

农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	6
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.....	12
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§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.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54

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	54
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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	农银主题轮动混合
基金主代码	000462
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 10 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	600,476,318.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用主题投资策略，把握中国经济发展和结构转型过程中各种投资主题的轮动效应，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>本基金采用“主题投资策略”（Thematic Investment Approach），综合运用定量和定性的分析方法，自上而下，针对经济发展和结构转型的驱动因素进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，结合价值投资理念，精选投资主题下的受益个股，力争获取市场超额收益，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>1、大类资产配置策略。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。本基金的股票投资将运用主题投资策略从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建投资组合。</p> <p>3、债券投资策略。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。</p> <p>4、权证投资策略。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	沪深 300 指数×65%+中证全债指数×35%

风险收益特征	本基金为中高风险、中高预期收益的混合型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	郭明
	联系电话	021-61095588	010-66105799
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		于进	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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 4 月 10 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-124,733,902.07	324,315,944.26	-
本期利润	-202,913,554.19	388,734,733.43	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3048	0.1467	-
本期加权平均净值利润率	-30.23%	14.27%	-
本期基金份额净值增长率	-24.59%	29.83%	-
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	-12,529,167.33	196,807,773.77	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0209	0.2923	-
期末基金资产净值	587,947,151.38	874,067,079.08	-
期末基金份额净值	0.9791	1.2983	-
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	-2.09%	29.83%	-

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。

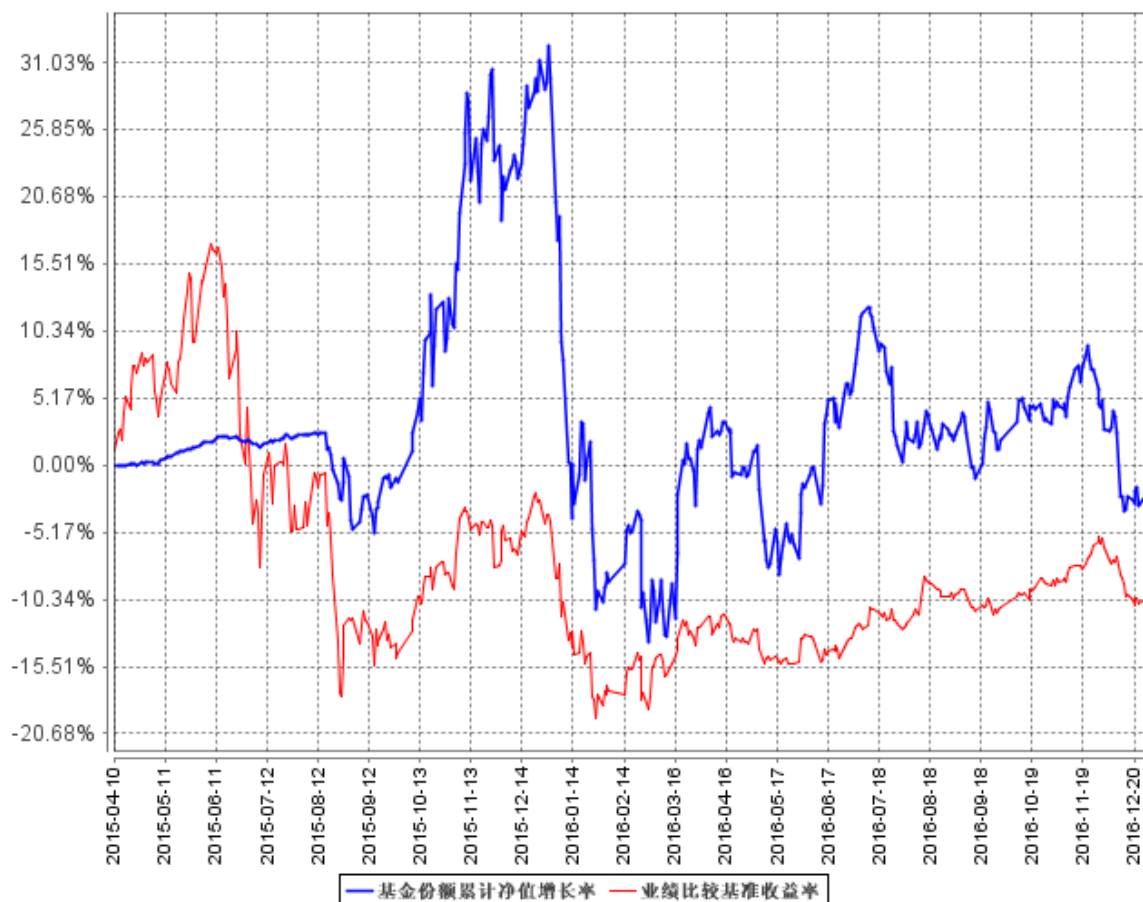
3.2 基金净值表现

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	-3.93%	1.04%	0.53%	0.48%	-4.46%	0.56%
过去六个月	-7.12%	1.09%	3.40%	0.50%	-10.52%	0.59%
过去一年	-24.59%	1.91%	-6.33%	0.91%	-18.26%	1.00%
自基金合同生效起至今	-2.09%	1.71%	-10.45%	1.33%	8.36%	0.38%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

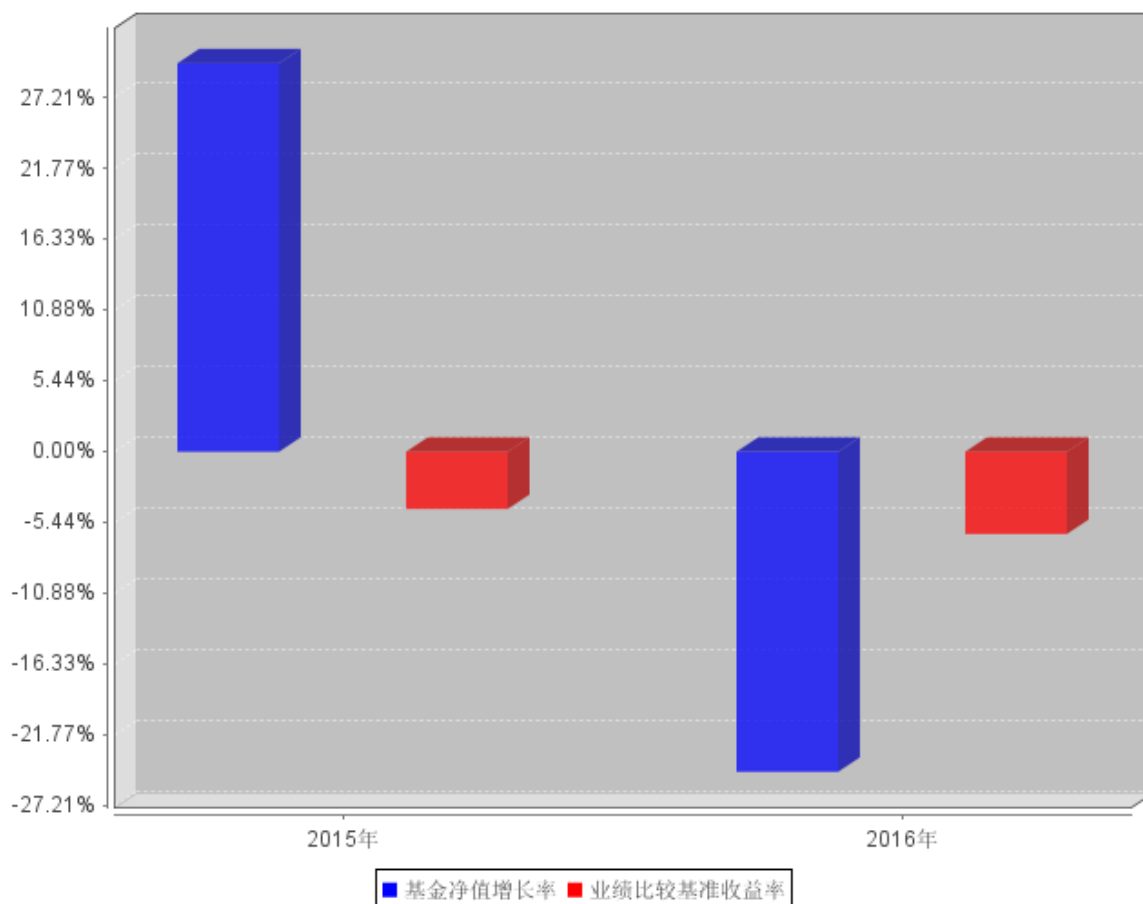
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证资产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（2015 年 4 月 10 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 37 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理纯债一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金及农银汇理日日鑫交易型货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2015 年 4 月 10 日	2016 年 12 月 28 日	8	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理，农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
史向明	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2015 年 5 月 26 日	2016 年 12 月 28 日	16	理学硕士，具有基金从业资格。历任中国银河证券公司上海总部债券研究员、天治基金管理公司债券

					研究员及天治天得利货币市场基金经理、上投摩根基金管理公司固定收益部投资经理、农银汇理恒久增利债券型基金基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司固定收益部总经理、基金经理。
颜伟鹏	本基金基金经理	2015 年 5 月 26 日	-	5	工学硕士。历任交银施罗德基金公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

回顾本基金 2016 年操作，本基金全年坚持了至下而上的投资风格，深度研究基本面，在分化的行情中，挖掘个股，业绩逐渐好转；未来的配置重点依然是优质的成长股，在深度研究优秀上市公司的基础上进行配置。

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-24.59%，业绩比较基准收益率为-6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济来看，目前国内经济改善明显，预计 2017 年经济增长目标设定在 6.5-7%的区间，和去年持平。截至目前，除海南省外的 30 个省区公布了 2017 年地区生产总值增长目标，其中 6 个省上调目标增速，11 个省下调目标增速，13 个省目标不变。今年以来经济活动继续保持较强增长势头。

货币政策仍中性略偏紧，并更注重防风险。2 月 17 日，央行公布 2016 年第四季度中国货币政策执行报告，指出下一阶段将实施好稳健中性的货币政策；平衡稳增长、调结构、抑泡沫和防风险之间的关系，防止“脱实向虚”；调控框架逐步从货币转向“货币+宏观审慎”，引导资金支持实体经济。

国际经济来看，今年的国际政治方面不确定性较大，要时刻关注可能的风险。相关的风险可能会随着退欧进程的展开而释放，英、欧仍可能受到冲击，但受到的冲击程度可能不同。意大利因其脆弱的银行系统和修宪公投带来的政治不确定性，自退欧以来其 10 年期国债收益率相对西班牙大幅上升。而最需要关注的是意大利带来的多米诺骨牌效应，民粹政党在欧陆各国迅速崛起，部分国家退欧呼声也随之高涨。综合来看，欧盟面临的潜在的风险可能大于英国。

在经济企稳的背景下，权益市场的信心逐渐的修复，随着产业演进的加速和热点的逐渐出现，A 股有望延续结构性的牛市的行情。

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、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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配”，即本基金本年无应分配利润。

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

本报告期内，本基金托管人在对农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20968 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	农银汇理主题轮动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主题轮动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“农银汇理主题轮动混合型基金”)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主题轮动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

	<p>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	我们认为，上述农银纯债定开债券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，公允反映了农银纯债定开债券基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 6 月 20 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。
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：农银汇理主题轮动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	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	55,987,834.66	81,259,335.57
结算备付金		3,165,985.31	11,383,229.88
存出保证金		789,017.72	1,495,958.91
交易性金融资产	7.4.7.2	498,809,156.50	792,044,626.42

其中：股票投资		498,809,156.50	759,196,354.42
基金投资		-	-
债券投资		-	32,848,272.00
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	47,000,000.00	-
应收证券清算款		4,570,982.56	36,735,312.58
应收利息	7.4.7.5	18,450.06	1,102,370.38
应收股利		-	-
应收申购款		91,813.92	834,763.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		610,433,240.73	924,855,597.60
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		19,099,316.16	30,184,031.91
应付赎回款		151,754.41	11,834,024.87
应付管理人报酬		756,922.52	1,183,607.99
应付托管费		126,153.74	197,268.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,971,639.61	7,260,492.43
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	380,302.91	129,093.32
负债合计		22,486,089.35	50,788,518.52
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	600,476,318.71	673,242,333.49
未分配利润	7.4.7.10	-12,529,167.33	200,824,745.59
所有者权益合计		587,947,151.38	874,067,079.08
负债和所有者权益总计		610,433,240.73	924,855,597.60

注：

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9791 元，基金份额总额 600,476,318.71 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12

月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理主题轮动灵活配置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 4 月 10 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-165,183,678.35	439,497,155.58
1. 利息收入		1,216,848.63	36,169,038.91
其中：存款利息收入	7.4.7.11	887,291.94	31,304,141.34
债券利息收入		271,805.22	2,459,737.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		57,751.47	2,405,160.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-89,069,750.07	320,994,675.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-90,159,462.91	321,112,700.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-222,691.12	-723,495.66
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	1,312,403.96	605,470.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-78,179,652.12	64,418,789.17
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	848,875.21	17,914,652.29
减：二、费用		37,729,875.84	50,762,422.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,073,113.73	29,371,146.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,678,852.37	4,895,191.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	25,555,552.03	16,102,627.57
5. 利息支出		-	13,348.32
其中：卖出回购金融资产支出		-	13,348.32
6. 其他费用	7.4.7.20	422,357.71	380,108.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-202,913,554.19	388,734,733.43
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-202,913,554.19	388,734,733.43
-------------------	--	-----------------	----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理主题轮动灵活配置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）	673,242,333.49	200,824,745.59	874,067,079.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-202,913,554.19	-202,913,554.19
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）	-72,766,014.78	-10,440,358.73	-83,206,373.51
其中：1. 基金申购款	234,658,175.91	3,253,331.03	237,911,506.94
2. 基金赎回款	-307,424,190.69	-13,693,689.76	-321,117,880.45
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）	600,476,318.71	-12,529,167.33	587,947,151.38
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）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）	5,628,144,009.75	-	5,628,144,009.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	388,734,733.43	388,734,733.43
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）	-4,954,901,676.26	-187,909,987.84	-5,142,811,664.10

其中：1. 基金申购款	653,527,638.93	21,182,021.83	674,709,660.76
2. 基金赎回款	-5,608,429,315.19	-209,092,009.67	-5,817,521,324.86
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）	673,242,333.49	200,824,745.59	874,067,079.08

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

农银汇理主题轮动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[2013]第1465号《关于核准农银汇理主题轮动股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2015]第50号《关于核准农银汇理主题轮动股票型证券投资基金变更注册的批复》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《农银汇理主题轮动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5,628,054,391.09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(2015)第299号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,628,144,009.75份基金份额,其中认购资金利息折合89,618.66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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理主题轮动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的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、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%，权证资产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×65%+中证全债指数×35%。

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》、《农银汇理主题轮动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。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 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卖出回购金融资产款和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) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中证指数有限公司独立提供。

(3) 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间及上年度可比期间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及上年度可比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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	55,987,834.66	81,259,335.57
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-

其他存款	-	-
合计：	55,987,834.66	81,259,335.57

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	512,570,019.45	498,809,156.50	-13,760,862.95
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	512,570,019.45	498,809,156.50	-13,760,862.95
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	694,754,871.03	759,196,354.42	64,441,483.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,634,396.22	2,753,272.00
	银行间市场	30,236,570.00	30,095,000.00
	合计	32,870,966.22	32,848,272.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	727,625,837.25	792,044,626.42	64,418,789.17

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日

	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	47,000,000.00	-
合计	47,000,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

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	15,789.01	15,478.10
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	1,424.70	5,122.40
应收债券利息	-	1,081,096.68
应收买入返售证券利息	881.25	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	355.10	673.20
合计	18,450.06	1,102,370.38

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	1,971,639.61	7,260,164.93
银行间市场应付交易费用	-	327.50
合计	1,971,639.61	7,260,492.43

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	302.91	39,093.32
预提费用	380,000.00	90,000.00
合计	380,302.91	129,093.32

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	673,242,333.49	673,242,333.49
本期申购	234,658,175.91	234,658,175.91
本期赎回（以“-”号填列）	-307,424,190.69	-307,424,190.69
- 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	600,476,318.71	600,476,318.71

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	196,807,773.77	4,016,971.82	200,824,745.59
本期利润	-124,733,902.07	-78,179,652.12	-202,913,554.19
本期基金份额交易产生的变动数	-6,258,297.06	-4,182,061.67	-10,440,358.73
其中：基金申购款	29,641,716.07	-26,388,385.04	3,253,331.03
基金赎回款	-35,900,013.13	22,206,323.37	-13,693,689.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,815,574.64	-78,344,741.97	-12,529,167.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 4 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	739,730.17	4,286,852.69
定期存款利息收入	-	26,925,152.79

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	123,009.46	80,571.87
其他	24,552.31	11,563.99
合计	887,291.94	31,304,141.34

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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年4月10日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
卖出股票成交总额	8,437,349,796.34	5,177,628,086.58
减：卖出股票成本总额	8,527,509,259.25	4,856,515,385.82
买卖股票差价收入	-90,159,462.91	321,112,700.76

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4月10日(基金合 同生效日)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	-222,691.12	-723,495.66
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	-222,691.12	-723,495.66

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4月10日(基金合 同生效日)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	34,001,177.00	89,540,370.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	32,870,966.22	87,487,803.58

减：应收利息总额	1,352,901.90	2,776,062.63
买卖债券差价收入	-222,691.12	-723,495.66

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其他投资收益。

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4月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,312,403.96	605,470.11

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,312,403.96	605,470.11

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4月10日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-78,179,652.12	64,418,789.17
——股票投资	-78,202,346.34	64,441,483.39
——债券投资	22,694.22	-22,694.22
——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	-78,179,652.12	64,418,789.17

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4月10日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
基金赎回费收入	809,688.33	14,840,433.72
转换费	39,186.88	3,074,218.57
合计	848,875.21	17,914,652.29

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，赎回费总额归入基金资产的比例随着持有期限而变化。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费部分归入基金资产的比例随着持有期限而变化。

7.4.7.19 交易费用

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 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	25,555,552.03	16,102,002.57
银行间市场交易费用	-	625.00
合计	25,555,552.03	16,102,627.57

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 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	240,000.00
清算所账户服务费	18,000.00	1,500.00
账户服务费	18,000.00	4,500.00
银行汇划费	6,357.71	43,708.82
其他	-	400.00
合计	422,357.71	380,108.82

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

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
中国工商银行股份有限公司	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

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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 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4月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,073,113.73	29,371,146.35
其中：支付销售机构的客户维护费	5,551,844.40	16,127,985.74

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年4月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,678,852.37	4,895,191.09

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本期无销售服务费。

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年4月10日(基金合同生效日)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
中国工商银行——活期	55,987,834.66	739,730.17	81,259,335.57	4,286,852.69
中国工商银行——定期	-	-	-	375,000.00

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
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
300473	德尔股份	2016年11月1日	公告重大事项	77.06	2017年2月10日	71.00	496,605	36,903,074.90	38,268,381.30	-

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，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、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。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。

本基金的银行存款存放于本基金的托管银行—工商银行，本基金认为与工商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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,011,000.00
合计	-	10,011,000.00

注：未评级的债券投资包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	753,072.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	22,084,200.00
合计	-	22,837,272.00

注：未评级的债券投资包括国债、央行票据、政策性银行金融债、超短期融资券和同业存单

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。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析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	55,987,834.66	-	-	-	55,987,834.66
清算备付金	3,165,985.31	-	-	-	3,165,985.31
存出保证金	789,017.72	-	-	-	789,017.72
交易性金融资产	-	-	-	498,809,156.50	498,809,156.50
买入返售金融资产	47,000,000.00	-	-	-	47,000,000.00
应收利息	-	-	-	18,450.06	18,450.06
应收申购款	-	-	-	91,813.92	91,813.92
应收证券清算款	-	-	-	4,570,982.56	4,570,982.56
资产总计	106,942,837.69	-	-	503,490,403.04	610,433,240.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	151,754.41	151,754.41
应付管理人报酬	-	-	-	756,922.52	756,922.52
应付托管费	-	-	-	126,153.74	126,153.74
应付交易费用	-	-	-	1,971,639.61	1,971,639.61
应付证券清算款	-	-	-	19,099,316.16	19,099,316.16
其他负债	-	-	-	380,302.91	380,302.91
负债总计	-	-	-	22,486,089.35	22,486,089.35
利率敏感度缺口	106,942,837.69	-	-	481,004,313.69	587,947,151.38

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	81,259,335.57	-	-	-	81,259,335.57
清算备付金	11,383,229.88	-	-	-	11,383,229.88
存出保证金	1,495,958.91	-	-	-	1,495,958.91
交易性金融资产	32,848,272.00	-	-	759,196,354.42	792,044,626.42
应收利息	-	-	-	1,102,370.38	1,102,370.38
应收申购款	3,000.00	-	-	831,763.86	834,763.86
应收证券清算款	-	-	-	36,735,312.58	36,735,312.58
资产总计	126,989,796.36	-	-	797,865,801.24	924,855,597.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,834,024.87	11,834,024.87
应付管理人报酬	-	-	-	1,183,607.99	1,183,607.99
应付托管费	-	-	-	197,268.00	197,268.00
应付交易费用	-	-	-	7,260,492.43	7,260,492.43
应付证券清算款	-	-	-	30,184,031.91	30,184,031.91
其他负债	-	-	-	129,093.32	129,093.32
负债总计	-	-	-	50,788,518.52	50,788,518.52
利率敏感度缺口	126,989,796.36	-	-	-747,077,282.72	874,067,079.08

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

假设	收益率曲线平行变化		
	忽略债券组合凸性变化对基金资产净值的影响		
	其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率平行上升25个基点	-	-29,150.89
	市场利率平行下降25个基点	-	29,150.89

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，股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证资产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	498,809,156.50	84.84	759,196,354.42	86.86
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	498,809,156.50	84.84	792,044,626.42	90.62

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其它变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	49,712,306.18	-
业绩比较基准下降 5%	-49,712,306.18	-	

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。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截至上年度末，本基金的运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行分析，因此不披露本报告期末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 460,328,357.62 元，属于第二层次的余额为 38,480,798.88 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 694,099,058.92 元，第二层次 97,945,567.50 元，无属于第三层次的余额)。

(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(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	498,809,156.50	81.71
	其中：股票	498,809,156.50	81.71
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	47,000,000.00	7.70
	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	59,153,819.97	9.69
7	其他各项资产	5,470,264.26	0.90
8	合计	610,433,240.73	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	566,400.00	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	406,359,451.19	69.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	50,201,189.71	8.54
F	批发和零售业	8,821,712.40	1.50
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	6,817.20	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,695,104.00	1.48
L	租赁和商务服务业	22,934,054.00	3.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	597,060.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	627,368.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	498,809,156.50	84.84

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	300461	田中精机	679,200	43,353,336.00	7.37
2	300476	胜宏科技	1,819,000	41,564,150.00	7.07
3	300473	德尔股份	496,605	38,268,381.30	6.51
4	002120	新海股份	759,063	38,256,775.20	6.51
5	000928	中钢国际	1,974,207	34,607,848.71	5.89
6	002281	光迅科技	428,735	33,655,697.50	5.72
7	600104	上汽集团	1,016,900	23,846,305.00	4.06
8	600409	三友化工	2,493,100	23,410,209.00	3.98
9	002712	思美传媒	801,890	22,934,054.00	3.90
10	600309	万华化学	1,018,400	21,926,152.00	3.73
11	002045	国光电器	1,381,744	17,202,712.80	2.93
12	002508	老板电器	411,400	15,139,520.00	2.57
13	600233	圆通速递	546,600	13,932,834.00	2.37
14	600426	华鲁恒升	886,500	11,746,125.00	2.00

15	002051	中工国际	509,100	11,668,572.00	1.98
16	600521	华海药业	523,200	11,526,096.00	1.96
17	000858	五粮液	323,700	11,161,176.00	1.90
18	000930	中粮生化	791,800	10,641,792.00	1.81
19	000568	泸州老窖	271,100	8,946,300.00	1.52
20	300219	鸿利智汇	824,392	8,944,653.20	1.52
21	600067	冠城大通	1,214,400	8,695,104.00	1.48
22	600056	中国医药	456,900	8,694,807.00	1.48
23	002258	利尔化学	680,800	8,462,344.00	1.44
24	601607	上海医药	301,700	5,901,252.00	1.00
25	000630	铜陵有色	1,909,300	5,880,644.00	1.00
26	002101	广东鸿图	154,869	3,600,704.25	0.61
27	601908	京运通	484,000	3,446,080.00	0.59
28	601117	中国化学	491,700	3,328,809.00	0.57
29	002640	跨境通	159,588	2,920,460.40	0.50
30	000700	模塑科技	236,800	1,977,280.00	0.34
31	002044	美年健康	47,600	627,368.00	0.11
32	600054	黄山旅游	37,200	597,060.00	0.10
33	300197	铁汉生态	47,000	595,960.00	0.10
34	002041	登海种业	30,000	566,400.00	0.10
35	300373	扬杰科技	14,492	285,202.56	0.05
36	600699	均胜电子	8,600	284,574.00	0.05
37	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
38	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
39	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
40	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
41	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
42	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
43	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
44	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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	600547	山东黄金	124,583,652.52	14.25

2	002712	思美传媒	123,367,590.57	14.11
3	002655	共达电声	111,947,927.09	12.81
4	002502	骅威文化	100,114,495.26	11.45
5	600489	中金黄金	99,118,819.89	11.34
6	000700	模塑科技	97,010,617.43	11.10
7	300031	宝通科技	96,661,189.32	11.06
8	600114	东睦股份	93,575,291.69	10.71
9	002299	圣农发展	93,384,642.82	10.68
10	300148	天舟文化	90,416,024.28	10.34
11	002425	凯撒文化	85,795,196.50	9.82
12	002224	三力士	82,510,695.88	9.44
13	002174	游族网络	81,079,733.91	9.28
14	300467	迅游科技	80,693,258.78	9.23
15	300133	华策影视	80,580,022.10	9.22
16	002281	光迅科技	78,266,787.34	8.95
17	300059	东方财富	78,117,883.80	8.94
18	002458	益生股份	76,399,581.24	8.74
19	002714	牧原股份	76,092,030.94	8.71
20	002477	雏鹰农牧	75,704,425.73	8.66
21	603598	引力传媒	75,398,544.62	8.63
22	600285	羚锐制药	72,819,042.29	8.33
23	002699	美盛文化	71,679,242.35	8.20
24	600459	贵研铂业	71,095,884.03	8.13
25	600389	江山股份	70,505,220.71	8.07
26	002311	海大集团	66,191,590.06	7.57
27	002120	新海股份	66,141,177.54	7.57
28	300364	中文在线	63,259,952.64	7.24
29	002167	东方锆业	62,619,762.77	7.16
30	002155	湖南黄金	62,486,003.47	7.15
31	000603	盛达矿业	62,165,110.80	7.11
32	002733	雄韬股份	61,263,032.11	7.01
33	300336	新文化	60,596,085.78	6.93
34	600233	圆通速递	60,470,434.84	6.92
35	300078	思创医惠	60,401,034.42	6.91
36	000928	中钢国际	59,494,523.41	6.81
37	000903	云内动力	59,288,195.81	6.78

38	600458	时代新材	58,583,312.29	6.70
39	300219	鸿利智汇	58,031,387.51	6.64
40	000858	五粮液	57,115,571.32	6.53
41	300033	同花顺	56,817,494.49	6.50
42	300278	华昌达	56,508,537.95	6.47
43	300326	凯利泰	55,567,750.89	6.36
44	002045	国光电器	55,473,646.19	6.35
45	000333	美的集团	55,050,737.57	6.30
46	300476	胜宏科技	54,047,284.77	6.18
47	002137	麦达数字	53,092,054.54	6.07
48	600338	西藏珠峰	52,606,029.64	6.02
49	300461	田中精机	52,576,122.65	6.02
50	600054	黄山旅游	52,446,981.84	6.00
51	603799	华友钴业	50,363,885.50	5.76
52	300083	劲胜精密	49,401,567.81	5.65
53	300233	金城医药	48,324,331.52	5.53
54	601668	中国建筑	48,054,243.52	5.50
55	300280	南通锻压	47,676,658.49	5.45
56	002624	完美世界	47,605,622.86	5.45
57	000703	恒逸石化	47,290,711.88	5.41
58	600782	新钢股份	46,146,699.82	5.28
59	300503	昊志机电	45,435,817.38	5.20
60	601198	东兴证券	45,421,022.58	5.20
61	300291	华录百纳	44,856,383.00	5.13
62	000959	首钢股份	41,595,488.47	4.76
63	002380	科远股份	41,481,251.82	4.75
64	002271	东方雨虹	41,478,197.53	4.75
65	002667	鞍重股份	40,935,728.07	4.68
66	002340	格林美	40,852,441.33	4.67
67	002019	亿帆医药	40,706,475.66	4.66
68	000402	金融街	39,643,913.72	4.54
69	600519	贵州茅台	39,598,776.40	4.53
70	002484	江海股份	39,172,634.52	4.48
71	300384	三联虹普	38,178,902.40	4.37
72	002582	好想你	37,500,763.97	4.29
73	600711	盛屯矿业	37,252,898.93	4.26

74	300473	德尔股份	36,903,074.90	4.22
75	300014	亿纬锂能	36,879,540.18	4.22
76	000036	华联控股	36,272,123.40	4.15
77	000851	高鸿股份	36,134,404.42	4.13
78	601699	潞安环能	35,044,839.14	4.01
79	000802	北京文化	34,558,282.37	3.95
80	002364	中恒电气	34,371,194.92	3.93
81	002427	尤夫股份	34,062,431.69	3.90
82	601788	光大证券	33,898,888.95	3.88
83	000030	富奥股份	33,398,700.14	3.82
84	300071	华谊嘉信	33,258,969.86	3.81
85	600409	三友化工	32,601,592.22	3.73
86	002468	艾迪西	32,071,642.40	3.67
87	601233	桐昆股份	32,054,610.45	3.67
88	300113	顺网科技	31,880,959.11	3.65
89	300408	三环集团	31,726,919.70	3.63
90	603729	龙韵股份	31,049,609.11	3.55
91	300037	新宙邦	30,909,101.80	3.54
92	600418	江淮汽车	30,627,753.63	3.50
93	300440	运达科技	30,232,696.60	3.46
94	600884	杉杉股份	29,307,931.25	3.35
95	300251	光线传媒	28,748,202.77	3.29
96	601199	江南水务	28,440,668.75	3.25
97	002142	宁波银行	27,942,622.52	3.20
98	002674	兴业科技	27,871,247.29	3.19
99	300137	先河环保	27,805,796.70	3.18
100	600449	宁夏建材	27,518,441.58	3.15
101	600521	华海药业	27,267,905.04	3.12
102	002044	美年健康	27,243,848.25	3.12
103	601069	西部黄金	27,192,299.63	3.11
104	002517	恺英网络	26,976,171.25	3.09
105	600570	恒生电子	26,754,750.92	3.06
106	002444	巨星科技	26,703,420.26	3.06
107	002553	南方轴承	26,333,279.23	3.01
108	600240	华业资本	26,273,869.91	3.01
109	000060	中金岭南	25,801,582.76	2.95

110	300011	鼎汉技术	25,726,460.72	2.94
111	000426	兴业矿业	25,085,991.46	2.87
112	000932	华菱钢铁	24,976,390.00	2.86
113	600978	宜华生活	24,787,753.19	2.84
114	002048	宁波华翔	24,754,519.56	2.83
115	600104	上汽集团	24,608,250.42	2.82
116	600386	北巴传媒	24,133,369.24	2.76
117	600988	赤峰黄金	24,080,817.38	2.76
118	300494	盛天网络	24,033,213.31	2.75
119	601225	陕西煤业	23,786,703.56	2.72
120	000983	西山煤电	23,759,752.70	2.72
121	600963	岳阳林纸	23,358,244.96	2.67
122	300426	唐德影视	23,225,891.91	2.66
123	300008	天海防务	22,990,340.08	2.63
124	600376	首开股份	22,739,168.95	2.60
125	300299	富春通信	22,334,493.50	2.56
126	600309	万华化学	22,023,987.46	2.52
127	002234	民和股份	22,022,770.00	2.52
128	002035	华帝股份	21,484,677.11	2.46
129	002108	沧州明珠	21,156,018.50	2.42
130	000488	晨鸣纸业	21,061,591.24	2.41
131	002171	楚江新材	20,812,085.30	2.38
132	002501	利源精制	20,397,513.11	2.33
133	300058	蓝色光标	20,217,294.07	2.31
134	000911	南宁糖业	19,981,144.04	2.29
135	002117	东港股份	19,752,181.83	2.26
136	002353	杰瑞股份	19,560,317.21	2.24
137	600900	长江电力	19,488,546.58	2.23
138	002739	万达院线	19,397,398.30	2.22
139	603686	龙马环卫	19,340,050.70	2.21
140	601688	华泰证券	19,324,352.40	2.21
141	603160	汇顶科技	19,254,571.00	2.20
142	600655	豫园商城	18,966,622.50	2.17
143	300207	欣旺达	18,951,322.70	2.17
144	002094	青岛金王	18,902,116.75	2.16
145	002280	联络互动	18,447,449.88	2.11

146	002766	索菱股份	18,268,619.66	2.09
147	300196	长海股份	17,787,856.80	2.04
148	300068	南都电源	17,678,480.64	2.02
149	000630	铜陵有色	17,532,605.03	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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	600547	山东黄金	130,098,284.07	14.88
2	300031	宝通科技	124,135,230.73	14.20
3	002655	共达电声	108,226,785.48	12.38
4	002712	思美传媒	104,637,670.02	11.97
5	000700	模塑科技	103,186,581.89	11.81
6	600489	中金黄金	101,552,943.53	11.62
7	002502	骅威文化	97,982,020.26	11.21
8	002224	三力士	92,652,474.38	10.60
9	603598	引力传媒	92,289,345.68	10.56
10	600285	羚锐制药	91,251,983.49	10.44
11	002137	麦达数字	89,149,285.76	10.20
12	600114	东睦股份	88,254,598.07	10.10
13	002299	圣农发展	88,213,282.66	10.09
14	300148	天舟文化	85,342,423.80	9.76
15	300133	华策影视	84,858,760.30	9.71
16	002425	凯撒文化	83,891,324.44	9.60
17	002477	雏鹰农牧	83,613,439.57	9.57
18	002174	游族网络	82,189,583.26	9.40
19	300467	迅游科技	81,574,758.54	9.33
20	300059	东方财富	77,781,571.00	8.90
21	002714	牧原股份	77,343,857.22	8.85
22	002458	益生股份	76,283,708.12	8.73
23	600459	贵研铂业	73,689,527.63	8.43
24	600233	圆通速递	72,536,043.89	8.30
25	600389	江山股份	70,887,268.41	8.11
26	002699	美盛文化	66,036,476.66	7.56
27	300364	中文在线	64,873,337.56	7.42
28	002311	海大集团	64,756,376.82	7.41

29	300078	思创医惠	64,627,272.94	7.39
30	300326	凯利泰	64,491,360.86	7.38
31	600458	时代新材	63,504,514.53	7.27
32	300278	华昌达	62,462,272.98	7.15
33	000603	盛达矿业	61,472,632.47	7.03
34	603799	华友钴业	60,995,263.66	6.98
35	002167	东方锆业	59,502,744.44	6.81
36	002155	湖南黄金	58,921,646.41	6.74
37	000802	北京文化	58,727,922.04	6.72
38	300336	新文化	56,935,027.01	6.51
39	300113	顺网科技	56,904,096.56	6.51
40	300033	同花顺	55,855,767.80	6.39
41	000333	美的集团	55,505,776.57	6.35
42	002733	雄韬股份	55,174,584.27	6.31
43	300219	鸿利智汇	54,500,604.83	6.24
44	000903	云内动力	54,376,305.55	6.22
45	300279	和晶科技	52,752,420.01	6.04
46	300503	昊志机电	51,855,205.74	5.93
47	600054	黄山旅游	51,753,819.46	5.92
48	002340	格林美	51,024,127.86	5.84
49	600338	西藏珠峰	50,048,341.12	5.73
50	601668	中国建筑	47,898,806.93	5.48
51	300280	南通锻压	47,520,809.06	5.44
52	002624	完美世界	47,494,645.80	5.43
53	300233	金城医药	47,231,181.73	5.40
54	600782	新钢股份	47,151,612.08	5.39
55	002281	光迅科技	46,672,737.21	5.34
56	000858	五粮液	45,361,530.83	5.19
57	300083	劲胜精密	44,834,726.52	5.13
58	300011	鼎汉技术	43,523,091.35	4.98
59	601198	东兴证券	43,335,353.78	4.96
60	000959	首钢股份	42,337,474.68	4.84
61	300291	华录百纳	42,329,389.98	4.84
62	002271	东方雨虹	42,043,062.79	4.81
63	000703	恒逸石化	41,004,524.65	4.69
64	002019	亿帆医药	40,739,533.48	4.66
65	600519	贵州茅台	40,551,034.64	4.64
66	002582	好想你	39,584,479.85	4.53

67	600449	宁夏建材	38,944,330.17	4.46
68	002484	江海股份	38,943,044.88	4.46
69	002380	科远股份	38,252,014.64	4.38
70	300014	亿纬锂能	38,247,433.62	4.38
71	000402	金融街	37,274,964.08	4.26
72	002667	鞍重股份	37,251,999.49	4.26
73	000851	高鸿股份	36,223,967.33	4.14
74	000928	中钢国际	36,206,541.09	4.14
75	000036	华联控股	36,076,313.57	4.13
76	300071	华谊嘉信	35,957,522.31	4.11
77	600711	盛屯矿业	35,743,933.81	4.09
78	601699	潞安环能	35,708,141.95	4.09
79	600593	大连圣亚	35,530,966.47	4.07
80	002045	国光电器	35,355,794.92	4.04
81	002364	中恒电气	34,607,594.60	3.96
82	002468	艾迪西	34,109,423.98	3.90
83	300384	三联虹普	34,100,087.99	3.90
84	000835	长城动漫	33,537,234.11	3.84
85	000030	富奥股份	33,223,901.02	3.80
86	600083	博信股份	33,037,267.23	3.78
87	002474	榕基软件	32,603,531.93	3.73
88	002120	新海股份	32,350,319.87	3.70
89	002427	尤夫股份	32,180,654.59	3.68
90	603729	龙韵股份	32,133,259.53	3.68
91	601788	光大证券	32,049,213.40	3.67
92	600570	恒生电子	31,624,400.67	3.62
93	300408	三环集团	30,777,534.81	3.52
94	300037	新宙邦	30,645,599.52	3.51
95	600884	杉杉股份	30,139,371.89	3.45
96	002048	宁波华翔	30,087,701.38	3.44
97	300241	瑞丰光电	29,955,389.47	3.43
98	600418	江淮汽车	29,294,407.68	3.35
99	002444	巨星科技	29,065,512.45	3.33
100	002674	兴业科技	29,030,894.82	3.32
101	601233	桐昆股份	29,011,738.43	3.32
102	002553	南方轴承	28,996,671.65	3.32
103	002517	恺英网络	28,841,349.48	3.30
104	300137	先河环保	28,341,736.78	3.24

105	300440	运达科技	28,332,864.95	3.24
106	601199	江南水务	28,263,990.49	3.23
107	600720	祁连山	27,920,720.06	3.19
108	002142	宁波银行	27,867,712.67	3.19
109	601069	西部黄金	27,791,094.52	3.18
110	300251	光线传媒	26,944,213.73	3.08
111	000932	华菱钢铁	26,522,916.22	3.03
112	000695	滨海能源	25,955,295.96	2.97
113	002044	美年健康	25,863,480.29	2.96
114	600240	华业资本	25,737,361.00	2.94
115	300008	天海防务	25,376,973.67	2.90
116	000060	中金岭南	25,123,523.61	2.87
117	601225	陕西煤业	24,569,038.80	2.81
118	600386	北巴传媒	24,513,858.90	2.80
119	600376	首开股份	24,485,600.65	2.80
120	600978	宜华生活	24,018,129.26	2.75
121	000426	兴业矿业	23,460,558.35	2.68
122	600963	岳阳林纸	23,336,921.85	2.67
123	000983	西山煤电	23,322,282.21	2.67
124	002035	华帝股份	23,313,624.72	2.67
125	600988	赤峰黄金	23,074,137.40	2.64
126	300494	盛天网络	23,052,045.48	2.64
127	002171	楚江新材	22,307,415.49	2.55
128	002108	沧州明珠	21,380,658.01	2.45
129	002234	民和股份	21,311,335.59	2.44
130	000911	南宁糖业	20,903,862.13	2.39
131	002501	利源精制	20,489,072.23	2.34
132	002739	万达院线	20,240,422.59	2.32
133	002308	威创股份	20,159,155.65	2.31
134	002280	联络互动	19,581,569.00	2.24
135	300426	唐德影视	19,359,761.00	2.21
136	002117	东港股份	19,355,679.46	2.21
137	002353	杰瑞股份	19,241,485.05	2.20
138	300058	蓝色光标	19,052,108.54	2.18
139	300299	富春通信	18,833,211.91	2.15
140	000488	晨鸣纸业	18,668,924.13	2.14
141	300207	欣旺达	18,596,664.90	2.13
142	601688	华泰证券	18,587,464.00	2.13

143	600900	长江电力	18,547,193.99	2.12
144	002707	众信旅游	18,544,211.44	2.12
145	002766	索菱股份	18,477,310.91	2.11
146	600655	豫园商城	18,308,083.00	2.09
147	600518	康美药业	18,188,307.54	2.08
148	300068	南都电源	18,183,357.35	2.08

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	8,345,324,407.67
卖出股票收入（成交）总额	8,437,349,796.34

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

2016 年 4 月 14 日, 唐山三友化工股份有限公司(以下简称“三友化工”)收到上海证券交易所口头警示通报。警示事项为: 三友化工的股东大会决议中与非公开发行有关的 12 项议案前后信息披露不一致, 对相关规则理解不准确, 信息披露操作不审慎, 经部门纪律处分小组讨论决定, 对三友化工及董事会秘书刘印江予以口头警告。三友化工目前已整改完毕。

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	789,017.72
2	应收证券清算款	4,570,982.56
3	应收股利	-
4	应收利息	18,450.06
5	应收申购款	91,813.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,470,264.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300473	德尔股份	38,268,381.30	6.51	公告重大事项

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
19,616	30,611.56	197,634.46	0.03%	600,278,684.25	99.97%

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	49,814.23	0.0083%

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 (2015 年 4 月 10 日) 基金份额总额	5,628,144,009.75
------------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	673,242,333.49
本报告期基金总申购份额	234,658,175.91
减:本报告期基金总赎回份额	307,424,190.69
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	600,476,318.71

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8万元,该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受稽查或处罚情况。本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
申万宏源		22,813,037,405.21	16.76%	2,619,782.16	16.76%	-
长江证券		22,294,273,939.18	13.67%	2,136,662.28	13.67%	-
国泰君安		22,067,717,083.67	12.32%	1,925,673.63	12.32%	-
安信证券		21,912,421,483.89	11.40%	1,781,040.22	11.40%	-
东方证券		21,791,924,186.46	10.68%	1,668,821.84	10.68%	-
华泰证券		21,785,914,605.73	10.64%	1,663,216.81	10.64%	-
中信证券		21,396,170,925.03	8.32%	1,300,256.61	8.32%	-
兴业证券		21,096,466,392.09	6.53%	1,021,142.53	6.53%	-
银河证券		21,007,568,507.17	6.00%	938,342.65	6.00%	-
东北证券	2	362,708,403.29	2.16%	337,793.94	2.16%	-
西南证券	2	254,138,315.14	1.51%	236,683.48	1.51%	-

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。

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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	74,300,000.00	23.38%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	649,137.00	100.00%	63,200,000.00	19.89%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	180,300,000.00	56.73%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于指数熔断机制实施期间旗下部分基金调整开放时间的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	农银汇理基金管理有限公司关于参与深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
5	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
6	农银汇理基金管理有限公司关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 12 日
7	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 29 日
8	关于工商银行开展个人电子银行	上海证券报、中国证	2016 年 3 月 31 日

	基金申购费率优惠活动的公告	券报、证券时报、基金管理人网站	
9	农银汇理基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
10	农银汇理基金管理有限公司关于参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
11	农银汇理基金管理有限公司关于参加陆金所认（申）购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 16 日
12	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 20 日
13	农银汇理基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于继续参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
15	农银主题轮动混合基金-招募说明书更新-2016 年第 1 次	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 21 日
16	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
17	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基	2016 年 6 月 29 日

	购手续费费率优惠活动的公告	金管理人网站	
18	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
19	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2016 年半年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
20	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 7 月 20 日
21	农银汇理基金管理有限公司关于股东变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 6 日
22	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 15 日
23	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 22 日
24	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 8 月 26 日
25	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
26	关于交通银行开展手机银行渠道	上海证券报、中国证	2016 年 9 月 20 日

	基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	券报、证券时报、基金管理人网站	
27	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 10 月 25 日
28	农银主题轮动混合基金-招募说明书更新-2016 年第 2 号	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 11 月 23 日
29	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 11 月 29 日
30	关于交通银行开展网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 13 日
31	农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 12 月 22 日
32	关于农业银行开展 2017 年基金交易费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 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	上海证券报、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、《农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件;
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

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