,500	412,300.00	0.15
194	600606	绿地控股	47,200	411,112.00	0.15
195	600340	华夏幸福	17,200	411,080.00	0.15
196	000413	东旭光电	36,400	409,864.00	0.15
197	600362	江西铜业	24,400	408,212.00	0.15
198	600816	安信信托	17,200	406,264.00	0.15
199	600352	浙江龙盛	44,100	406,161.00	0.15
200	600489	中金黄金	33,394	403,733.46	0.15
201	600115	东方航空	57,000	402,990.00	0.15
202	600820	隧道股份	36,600	402,966.00	0.15
203	000895	双汇发展	19,200	401,856.00	0.15
204	000630	铜陵有色	129,700	399,476.00	0.15
205	000750	国海证券	57,200	398,684.00	0.15
206	600426	华鲁恒升	30,000	397,500.00	0.14
207	601021	春秋航空	10,683	392,493.42	0.14
208	600369	西南证券	54,746	390,338.98	0.14
209	000540	中天城投	56,200	389,466.00	0.14
210	600741	华域汽车	24,400	389,180.00	0.14

211	601018	宁波港	76,800	388,608.00	0.14
212	002465	海格通信	33,300	387,945.00	0.14
213	601919	中远海控	74,000	387,760.00	0.14
214	000157	中联重科	85,100	386,354.00	0.14
215	600157	永泰能源	96,300	386,163.00	0.14
216	002236	大华股份	28,100	384,408.00	0.14
217	601998	中信银行	59,400	380,754.00	0.14
218	300124	汇川技术	18,697	380,110.01	0.14
219	600718	东软集团	19,300	379,438.00	0.14
220	002466	天齐锂业	11,600	376,420.00	0.14
221	002008	大族激光	16,467	372,154.20	0.14
222	600674	川投能源	42,700	371,490.00	0.14
223	600150	中国船舶	13,400	369,974.00	0.13
224	601933	永辉超市	74,200	364,322.00	0.13
225	600118	中国卫星	11,500	359,260.00	0.13
226	601111	中国国航	49,500	356,400.00	0.13
227	300027	华谊兄弟	32,373	356,103.00	0.13
228	600153	建发股份	33,000	353,100.00	0.13
229	002085	万丰奥威	17,700	349,752.00	0.13
230	300315	掌趣科技	37,600	347,424.00	0.13
231	600959	江苏有线	30,150	340,695.00	0.12
232	002475	立讯精密	16,400	340,300.00	0.12
233	000963	华东医药	4,700	338,729.00	0.12
234	000686	东北证券	27,220	336,439.20	0.12
235	600061	国投安信	21,500	335,615.00	0.12
236	000060	中金岭南	30,000	334,500.00	0.12
237	600005	武钢股份	97,800	333,498.00	0.12
238	601333	广深铁路	65,700	333,099.00	0.12
239	600085	同仁堂	10,565	331,529.70	0.12
240	600170	上海建工	69,060	326,653.80	0.12
241	000826	启迪桑德	9,900	326,502.00	0.12
242	000876	新希望	40,400	325,220.00	0.12
243	600018	上港集团	62,900	322,048.00	0.12
244	000917	电广传媒	22,000	316,580.00	0.12
245	600583	海油工程	42,800	315,864.00	0.12
246	600663	陆家嘴	14,200	314,246.00	0.11
247	002183	怡亚通	28,700	311,682.00	0.11
248	002081	金螳螂	30,650	300,063.50	0.11
249	600839	四川长虹	71,600	299,288.00	0.11

250	600588	用友网络	14,199	295,623.18	0.11
251	000821	京山轻机	18,200	295,568.00	0.11
252	000559	万向钱潮	22,200	294,372.00	0.11
253	002310	东方园林	20,800	294,320.00	0.11
254	300168	万达信息	14,300	289,146.00	0.11
255	300033	同花顺	4,200	288,876.00	0.11
256	002385	大北农	39,650	281,515.00	0.10
257	603993	洛阳钼业	75,300	280,116.00	0.10
258	600208	新湖中宝	66,700	277,472.00	0.10
259	000425	徐工机械	81,500	275,470.00	0.10
260	601718	际华集团	29,900	275,379.00	0.10
261	300058	蓝色光标	27,059	275,190.03	0.10
262	000709	河钢股份	82,300	274,882.00	0.10
263	000792	盐湖股份	14,400	274,608.00	0.10
264	002426	胜利精密	33,200	274,564.00	0.10
265	600688	上海石化	42,500	273,700.00	0.10
266	601958	金钼股份	34,800	266,220.00	0.10
267	600895	张江高科	15,000	265,800.00	0.10
268	002074	国轩高科	8,500	263,415.00	0.10
269	002500	山西证券	21,860	262,757.20	0.10
270	600332	白云山	10,900	261,382.00	0.10
271	600446	金证股份	10,350	260,095.50	0.09
272	600060	海信电器	15,178	259,847.36	0.09
273	600654	中安消	14,900	259,707.00	0.09
274	600875	东方电气	24,000	258,960.00	0.09
275	601633	长城汽车	23,400	258,804.00	0.09
276	000983	西山煤电	30,500	258,030.00	0.09
277	600233	圆通速递	10,000	254,900.00	0.09
278	600498	烽火通信	10,100	254,621.00	0.09
279	601258	庞大集团	90,700	251,239.00	0.09
280	601866	中远海发	61,500	250,920.00	0.09
281	600074	保千里	18,900	250,236.00	0.09
282	600737	中粮屯河	19,900	247,954.00	0.09
283	600252	中恒集团	53,900	246,862.00	0.09
284	000977	浪潮信息	11,600	245,920.00	0.09
285	300002	神州泰岳	26,600	245,784.00	0.09
286	002470	金正大	30,400	240,160.00	0.09
287	600666	奥瑞德	8,900	239,855.00	0.09
288	000402	金融街	23,200	238,960.00	0.09

289	600376	首开股份	20,000	236,200.00	0.09
290	600873	梅花生物	36,100	235,372.00	0.09
291	002049	紫光国芯	7,100	233,874.00	0.09
292	300015	爱尔眼科	7,800	233,220.00	0.08
293	600704	物产中大	22,300	230,359.00	0.08
294	002292	奥飞娱乐	10,100	229,270.00	0.08
295	601216	君正集团	49,100	228,315.00	0.08
296	600038	中直股份	4,600	222,732.00	0.08
297	600827	百联股份	15,400	221,144.00	0.08
298	000738	中航动控	8,932	220,977.68	0.08
299	000778	新兴铸管	42,400	219,208.00	0.08
300	000039	中集集团	14,800	216,376.00	0.08
301	600373	中文传媒	10,700	216,140.00	0.08
302	002195	二三四五	18,704	211,729.28	0.08
303	002129	中环股份	25,400	210,058.00	0.08
304	002152	广电运通	15,700	208,496.00	0.08
305	600037	歌华有线	13,500	206,820.00	0.08
306	601155	新城控股	17,500	205,625.00	0.07
307	300182	捷成股份	19,900	205,169.00	0.07
308	000712	锦龙股份	8,700	203,928.00	0.07
309	601872	招商轮船	41,100	203,034.00	0.07
310	000718	苏宁环球	23,500	202,805.00	0.07
311	600021	上海电力	16,500	200,310.00	0.07
312	002131	利欧股份	12,500	199,375.00	0.07
313	000156	华数传媒	11,100	198,801.00	0.07
314	002146	荣盛发展	25,300	198,605.00	0.07
315	600008	首创股份	46,700	191,937.00	0.07
316	000627	天茂集团	24,800	189,720.00	0.07
317	600372	中航电子	10,200	189,312.00	0.07
318	603000	人民网	10,700	188,962.00	0.07
319	601225	陕西煤业	38,800	188,180.00	0.07
320	002714	牧原股份	8,000	186,240.00	0.07
321	002174	游族网络	7,000	185,150.00	0.07
322	601611	中国核建	10,200	175,338.00	0.06
323	000671	阳光城	31,400	174,898.00	0.06
324	000800	一汽轿车	15,800	171,746.00	0.06
325	002027	分众传媒	12,000	171,240.00	0.06
326	300146	汤臣倍健	14,100	168,354.00	0.06
327	300251	光线传媒	17,100	166,896.00	0.06

328	601118	海南橡胶	23,600	164,256.00	0.06
329	000061	农产品	13,200	163,284.00	0.06
330	000938	紫光股份	2,800	160,692.00	0.06
331	600582	天地科技	32,100	159,537.00	0.06
332	000027	深圳能源	23,000	158,010.00	0.06
333	002151	北斗星通	4,900	156,310.00	0.06
334	002424	贵州百灵	8,200	155,308.00	0.06
335	601928	凤凰传媒	14,800	154,956.00	0.06
336	601877	正泰电器	7,700	154,000.00	0.06
337	300133	华策影视	13,478	152,975.30	0.06
338	002153	石基信息	6,200	151,094.00	0.06
339	000008	神州高铁	16,000	149,120.00	0.05
340	600871	石化油服	35,000	143,500.00	0.05
341	601608	中信重工	25,200	141,372.00	0.05
342	600783	鲁信创投	5,800	131,196.00	0.05
343	600996	贵广网络	6,666	125,254.14	0.05
344	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.04
345	603885	吉祥航空	5,000	116,500.00	0.04
346	000555	神州信息	5,300	112,519.00	0.04
347	300085	银之杰	5,300	110,770.00	0.04
348	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.04
349	600188	兖州煤业	8,500	92,310.00	0.03
350	600754	锦江股份	3,100	91,326.00	0.03
351	603298	杭叉集团	3,283	79,711.24	0.03
352	601375	中原证券	19,340	77,360.00	0.03
353	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.03
354	002568	百润股份	3,600	72,864.00	0.03
355	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
356	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
357	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.03
358	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
359	002831	裕同科技	843	58,335.60	0.02
360	000531	穗恒运 A	5,000	57,350.00	0.02
361	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
362	002452	长高集团	5,000	47,000.00	0.02
363	603877	太平鸟	2,035	43,345.50	0.02
364	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
365	000878	云南铜业	3,600	42,516.00	0.02
366	603598	引力传媒	1,800	40,248.00	0.01

367	601799	星宇股份	1,000	38,500.00	0.01
368	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
369	603799	华友钴业	1,000	35,170.00	0.01
370	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
371	002032	苏泊尔	1,000	34,920.00	0.01
372	300100	双林股份	1,000	34,000.00	0.01
373	002833	弘亚数控	1,910	33,654.20	0.01
374	600976	健民集团	1,000	31,930.00	0.01
375	600858	银座股份	3,300	30,888.00	0.01
376	603389	亚振家居	1,073	25,870.03	0.01
377	603585	苏利股份	361	25,168.92	0.01
378	603878	武进不锈	627	25,080.00	0.01
379	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
380	603266	天龙股份	1,453	21,257.39	0.01
381	600195	中牧股份	1,000	21,250.00	0.01
382	300587	天铁股份	1,395	19,683.45	0.01
383	300409	道氏技术	500	17,200.00	0.01
384	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.01
385	603886	元祖股份	872	15,434.40	0.01
386	603035	常熟汽饰	1,445	15,085.80	0.01
387	603228	景旺电子	613	14,197.08	0.01
388	603239	N 仙通	428	13,460.60	0.00
389	600285	羚锐制药	1,000	12,760.00	0.00
390	300113	顺网科技	452	12,154.28	0.00
391	000890	法尔胜	1,000	12,030.00	0.00
392	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
393	600257	大湖股份	1,000	10,650.00	0.00
394	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
395	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
396	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
397	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
398	002245	澳洋顺昌	1,000	8,920.00	0.00
399	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
400	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
401	300457	赢合科技	100	6,258.00	0.00
402	002712	思美传媒	198	5,662.80	0.00
403	300467	迅游科技	100	4,380.00	0.00
404	000733	振华科技	100	1,785.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600485	信威集团	18,927,382.03	5.83
2	600519	贵州茅台	13,195,773.55	4.07
3	600016	民生银行	11,690,776.76	3.60
4	601398	工商银行	11,261,056.92	3.47
5	300058	蓝色光标	10,875,383.42	3.35
6	601166	兴业银行	10,179,565.00	3.14
7	601328	交通银行	10,055,185.00	3.10
8	300496	中科创达	8,926,455.28	2.75
9	300144	宋城演艺	8,639,611.20	2.66
10	601988	中国银行	8,100,801.28	2.50
11	600115	东方航空	7,267,235.00	2.24
12	002548	金新农	7,187,422.57	2.22
13	601318	中国平安	6,634,578.00	2.05
14	300100	双林股份	6,500,604.10	2.00
15	000860	顺鑫农业	6,020,871.00	1.86
16	300310	宜通世纪	5,907,053.44	1.82
17	300327	中颖电子	5,739,976.50	1.77
18	600056	中国医药	5,643,795.00	1.74
19	002224	三力士	5,575,112.44	1.72
20	600000	浦发银行	5,544,530.00	1.71

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300104	乐视网	18,386,642.02	5.67
2	300058	蓝色光标	15,907,874.96	4.90
3	600485	信威集团	14,013,259.68	4.32
4	002292	奥飞娱乐	13,395,185.24	4.13
5	002230	科大讯飞	12,985,315.90	4.00

6	300017	网宿科技	12,505,376.78	3.85
7	600519	贵州茅台	11,468,445.60	3.54
8	002224	三力士	10,879,130.24	3.35
9	600518	康美药业	9,899,291.75	3.05
10	002123	梦网荣信	9,719,406.53	3.00
11	300496	中科创达	8,642,433.86	2.66
12	002410	广联达	8,335,299.19	2.57
13	300133	华策影视	8,290,088.16	2.56
14	300144	宋城演艺	8,203,705.56	2.53
15	600804	鹏博士	8,073,672.97	2.49
16	600016	民生银行	7,801,965.00	2.40
17	601021	春秋航空	7,784,552.85	2.40
18	601398	工商银行	7,772,565.00	2.40
19	600298	安琪酵母	7,576,975.39	2.34
20	601328	交通银行	7,367,708.09	2.27
21	300100	双林股份	7,354,596.56	2.27
22	002548	金新农	7,064,369.78	2.18
23	002241	歌尔股份	6,948,647.92	2.14
24	300031	宝通科技	6,757,599.68	2.08
25	002456	欧菲光	6,628,063.31	2.04

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	822,031,246.34
卖出股票收入（成交）总额	828,539,783.66

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	17,198,110.70	6.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,615,250.00	0.95
	其中：政策性金融债	2,615,250.00	0.95
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	19,813,360.70	7.22

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

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	9,755,000.00	3.55
2	010303	03 国债(3)	49,230	5,009,152.50	1.82
3	018002	国开 1302	25,000	2,615,250.00	0.95
4	010107	21 国债(7)	23,040	2,424,960.00	0.88
5	010213	02 国债(13)	90	8,998.20	0.00

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

招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）于 2016 年 1 月 28 日受到中国银行间市场交易商协会自律处分。处分称因招商银行自身工作操作疏忽导致深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司的 2015 年上半年度财务报表未能按期披露，银行间市场交易商协会给予招商银行通报批评处分，并处责令改正。

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。

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	64,011.74
2	应收证券清算款	57,497.95
3	应收股利	-
4	应收利息	451,268.80
5	应收申购款	130,270.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	703,049.35

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 (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, 125	16, 774. 91	7, 441, 748. 79	2. 59%	279, 828, 552. 82	97. 41%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	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 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 (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	63, 369, 342. 90
减:本报告期基金总赎回份额	67, 755, 829. 33
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	287, 270, 301. 61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。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	
银河证券	1	445,632,700.87	27.05%	415,022.08	27.05%	-
海通证券	2	238,548,013.91	14.48%	222,160.28	14.48%	-
国信证券	2	238,253,266.02	14.46%	221,886.84	14.46%	-
中信证券	2	234,563,089.61	14.24%	218,448.75	14.24%	-

广发证券	2	179,412,315.63	10.89%	167,088.50	10.89%	-
国金证券	2	116,415,890.77	7.07%	108,418.56	7.07%	-
申万宏源	2	81,620,799.63	4.95%	76,013.87	4.95%	-
国泰君安	2	67,865,019.21	4.12%	63,202.66	4.12%	-
中金公司	2	32,453,657.91	1.97%	30,220.06	1.97%	-
安信证券	2	12,836,437.83	0.78%	11,954.79	0.78%	-
东方证券	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。

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
银河证券	57,314,415.80	50.91%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	21,514,538.50	19.11%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	6,409,348.80	5.69%	-	-	-	-
国金证券	13,477,990.80	11.97%	-	-	-	-
申万宏源	7,307,764.70	6.49%	-	-	-	-
国泰君安	5,008,757.50	4.45%	24,600,000.00	100.00%	-	-
中金公司	1,536,529.70	1.36%	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	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 3 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	中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 16 日

	参加上海天天基金销售有限公司费率优惠的公告	报、基金管理人网站	
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）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
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 6 月 29 日
19	农银汇理基金管理有限公司关于旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定期定额投资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 7 月 1 日
20	农银汇理基金管理有限公司管理	中国证券报、证券时	2016 年 7 月 1 日

	的基金 2016 年半年度资产净值公告	报、基金管理人网站	
21	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 20 日
22	农银汇理基金管理有限公司关于股东变更的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 6 日
23	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并参加其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 15 日
24	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理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 8 月 22 日
25	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 26 日
26	农银汇理基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
27	关于交通银行开展手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续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 9 月 20 日
28	农银大盘蓝筹混合一招募说明书更新—2016 年第 2 号	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日
29	农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 10 月 25 日
30	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加四家机构为代销机构并参加其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 11 月 29 日
31	关于交通银行开展网上银行、手	中国证券报、证券时报	2016 年 12 月 13 日

	机银行基金申购费率优惠活动的公告	报、基金管理人网站	
32	关于农业银行开展 2017 年基金交易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 12 月 30 日
33	关于配合工商银行展开“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 30 日

§ 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

13.3 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
2017年3月30日