农银汇理中小盘股票型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

2015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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年8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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	农银中小盘股票
基金主代码	660005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	695,475,960.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选基本面优良且具有良好成长潜力的中小盘股票,在严格控制风险的前提下采用积极主动的管理手段,以充分分享中小市值上市公司成长过程所带来的收益。
投资策略	本基金在投资上遵循"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建投资组合。基金管理人将严格遵循股票库的制度,在中小盘股票库内通过对个股基本面、估值水平、成长潜力等因素的深入分析,以筛选出符合本基金投资要求的股票。
业绩比较基准	中证700 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为中小盘股票型证券投资基金,是高风险、高收益的基金品种,其风险和收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于股票型基金中风险和收益水平较高的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		农银汇理基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	田青
	联系电话	021-61095588	010-67595096
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-61095599	010-67595096
传真		021-61095556	010-66275853

2.4 信息披露方式

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	上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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(2015年1月1日 – 2015年6月30日)
本期已实现收益	695,000,066.65
本期利润	630,203,935.48
加权平均基金份额本期利润	0.9901
本期加权平均净值利润率	38.59%
本期基金份额净值增长率	68.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	1,219,446,560.56
期末可供分配基金份额利润	1.7534
期末基金资产净值	1,914,922,520.67
期末基金份额净值	2.7534
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	183.31%

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。

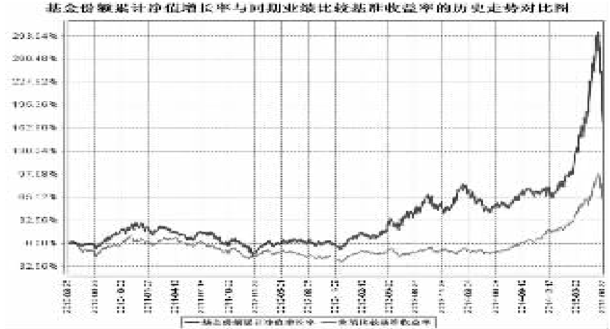
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30日。

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	-19.81%	4.22%	-7.22%	2.85%	-12.59%	1.37%
过去三个月	22.87%	3.31%	14.93%	2.16%	7.94%	1.15%
过去六个月	68.25%	2.61%	41.89%	1.73%	26.36%	0.88%
过去一年	80.59%	2.03%	86.30%	1.36%	-5.71%	0.67%
过去三年	172.92%	1.75%	96.07%	1.14%	76.85%	0.61%
自基金合同生效起至今	183.31%	1.55%	66.29%	1.14%	117.02%	0.41%

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:1、本基金股票投资比例范围为基金资产的60%—95%,其中投资于中小盘股票的比例不少于股票投资的80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—40%,其中权证投资比例范围为基金资产净值的0%—3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2010年3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。

2、农银汇理基金管理有限公司根据《农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案后,自2012年11月1日起,将农银汇理中小盘股票型证券投资基金的业绩比较基准由"30%×天相小盘指数+45%×天相中盘指数+25%×中证全债指数"变更为"中证700 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%"。

§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银城路9号农银大厦50层。公司法定代表人为董事长刁钦义先生。

截止2015年6月30日,公司现管理25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、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和农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金。

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		
付娟	本基金基金经理、公司投资副总监、公司投资部总经理	2013年3月5日	–	9	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、研究部副总经理。现任农银汇理基金管理有限公司投资副总监、投资部总经理、基金经理。
颜伟鹏	本基金基金经理	2015年3月3日	–	4	工学硕士。历任交银施罗德基金公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

一季度过后,在宏观数据疲软的经济环境下,二季度经济政策趋向宽松友好,市场对于政策进一步放松的预期持续发酵,4月19日央行再度下调存款准备金率,新的降息时间窗口正在快速打开。在风险偏好提升的背景下,资金加速流入股市,看空的力量有所消减,股指一路突破上涨,并在6月达到阶段高点,上证指数突破5000点,创业板指数接近4000点,本基金净值也持续创下新高。

6月中旬以来A股市场出现明显回调,短期调整幅度之大超出预期。市场调整存在两方面的重要诱发因素。一是流动性的边际变化,六月底之前市场流动性水平出现季节性紧张,新股上市节奏加快,也加强了短期流动性的压力。同时债务置换等稳增长手段的加码,显示财政政策转向积极,持续宽松货币政策预期的边际变化对金融资产价格产生冲击;二是监管层加强了对于杠杆和场外配资的限制,对融资交易形成明显限制,可能放大市场的波动幅度。本轮牛市的新特点是有大量的融资盘,股指初始下跌产生了连锁反应,极端的跌幅本身加强了市场自我负反馈,使得市场出现了罕见的流动性危机,监管机构及时出手以组合拳强力救市,收到了显著成效,目前被动去杠杆结束,场内流动性恢复,救市初步成功。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金份额净值增长率为68.25%,同期业绩比较基准收益率为41.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮自14年下半年而起的牛市,除"资金牛"、"改革牛"、"转型牛"外,还有着"杠杆牛"的新特征。金融杠杆是把双刃剑,杠杆交易和场外配资清理引发的雪崩式平仓及大幅市场波动在中国资本市场上史无前例,我们对此预判不足,应对措施亦不够坚决果断,造成净值出现明显回撤,给投资人造成一定损失,在此深表歉意。季末我们已经在仓位控制、行业配置方面进行了调整,以顺应市场的变化,下半年对此我们更将严谨思考、审慎判断。

面对牛市中的中期调整,监管部门已经出台一系列举措进行救市,如7月证监会要求21家证券公司出资近1200亿元,投资蓝筹股ETF,同时宣布扩大证金公司融资,央行将协助支持。在监管层一系列及时、有效的救市措施下,市场的极端情绪有所缓解,负反馈式持续下跌被打破,流动性最紧张的局面已经过去,进一步出现系统性金融风险的概率大大降低。我们认为在市场中流动性条件稳步改善的条件下,局部结构性投资机会开始显现,有望出现主题轮动的特点。

我们判断,长期来看本轮牛市的根基并未动摇,经济疲弱货币政策宽松,政府对于股市政策仍较友好,管理层借助资本市场实现改革转型意图未变,大类资产配置转移的长期逻辑仍然成立。我们战略上仍将坚持沿着成长和改革的主线,同时高度关注市场风险偏好及微观结构上的变化方向,综合考量增长、估值、筹码集中度、确定性等衡量因素,在深度研究优秀上市公司的基础上进行积极配置。

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

根据基金合同的要求,报告期内本基金不需分配利润。

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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:农银汇理中小盘股票型证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		205,295,235.74	244,727,087.80
结算备付金		10,148,293.59	1,990,769.84
存出保证金		1,485,582.87	743,887.21
交易性金融资产		1,775,280,781.12	804,325,939.65
其中:股票投资		1,775,280,781.12	804,325,939.65
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		–	–
应收证券清算款		4,360,955.64	4,421,489.77
应收利息		46,796.79	43,236.00
应收股利		–	–
应收申购款		1,731,854.54	1,268,621.32
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,998,349,500.29	1,057,521,031.59
负债和所有者权益		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		–	31,616,995.99
应付赎回款		74,167,811.73	5,270,376.05
应付管理人报酬		3,130,163.17	1,390,713.75
应付托管费		521,693.87	231,785.62
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		4,775,495.55	2,913,310.08
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		831,815.30	806,490.87
负债合计		83,426,979.62	42,229,672.36
所有者权益:			
实收基金		695,475,960.11	620,418,506.27
未分配利润		1,219,446,560.56	394,872,852.96
所有者权益合计		1,914,922,520.67	1,015,291,359.23
负债和所有者权益总计		1,998,349,500.29	1,057,521,031.59

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.7534元,基金份额总额695,475,960.11份。

6.2 利润表

会计主体:农银汇理中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目		本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		661,950,471.34	40,429,397.55
1.利息收入		846,076.23	1,119,010.96
其中:存款利息收入		845,792.47	1,119,010.96
债券利息收入		283.76	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		–	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		725,064,273.16	202,532,869.41
其中:股票投资收益		720,749,948.10	195,796,097.38
基金投资收益		–	–
债券投资收益		953,676.24	–
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		3,360,648.82	6,736,772.03
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-64,796,131.17	-165,598,317.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		836,253.12	2,375,835.06
减:二、费用		31,746,535.86	25,550,993.75
1. 管理人报酬		11,953,613.98	14,818,732.54
2. 托管费		1,992,268.99	2,469,788.76
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		17,621,536.89	8,093,062.76
5. 利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用		179,116.00	169,409.69
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		630,203,935.48	14,878,403.80
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		630,203,935.48	14,878,403.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:农银汇理中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	620,418,506.27	394,872,852.96	1,015,291,359.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	630,203,935.48	630,203,935.48
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)	75,057,453.84	194,369,772.12	269,427,225.96
其中:1.基金申购款	548,804,397.46	968,316,653.58	1,517,121,051.04
2.基金赎回款	-473,746,943.62	-773,946,881.46	-1,247,693,825.08
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)	695,475,960.11	1,219,446,560.56	1,914,922,520.67
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	1,382,304,264.10	677,277,259.82	2,059,581,523.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	14,878,403.80	14,878,403.80
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)	-461,514,688.04	-209,004,839.01	-670,519,527.05
其中:1.基金申购款	850,285,966.58	552,127,459.14	1,402,413,425.72
2.基金赎回款	-1,311,800,654.62	-761,132,298.15	-2,072,932,952.77
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)	920,789,576.06	483,150,824.61	1,403,940,400.67

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	王梅华	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理中小盘股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2010]第106号《关于同意农银汇理中小盘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《农银汇理中小盘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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集9,726,189,932.23元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第064号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2010年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为9,730,785,653.20份基金份额,其中认购资金利息折合4,595,720.97份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理中小盘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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于中小盘股票的比例不少于股票资产的80%,除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-40%,其中权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:75%×中证700 指数收益率+25%×中证全债指数收益率。

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》、《 农银汇理中小盘股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年上半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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

除6.4.5.2所述会计估计变更外,本基金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

本基金在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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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、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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

(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,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对基金取得的股票股息、红利收入,要求基金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,暂减按25%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。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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	本基金管理人
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,953,613.98	14,818,732.54
其中:支付销售机构的客户维护费	2,346,487.46	2,953,760.80

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,992,268.99	2,469,788.76

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国建设银行	205,295,235.74	734,565.84	256,853,585.93	1,068,990.19

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.9.6 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。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配情况。

6.4.11 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 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
300291	华录百纳	2015年6月30日	公告重大事项	39.95	2015年7月13日	34.65	2,589,250	84,136,948.01	103,440,537.50	–
000700	模塑科技	2015年4月15日	公告重大事项	28.41	2015年7月21日	24.44	3,144,190	57,240,361.19	89,326,437.90	–
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	公告重大事项	37.29	–	–	2,377,680	65,923,882.07	88,663,687.20	–
300418	昆仑万维	2015年5月5日	公告重大事项	144.78	2015年8月6日	140.09	604,114	70,681,219.74	87,463,624.92	–
300113	顺网科技	2015年5月5日	公告重大事项	53.60	2015年8月6日	51.93	1,478,135	84,709,599.96	79,228,036.00	–
600654	中安消	2015年6月29日	公告重大事项	30.11	–	–	1,933,600	72,772,644.48	58,220,696.00	–
300163	先锋新材	2015年6月30日	公告重大事项	29.92	–	–	1,830,405	85,605,346.51	54,765,717.60	–
300144	宋城演艺	2015年6月18日	公告重大事项	56.66	2015年7月20日	68.82	467,709	26,537,965.27	26,500,391.94	–
300431	暴风科技	2015年6月11日	公告重大事项	211.45	2015年7月13日	276.80	113,950	33,875,899.61	24,094,727.50	–
300294	博雅生物	2015年4月23日	公告重大事项	75.46	–	–	3,500	256,528.88	264,110.00	–

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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 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	1,775,280,781.12	88.84
	其中:股票	1,775,280,781.12	88.84
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	215,443,529.33	10.78
7	其他各项资产	7,625,189.84	0.38
8	合计	1,998,349,500.29	100.00

7.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	66,770,380.80	3.49
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,049,395,984.99	54.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
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	49,681,350.00	2.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	401,384,950.91	20.96
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	31,978,763.52	1.67
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,986.00	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	176,066,364.90	9.19
S	综合	–	–
	合计	1,775,280,781.12	92.71

7.3 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	002339	积成电子	3,842,800	128,349,520.00	6.70
2	300291	华录百纳	2,589,250	103,440,537.50	5.40
3	000700	模塑科技	3,144,190	89,326,437.90	4.66
4	002292	奥飞动漫	2,377,680	88,663,687.20	4.63
5	300418	昆仑万维	604,114	87,463,624.92	4.57
6	600271	航天信息	1,310,992	84,834,292.32	4.43
7	300113	顺网科技	1,478,135	79,228,036.00	4.14
8	603555	贵人鸟	1,755,600	73,348,968.00	3.83
9	300397	天和防务	390,242	70,633,802.00	3.69
10	002657	中科金财	739,066	68,008,853.32	3.55

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

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	600570	恒生电子	155,316,109.70	15.30
2	300295	三六五网	112,259,456.29	11.06
3	603555	贵人鸟	112,042,370.71	11.04
4	002339	积成电子	105,589,947.06	10.40
5	600271	航天信息	97,551,721.31	9.61
6	300273	和佳股份	90,615,027.66	8.93
7	300291	华录百纳	88,955,914.66	8.76
8	300163	先锋新材	85,605,346.51	8.43
9	300113	顺网科技	84,709,599.96	8.34
10	300397	天和防务	78,033,460.39	7.69
11	601688	华泰证券	74,681,105.14	7.36
12	600654	中安消	72,772,644.48	7.17
13	002657	中科金财	71,431,473.20	7.04
14	300418	昆仑万维	70,681,219.74	6.96
15	002477	雏鹰农牧	67,320,795.25	6.63
16	600446	金证股份	66,811,795.50	6.58
17	002699	美盛文化	66,792,706.90	6.58
18	300299	富春通信	66,537,714.94	6.55
19	002292	奥飞动漫	65,923,882.07	6.49
20	600038	中直股份	62,661,815.18	6.17
21	300053	欧比特	62,206,994.32	6.13
22	601628	中国人寿	58,816,645.62	5.79
23	601567	三星电气	57,765,865.76	5.69
24	000700	模塑科技	57,240,361.19	5.64
25	300086	康芝药业	55,768,694.89	5.49
26	000721	西安饮食	55,542,726.54	5.47
27	601166	兴业银行	55,456,125.98	5.46
28	002073	软控股份	55,192,392.00	5.44
29	300144	宋城演艺	54,051,296.90	5.32
30	600358	国旅联合	53,745,006.57	5.29
31	300253	卫宁软件	53,597,474.83	5.28
32	300392	腾信股份	52,687,712.13	5.19
33	000712	锦龙股份	50,273,482.18	4.95
34	601989	中国重工	49,944,337.27	4.92
35	002380	科远股份	49,443,688.30	4.87
36	601318	中国平安	49,202,875.07	4.85
37	000831	五矿稀土	48,969,899.57	4.82
38	601107	四川成渝	48,915,199.43	4.82
39	300133	华策影视	48,737,586.78	4.80
40	300207	欣旺达	48,398,396.06	4.77
41	002551	尚荣医疗	47,482,686.64	4.68
42	600682	南京新百	46,318,599.06	4.56
43	601377	兴业证券	45,495,885.96	4.48
44	300271	华宇软件	45,469,293.02	4.48
45	000705	浙江震元	45,266,381.79	4.46
46	600481	双良节能	44,371,729.04	4.37
47	300364	中文在线	44,347,110.64	4.37
48	000861	海印股份	44,340,376.24	4.37
49	002291	星期六	43,617,208.23	4.30
50	001696	宗申动力	42,828,041.98	4.22
51	002701	奥瑞金	41,804,298.51	4.12
52	600420	现代制药	40,258,812.70	3.97
53	300016	北陆药业	39,692,289.51	3.91
54	300226	上海钢联	39,510,515.12	3.89
55	300030	阳普医疗	38,577,993.52	3.80
56	300310	宜通世纪	38,330,344.67	3.78
57	002572	索菲亚	38,219,002.39	3.76
58	600259	广晟有色	37,123,553.10	3.66
59	002467	二六三	36,871,144.34	3.63
60	002450	康得新	36,869,246.89	3.63
61	300439	美康生物	35,672,409.00	3.51
62	600588	用友网络	35,625,033.57	3.51
63	002407	多氟多	35,184,818.01	3.47
64	600518	康美药业	35,082,874.18	3.46
65	002649	博彦科技	34,802,013.03	3.43
66	300004	南风股份	34,269,848.41	3.38
67	300431	暴风科技	33,875,899.61	3.34
68	600999	招商证券	32,636,176.10	3.21
69	600080	金花股份	32,317,446.25	3.18
70	603368	柳州医药	32,074,775.00	3.16
71	300345	红宇新材	31,360,856.25	3.09
72	600280	中央商场	30,866,634.69	3.04
73	000100	TCL 集团	30,566,214.05	3.01
74	601988	中国银行	30,121,652.00	2.97
75	000952	广济药业	29,912,646.56	2.95
76	002449	国星光电	29,592,689.34	2.91
77	002284	亚太股份	28,876,758.23	2.84
78	002065	东华软件	28,102,980.49	2.77
79	600048	保利地产	27,796,086.29	2.74
80	601126	四方股份	26,920,858.09	2.65
81	002041	登海种业	26,098,295.62	2.57
82	002050	三花股份	25,832,058.09	2.54
83	000024	招商地产	25,810,925.18	2.54
84	000998	隆平高科	25,704,284.94	2.53
85	002285	世联行	25,599,665.78	2.52
86	002085	万丰奥威	25,505,188.33	2.51
87	000671	阳 光 城	25,273,608.98	2.49
88	002364	中恒电气	24,922,162.81	2.45
89	300198	纳川股份	24,899,733.76	2.45
90	601788	光大证券	24,665,934.98	2.43
91	002400	省广股份	24,601,746.60	2.42
92	300170	汉得信息	24,510,758.39	2.41
93	000540	中天城投	24,107,621.56	2.37
94	002124	天邦股份	24,059,280.14	2.37
95	000975	银泰资源	24,031,158.99	2.37
96	600058	五矿发展	23,725,904.24	2.34
97	002236	大华股份	23,316,735.35	2.30
98	300147	香雪制药	23,223,938.68	2.29
99	002375	亚厦股份	23,207,831.43	2.29
100	000035	中国天楹	22,482,436.54	2.21
101	300075	数字政通	21,169,381.91	2.09
102	300070	碧水源	21,047,230.85	2.07
103	600490	鹏欣资源	21,022,515.50	2.07
104	600366	宁波韵升	20,924,473.87	2.06
105	002273	水晶光电	20,895,873.12	2.06
106	300140	启源装备	20,847,347.60	2.05
107	600115	东方航空	20,786,020.36	2.05
108	600109	国金证券	20,773,177.43	2.05
109	000829	天音控股	20,711,003.90	2.04
110	600436	片仔癀	20,637,021.12	2.03
111	600060	海信电器	20,618,405.06	2.03
112	600150	中国船舶	20,558,483.81	2.02
113	000001	平安银行	20,526,763.02	2.02
114	600061	中纺投资	20,448,134.31	2.01
115	000625	长安汽车	20,355,598.15	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。

7.4.2 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	601567	三星电气	104,863,709.24	10.33
2	600446	金证股份	99,681,535.11	9.82
3	601318	中国平安	98,917,964.99	9.74
4	600682	南京新百	96,090,757.65	9.46
5	600588	用友网络	89,673,339.47	8.83
6	600420	现代制药	83,335,966.81	8.21
7	300295	三六五网	82,771,565.22	8.15
8	000831	五矿稀土	76,743,482.87	7.56
9	601628	中国人寿	76,432,479.64	7.53
10	300147	香雪制药	74,099,536.78	7.30
11	600570	恒生电子	73,958,862.88	7.28
12	601688	华泰证券	72,842,090.44	7.17
13	601989	中国重工	70,133,566.14	6.91
14	300392	腾信股份	69,441,036.44	6.84
15	001696	宗申动力	68,896,140.15	6.79
16	600038	中直股份	68,336,373.52	6.73
17	000997	新 大 陆	65,724,894.20	6.47
18	002657	中科金财	63,836,561.39	6.29
19	300253	卫宁软件	63,316,086.64	6.24
20	002339	积成电子	60,979,452.05	6.01
21	300133	华策影视	60,489,593.52	5.96
22	300271	华宇软件	59,186,459.72	5.83
23	600259	广晟有色	58,426,382.79	5.75
24	000540	中天城投	57,572,904.43	5.67
25	600048	保利地产	57,522,437.45	5.67
26	002284	亚太股份	57,223,722.26	5.64
27	002701	奥瑞金	55,703,004.77	5.49
28	002551	尚荣医疗	54,970,368.31	5.41
29	600271	航天信息	52,448,953.12	5.17
30	601166	兴业银行	52,324,468.22	5.15
31	000861	海印股份	51,336,235.30	5.06
32	000712	锦龙股份	50,768,965.47	5.00
33	601988	中国银行	50,757,260.54	5.00
34	601107	四川成渝	49,743,412.51	4.90
35	002467	二六三	49,624,163.61	4.89
36	601377	兴业证券	49,427,589.51	4.87
37	300207	欣旺达	48,133,699.68	4.74
38	600481	双良节能	47,936,992.19	4.72
39	000705	浙江震元	47,830,079.67	4.71
40	300364	中文在线	46,877,426.74	4.62
41	300030	阳普医疗	45,664,432.36	4.50
42	002291	星期六	44,097,091.65	4.34
43	603368	柳州医药	43,697,001.68	4.30
44	300004	南风股份	43,214,113.05	4.26
45	300273	和佳股份	43,099,412.04	4.25
46	300226	上海钢联	41,164,850.40	4.05
47	600518	康美药业	40,759,419.60	4.01
48	300310	宜通世纪	40,006,984.72	3.94
49	002450	康得新	39,850,714.91	3.93
50	002649	博彦科技	39,820,648.21	3.92
51	000952	广济药业	39,769,519.41	3.92
52	000958	东方能源	39,428,045.42	3.88
53	300144	宋城演艺	39,126,340.11	3.85
54	002407	多氟多	38,509,858.73	3.79
55	000001	平安银行	38,227,325.42	3.77
56	000998	隆平高科	37,223,380.97	3.67
57	002364	中恒电气	36,620,637.25	3.61
58	600999	招商证券	36,069,712.40	3.55
59	002050	三花股份	35,570,280.37	3.50
60	002275	桂林三金	34,845,679.98	3.43
61	002375	亚厦股份	32,806,866.04	3.23
62	300345	红宇新材	32,788,797.31	3.23
63	000829	天音控股	31,479,325.45	3.10
64	300086	康芝药业	31,023,689.29	3.06
65	002065	东华软件	30,983,353.09	3.05
66	600280	中央商场	30,242,529.36	2.98
67	300439	美康生物	30,074,572.56	2.96
68	600080	金花股份	29,930,917.74	2.95
69	000100	TCL 集团	29,716,051.37	2.93
70	601336	新华保险	29,401,268.96	2.90
71	601788	光大证券	29,171,839.21	2.87
72	300170	汉得信息	28,925,569.13	2.85
73	000002	万 科A	28,799,402.26	2.84
74	601126	四方股份	28,328,217.01	2.79
75	002085	万丰奥威	28,321,179.91	2.79
76	300198	纳川股份	28,040,935.44	2.76
77	002400	省广股份	27,446,727.53	2.70
78	000671	阳 光 城	27,061,056.84	2.67
79	002285	世联行	26,856,582.34	2.65
80	600058	五矿发展	26,424,801.57	2.60
81	600115	东方航空	26,370,313.40	2.60
82	002236	大华股份	25,881,506.42	2.55
83	002009	天奇股份	25,487,833.30	2.51
84	600114	东睦股份	25,210,489.49	2.48
85	000975	银泰资源	24,854,333.02	2.45
86	002074	东源电器	24,689,066.37	2.43
87	002383	合众思壮	24,688,331.49	2.43
88	002124	天邦股份	24,515,598.22	2.41
89	002496	辉丰股份	23,995,195.47	2.36
90	002041	登海种业	23,748,707.14	2.34
91	002183	怡 亚 通	23,596,929.88	2.32
92	601169	北京银行	23,453,505.21	2.31
93	000024	招商地产	23,391,591.17	2.30
94	300369	绿盟科技	23,357,178.40	2.30
95	002081	金 螳 螂	23,295,986.75	2.29
96	000035	中国天楹	23,040,408.28	2.27
97	000625	长安汽车	22,229,827.43	2.19
98	002273	水晶光电	21,935,072.00	2.16
99	600490	鹏欣资源	21,709,943.14	2.14
100	300378	鼎捷软件	21,671,846.39	2.13
101	002410	广联达	21,617,858.97	2.13
102	600061	中纺投资	21,566,670.42	2.12
103	600109	国金证券	21,527,706.82	2.12
104	002117	东港股份	21,432,756.60	2.11
105	600436	片仔癀	21,061,634.03	2.07
106	600366	宁波韵升	20,894,337.01	2.06
107	600079	人福医药	20,812,263.18	2.05
108	300075	数字政通	20,761,186.53	2.04
109	002019	亿帆鑫富	20,650,250.23	2.03
110	300336	新文化	20,488,887.16	2.02
111	002522	浙江众成	20,363,929.51	2.01

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	6,000,847,201.11
卖出股票收入(成交)总额	5,685,846,176.57

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	1,485,582.87
2	应收证券清算款	4,360,955.64
3	应收股利	–
4	应收利息	46,796.79
5	应收申购款	1,731,854.54
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,625,189.84

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

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	300291	华录百纳	103,440,537.50	5.40	公告重大事项
2	000700	模塑科技	89,326,437.90	4.66	公告重大事项
3	002292	奥飞动漫	88,663,687.20	4.63	公告重大事项
4	300418	昆仑万维	87,463,624.92	4.57	公告重大事项
5	300113	顺网科技	79,228,036.00	4.14	公告重大事项

§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
72,778	9,556.13	306,020,886.28	44.00%	389,455,073.83	56.00%

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	27,159.09	0.0039%

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(2010年3月25日)基金份额总额	9,730,785,653.20
本报告期期初基金份额总额	620,418,506.27
本报告期基金总申购份额	548,804,397.46
减:本报告期基金总赎回份额	473,746,943.62
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	695,475,960.11

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

本报告期内,基金管理人农银汇理基金管理有限公司于2015年5月28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》,许金超任农银汇理基金管理有限公司总经理职务,施卫不再代为履行副总经理职务;农银汇理基金管理有限公司于2015年4月29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》,Laurent Tournier(杜明华)因任职到期而不再担任农银汇理基金管理有限公司副总经理职务。

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。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	2	2,622,951,296.05	22.44%	2,387,932.98	22.44%	–
兴业证券	2	2,238,421,463.81	19.15%	2,037,859.89	19.15%	–
方正证券	2	1,368,944,383.00	11.71%	1,246,285.94	11.71%	–
长江证券	2	1,319,543,303.59	11.29%	1,201,313.73	11.29%	–
招商证券	2	1,312,326,710.05	11.23%	1,194,750.24	11.23%	–
华创证券	2	1,178,213,021.25	10.08%	1,072,651.97	10.08%	–
国信证券	2	960,771,197.85	8.22%	874,689.87	8.22%	–
中信证券	2	241,540,529.64	2.07%	219,900.62	2.07%	–
申万宏源	2	173,573,890.49	1.49%	158,023.59	1.49%	–
宏源证券	1	135,489,559.59	1.16%	123,349.90	1.16%	–
国泰君安	2	134,918,022.36	1.15%	122,830.17	1.15%	–
光大证券	2	–	–	–	–	–
东方证券	2	–	–	–	–	–
中信金通	2	–	–	–	–	–
国金证券	2	–	–	–	–	–

注:1、交易单元选择标准有:

(1)、实力雄厚,注册资本不少于20亿元人民币。

(2)、市场形象及财务状况良好。

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

(4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

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

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

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

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
华泰联合	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	4,360,960.00	100.00%	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
中信金通	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–

§11 影响投资者决策的其他重要信息

2015年7月30日,农银汇理基金管理有限公司(以下简称"本公司")发布《农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称的公告》(以下简称"公告"),公告指出"本公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和旗下各股票型基金《基金合同》的相关规定,经对相关风险进行审慎、充分评估,且经与相关基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年8月7日起将'农银汇理中小盘股票型证券投资基金'变更为'农银汇理中小盘混合型证券投资基金',但不变更基金的股票投资比例和基金代码。"

由于本次基金更名不改变基金投资范围,对基金持有人利益无实质性不利影响,且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。因此,按照基金合同的约定,不需要召开持有人大会。

农银汇理基金管理有限公司
2015年8月26日