农银汇理行业领先股票型证券投资基金

2014年度报告摘要

2014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：交通银行股份有限公司
送出日期：2015年3月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2015年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理行业领先股票型证券投资基金
基金简称	农银行业领先股票
基金主代码	000127
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月25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	448,758,519.63份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过寻找受益于中国经济发展且在所属行业中处于领先地位的上市公司，进一步优化投资组合，在严格控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金认为行业领先企业具备较强的竞争优势，不仅能够获取超过行业平均水平以上的回报，而且在经济发生波动时抵抗风险能力也更强。
业绩比较基准	75%×沪深300指数＋25%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的基金产品。

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	信息披露负责人
	联系电话	021-61095588	95559
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		021-61095599	95559
传真		021-61095556	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200122	200120
法定代表人		刁钦义	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	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	上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7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	2014年	2013年6月25日(基金合同生效日)-2013年12月31日	2012年
本期已实现收益	123,468,265.12	-39,901,210.17	-
本期利润	147,247,607.44	-40,815,488.91	-
加权平均基金份额本期利润	0.3935	-0.0549	-
本期加权平均净值利润率	37.97%	-5.56%	-
本期基金份额净值增长率	43.53%	-7.26%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	141,496,129.81	-41,371,255.42	-
期末可供分配基金份额利润	0.3153	-0.0726	-
期末基金资产净值	597,358,866.01	528,610,358.49	-
期末基金份额净值	1.3311	0.9274	-
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	33.11%	-7.26%	-

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。

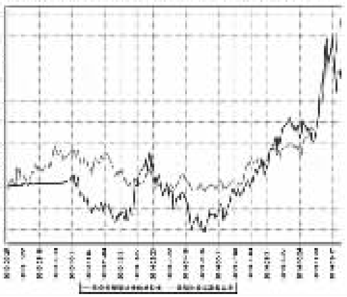
4、本基金合同生效日为2013年6月25日，上年度实际报告期为2013年6月25日至2013年12月31日。

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

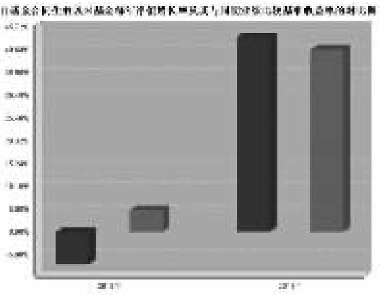
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.44%	1.75%	32.85%	1.24%	-19.41%	0.51%
过去六个月	38.90%	1.41%	46.44%	0.99%	-7.54%	0.42%
过去一年	43.53%	1.41%	40.69%	0.91%	2.84%	0.50%
自基金合同生效起至今	33.11%	1.20%	47.61%	0.93%	-14.50%	0.27%

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



本基金股票投资比例不低于基金资产的60%，其中投资于行业领先类股票的比例不低于非现金基金资产投资的80%；除股票以外的其它资产投资比例范围为基金资产的5%－40%。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（2013年6月25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



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%，中国铝业股份有限公司出资比例为15%。公司办公地址为上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。公司法定代表人为董事长刁钦义先生。

截止2014年12月31日，公司共管理22只开放式基金，分别为农银汇理行业成长股票型证券投资基金、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、农银汇理策略价值股票型证券投资基金、农银汇理中小盘股票型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金、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、农银汇理策略精选股票型证券投资基金、农银汇理中证500指数证券投资基金、农银汇理消费主题股票型证券投资基金、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、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、农银汇理行业领先股票型证券投资基金、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和农银汇理红利日结货币市场基金。

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		
徐莉	本基金基金经理	2013年6月25日	-	6	北京大学中国经济研究中心经济学硕士，具有基金从业资格。曾任野村证券公司研究部研究员、农银汇理基金公司研究部研究员，现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

2014年国内宏观经济乏善可陈，经济增长低迷，商品价格出现此起彼伏的暴跌。在此背景之下货币政策和财政政策均呈现明显的松动，流动性整体呈现宽松格局，不同期限的国债收益率较年初均有明显下行。从股票市场表现来，一季度小股票表现较好，后三个季度尤其是四季度大盘蓝筹股表现优异。贯穿全年的机会主要集中在计算机、军工等板块。全年来看非银金融是全市场表现最好的行业。本基金在2014年遵循了低估值、高增长以及行业大空间等选股思路，对计算机行业进行了超配，以及至下而上配置了成长性较好具备核心竞争力的公司。下半年配置则相对均衡，提高了金融地产等蓝筹股的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为43.53%，业绩比较基准收益率为40.69%。

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2015年，经济增长回升的预期不明确，在全球央行竞相降息以及美国加息预期的背景下，流动性环境的持续改善、社会融资成本的持续降低将一波三折。尤其是整体市场经历了2014年的大幅上扬后，整体市场的选股难度将加大。本基金依旧会关注TMT行业和医药等行业的投资机会，尤其关注新的商业模式、传统行业的变革带来的投资机遇。同时积极关注化工、农业等行业的阶段性投资机会。

4.6 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。”即本基金报告期无应分配利润金额。

2.本基金报告期内没有实施利润分配。

3.本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

4.7 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

2014年度，基金托管人在农银汇理行业领先股票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

2014年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理行业领先股票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。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2014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行业领先股票型证券投资基金的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 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(2015)第20338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	农银汇理行业领先股票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行业领先股票型证券投资基金(以下简称“农银汇理行业领先股票型基金”)的财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表、2014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行业领先股票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”)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，上述农银汇理行业领先股票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行业领先股票型基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汪棣	张勇
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	2015年3月24日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：农银汇理行业领先股票型证券投资基金
报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	87,829,264.79	97,388,630.48
结算备付金	3,490,611.19	11,814,113.48
存出保证金	510,151.75	493,693.80
交易性金融资产	506,746,198.16	368,942,176.05
其中：股票投资	506,746,198.16	368,942,176.05
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	52,000,000.00
应收证券清算款	9,671,607.24	632,762.43
应收利息	28,614.18	113,046.54
应收股利	-	-
应收申购款	4,012,961.93	709,754.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	612,289,409.24	532,094,177.64
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,546,358.81	162,822.94
应付赎回款	8,099,086.15	781,633.47
应付管理人报酬	626,068.90	688,715.28
应付托管费	104,344.81	114,785.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,265,968.49	1,592,915.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	288,716.07	142,945.78
负债合计	14,930,543.23	3,483,819.15
所有者权益：		
实收基金	448,758,519.63	569,981,613.91
未分配利润	148,600,346.38	-41,371,255.42
所有者权益合计	597,358,866.01	528,610,358.49
负债和所有者权益总计	612,289,409.24	532,094,177.64

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.3311元，基金份额总额448,758,519.63份。

7.2 利润表

会计主体：农银汇理行业领先股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	165,602,657.09	-30,192,253.23
1.利息收入	997,518.34	15,088,614.39
其中：存款利息收入	926,707.83	12,458,782.26
债券利息收入	-	2,270.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	70,810.51	2,627,561.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	139,678,732.66	-44,816,899.92
其中：股票投资收益	137,863,813.57	-43,615,126.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-1,259,571.35
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,814,919.09	57,797.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	23,779,342.32	-914,278.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,147,063.77	450,311.04
减：二、费用	18,355,049.65	10,623,235.68
1. 管理人报酬	5,839,065.69	5,697,571.06
2. 托管费	973,177.64	949,595.18
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,163,676.32	3,712,057.44
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	379,130.00	264,012.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	147,247,607.44	-40,815,488.91
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	147,247,607.44	-40,815,488.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理行业领先股票型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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）	569,981,613.91	-41,371,255.42	528,610,358.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	147,247,607.44	147,247,607.44
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）	-121,223,094.28	42,723,994.36	-78,499,099.92
其中：1.基金申购款	787,428,604.56	161,140,674.97	948,569,279.53
2.基金赎回款	-908,651,698.84	-118,416,680.61	-1,027,068,379.45
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）	448,758,519.63	148,600,346.38	597,358,866.01
项目	上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)至2013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）	863,696,776.13	-	863,696,776.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-40,815,488.91	-40,815,488.91
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）	-293,715,162.22	-555,766.51	-294,270,928.73
其中：1.基金申购款	66,306,079.04	-339,315.29	65,966,763.75
2.基金赎回款	-360,021,241.26	-216,451.22	-360,237,692.48
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）	569,981,613.91	-41,371,255.42	528,610,358.49

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：

______施卫______　　______杜明华______　　____于意____
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

农银汇理行业领先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?2013]第292号《关于核准农银汇理行业领先股票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《农银汇理行业领先股票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863,512,471.08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(2013)第385号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》于2013年6月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为863,696,776.13份基金份额，其中认购资金利息折合184,305.05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》和《农银汇理行业领先股票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。其中：股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，其中投资于行业领先类股票的比例不低于非现金基金资产投资的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%。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：75% X 沪深300指数＋25%X中证全债指数。

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日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理行业领先股票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2013年6月25日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2013年6月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》，同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.4.3 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。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

7.4.6 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
交通银行股份有限公司	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
中国铝业股份有限公司	本基金管理人的股东

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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。

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。

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。

7.4.7.1.2 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。

7.4.7.1.3 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,839,065.69	5,697,571.06
其中：支付销售机构的客户维护费	2,246,003.00	2,222,463.49

注：支付基金管理人农银汇理基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	973,177.64	949,595.18

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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年6月25日(基金合同生效日)至2013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
交通银行	87,829,264.79	795,186.61	97,388,630.48	582,208.34

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。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8 期末（ 2014年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.8.2 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
300168	万达信息	2014年12月31日	公告重大事项	46.20	2015年1月8日	44.50	310,238	13,108,919.64	14,332,995.60	-
300252	金信诺	2014年11月11日	公告重大事项	43.40	2015年1月28日	46.99	136,550	5,431,944.00	5,926,270.00	-
002184	海得控制	2014年11月27日	公告重大事项	21.82	2015年1月26日	20.00	161,500	3,525,922.76	3,523,930.00	-
002439	启明星辰	2014年12月8日	公告重大事项	23.84	2015年3月12日	28.86	6,500	169,573.00	154,960.00	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 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。

7.4.8.3.2 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。

7.4.9 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2014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23,938,155.60元，属于第二层次的余额为482,808,042.56元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次347,449,625.35元，第二层次21,492,550.70元，无第三层次)。

(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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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2014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(2013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	506,746,198.16	82.76
	其中：股票	506,746,198.16	82.76
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	91,319,875.98	14.91
7	其他各项资产	14,223,335.10	2.32
8	合计	612,289,409.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,549,084.00	1.77
C	制造业	124,798,534.44	20.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,372,209.00	8.60
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,000,810.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,078,696.97	7.71
J	金融业	169,570,871.50	28.39
K	房地产业	93,226,636.25	15.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,149,356.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	506,746,198.16	84.83

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	2,900,100	31,379,082.00	5.25
2	600340	华夏幸福	709,830	30,948,588.00	5.18
3	600068	葛洲坝	2,905,600	27,109,248.00	4.54
4	000002	万科A	1,377,900	19,152,810.00	3.21
5	601166	兴业银行	1,128,800	18,625,200.00	3.12
6	601318	中国平安	240,500	17,967,755.00	3.01
7	601988	中国银行	4,279,400	17,759,510.00	2.97
8	601186	中国铁建	1,053,850	16,081,751.00	2.69
9	600588	用友软件	649,333	15,252,832.17	2.55
10	002588	史丹利	389,765	15,181,346.75	2.54

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于农银汇理基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	600340	华夏幸福	54,458,836.42	10.30
2	600588	用友软件	44,083,610.27	8.34
3	601668	中国建筑	37,331,228.79	7.06
4	000671	阳光城	37,201,524.72	7.04
5	600048	保利地产	37,113,349.97	7.02
6	601688	华泰证券	35,933,538.00	6.80
7	000002	万科A	34,912,641.89	6.60
8	600030	中信证券	33,492,158.69	6.34
9	300323	华灿光电	32,511,988.69	6.15
10	300010	立思辰	31,141,191.78	5.89
11	600794	保税科技	31,121,146.56	5.89
12	300287	飞利信	29,459,142.39	5.57
13	600109	国金证券	29,357,691.66	5.55
14	300170	汉得信息	29,048,389.67	5.50
15	002588	史丹利	28,547,451.69	5.40
16	600068	葛洲坝	28,501,741.22	5.39
17	600312	平高电气	28,276,290.82	5.35
18	600571	信雅达	26,408,413.62	5.00
19	000625	长安汽车	25,589,923.46	4.84
20	300113	顺网科技	25,424,658.07	4.81
21	300072	三聚环保	25,008,845.66	4.73
22	601788	光大证券	24,941,345.58	4.72
23	000400	许继电气	24,814,338.16	4.69
24	000712	锦龙股份	23,696,653.40	4.48
25	300295	三六五网	22,943,288.46	4.34
26	300203	聚光科技	21,991,543.62	4.16
27	300017	网宿科技	21,599,749.42	4.09
28	600019	宝钢股份	21,533,137.00	4.07
29	000952	广济药业	21,366,151.28	4.04
30	600175	美都能源	21,319,229.75	4.03
31	600261	阳光照明	21,282,358.93	4.03
32	300033	同花顺	21,169,430.98	4.00
33	600158	中体产业	20,944,222.96	3.96
34	000732	泰禾集团	20,122,055.73	3.81
35	002390	信邦制药	20,082,955.61	3.80
36	600707	彩虹股份	19,545,429.24	3.70
37	300238	冠昊生物	19,294,595.94	3.65
38	300133	华策影视	19,268,287.83	3.65
39	300008	上海佳豪	18,942,211.12	3.58
40	600782	新钢股份	18,844,164.03	3.56
41	600000	浦发银行	18,661,090.34	3.53
42	002153	石基信息	18,302,646.90	3.46
43	600406	国电南瑞	18,271,460.69	3.46
44	300049	福瑞股份	18,164,122.49	3.44
45	300002	神州泰岳	17,860,041.74	3.38
46	002065	东华软件	17,801,188.71	3.37
47	300380	安硕信息	17,729,608.27	3.35
48	002609	捷顺科技	17,601,968.96	3.33
49	600887	伊利股份	17,277,318.70	3.27
50	300059	东方财富	17,275,865.96	3.27
51	002318	久立特材	17,163,533.40	3.25
52	300005	探路者	17,124,813.42	3.24
53	000541	佛山照明	16,932,010.90	3.20
54	600584	长电科技	16,773,872.62	3.17
55	601318	中国平安	16,676,802.46	3.15
56	002268	卫士通	16,350,155.63	3.09
57	601988	中国银行	16,335,390.99	3.09
58	000024	招商地产	16,244,807.72	3.07
59	300334	津膜科技	16,202,843.86	3.07
60	601186	中国铁建	15,933,570.30	3.01
61	601166	兴业银行	15,822,418.44	2.99
62	300104	乐视网	15,591,068.63	2.95
63	600028	中国石化	15,577,344.32	2.95
64	601555	东吴证券	15,393,694.56	2.91
65	600999	招商证券	15,391,284.10	2.91
66	002261	拓维信息	15,295,195.93	2.89
67	300090	盛运股份	15,237,501.37	2.88
68	300303	聚飞光电	15,222,828.66	2.88
69	300168	万达信息	15,208,963.18	2.88
70	002415	海康威视	15,133,842.89	2.86
71	300255	常山药业	14,935,610.81	2.83
72	600867	通化东宝	14,545,733.73	2.75
73	300315	掌趣科技	14,415,942.16	2.73
74	000932	华菱钢铁	14,114,846.95	2.67
75	600486	扬农化工	14,096,963.54	2.67
76	002649	博彦科技	14,077,650.98	2.66
77	000961	中南建设	14,047,123.10	2.66
78	600962	国投中鲁	13,919,199.37	2.63
79	002502	骅威股份	13,495,657.44	2.55
80	002396	星网锐捷	13,420,745.04	2.54
81	002094	青岛金王	13,325,758.43	2.52
82	600446	金证股份	13,305,791.32	2.52
83	000049	德赛电池	13,212,344.97	2.50
84	002496	辉丰股份	13,176,636.77	2.49
85	000831	五矿稀土	13,072,523.41	2.47
86	300178	腾邦国际	13,043,218.91	2.47
87	000709	河北钢铁	12,749,784.35	2.41
88	300226	上海钢联	12,424,107.09	2.35
89	002229	鸿博股份	12,393,798.41	2.34
90	002019	亿帆鑫富	12,384,637.92	2.34
91	601377	兴业证券	12,282,871.00	2.32
92	300036	超图软件	12,204,102.04	2.31
93	600376	首开股份	11,949,597.99	2.26
94	600080	金花股份	11,635,465.09	2.20
95	600067	冠城大通	11,582,083.18	2.19
96	300058	蓝色光标	11,536,972.82	2.18
97	300043	互动娱乐	11,534,436.79	2.18
98	600372	中航电子	11,531,674.58	2.18
99	600576	万好万家	11,298,315.48	2.14
100	300182	捷成股份	11,034,311.66	2.09
101	601231	环旭电子	10,993,323.85	2.08
102	600801	华新水泥	10,971,683.08	2.08
103	300026	红日药业	10,932,944.59	2.07
104	002569	步森股份	10,926,601.14	2.07
105	300253	卫宁软件	10,870,011.08	2.06
106	600010	包钢股份	10,849,322.00	2.05
107	600741	华域汽车	10,838,572.01	2.05
108	600031	三一重工	10,829,932.42	2.05
109	002456	欧菲光	10,814,658.96	2.05
110	000776	广发证券	10,740,796.00	2.03
111	600271	航天信息	10,728,374.60	2.03
112	600259	广晟有色	10,727,348.01	2.03
113	300251	光线传媒	10,721,932.50	2.03
114	300352	北信源	10,648,773.29	2.01
115	601998	中信银行	10,633,966.82	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	300287	飞利信	41,752,394.79	7.90
2	601668	中国建筑	40,821,535.59	7.72
3	000625	长安汽车	39,158,702.95	7.41
4	300323	华灿光电	38,300,759.34	7.25
5	600109	国金证券	34,238,135.41	6.48
6	600030	中信证券	33,914,781.58	6.42
7	300049	福瑞股份	33,024,480.18	6.25
8	600340	华夏幸福	32,272,552.02	6.11
9	601688	华泰证券	31,191,700.51	5.90
10	300010	立思辰	30,660,077.78	5.80
11	300170	汉得信息	30,636,972.15	5.80
12	600794	保税科技	30,474,062.15	5.76
13	000671	阳光城	29,554,318.87	5.59
14	600312	平高电气	29,477,303.72	5.58
15	600571	信雅达	29,239,216.65	5.53
16	300072	三聚环保	28,413,606.85	5.38
17	600588	用友软件	28,310,206.83	5.36
18	000400	许继电气	27,085,938.04	5.12
19	600406	国电南瑞	26,726,772.10	5.06
20	300113	顺网科技	26,423,707.53	5.00
21	000952	广济药业	24,209,599.95	4.58
22	300033	同花顺	23,656,380.47	4.48
23	600703	三安光电	22,870,875.46	4.33
24	002019	亿帆鑫富	22,720,782.70	4.30
25	600887	伊利股份	22,310,476.54	4.22
26	300017	网宿科技	22,073,479.76	4.18
27	600261	阳光照明	21,630,841.90	4.09
28	600158	中体产业	21,555,350.91	4.08
29	300133	华策影视	21,465,068.77	4.06
30	600584	长电科技	21,378,925.31	4.04
31	000712	锦龙股份	20,730,037.33	3.92
32	300203	聚光科技	20,728,014.55	3.92
33	600175	美都能源	20,514,191.00	3.88
34	000732	泰禾集团	20,410,651.79	3.86
35	002318	久立特材	20,025,379.28	3.79
36	600707	彩虹股份	20,020,377.39	3.79
37	002153	石基信息	19,956,549.93	3.78
38	002609	捷顺科技	19,941,856.50	3.77
39	002390	信邦制药	19,657,249.69	3.72
40	300059	东方财富	19,490,872.68	3.69
41	000002	万科A	19,462,577.34	3.68
42	002588	史丹利	19,419,415.45	3.67
43	002131	利欧股份	19,228,125.25	3.64
44	000024	招商地产	19,169,005.46	3.63
45	000541	佛山照明	18,712,281.16	3.54
46	300238	冠昊生物	18,627,090.15	3.52
47	600372	中航电子	18,097,115.25	3.42
48	300008	上海佳豪	17,920,585.82	3.39
49	002108	沧州明珠	17,814,904.44	3.37
50	601555	东吴证券	17,608,392.45	3.33
51	002065	东华软件	17,501,944.76	3.31
52	300002	神州泰岳	17,242,915.45	3.26
53	002261	拓维信息	17,179,183.84	3.25
54	600420	现代制药	17,067,301.09	3.23
55	300295	三六五网	17,038,456.43	3.22
56	600150	中国船舶	17,032,256.12	3.22
57	601788	光大证券	16,842,806.69	3.19
58	000932	华菱钢铁	16,682,044.03	3.16
59	002268	卫士通	16,652,921.86	3.15
60	300303	聚飞光电	16,451,053.32	3.11
61	601318	中国平安	16,317,729.94	3.09
62	600867	通化东宝	16,234,289.61	3.07
63	300334	津膜科技	15,983,728.53	3.02
64	000521	美菱电器	15,901,130.48	3.01
65	300315	掌趣科技	15,728,817.96	2.98
66	002649	博彦科技	15,685,796.82	2.97
67	300104	乐视网	15,562,542.85	2.94
68	300380	安硕信息	15,257,148.00	2.89
69	600028	中国石化	15,134,777.49	2.86
70	002415	海康威视	15,060,966.19	2.85
71	002325	洪涛股份	14,817,450.51	2.80
72	600446	金证股份	14,567,789.70	2.76
73	002502	骅威股份	14,523,487.85	2.75
74	300226	上海钢联	14,251,735.07	2.70
75	002094	青岛金王	14,203,723.49	2.69
76	000961	中南建设	14,065,511.14	2.66
77	300090	盛运股份	13,897,916.62	2.63
78	601992	金隅股份	13,669,169.88	2.59
79	600585	海螺水泥	13,609,487.53	2.57
80	000709	河北钢铁	13,565,458.64	2.57
81	300118	东方日升	13,520,631.80	2.56
82	000851	高鸿股份	13,188,375.00	2.49
83	300178	腾邦国际	13,126,776.60	2.48
84	300255	常山药业	13,045,262.24	2.47
85	601607	上海医药	13,026,103.69	2.46
86	600486	扬农化工	12,998,258.84	2.46
87	002005	德豪润达	12,980,351.24	2.46
88	600962	国投中鲁	12,713,167.82	2.41
89	002470	金正大	12,705,290.55	2.40
90	600080	金花股份	12,691,295.03	2.40
91	601231	环旭电子	12,671,195.25	2.40
92	002396	星网锐捷	12,490,672.18	2.36
93	002496	辉丰股份	12,331,676.90	2.33
94	601700	风范股份	12,301,991.35	2.33
95	002229	鸿博股份	12,207,564.79	2.31
96	600376	首开股份	12,180,815.46	2.30
97	000049	德赛电池	12,080,860.43	2.29
98	600067	冠城大通	12,024,744.82	2.27
99	002437	誉衡药业	12,020,266.13	2.27
100	601933	永辉超市	11,953,825.72	2.26
101	300036	超图软件	11,867,526.60	2.25
102	300058	蓝色光标	11,658,915.75	2.21
103	000555	神州信息	11,583,243.46	2.19
104	600801	华新水泥	11,531,696.74	2.18
105	600048	保利地产	11,422,035.06	2.16
106	601998	中信银行	11,413,798.18	2.16
107	002363	隆基机械	11,377,765.54	2.15
108	000977	浪潮信息	11,349,264.35	2.15
109	300026	红日药业	11,308,110.90	2.14
110	300251	光线传媒	11,164,676.28	2.11
111	600576	万好万家	11,022,785.21	2.09
112	600718	东软集团	10,984,031.10	2.08
113	300005	探路者	10,981,468.66	2.08
114	000592	平潭发展	10,956,181.65	2.07
115	002285	世联行	10,801,960.19	2.04
116	300183	东软载波	10,754,461.70	2.03
117	300271	华宇软件	10,739,366.36	2.03
118	600019	宝钢股份	10,729,766.26	2.03
119	000903	云内动力	10,612,386.48	2.01
120	300085	银之杰	10,586,296.63	2.00

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	3,641,422,970.62
卖出股票收入（成交）总额	3,665,262,104.40

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

2014年1月21日，史丹利化肥股份有限公司（下称：史丹利，股票代码：002588）发布公告，公告指出史丹利收到中国银行间市场交易商协会通报批评。在非金融企业债务融资工具发行企业及信用增进机构2013年第三季度财务报表披露工作中，史丹利涉及信息披露质量不合规问题，披露了错误的三季报链接。

对史丹利股票投资决策程序的说明：该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库，由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断、按照相关投资决策流程投资了该股票。

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	510,151.75
2	应收证券清算款	9,671,607.24
3	应收股利	-
4	应收利息	28,614.18
5	应收申购款	4,012,961.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,223,335.10

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
14,790	30,342.02	61,016,703.80	13.60%	387,741,815.83	86.40%

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	485,549.89	0.1082%

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（ 2013年6月25日 ）基金份额总额	863,696,776.13
本报告期期初基金份额总额	569,981,613.91
本报告期基金总申购份额	787,428,604.56
减：本报告期基金总赎回份额	908,651,698.84
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	448,758,519.63

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，基金管理人农银汇理基金管理有限公司于2014年3月5日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，许红波不再担任农银汇理基金管理有限公司总经理职务，施卫代为履行总经理职务；于2014年8月25日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，陈献明担任农银汇理基金管理有限公司总经理职务，施卫不再代为履行总经理职务；于2014年12月20日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，陈献明不再担任农银汇理基金管理有限公司总经理职务，施卫代为履行总经理职务。

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。

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，目前事务所已提供审计服务的连续年限为一年。

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	
中信证券	2	1,250,261,564.18	17.11%	1,138,261.26	17.11%	-
中信建投	1	1,017,502,274.15	13.93%	926,342.67	13.93%	-
招商证券	2	743,006,805.30	10.17%	676,467.27	10.17%	-
长江证券	2	595,987,938.63	8.16%	542,589.24	8.16%	-
东兴证券	2	551,340,655.13	7.55%	501,937.23	7.55%	-
海通证券	2	422,414,616.86	5.78%	384,560.92	5.78%	-
平安证券	1	390,522,963.50	5.34%	355,540.65	5.34%	-
民生证券	2	379,368,446.93	5.19%	345,361.30	5.19%	-
银河证券	1	304,886,970.06	4.17%	277,567.98	4.17%	-
华泰证券	2	282,313,937.10	3.86%	257,019.03	3.86%	-
华创证券	2	39,465,953.31	0.54%	35,927.78	0.54%	-
国泰君安	2	204,310,424.29	2.80%	186,005.18	2.80%	-
国金证券	1	168,527,866.77	2.31%	153,431.40	2.31%	-
申银万国	1	203,600,825.99	2.79%	185,379.27	2.79%	-
方正证券	2	178,446,741.75	2.44%	162,460.40	2.44%	-
安信证券	2	176,386,118.10	2.41%	160,583.65	2.41%	-
中银国际	1	163,555,347.92	2.24%	148,901.02	2.24%	-
东方证券	1	119,391,006.93	1.63%	108,696.98	1.63%	-
广发证券	1	75,366,741.15	1.03%	68,610.76	1.03%	-
光大证券	1	39,940,413.77	0.55%	36,362.08	0.55%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	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、本基金本报告期新增华创证券、平安证券、方正证券交易单元。

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
中信证券	-	-	69,000,000.00	51.38%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	35,300,000.00	26.28%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	30,000,000.00	22.34%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

§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、《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》；

3、《农银汇理行业领先股票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

上海市浦东新区世纪大道1600 号陆家嘴商务广场7 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
2015年3月26日