农银汇理消费主题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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	农银汇理消费主题股票型证券投资基金
基金简称	农银消费主题股票
基金主代码	660012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月24日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	499,148,386.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资与居民消费相关行业的上市公司,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	本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。首先根据对宏观经济、政策环境、资金供求和市场情绪等因素的深入分析,对未来股票市场和债券市场的走势进行科学预判,并以此为基础对基金组合在股票类资产、债券类资产和现金类资产上的配置比例进行明确。在“自下而上”的层面,本基金将严格执行备选股票库制度,在建立消费相关行业股票库的基础上,综合运用定性和定量的手段,筛选出具有良好基本面和发展前景的个股进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为高风险、高预期收益的股票型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	胡涛
	联系电话	021-61095588	010-68858112
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95580
传真		021-61095556	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200122	100808
法定代表人		刁钦义	李国华

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

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	2012年4月24日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	155,605,822.06	194,306,063.07	-23,394,014.91
本期利润	93,700,575.19	236,548,537.21	31,396,741.89
加权平均基金份额本期利润	0.0847	0.4956	0.0305
本期加权平均净值利润率	5.14%	36.12%	3.05%
本期基金份额净值增长率	11.98%	58.19%	4.35%
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	314,036,328.01	265,199,829.45	-11,342,651.44
期末可供分配基金份额利润	0.6291	0.3832	-0.0217
期末基金资产净值	856,821,559.47	1,061,041,019.90	545,368,655.32
期末基金份额净值	1.7166	1.5330	1.0435
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	84.84%	65.07%	4.35%

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。

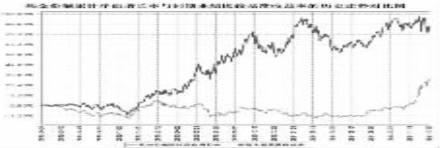
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即12月31日。

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

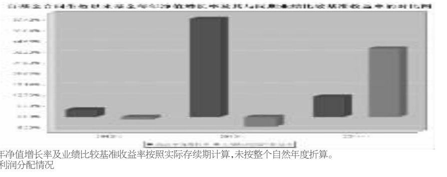
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.32%	1.59%	32.85%	1.24%	-38.17%	0.35%
过去六个月	8.34%	1.31%	46.44%	0.99%	-38.10%	0.32%
过去一年	11.98%	1.35%	40.69%	0.91%	-28.71%	0.44%
自基金合同生效起至今	84.84%	1.45%	30.79%	0.96%	54.05%	0.49%

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



注:本基金股票投资比例范围为基金资产的60%—95%,其中投资于消费相关行业股票的比例不低于股票投资的80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—40%。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(2012年4月24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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	
2013	0.8000	22,405,158.78	1,234,669.49	23,639,828.27	
2012	-	-	-	-	
合计	0.8000	22,405,158.78	1,234,669.49	23,639,828.27	

§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		
付娟	本基金基金经理、公司投资部总经理	2012年4月24日	-	8	会计学博士,具有基金从业资格。历任申银万国证券研究所分析师、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投资部总经理、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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初至2月中旬,在新股上市提振风险偏好、央行逆回购释放流动性的宽松环境下,以传媒,通讯,计算机等TMT行业为代表的创业板指大幅上涨。随后,2月中旬至5月上旬,经济数据逐渐恶化,地产销售低迷,PPI降幅一度创6个月以来新低;这一时期,市场担心公司业绩以及大量新股IPO分流,导致股指深幅下跌;严峻的形式下,央行即时采取定向降准、再贷款等宽货币政策;财政支出也通过微刺激提速。在政策的累积效应下,经济出现企稳迹象,创业板指重拾升势。进入四季度,降息进一步预示了央行施行宽松的倾向政策取向,券商、建筑以及一部分以高股息率为特征的大盘蓝筹大幅上涨,资金分流导致小盘成长股持续下跌。全年来看非银金融是全市场表现最好的行业。本基金在2014年遵循了相对低估值、高增长以及行业大空间等选股思路,对计算机、医药、传媒等行业进行了超配,以及至下而上配置了成长性较好具备核心竞争力的公司。

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11.98%,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。本基金会关注TMT行业、传统行业转型以及改革相关的投资机会,尤其是消费性相关行业转型互联网的投资机会。

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,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的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

本报告期内,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对农银汇理消费主题股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

中国邮政储蓄银行股份有限公司依法对基金管理人——农银汇理基金管理有限公司编制的“农银汇理消费主题股票型证券投资基金2014年年度报告”进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§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20333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	农银汇理消费主题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消费主题股票型证券投资基金(以下简称“农银汇理消费主题股票型基金”)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消费主题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,上述农银汇理消费主题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消费主题股票型基金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:农银汇理消费主题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	附注号	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	7.4.7.1	150,342,208.50	122,159,968.24
结算备付金		2,141,744.17	3,964,387.42
存出保证金		3,041,252.75	2,045,872.79
交易性金融资产	7.4.7.2	741,569,763.96	934,839,993.73
其中:股票投资		741,569,763.96	934,839,993.73
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	14,143,742.59
应收利息	7.4.7.5	23,658.96	23,664.14
应收股利		-	-
应收申购款		629,845.29	12,743,387.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		897,748,473.63	1,089,921,016.77
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,990,643.16	8,867,133.93
应付赎回款		8,678,498.39	15,256,869.97
应付管理人报酬		1,247,200.71	1,329,086.07
应付托管费		207,866.76	221,514.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,975,798.01	2,244,334.39
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	826,907.13	961,058.17
负债合计		40,926,914.16	28,879,996.87
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	499,148,386.10	692,123,873.23
未分配利润	7.4.7.10	357,673,173.37	368,917,146.67
所有者权益合计		856,821,559.47	1,061,041,019.90
负债和所有者权益总计		897,748,473.63	1,089,921,016.77

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.7166元,基金份额总额499,148,386.10份。

7.2 利润表

会计主体:农银汇理消费主题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	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		146,621,318.70	258,990,100.92
1.利息收入		2,458,261.98	878,797.31
其中:存款利息收入	7.4.7.11	2,454,236.77	726,481.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,025.21	152,316.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		199,947,495.01	213,247,633.66
其中:股票投资收益	7.4.7.12	186,112,220.97	212,249,489.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	13,835,274.04	998,143.75
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-61,905,246.87	42,242,474.14
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	6,120,808.58	2,621,195.81
减:二、费用		52,920,743.51	22,441,563.71
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	27,225,123.66	9,762,792.64
2.托管费	7.4.10.2.2	4,537,520.62	1,627,132.18
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	20,740,099.23	10,678,638.89
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	418,000.00	373,000.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		93,700,575.19	236,548,537.21
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		93,700,575.19	236,548,537.21

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:农银汇理消费主题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)	692,123,873.23	368,917,146.67	1,061,041,019.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	93,700,575.19	93,700,575.19
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)	-192,975,487.13	-104,944,548.49	-297,920,035.62
其中:1.基金申购款	2,759,473,353.93	1,956,681,112.53	4,716,154,466.46
2.基金赎回款	-2,952,448,841.06	-2,061,625,661.02	-5,014,074,502.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	499,148,386.10	357,673,173.37	856,821,559.47
项目	上年度可比期间 2013年1月1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)	522,640,338.03	22,728,317.29	545,368,655.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	236,548,537.21	236,548,537.21
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)	169,483,535.20	133,280,120.44	302,763,655.64
其中:1.基金申购款	1,741,484,506.28	701,227,410.20	2,442,711,916.48
2.基金赎回款	-1,572,000,971.08	-567,947,289.76	-2,139,948,260.84
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)	-	-23,639,828.27	-23,639,828.27
五、期末所有者权益(基金净值)	692,123,873.23	368,917,146.67	1,061,041,019.90

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

农银汇理消费主题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[2012]第102号《关于核准农银汇理消费主题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《农银汇理消费主题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1,629,917,809.49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(2012)第106号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金合同》于2012年4月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,630,484,406.34份基金份额,其中认购资金利息折合566,596.85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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理消费主题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,包括国内依法上市的股票(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,但须符合中国证监会的相关规定。其中:股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于消费相关行业股票的比例不低于股票投资的80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-40%。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指数收益率+25% X 中证全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人农银汇理基金管理有限公司于2015年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理消费主题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2014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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.5 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,225,123.66	9,762,792.64
其中:支付销售机构的客户维护费	10,279,463.09	3,022,079.30

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.7.2.2 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1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,537,520.62	1,627,132.18

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.7.3 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1月1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
邮储银行	150,342,208.50	2,304,632.05	122,159,968.24	645,938.92

注:本基金的银行存款由基金托管人邮储银行保管,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。

7.4.7.7 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。

7.4.8 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
002507	涪陵榨菜	2014年12月22日	公告重大事项	28.80	2015年3月23日	31.68	486,627	13,704,202.01	14,014,857.60	-
300009	安科生物	2014年12月15日	公告重大事项	17.82	2015年3月18日	19.60	491,500	8,538,382.60	8,758,530.00	-
300073	当升科技	2014年12月11日	公告重大事项	17.60	-	-	1,000	15,183.24	17,600.00	-
002009	天奇股份	2014年10月20日	公告重大事项	17.85	2015年1月28日	17.93	1,689,996	24,954,754.70	30,166,428.60	-
600580	卧龙电气	2014年12月8日	公告重大事项	10.48	2015年1月14日	11.12	1,000	6,648.68	10,480.00	-

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的金融工具中属于第一层次的余额为688,601,867.76元,属于第二层次的余额为52,967,896.20元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次的余额为915,036,236.89元,属于第二层次的余额为19,803,756.84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,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的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于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	741,569,763.96	82.60
	其中:股票	741,569,763.96	82.60
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	152,483,952.67	16.99
7	其他各项资产	3,694,757.00	0.41
8	合计	897,748,473.63	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	17,435,890.64	2.03
C	制造业	337,755,343.97	39.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,888,422.60	2.67
E	建筑业	17,417,734.88	2.03
F	批发和零售业	-	-
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	124,474,763.36	14.53
J	金融业	130,608,738.75	15.24
K	房地产业	74,892,187.76	8.74
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	1,922.00	0.00
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	16,094,760.00	1.88
S	综合	-	-
	合计	741,569,763.96	86.55

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	601318	中国平安	609,387	45,527,302.77	5.31
2	000997	新大陆	1,413,951	39,788,581.14	4.64
3	002275	桂林三金	2,138,187	39,235,731.45	4.58
4	600588	用友软件	1,543,734	36,262,311.66	4.23
5	300147	香雪制药	1,893,815	31,588,834.20	3.69
6	002009	天奇股份	1,689,996	30,166,428.60	3.52
7	600420	现代制药	1,431,826	29,939,481.66	3.49
8	600048	保利地产	2,446,915	26,475,620.30	3.09
9	000002	万科A	1,880,400	26,137,560.00	3.05
10	000958	东方能源	1,802,238	22,888,422.60	2.67

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	002440	闰土股份	157,675,703.16	14.86
2	002701	奥瑞金	105,088,101.43	9.90
3	601700	风范股份	102,572,970.46	9.67
4	600109	国金证券	101,564,753.68	9.57
5	300207	欣旺达	92,744,943.19	8.74
6	600572	康恩贝	91,619,029.55	8.63
7	300147	香雪制药	91,616,171.79	8.63
8	300251	光线传媒	91,362,734.25	8.61
9	600048	保利地产	89,932,131.20	8.48
10	002064	华峰氨纶	88,630,861.99	8.35
11	002021	中捷资源	87,555,045.56	8.25
12	601668	中国建筑	82,761,733.63	7.80
13	601012	隆基股份	82,005,994.83	7.73
14	000958	东方能源	81,232,264.35	7.66
15	000748	长城信息	76,801,331.14	7.24
16	300021	大禹节水	73,601,871.08	6.94
17	300157	恒泰艾普	73,043,845.98	6.88
18	300206	理邦仪器	72,139,686.56	6.80
19	002603	以岭药业	71,009,963.62	6.69
20	000997	新大陆	70,977,050.83	6.69
21	600420	现代制药	70,130,173.96	6.61
22	002185	华天科技	67,507,482.25	6.36
23	002085	万丰奥威	67,489,594.20	6.36
24	300073	当升科技	66,212,479.78	6.24
25	000970	中科三环	61,496,814.79	5.80
26	000541	佛山照明	60,954,405.37	5.74
27	002565	上海绿新	60,719,403.76	5.72
28	601318	中国平安	56,944,999.62	5.37
29	002551	尚荣医疗	56,714,373.95	5.35
30	600485	信威集团	55,684,922.16	5.25
31	002410	广联达	54,804,039.00	5.17
32	601555	东吴证券	53,261,857.93	5.02
33	300228	富瑞特装	52,992,024.12	4.99
34	600187	国中水务	51,252,345.61	4.83
35	600588	用友软件	50,669,627.49	4.78
36	002275	桂林三金	50,619,827.17	4.77
37	600410	华胜天成	49,978,209.61	4.71
38	600340	华夏幸福	49,892,449.30	4.70
39	000540	中天城投	49,049,757.53	4.62
40	000028	国药一致	48,511,802.84	4.57
41	300164	通源石油	48,389,155.92	4.56
42	002454	松芝股份	48,356,105.77	4.56
43	600794	保税科技	45,958,910.05	4.33
44	600446	金证股份	45,781,537.36	4.31
45	002358	森源电气	45,247,009.53	4.26
46	002153	石基信息	44,489,834.97	4.19
47	600612	老凤祥	44,398,597.60	4.18
48	000625	长安汽车	43,865,126.42	4.13
49	002178	延华智能	42,500,744.08	4.01
50	002089	新海宜	42,148,590.33	3.97
51	000826	桑德环境	42,047,772.98	3.96
52	300245	天玑科技	41,617,902.40	3.92
53	600587	新华医疗	41,591,284.05	3.92
54	300088	长信科技	41,571,196.10	3.92
55	002604	龙力生物	41,066,889.04	3.87
56	600594	益佰制药	39,633,755.44	3.74
57	600067	冠城大通	39,402,779.96	3.71
58	600741	华域汽车	39,192,795.10	3.69
59	600158	中体产业	39,179,891.73	3.69
60	601888	中国国旅	38,950,756.58	3.67
61	600406	国电南瑞	38,860,771.20	3.66
62	600855	航天长峰	38,060,736.43	3.59
63	300005	探路者	37,467,917.15	3.53
64	300287	飞利信	37,414,877.51	3.53
65	000801	四川九洲	37,282,282.68	3.51
66	600210	紫江企业	37,255,622.34	3.51
67	601808	中海油服	36,768,711.45	3.47
68	300315	掌趣科技	36,617,885.96	3.45
69	000831	五矿稀土	36,573,861.95	3.45
70	600271	航天信息	35,619,387.30	3.36
71	300115	长盈精密	35,547,059.96	3.35
72	601336	新华保险	35,407,400.98	3.34
73	600343	航天动力	35,069,827.76	3.31
74	601989	中国重工	34,560,898.83	3.26
75	300246	宝莱特	32,821,628.10	3.09
76	002421	达实智能	32,510,851.26	3.06
77	002383	合众思壮	32,142,145.18	3.03
78	300170	汉得信息	31,978,700.64	3.01
79	300166	东方国信	31,709,218.04	2.99
80	000002	万科A	31,443,485.85	2.96
81	300133	华策影视	31,355,325.32	2.96
82	002191	劲嘉股份	30,349,172.44	2.86
83	000739	普洛药业	30,257,184.40	2.85
84	000513	丽珠集团	30,132,004.56	2.84
85	002368	太极股份	29,330,897.43	2.76
86	600850	华东电脑	28,919,813.92	2.73
87	300224	正海磁材	28,115,378.09	2.65
88	002411	九九久	28,043,247.37	2.64
89	300070	碧水源	27,368,124.18	2.58
90	300274	阳光电源	27,282,883.89	2.57
91	300231	银信科技	27,248,373.94	2.57
92	000651	格力电器	27,168,803.60	2.56
93	002268	卫士通	27,079,539.70	2.55
94	601988	中国银行	26,171,518.00	2.47
95	002009	天奇股份	24,954,754.70	2.35
96	300323	华灿光电	24,855,996.75	2.34
97	600261	阳光照明	24,754,063.19	2.33
98	002294	信立泰	24,751,394.52	2.33
99	600416	湘电股份	24,690,493.68	2.33
100	600549	厦门钨业	24,576,923.94	2.32
101	300291	华录百纳	24,537,048.14	2.31
102	600077	宋都股份	24,281,443.88	2.29
103	000768	中航飞机	23,937,775.65	2.26
104	600525	长园集团	23,630,524.79	2.23
105	300255	常山药业	23,624,533.51	2.23
106	600580	卧龙电气	23,588,289.14	2.22
107	600270	外运发展	23,085,150.47	2.18
108	600869	智慧能源	22,972,882.17	2.17
109	002318	久立特材	22,843,048.48	2.15
110	600699	均胜电子	22,639,894.88	2.13
111	002520	日发精机	22,602,682.99	2.13
112	002138	顺络电子	22,558,869.03	2.13
113	000069	华侨城A	22,417,588.61	2.11
114	300090	盛运股份	22,185,415.42	2.09
115	601818	光大银行	22,065,608.96	2.08
116	002507	涪陵榨菜	21,581,596.99	2.03
117	600487	亨通光电	21,405,685.08	2.02
118	300304	云意电气	21,265,755.50	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002440	闰土股份	151,696,840.34	14.30
2	300157	恒泰艾普	126,025,748.48	11.88
3	600109	国金证券	119,325,174.46	11.25
4	300133	华策影视	113,755,705.80	10.72
5	300274	阳光电源	107,593,467.73	10.14
6	600572	康恩贝	102,345,364.14	9.65
7	300207	欣旺达	99,968,836.91	9.42
8	002085	万丰奥威	98,933,502.50	9.32
9	002021	中捷资源	88,844,422.08	8.37
10	300251	光线传媒	88,633,863.37	8.35
11	600485	信威集团	83,868,402.10	7.90
12	000748	长城信息	82,797,887.99	7.80
13	002701	奥瑞金	81,960,431.78	7.72
14	300058	蓝色光标	80,559,360.81	7.59
15	601700	风范股份	79,810,543.75	7.52
16	002064	华峰氨纶	77,797,365.24	7.33
17	601012	隆基股份	77,707,367.34	7.32
18	601668	中国建筑	76,162,547.50	7.18
19	002185	华天科技	73,627,827.91	6.94
20	300315	掌趣科技	73,000,514.09	6.88
21	600048	保利地产	72,209,128.83	6.81
22	000541	佛山照明	71,535,408.43	6.74
23	600587	新华医疗	69,847,101.22	6.58
24	300287	飞利信	66,648,812.79	6.28
25	300021	大禹节水	66,355,362.00	6.25
26	300115	长盈精密	64,614,600.56	6.09
27	000958	东方能源	63,247,468.41	5.96
28	300206	理邦仪器	63,147,778.98	5.95
29	300073	当升科技	62,864,910.57	5.92
30	000970	中科三环	62,483,542.11	5.89
31	300147	香雪制药	61,648,111.06	5.81
32	600420	现代制药	60,016,547.72	5.66
33	002603	以岭药业	57,691,498.67	5.44
34	002565	上海绿新	57,174,662.25	5.39
35	002551	尚荣医疗	57,047,129.63	5.38
36	002454	松芝股份	56,967,379.31	5.37
37	601555	东吴证券	56,636,326.05	5.34
38	600187	国中水务	55,626,398.86	5.24
39	600594	益佰制药	55,493,738.93	5.23
40	000028	国药一致	53,672,243.51	5.06
41	002089	新海宜	53,480,111.09	5.04
42	600410	华胜天成	53,263,480.92	5.02
43	002358	森源电气	51,833,194.32	4.89
44	300070	碧水源	49,522,205.01	4.67
45	002410	广联达	49,431,264.00	4.66
46	600612	老凤祥	49,239,313.63	4.64
47	000651	格力电器	48,650,797.34	4.59
48	600340	华夏幸福	47,560,986.41	4.48
49	002191	劲嘉股份	47,492,077.81	4.48
50	000625	长安汽车	47,228,985.33	4.45
51	600699	均胜电子	46,827,513.12	4.41
52	600794	保税科技	45,849,925.05	4.32
53	002178	延华智能	45,584,245.32	4.30
54	300164	通源石油	44,583,184.31	4.20
55	000826	桑德环境	44,332,950.71	4.18
56	300228	富瑞特装	43,809,903.72	4.13
57	601515	东风股份	43,598,316.38	4.11
58	600158	中体产业	43,468,642.21	4.10
59	600406	国电南瑞	42,881,537.21	4.04
60	002400	省广股份	41,939,543.82	3.95
61	300088	长信科技	41,383,324.88	3.90
62	300245	天玑科技	40,419,479.36	3.81
63	300005	探路者	40,244,560.72	3.79
64	600446	金证股份	40,113,355.54	3.78
65	000801	四川九洲	40,052,167.95	3.77
66	002153	石基信息	39,264,574.09	3.70
67	600210	紫江企业	38,685,058.07	3.65
68	601888	中国国旅	38,681,066.67	3.65
69	600690	青岛海尔	38,672,088.60	3.64
70	002421	达实智能	38,051,517.04	3.59
71	000997	新大陆	37,940,260.59	3.58
72	600067	冠城大通	37,750,228.51	3.56
73	300104	乐视网	37,704,046.47	3.55
74	600855	航天长峰	37,635,101.72	3.55
75	000938	紫光股份	37,502,514.82	3.53
76	002368	太极股份	37,459,987.02	3.53
77	002268	卫士通	37,326,182.36	3.52
78	002604	龙力生物	35,673,956.95	3.36
79	300170	汉得信息	35,602,442.80	3.36
80	601808	中海油服	34,955,633.45	3.29
81	600343	航天动力	34,073,050.18	3.21
82	600741	华域汽车	33,971,720.78	3.20
83	300166	东方国信	33,918,030.45	3.20
84	002019	亿帆鑫富	32,717,009.48	3.08
85	300090	盛运股份	32,347,956.98	3.05
86	000739	普洛药业	30,801,170.23	2.90
87	300246	宝莱特	30,227,618.99	2.85
88	000513	丽珠集团	29,637,804.95	2.79
89	600850	华东电脑	29,548,897.81	2.78
90	002353	杰瑞股份	29,009,446.74	2.73
91	000540	中天城投	28,475,430.60	2.68
92	601222	林洋电子	28,332,749.35	2.67
93	300291	华录百纳	28,181,914.55	2.66
94	600271	航天信息	27,619,319.79	2.60
95	002318	久立特材	26,876,947.72	2.53
96	300071	华谊嘉信	26,109,623.94	2.46
97	002138	顺络电子	26,101,480.11	2.46
98	600580	卧龙电气	25,826,608.28	2.43
99	600416	湘电股份	25,785,273.21	2.43
100	002520	日发精机	25,681,059.53	2.42
101	600261	阳光照明	25,521,333.13	2.41
102	600549	厦门钨业	24,869,742.89	2.34
103	600077	宋都股份	24,038,043.46	2.27
104	300323	华灿光电	23,838,480.69	2.25
105	002294	信立泰	23,695,967.44	2.23
106	300255	常山药业	23,675,975.79	2.23
107	300304	云意电气	23,491,682.37	2.21
108	002236	大华股份	23,331,157.05	2.20
109	000069	华侨城A	23,324,200.72	2.20
110	000768	中航飞机	22,406,703.11	2.11
111	600487	亨通光电	22,134,204.59	2.09
112	601818	光大银行	21,972,875.38	2.07
113	600525	长园集团	21,952,747.49	2.07
114	600212	江泉实业	21,436,338.19	2.02

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	6,588,030,925.82
卖出股票收入(成交)总额	6,905,508,129.69

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投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12..1

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

8.12..2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12..3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,041,252.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,658.96
5	应收申购款	629,845.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,694,757.00

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	002009	天奇股份	30,166,428.60	3.52	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
40,401	12,354.85	45,758,062.09	9.17%	453,390,324.01	90.83%

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	100,756.27	0.0202%

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(2012年4月24日)基金份额总额	1,630,484,406.34
本报告期期初基金份额总额	692,123,873.23
本报告期基金总申购份额	2,759,473,353.93
减:本报告期基金总赎回份额	2,952,448,841.06
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	499,148,386.10

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10万元,目前事务所已提供审计服务的连续年限为三年。

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	
海通证券	1	6,127,547,690.95	45.41%	5,578,536.84	45.41%	-
中信证券	1	2,444,329,422.55	18.12%	2,225,328.09	18.12%	-
中金公司	1	2,442,291,618.70	18.10%	2,223,465.39	18.10%	-
国泰君安	1	1,338,073,442.12	9.92%	1,218,171.48	9.92%	-
申银万国	1	1,028,340,704.52	7.62%	936,207.64	7.62%	-
安信证券	1	112,781,250.27	0.84%	102,677.11	0.84%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-

注:1、交易单元选择标准有:

(1)、实力雄厚,注册资本不少于20亿元人民币。

(2)、市场形象及财务状况良好。

(3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。

(4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请,集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后,研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价,做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期内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
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

§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、《农银汇理消费主题股票型证券投资基金基金合同》;
3、《农银汇理消费主题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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。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