农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（2015年第1次）摘要

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

农银汇理主题轮动股票型证券投资基金的募集申请经中国证监会2013年11月20日证监许可【2013】1465号文注册，并经2015年1月7日证监许可【2015】50号文变更注册为农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，某一基金的特定风险等。本基金为中高风险、中高预期收益的混合型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。投资有风险，投资者认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金托管人已经对本招募说明书中涉及与托管业务相关的更新信息进行了复核、审查。招募说明书（更新）所载内容截止日为2015年10月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）公司概况

名称：农银汇理基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼
办公地址：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
成立日期：2008年3月18日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监许可【2008】307号
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币贰亿零壹元
存续期限：持续经营
联系人：翟爱东
联系电话：021－61095588
股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
中国农业银行股份有限公司	103,333,334	51.67%
东方汇理资产管理公司	66,666,667	33.33%
中国铝业股份有限公司	30,000,000	15%
合　计	200,000,001	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员：

于进先生：董事长

金融学硕士，高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息部副处长、处长，人事部处长、副总经理，电子银行总经理，科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。

Bernard Carayon先生：副董事长

经济学博士。1978年起历任法国农业信贷银行集团督察员、中央风险控制部主管，东方汇理银行和东方汇理投资银行风险控制部门主管，东方汇理资产管理公司管理委员会成员。现任东方汇理资产管理公司副总裁。

许金超先生：董事

高级经济师、经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行采购管理部总经理，中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

Thierry Mequillet先生：董事

工商管理硕士。1979年开始从事银行工作，在Credit Agricole Indosuez 工作近15年并担任多项管理职务。1994年加入东方汇理资产管理香港有限公司，任香港地区总经理。1999年起至今任东方汇理资产管理香港有限公司亚太区行政总裁。

谢尉志先生：董事

工商管理硕士、高级会计师。1986年开始在中国海洋石油公司工作，先后任总公司财务部、资金部总经理，中海石油财务有限公司总经理。2011年2月起，任中国铝业公司总经理助理，并先后兼任中铝海外控股有限公司总裁、中铝矿业国际有限公司总裁。2013年2月起任中国铝业股份有限公司副总裁、财务总监。

华若鸣女士：董事

高级工商管理硕士，高级经济师。1989年起在中国农业银行工作，先后任中国农业银行总行国际业务部副总经理、香港分行总经理，中国农业银行电子银行部副总经理。现任中国农业银行股份有限公司金融市场部总经理兼资金交易中心总经理、外汇交易中心总经理。

王小卒先生：独立董事

经济学博士。曾任香港城市大学助理教授、世界银行顾问、联合国顾问、韩国首尔国立大学客座教授。现任复旦大学管理学院财务金融系教授，兼任香港大学商学院名誉教授和挪威管理学院兼职教授。

傅继军先生：独立董事

经济学博士，高级经济师。1973年起，任江苏省盐城汽车运输公司教师，江苏省人民政府研究中心科员。1990年3月起任中华财务咨询公司总经理。

徐信忠先生：独立董事

金融学博士、教授。曾任英国Bank of England货币政策局金融经济学家；英国兰卡斯特大学管理学院金融学教授；北京大学光华管理学院副院长、金融学教授。现任中山大学岭南（大学）学院院长、金融学教授。

2、公司监事

Jean-Yves Glain先生：监事

硕士。1995年加入东方汇理资产管理公司，历任销售部负责人、市场部负责人、国际事务协调和销售部副负责人。现任东方汇理资产管理公司国际协调与支持部负责人。

欧小武先生：监事

1985年起在中国有色金属工业总公司、中国铜铅锌集团公司工作。2000年起历任中国铝业公司和中国铝业股份有限公司处长、财务部（审计部）主任和财务部总经理。2001年至2006年任中国铝业股份有限公司监事。现任中国铝业公司审计部主任、中国铝业股份有限公司审计部总经理。

胡惠琳女士：监事

工商管理硕士。2004年起进入基金行业，先后就职于长信基金管理有限公司、富国基金管理有限公司。2007年参与农银汇理基金管理有限公司筹建工作，2008年3月公司成立后任市场部总经理。

高利民先生：监事

项目管理硕士。2002年起进入资产管理相关行业，先后就职于恒生电子股份有限公司、国联安基金管理有限公司。2007年加入农银汇理基金管理有限公司参与筹建工作，现任农银汇理基金管理有限公司运营部副总经理。

杨晓玫女士：监事

管理学学士。2008年加入农银汇理基金管理有限公司，现任综合管理部人力资源经理。

3、公司高级管理人员

于进先生：董事长

金融学硕士、高级经济师。于进先生1983年开始在农业银行总行工作，历任信息部副处长、处长，人事部处长、副总经理，电子银行总经理，科技与产品管理局局长。2015年9月30日起任农银汇理基金管理有限公司董事长。

许金超先生：总经理

高级经济师、经济学硕士。许金超先生1983年7月进入中国农业银行工作，历任中国农业银行河南省分行办公室副主任、处长、副行长，中国农业银行山西分行党委副书记，中国农业银行内蒙古自治区分行党委书记、行长，中国农业银行采购管理部总经理，中国农业银行托管业务部总经理。2014年12月起任农银汇理基金管理有限公司董事。2015年5月28日起任农银汇理基金管理有限公司总经理。

施卫先生：副总经理

经济学硕士、金融理学硕士。1992年7月起任中国农业银行上海市浦东分行国际部经理、办公室主任、行长助理，2002年7月起任中国农业银行上海市分行公司业务部副总经理，2004年3月起任中国农业银行香港分行副总经理，2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监，2010年10月起任中国农业银行东京分行筹备组组长，2012年12月起任农银汇理基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

翟爱东先生：督察长

高级工商管理硕士。1988年起先后在中国农业银行《中国城乡金融报》社、国际部、伦敦代表处、银行卡部工作。2004年11月起参加农银汇理基金管理有限公司筹备工作。2008年3月起任农银汇理基金管理有限公司董事会秘书、监察稽核部总经理，2012年1月起任农银汇理基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

陈富权，金融学硕士，具有基金从业资格。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、基金经理助理。2013年8月21日起任农银汇理区间收益基金基金经理，2014年4月15日起任农银汇理平衡双利基金基金经理，2015年4月10日起任农银汇理主题轮动基金基金经理，2015年6月6日起任农银汇理策略价值基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主席许金超先生，现任农银汇理基金管理有限公司总经理；

投资决策委员会成员付娟女士，投资副总监兼任投资部总经理，农银汇理消费主题混合型证券投资基金基金经理、农银汇理中小盘混合型证券投资基金基金经理；

投资决策委员会成员凌晨先生，研究部副总经理，农银汇理研究精选灵活配置混合型基金基金经理、农银汇理低估值高增长混合型基金基金经理、农银汇理医疗保健主题股票型基金基金经理、农银汇理信息传媒主题股票型基金基金经理；

投资决策委员会成员史向明女士，固定收益部总经理，农银汇理恒久增利债券型基金基金经理、农银汇理增强收益债券型基金基金经理、农银汇理7天理财债券型基金基金经理、农银汇理主题轮动灵活配置混合型基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010－66105799
联系人：洪渊

（二）主要人员情况

截至2015年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工203人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年3月，中国工商银行共托管证券投资基金428只。自2003年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的45项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

名称：农银汇理基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层
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
法定代表人：于进
联系人：沈娴
客户服务电话：4006895599、021-61095599
联系电话：021-61095610
网址：www.abc-ca.com

2、代销机构：

（1）中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：刘士余
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
传真：010－66107914
客户服务电话：95588
网址：http://www.icbc.com.cn

（3）交通银行股份有限公司
住所：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：张宏革
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（4）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60833722
传真：010-60833739
客服电话：95558
网址：www.citics.com

（5）中信证券（山东）有限责任公司
住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客服电话：95548
网址：www.citicssd.com

（6）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法人代表：沈强
联系人：李珊
电话：0571-85783737
传真：0571-85106383
客服电话：95548
网址：www.bigsun.com.cn

（7）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈有安
联系人：田薇
电话：010-66568430
传真：010-66568990
客服电话：400-8888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（8）广发证券股份有限公司
住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555417
客服电话：95575或致电各地营业网点
网址：www.gf.com.cn

（9）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508 号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169081
传真：021-22169134
客服电话：4008888788、95525
网址：www.ebscn.com

（10）申万宏源证券有限公司
住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：李梅
联系人：王序微
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客服电话：95523、4008895523
网址：www.swhysc.com

（11）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
传真：010-65182261
客户服务电话：400-888-8108
网址：www.csc108.com

（12）长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：杨泽柱
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：95579;4008-888-999
网址：http://www.95579.com

（13）上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509988
传真：021-64385308
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

（14）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
传真：021-68596916
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（15）杭州数米基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：李晓明
电话：021-60897832
传真：0571-26697013
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（16）深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn

（17）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人：陈操
联系人：张燕
电话：010-53855388*1588
传真：010-58325282
客服电话：400-850-7771
网址：t.jrj.com

（18）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22 号泛利大厦10 层
法定代表人：王莉
电话：021-53835888
传真：021-20835879
联系人：吴卫东
客服电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com

（19）上海陆金所资产管理有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：郭坚
电话：021-20665952
联系人：宁博宇
客服电话：400-821-9031
网址：www.lufunds.com

其它代销机构名称及其信息另行公告。

（二）登记机构

农银汇理基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼
办公地址：上海市浦东新区银城路9号农银大厦50楼
法定代表人：于进
电话：021-61095588
传真：021-61095556
联系人：高利民
客户服务电话：4006895599

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
联系电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：廖海、刘佳

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
联系人：张勇
经办注册会计师：汪棣、张勇

四、基金名称

农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金

五、基金类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金运用主题投资策略，把握中国经济发展和结构转型过程中各种投资主题的轮动效应，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转债、可分离债、央票、中期票据、资产支持证券等）、货币市场工具（包括短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

八、投资策略

本基金采用“主题投资策略”（Thematic Investment Approach），综合运用定量和定性的分析方法，自上而下，针对经济发展和结构转型的驱动因素进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，结合价值投资理念，精选投资主题下的受益个股，力争获取市场超额收益，实现基金资产的长期稳定增值。

1、大类资产配置策略

本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。

2、股票投资策略

本基金的股票投资将运用主题投资策略从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建投资组合。

（1）主题发掘

基金管理人从宏观经济、政策制度、技术演进和社会文化等多角度出发，动态分析影响经济发展和企业盈利的关键性、趋势性因素，前瞻性发掘在中国发展过程中不断涌现出的有影响力的投资主题。

（2）主题配置

在主题挖掘的基础上，基金管理人将综合考虑主题发展阶段、主题轮动效应、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重。主题配置中，本基金管理人将重点考察主题的生命周期和主题轮动效应。

1）主题的生命周期

主题的生命周期是指投资主题对经济和资本市场的影响持续期。根据投资主体对经济和资本市场影响力的强弱，可以将主题的发展分为主题萌芽、主题形成、主题繁荣及主题衰退等四个阶段。对基金投资而言，主题萌芽期和形成期是比较好的介入时机，而主题的繁荣期是实现投资收益的阶段。通过判断主题的生命周期进行主题配置，可以增厚投资收益和规避投资风险。

2）主题轮动

经济发展具备多层次、多元化、长周期的特点，资本市场上会同时出现多个相关或独立的投资主题，在不同阶段各投资主题的效应也强弱有别。本基金通过紧密跟踪经济发展趋势，关注因内在驱动因素变化所引起的投资主题的转换和轮动，根据投资主题的传导路径和轮动效应，把握新旧投资主题的转换时机，适时调整基金资产在不同的投资主题间的配置比例，分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

（3）个股精选

在主题挖掘和配置的基础上，本基金将兼顾主题和价值，优选受益于相关主题的上市公司，构建投资组合并持续优化。主题方面，综合考虑个股对投资主题的联动逻辑、敏感程度以及获益水平等预期指标；价值方面，综合考虑公司治理、行业地位、竞争优势、财务情况和估值水平等基本面因素。主题受益程度高又具备一定投资安全边际的个股将是本基金的投资重点。

3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金债券投资管理将主要采取以下策略：

（1）合理预计利率水平

对市场长期、中期和短期利率的正确预测是实现有效债券投资的基础。管理人将全面研究物价、就业、国际收支和政策变更等宏观经济运行状况，预测未来财政政策和货币政策等宏观经济政策走向，以此判断资金市场长期的供求关系变化。同时，通过具体分析货币供应量变动，M1和M2增长率等因素判断中短期资金市场供求的趋势。在此基础上，管理人将对于市场利率水平的变动进行合理预测，对包括收益率曲线斜度等因素的变化进行科学预测。

（2）灵活调整组合久期

管理人将在合理预测市场利率水平的基础上，在不同的市场环境下灵活调整组合的目标久期。当预期市场利率上升时，通过增加持有短期债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场利率下降时，通过增持长期债券等方式提高组合久期，以充分分享债券价格上升的收益。

（3）科学配置投资品种

管理人将通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、央票、金融债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

（4）谨慎选择个券

在具体券种的选择上，管理人主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估和流动性分析等方式，合理评估不同券种的风险收益水平。筛选出的券种一般具有流动性较好、符合目标久期、同等条件下信用质量较好或预期信用质量将得到改善、风险水平合理、有较好下行保护等特征。

4、权证投资策略

本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析，以有利于资产增值为原则，加强风险控制，谨慎参与投资。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×65%＋中证全债指数×35%

十、基金的风险收益特征

本基金为中高风险、中高预期收益的混合型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

十一、投资组合报告

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2015年10月29日复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容。

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	72,374,129.05	1.73
	其中：股票	72,374,129.05	1.73
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	56,272,898.00	1.35
	其中：债券	56,272,898.00	1.35
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	4,034,652,174.88	96.70
8	其他资产	8,959,472.38	0.21
9	合计	4,172,258,674.31	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	484,279.65	0.01
B	采矿业	–	–
C	制造业	46,299,635.28	1.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,849,596.64	0.07
E	建筑业	1,237,719.72	0.03
F	批发和零售业	1,470,612.00	0.04
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	16,723,403.42	0.42
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	2,296,020.51	0.06
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,012,861.83	0.03
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	72,374,129.05	1.81

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	322,948	14,145,122.40	0.35
2	300463	迈克生物	48,611	4,266,101.36	0.11
3	300442	普丽盛	54,410	3,612,279.90	0.09
4	002763	汇洁股份	84,064	3,055,726.40	0.08
5	601368	绿城水务	152,548	2,849,596.64	0.07
6	300476	胜宏科技	46,973	2,235,914.80	0.06
7	300458	全志科技	25,742	1,943,006.16	0.05
8	300473	德尔股份	28,645	1,901,455.10	0.05
9	603989	艾华集团	36,763	1,807,269.08	0.05
10	300477	合纵科技	42,625	1,686,671.25	0.04

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	54,309,100.00	1.36
	其中：政策性金融债	54,309,100.00	1.36
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	842,798.00	0.02
8	其他	1,121,000.00	0.03
9	合计	56,272,898.00	1.41

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开1301	530,000	54,309,100.00	1.36
2	132002	15天集EB	11,210	1,121,000.00	0.03
3	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.02

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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、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、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（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。

11、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	239,335.96
2	应收证券清算款	5,593,963.00
3	应收股利	–
4	应收利息	3,126,173.42
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	8,959,472.38

（4）报告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。

（5）报告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。

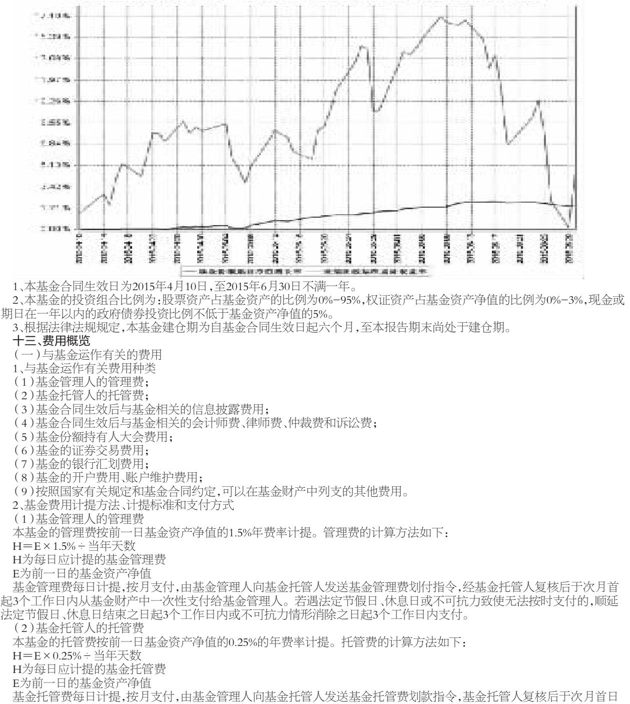
十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为2015年4月10日，基金业绩数据截至2015年6月30日。

一、本报告期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

序号	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
2015年4月10日-2015年6月30日	1.94%	0.09%	4.5%	1.77%	-2.56%	-1.68%
基金成立至2015年6月30日	1.94%	0.09%	4.5%	1.77%	-2.56%	-1.68%

二、自基金合同生效以来基金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



1、本基金合同生效日为2015年4月10日，至2015年6月30日不满一年。

2、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%，权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

3、根据法律法规规定，本基金建仓期为自基金合同生效日起六个月，至本报告期末尚处于建仓期。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用种类

（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
（4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券交易费用；
（7）基金的银行汇划费用；
（8）基金的开户费用、账户维护费用；
（9）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

上述“1、基金费用的种类中第3－9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
（3）基金合同生效前的相关费用；
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2015年4月1日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

（一）重要提示部分
增加了招募说明书更新所载内容的截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。
（二）第三部分“基金管理人”
对“公司概况”及“主要人员情况”进行了更新。
（三）第四部分“基金托管人”
对基金托管人基本情况进行了更新。
（四）第五部分“相关服务机构”
对基金相关服务机构进行了更新。
（五）第六部分“基金的募集
删除了部分不适用信息，增加了基金募集情况的内容。
（六）第七部分“基金合同的生效”
删除了部分不适用信息，增加了基金合同生效日。
（七）第八部分“基金份额的申购与赎回”
删除了部分不适用信息，增加了开始办理日常申购与赎回业务的日期。
（八）第九部分“基金的投资”
增加“投资组合报告”，并更新为截止至2015年6月30日的数据。
（九）第十部分“基金的业绩”
增加第十五部分“基金的业绩”，并更新为截止至2015年6月30日的数据。

农银汇理基金管理有限公司
二〇一五年十一月二十三日

?

证券代码：002212　　证券简称：南洋股份　　公告编号：2015-080

广东南洋电缆集团股份有限公司
股票交易异常波动的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

一、股票交易异常波动的具体情况

广东南洋电缆集团股份有限公司（以下简称"公司"或"本公司"）股票于2015年11月18日、2015年11月19日、2015年11月20日连续3个交易日收盘价涨幅累计偏离22.49%，根据《深圳证券交易所股票上市规则》的相关规定，属于股票交易异常波动。

二、公司关注并核实的相关情况

1、公司未发现近期公共传媒报道可能或已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

2、截止本公告日，本公司生产经营情况正常。

3、经征询，本公司控股股东不存在关于本公司应披露而未披露的重大事项或处于筹划阶段的重大事项；在本公司股票交易异常波动期间，控股股东及其一致行动人没有买卖本公司股票。

三、不存在应披露而未披露的重大信息的声明

本公司董事会确认：除公司已公开披露的信息外，本公司目前没有任何根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等；董事会也未获悉本公司有根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的、对本公司股票交易价格产生较大影响的信息；本公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

四、上市公司必要的风险提示

1、经自查，本公司不存在违反信息公平披露的情形。

2、截止本公告日，本公司预计2015年财务数据与公司2015年第三季度报告中披露的业绩预告范围不存在差异。

3、本公司指定信息披露媒体为《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），本公司所有信息均以指定媒体刊登的信息为准，请广大投资者理性投资，注意风险。

特此公告

广东南洋电缆集团股份有限公司董事会
二〇一五年十一月二十三日

股票简称：海峡股份　　股票代码：002320　　公告编号：2015-85

海南海峡航运股份有限公司
重大资产重组进展公告

本公司及全体董事会成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

海南海峡航运股份有限公司（简称"公司"）因筹划重大事项，经公司申请，公司股票（证券简称：海峡股份，证券代码：002320）于2015年6月25日下午开市起停牌，公司于2015年6月26日披露了《关于股票停牌的公告》（公告编号 2015-29）。公司于2015年8月25日披露了《重大资产重组停牌公告》（公告编号2015-58），于2015年8月27日，9月3日、10日、14日、21日、28日，10月12日、19日、26日，11月2日、9日、16日披露了《重大资产重组进展公告》（公告编号2015-61、2015-63、2015-64、2015-66、2015-67、2015-69、2015-70、2015-71、2015-74、2015-75、2015-81、2015-84），具体内容详见《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn/）。

公司拟筹划收购航运、港口、供应链管理等资产标的，其中包括拟通过发行股份的方式收购公司控股股东海南港航控股有限公司所持有新海港区汽车客货滚装码头一期工程，其他拟收购标的的工作同时正在进展当中，最终交易金额及交易方式尚未确定。

目前公司聘请江海证券有限公司作为财务顾问，正在对上述重大资产重组事项进行论证，抓紧开展各项工作。因有关事项尚存在不确定性，为了维护广大投资者的利益，避免公司股价异常波动，公司股票（证券简称：海峡股份，证券代码：002320）于 2015年11月23日开市起继续停牌。停牌期间，公司将根据相关规定及时履行信息披露义务，至少每五个交易日发布一次重大资产重组事项进展情况公告，直至相关事项确定并披露有关结果后复牌。

公司筹划的本次重大资产重组事项尚存在不确定性，敬请广大投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告

海南海峡航运股份有限公司
董 事 会
二〇一五年十一月二十三日

证券简称：贵糖股份　　证券代码：000833　　公告编号：2015－080

广西贵糖（集团）股份有限公司董事会
关于发行股份购买资产并募集配套资金的停牌进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，公告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

广西贵糖（集团）股份有限公司（下称"公司"）因筹划发行股份购买资产重大事项，公司股票（证券简称：贵糖股份，证券代码：000833）于2015 年10月19日开市起停牌。2015年11月16日公司在《证券时报》和巨潮资讯网上披露了《关于发行股份购买资产并募集配套资金的停牌公告》（2015-079），公司正在筹划的重大事项为发行股份购买资产并募集配套资金的事项，经公司申请，公司股票继续停牌。

截至本公告日，公司及有关各方正在积极推动本次发行股份购买资产并募集配套资金的各项工作，有关各方就所涉及的相关事项仍在做进一步协商和论证。公司初步确定了拟聘请的独立财务顾问、审计、评估等中介机构。被收购标的的各项尽职调查工作正在加紧进行中。

停牌期间，本公司将协助并督促中介机构加快开展各项工作，并将根据相关规定及时履行信息披露义务，至少每五个交易日发布一次停牌事项进展公告。待相关工作完成后，公司将召开董事会审议本次发行股份购买资产并募集配套资金的相关议案，及时公告并申请复牌。

公司指定的信息披露媒体是《证券时报》和巨潮资讯网，敬请投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告。

广西贵糖（集团）股份有限公司董事会
2015年11月23日

国金基金管理有限公司关于
参加利得基金和积木基金费率优惠的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持，经与上海利得基金销售有限公司（以下简称“利得基金”）和北京乐融多源投资咨询有限公司（以下简称“积木基金”）协商一致，国金基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定旗下基金参加利得基金和积木基金的费率优惠活动。现将具体费率优惠情况公告如下：

一、费率优惠

1、费率优惠内容

自2015年11月25日起，投资者通过利得基金和积木基金申购本公司旗下基金，申购费率不设折扣限制，具体折扣费率以利得基金和积木基金页面公示为准。基金原费率请详见基金合同、招募说明书（更新）等法律文件，以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内，如本公司新增通过利得基金和积木基金销售的基金产品，则自该基金产品开放申购当日起，将同时开通该基金上述费率优惠。

2、费率优惠期限

以利得基金和积木基金官方网站所示公告为准。

二、重要提示

1、本费率优惠仅适用于我司产品在利得基金和积木基金处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费（含定期定额申购业务产生的申购手续费）。

2、本费率优惠仅适用于我司产品在利得基金和积木基金申购业务的手续费，不包括基金赎回、转换业务等其他业务的手续费。

3、费率优惠解释权归利得基金和积木基金所有，有关费率优惠的具体规定如有变化，敬请投资者留意前述销售机构的有关规定。

4、费率优惠期间，业务办理的流程以利得基金和积木基金的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况，请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

机构名称	网址	客服热线
上海利得基金销售有限公司	www.leadbank.com.cn	400-067-6266
北京乐融多源投资咨询有限公司	www.jimufund.com	400-068-1176
国金基金管理有限公司	www.gfund.com	4000-2000-18

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书等法律文件。

特此公告。

国金基金管理有限公司
2015年11月23日