

农银汇理平衡双利混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	50

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金
基金简称	农银平衡双利混合
基金主代码	660003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 8 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	238,875,472.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在红利股票和高息债券等不同类型资产中的平衡配置，追求基金资产在风险可控前提下的持续增值，充分享受股票分红和债券利息的双重收益。
投资策略	本基金将在对宏观经济走势和证券市场科学预期的基础上，采取灵活的资产配置策略，构建具有弹性的股票债券平衡组合，寻求经风险调整后的收益水平最大化。在股票投资中以分红类型的股票为投资重点，以获取上市公司分红和股票增值的收益；在债券投资中重点关注高票息券种，通过多样化的投资手段达到提高债券组合收益水平并规避市场风险的目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中证全债指数×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	陆志俊
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559

传真	021-61095556	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	于进	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	12,589,002.77
本期利润	40,729,772.34
加权平均基金份额本期利润	0.1677
本期加权平均净值利润率	12.18%
本期基金份额净值增长率	12.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	115,534,217.70
期末可供分配基金份额利润	0.4837
期末基金资产净值	354,409,690.08
期末基金份额净值	1.4837
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	117.28%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.30%	0.80%	3.28%	0.37%	4.02%	0.43%
过去三个月	7.76%	0.77%	3.40%	0.35%	4.36%	0.42%
过去六个月	12.82%	0.67%	5.74%	0.32%	7.08%	0.35%
过去一年	12.09%	0.69%	8.86%	0.38%	3.23%	0.31%
过去三年	65.94%	1.70%	45.85%	0.97%	20.09%	0.73%

自基金合同生效起至今	117.28%	1.40%	46.96%	0.87%	70.32%	0.53%
------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

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 30%-80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%（其中，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（2009 年 4 月 8 日）起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 39 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、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2014年4月15日	-	9	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。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来，市场分化剧烈，不同风格、板块、个股走势偏差严重。本基金在年初意识到持续大批量新股发行对中小创已有估值体系的冲击，及时进行了风格的调整，一定程度上规避了风格偏差带来的损失。在行业方面，本基金基于经济重开商业周期的市场观点将在三四月份证伪的判断，采用低仓位、重配消费品轻仓参与周期的策略，虽然在春节前的中游板块上涨中表现一般，但在春节后的消费品行情中获得相对较好的收益。二季度的市场的表现先抑后扬，MSCI 主题表现强劲。本基金在二季度主要配置白酒板块、电子板块，并在期间陆续加配了一些行业龙头，在大盘下跌的 4、5 月份表现较佳。而在迈入 6 月份之后，基于蓝筹的大幅上涨以及市场对白马预期的提升，增加了成长类的配置，对组合进行了一定的均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4837 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.82%，业绩比较基准收益率为 5.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，流动性层面以及经济层面保持平稳的可能性很大。全国金融工作会议定调金融回归本源，意味过去放松监管带来的流动性宽松的局面在未来将会逐渐转变。但是考虑到换届之年防风险的重要性，在十九大之前保持稳定的利率和宽裕的流动性将是更为稳妥的政策选择。另一方面，较多行业的库存水平仍处于一个相对合理的位置，在利率水平保持平稳的情况下，经济趋势在短期内延续的可能性比较大。资本市场政策方面，由于金融支持实体的需要，IPO 的速度会继续保持，意味股票供给的冲击将持续，而结合之前的减持、并购新规，大部分中小市值股票的压力仍然较大。因此，展望下半年，风格上蓝筹占优，基本上周期占优。落实到投资上，相对看好消费类蓝筹、钢铁等高景气周期品以及部分高景气的细分成长行业，如全面屏及光模块等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《关于证券投资基金

执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字[2007]21号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件,本公司制订了证券投资基金估值政策和程序,并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责:公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释,并定期对估值政策和程序进行评价,在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时,估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性,必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化,书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部,运营部参考测算结果对估值调整进行试算,并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督,根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员,均具有基金从业资格,具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求,但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度,如估值委员会表决时,其仅有一票表决权,遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内已实施过一次利润分配,每 10 份基金份额派发红利 0.80 元,权益登记日为 2017 年 1 月 17 日,总计分配利润 18,510,500.77 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理平衡双利混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 18,510,500.77 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年上半年度，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	96,283.35	20,637,417.30
结算备付金		37,412,246.63	24,898,943.18
存出保证金		108,065.74	143,470.03
交易性金融资产	6.4.7.2	280,597,306.68	272,465,848.86
其中：股票投资		262,071,234.28	233,029,982.46
基金投资		-	-
债券投资		18,526,072.40	39,435,866.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	34,900,000.00	-
应收证券清算款		7,302,304.19	2,693,719.57
应收利息	6.4.7.5	298,387.26	1,805,143.46
应收股利		-	-
应收申购款		624,852.63	135,115.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		361,339,446.48	322,779,657.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,012,524.54	2,552,784.28
应付赎回款		952,244.36	186,420.70
应付管理人报酬		429,522.14	408,262.43
应付托管费		71,586.99	68,043.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	326,367.42	458,677.94

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	137,510.95	60,457.41
负债合计		6,929,756.40	3,734,646.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	238,875,472.38	228,330,863.70
未分配利润	6.4.7.10	115,534,217.70	90,714,147.44
所有者权益合计		354,409,690.08	319,045,011.14
负债和所有者权益总计		361,339,446.48	322,779,657.64

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4837 元，基金份额总额 238,875,472.38 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		45,076,279.25	-37,559,671.45
1.利息收入		1,989,915.20	2,094,015.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	360,818.22	419,342.15
债券利息收入		1,264,559.02	1,674,673.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		364,537.96	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,847,830.32	-16,868,176.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,669,830.95	-17,550,501.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-745,814.40	-25,137.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,923,813.77	707,462.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,140,769.57	-22,815,759.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	97,764.16	30,249.23
减：二、费用		4,346,506.91	4,649,048.51

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,481,596.48	2,257,612.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	413,599.39	376,268.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,357,952.28	1,917,295.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	93,358.76	97,871.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,729,772.34	-42,208,719.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,729,772.34	-42,208,719.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理平衡双利混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	228,330,863.70	90,714,147.44	319,045,011.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,729,772.34	40,729,772.34
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）	10,544,608.68	2,600,798.69	13,145,407.37
其中：1.基金申购款	77,528,762.70	28,404,699.17	105,933,461.87
2.基金赎回款	-66,984,154.02	-25,803,900.48	-92,788,054.50
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）	-	-18,510,500.77	-18,510,500.77
五、期末所有者权益（基金净值）	238,875,472.38	115,534,217.70	354,409,690.08

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	216,675,652.17	167,505,845.55	384,181,497.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,208,719.96	-42,208,719.96
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)	14,995,582.83	3,599,048.37	18,594,631.20
其中：1.基金申购款	39,463,105.79	11,847,296.87	51,310,402.66
2.基金赎回款	-24,467,522.96	-8,248,248.50	-32,715,771.46
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)	-	-34,738,185.44	-34,738,185.44
五、期末所有者权益(基金净值)	231,671,235.00	94,157,988.52	325,829,223.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理平衡双利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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[2009]74号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为6,465,518,027.79份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(09)第0008号验资报告。《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合

同》(以下简称“基金合同”)于 2009 年 4 月 8 日正式生效。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及最新适用的《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金招募说明书》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。基金的投资组合为:股票投资比例范围为基金资产的 30%-80%,其中投资于红利股的比例不少于股票资产的 80%;权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%;债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的 20%-70%(其中,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%)。本基金业绩比较基准为“55%×沪深 300 指数+45%×中证全债指数”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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]140 号《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[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。
- 3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- 5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方

不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	96,283.35
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	96,283.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	229,513,243.91	262,071,234.28	32,557,990.37
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	18,642,732.56	18,526,072.40
	银行间市场	-	-
	合计	18,642,732.56	18,526,072.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	248,155,976.47	280,597,306.68	32,441,330.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	34,900,000.00	-
合计	34,900,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	26.44
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	18,025.64
应收债券利息	294,116.08
应收买入返售证券利息	-13,824.66
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	43.74
合计	298,387.26

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	326,367.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	326,367.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,127.19
预提费用	134,383.76
合计	137,510.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	228,330,863.70	228,330,863.70
本期申购	77,528,762.70	77,528,762.70
本期赎回(以“-”号填列)	-66,984,154.02	-66,984,154.02
- 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	238,875,472.38	238,875,472.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	194,037,278.97	-103,323,131.53	90,714,147.44
本期利润	12,589,002.77	28,140,769.57	40,729,772.34
本期基金份额交易产生的变动数	8,197,136.62	-5,596,337.93	2,600,798.69
其中：基金申购款	61,728,047.76	-33,323,348.59	28,404,699.17
基金赎回款	-53,530,911.14	27,727,010.66	-25,803,900.48
本期已分配利润	-18,510,500.77	-	-18,510,500.77
本期末	196,312,917.59	-80,778,699.89	115,534,217.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	32,925.99
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	326,935.86
其他	956.37
合计	360,818.22

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	452,132,081.36
减：卖出股票成本总额	438,462,250.41
买卖股票差价收入	13,669,830.95

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-745,814.40
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	-745,814.40

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,192,488.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,349,814.40
减：应收利息总额	1,588,488.00

买卖债券差价收入	-745,814.40
----------	-------------

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,923,813.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,923,813.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28,140,769.57
——股票投资	27,700,749.17
——债券投资	440,020.40
——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	28,140,769.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	96,819.17
转换费	944.99
合计	97,764.16

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,357,952.28

银行间市场交易费用	-
合计	1,357,952.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,588.57
账户服务费	9,000.00
清算所账户服务费	9,200.00
银行汇划费	775.00
合计	93,358.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司	本基金的管理人
交通银行股份有限公司	本基金的托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,481,596.48	2,257,612.91
其中：支付销售机构的客户维护费	418,887.30	379,577.31

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 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	413,599.39	376,268.80

注：支付基金托管人交通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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期间无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	96,283.35	32,925.99	11,105,806.80	43,677.97

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					

1	2017 年 1 月 17 日	-	2017 年 1 月 17 日	0.8000	14,631,712.92	3,878,787.85	18,510,500.77	
合计	-	-		0.8000	14,631,712.92	3,878,787.85	18,510,500.77	

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600643	爱建集团	2017年4月17日	公告重大事件	14.98	2017年8月2日	16.48	223,200	2,999,622.20	3,343,536.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险，并通过设定相应的风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统，有效的控制和跟踪上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	18,526,072.40	39,435,866.40
未评级	0.00	0.00
合计	18,526,072.40	39,435,866.40

未评级的债券投资包括国债、央行票据和政策性银行金融债

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	96,283.35	-	-	-	96,283.35
结算备付金	37,412,246.63	-	-	-	37,412,246.63
存出保证金	108,065.74	-	-	-	108,065.74
交易性金融资产	1,376,524.80	17,149,547.60	-	-262,071,234.28	280,597,306.68
买入返售金融资产	34,900,000.00	-	-	-	34,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	7,302,304.19	7,302,304.19
应收利息	-	-	-	298,387.26	298,387.26
应收申购款	-	-	-	624,852.63	624,852.63
资产总计	73,893,120.52	17,149,547.60	-	-270,296,778.36	361,339,446.48
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,012,524.54	5,012,524.54
应付赎回款	-	-	-	952,244.36	952,244.36
应付管理人报酬	-	-	-	429,522.14	429,522.14
应付托管费	-	-	-	71,586.99	71,586.99
应付交易费用	-	-	-	326,367.42	326,367.42
其他负债	-	-	-	137,510.95	137,510.95
负债总计	-	-	-	6,929,756.40	6,929,756.40
利率敏感度缺口	73,893,120.52	17,149,547.60	-	-263,367,021.96	354,409,690.08
上年度末 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	20,637,417.30	-	-	-	20,637,417.30
结算备付金	24,898,943.18	-	-	-	24,898,943.18

存出保证金	143,470.03	-	-	-	143,470.03
交易性金融资产	28,969,866.40	10,466,000.00	-	-233,029,982.46	272,465,848.86
应收证券清算款	-	-	-	2,693,719.57	2,693,719.57
应收利息	-	-	-	1,805,143.46	1,805,143.46
应收申购款	-	-	-	135,115.24	135,115.24
资产总计	74,649,696.91	10,466,000.00	-	-237,663,960.73	322,779,657.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,552,784.28	2,552,784.28
应付赎回款	-	-	-	186,420.70	186,420.70
应付管理人报酬	-	-	-	408,262.43	408,262.43
应付托管费	-	-	-	68,043.74	68,043.74
应付交易费用	-	-	-	458,677.94	458,677.94
其他负债	-	-	-	60,457.41	60,457.41
负债总计	-	-	-	3,734,646.50	3,734,646.50
利率敏感度缺口	74,649,696.91	10,466,000.00	-	-233,929,314.23	319,045,011.14

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	上升25个基点	-93,154.28	-128,950.84
	下降25个基点	93,154.28	128,950.84

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本基金股票投资比例范围为基金资产的30% - 80%，其中投资于红利股的比例不少于股票资产的80%；权证投资比例范围为基金资产净值的0% - 3%；债券等其他资产的投资比例范围为基金资产的20% - 70%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%）。本基金的基金管理人每日对本基金所持

有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	262,071,234.28	73.95	233,029,982.46	73.04
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	262,071,234.28	73.95	233,029,982.46	73.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其它变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5 %	23,099,714.92	26,290,793.11
业绩比较基准下降 5 %	-23,099,714.92	-26,290,793.11	

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	262,071,234.28	72.53
	其中：股票	262,071,234.28	72.53
2	固定收益投资	18,526,072.40	5.13
	其中：债券	18,526,072.40	5.13
	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	34,900,000.00	9.66
	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	37,508,529.98	10.38
7	其他各项资产	8,333,609.82	2.31
8	合计	361,339,446.48	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,765,016.00	0.78
B	采矿业	-	-
C	制造业	195,271,738.49	55.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,183,990.20	4.57
F	批发和零售业	4,636,951.41	1.31
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	15,535,793.89	4.38
J	金融业	10,484,856.29	2.96
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	7,890,652.00	2.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,674,428.00	2.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,627,808.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	262,071,234.28	73.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	384,560	21,404,609.60	6.04
2	600519	贵州茅台	28,002	13,212,743.70	3.73
3	000568	泸州老窖	241,248	12,202,323.84	3.44
4	603589	口子窖	272,200	10,558,638.00	2.98
5	002833	弘亚数控	173,500	10,149,750.00	2.86
6	000063	中兴通讯	419,700	9,963,678.00	2.81
7	000651	格力电器	229,979	9,468,235.43	2.67
8	603179	新泉股份	207,495	9,111,105.45	2.57
9	002456	欧菲光	448,857	8,155,731.69	2.30
10	601888	中国国旅	261,800	7,890,652.00	2.23
11	002635	安洁科技	216,300	7,834,386.00	2.21
12	600779	水井坊	293,131	7,205,159.98	2.03
13	603808	歌力思	230,450	6,802,884.00	1.92
14	002262	恩华药业	434,128	6,568,356.64	1.85
15	601668	中国建筑	645,774	6,251,092.32	1.76
16	002555	三七互娱	243,551	6,227,599.07	1.76
17	000826	启迪桑德	175,400	6,160,048.00	1.74
18	300308	中际装备	141,352	5,813,807.76	1.64
19	300197	铁汉生态	383,481	5,092,627.68	1.44

20	002624	完美世界	146,600	5,028,380.00	1.42
21	600068	葛洲坝	427,179	4,801,491.96	1.35
22	600056	中国医药	184,300	4,782,585.00	1.35
23	600297	广汇汽车	615,797	4,636,951.41	1.31
24	300310	宜通世纪	323,160	4,272,175.20	1.21
25	002475	立讯精密	144,300	4,219,332.00	1.19
26	600612	老凤祥	84,466	4,136,300.02	1.17
27	600771	广誉远	102,171	4,081,731.45	1.15
28	000423	东阿阿胶	52,500	3,774,225.00	1.06
29	601939	建设银行	582,700	3,583,605.00	1.01
30	000625	长安汽车	244,200	3,521,364.00	0.99
31	300373	扬杰科技	168,370	3,392,655.50	0.96
32	002466	天齐锂业	61,900	3,364,265.00	0.95
33	600643	爱建集团	223,200	3,343,536.00	0.94
34	000596	古井贡酒	63,945	3,257,997.75	0.92
35	300424	航新科技	67,700	3,193,409.00	0.90
36	603040	新坐标	47,500	3,055,200.00	0.86
37	002008	大族激光	83,000	2,875,120.00	0.81
38	600521	华海药业	133,400	2,806,736.00	0.79
39	000711	京蓝科技	183,600	2,765,016.00	0.78
40	600741	华域汽车	113,757	2,757,469.68	0.78
41	002434	万里扬	123,400	1,964,528.00	0.55
42	600563	法拉电子	39,629	1,958,068.89	0.55
43	601377	兴业证券	243,832	1,811,671.76	0.51
44	600031	三一重工	218,600	1,777,218.00	0.50
45	300426	唐德影视	68,800	1,627,808.00	0.46
46	601166	兴业银行	92,414	1,558,100.04	0.44
47	603788	宁波高发	35,400	1,522,908.00	0.43
48	300070	碧水源	81,200	1,514,380.00	0.43
49	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.05
50	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
51	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
52	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
53	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
54	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
55	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
56	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
57	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
58	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01

59	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
60	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
61	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
62	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
63	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
64	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
65	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
66	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
67	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	20,126,143.34	6.31
2	000568	泸州老窖	12,949,257.54	4.06
3	000651	格力电器	11,299,821.86	3.54
4	603589	口子窖	9,255,670.36	2.90
5	600779	水井坊	9,173,168.07	2.88
6	002833	弘亚数控	9,042,848.00	2.83
7	603179	新泉股份	8,777,398.95	2.75
8	000711	京蓝科技	7,944,664.42	2.49
9	600702	沱牌舍得	7,874,094.97	2.47
10	300373	扬杰科技	7,779,169.99	2.44
11	600563	法拉电子	7,656,425.90	2.40
12	002281	光迅科技	7,522,040.67	2.36
13	002019	亿帆医药	7,311,558.77	2.29
14	002456	欧菲光	7,020,917.94	2.20
15	300197	铁汉生态	7,016,293.98	2.20
16	601166	兴业银行	6,943,832.74	2.18
17	000063	中兴通讯	6,886,874.00	2.16
18	601888	中国国旅	6,834,047.57	2.14

19	000625	长安汽车	6,670,272.57	2.09
20	002635	安洁科技	6,644,912.41	2.08
21	300308	中际装备	6,644,723.66	2.08
22	601668	中国建筑	6,621,712.00	2.08
23	300101	振芯科技	6,463,567.72	2.03
24	603369	今世缘	6,443,674.67	2.02
25	600612	老凤祥	6,402,125.05	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000930	中粮生化	15,546,720.07	4.87
2	300197	铁汉生态	14,743,403.44	4.62
3	000711	京蓝科技	11,217,617.57	3.52
4	002120	韵达股份	9,867,127.89	3.09
5	000858	五粮液	9,515,138.21	2.98
6	300115	长盈精密	9,252,372.70	2.90
7	600879	航天电子	9,150,718.84	2.87
8	002374	丽鹏股份	8,359,160.16	2.62
9	002281	光迅科技	7,904,532.71	2.48
10	300183	东软载波	7,854,884.69	2.46
11	600104	上汽集团	7,664,204.87	2.40
12	000513	丽珠集团	7,624,720.65	2.39
13	600702	沱牌舍得	7,456,179.28	2.34
14	600593	大连圣亚	7,446,614.51	2.33
15	002019	亿帆医药	7,358,286.28	2.31
16	002310	东方园林	7,354,388.35	2.31
17	600563	法拉电子	6,846,128.22	2.15
18	600976	健民集团	6,338,877.44	1.99
19	601117	中国化学	6,290,155.77	1.97
20	603369	今世缘	6,043,501.29	1.89

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	439,802,753.06
卖出股票收入（成交）总额	452,132,081.36

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,526,072.40	5.23
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	18,526,072.40	5.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112025	11 珠海债	100,000	10,278,000.00	2.90
2	122143	12 亿利 01	67,640	6,871,547.60	1.94
3	112142	12 格林债	13,440	1,376,524.80	0.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	108,065.74
2	应收证券清算款	7,302,304.19
3	应收股利	-
4	应收利息	298,387.26
5	应收申购款	624,852.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,333,609.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
51,979	4,595.62	5,611,540.62	2.35%	233,263,931.76	97.65%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年4月8日）基金份额总额	6,465,518,027.79
本报告期期初基金份额总额	228,330,863.70
本报告期基金总申购份额	77,528,762.70
减：本报告期基金总赎回份额	66,984,154.02
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	238,875,472.38

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
海通证券	2	699,155,416.20	78.73%	651,121.20	78.73%	-
中金公司	2	141,805,129.72	15.97%	132,064.02	15.97%	-
中信建投	1	31,852,089.86	3.59%	29,662.82	3.59%	-
长江证券	2	9,653,948.12	1.09%	8,986.96	1.09%	-
中信证券	2	5,577,412.00	0.63%	5,193.80	0.63%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：

- (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交易单元, 剔除财富证券深圳交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	1,330,400,000.00	59.05%	-	-
中金公司	-	-	576,300,000.00	25.58%	-	-
中信建投	-	-	312,200,000.00	13.86%	-	-
长江证券	-	-	34,000,000.00	1.51%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2016 年年度资产净值公告	上海证券报	2017 年 1 月 3 日
2	农银汇理平衡双利混合型证券投资基金分红公告	上海证券报	2017 年 1 月 13 日
3	农银汇理基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低保留份额的公告	上海证券报	2017 年 1 月 17 日
4	农银汇理基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低保留份额的公告	上海证券报	2017 年 1 月 17 日
5	农银汇理平衡双利混合基金 2016 年四季度报告	上海证券报	2017 年 1 月 19 日
6	农银汇理基金管理有限公司关于开通在中信证券股份有限公司等定投、转换业务的公告	上海证券报	2017 年 1 月 24 日
7	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	2017 年 2 月 23 日
8	农银汇理平衡双利混合基金 2016 年年度报告	上海证券报	2017 年 3 月 30 日
9	关于中国工商银行继续开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报	2017 年 3 月 31 日
10	关于广发证券开展网上、手机委托系统基金申购手续费费率优惠活动的公告	上海证券报	2017 年 4 月 7 日
11	关于交通银行开展手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	上海证券报	2017 年 4 月 22 日

12	农银汇理平衡双利混合基金 2017 年一季报	上海证券报	2017 年 4 月 24 日
13	农银平衡双利混合—招募说明书更新—2017 年第 1 号	上海证券报	2017 年 5 月 20 日
14	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加两家代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报	2017 年 6 月 12 日
15	农银汇理基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报	2017 年 6 月 16 日
16	关于农银汇理电话服务系统暂停基金转换业务的公告	上海证券报	2017 年 6 月 28 日
17	农银汇理基金管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	上海证券报	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）公司住所已于 2017 年 6 月 13 日变更为：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层；上述变更已完成工商变更登记。

本公司已于 2017 年 6 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述公司住所变更的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理平衡双利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理平衡双利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。

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

12.3 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 8 月 28 日