

农银汇理行业成长股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45

§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理行业成长股票型证券投资基金
基金简称	农银行业成长股票
基金主代码	660001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 8 月 4 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	982,932,774.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，重点投资成长性行业，力求为投资者取得长期稳定的资本增值。
投资策略	借助中国经济高速发展的动力，自上而下精选增长预期良好或景气复苏的行业，深入挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上挑选个股，充分分享中国经济快速成长的成果。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+25%×中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种，其风险和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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	汤嵩彦
	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		上海市浦东新区银城路 9	上海市浦东新区银城中路 188

	号农银大厦 50 层	号
邮政编码	200120	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
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	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	1,460,638,027.21
本期利润	1,348,426,311.14
加权平均基金份额本期利润	1.1245
本期加权平均净值利润率	43.43%
本期基金份额净值增长率	58.41%
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	1,833,711,509.17
期末可供分配基金份额利润	1.8656
期末基金资产净值	2,816,644,283.68
期末基金份额净值	2.8656
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	344.55%

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。

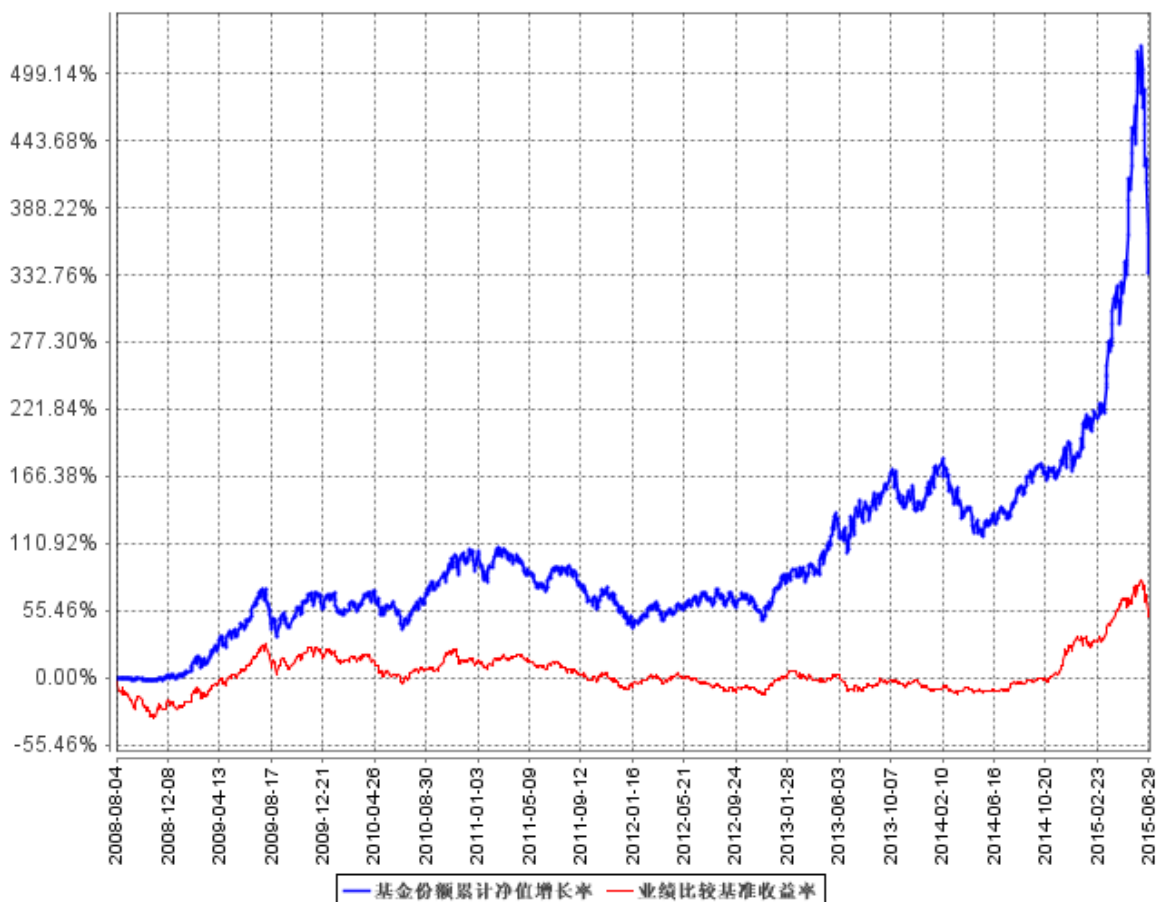
3.2 基金净值表现

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	-19.76%	3.94%	-5.48%	2.63%	-14.28%	1.31%
过去三个月	16.98%	3.17%	8.46%	1.96%	8.52%	1.21%
过去六个月	58.41%	2.54%	20.55%	1.71%	37.86%	0.83%
过去一年	87.56%	1.97%	76.71%	1.39%	10.85%	0.58%
过去三年	169.12%	1.71%	64.37%	1.13%	104.75%	0.58%
自基金合同生效起至今	344.55%	1.55%	58.39%	1.28%	286.16%	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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金主要投资于股票，股票投资比例范围为基金资产的 60%–95%，其中投资于成长性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 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不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2008 年 8 月 4 日起六个月，建仓期满时，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理

资产管理公司出资比例为 33.33%，中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		
郭世凯	本基金基金经理	2014 年 1 月 28 日	-	7	金融学硕士。历任海通证券研究所分析师、农银汇理基金管理有限公司研究员。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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

回顾 15 年整个上半年，在央行充裕的流动性、改革需要牛市的大背景下，再加上居民财富配置的提升，整个 A 股市场展现了一波波澜壮阔的牛市，市场又回到了 07 年全民炒股的时代。我们也一直坚持看好市场的整体表现，认为无论是成长股、主题概念还是蓝筹股都存在绝对收益的机会。

但这轮牛市与以往不同重要一点在于杠杆，场内场外的配资致使市场的波动性急剧加大，而 6 月初开始央行对流动性的微小变化，致使市场由最初的小幅调整，逐步演变成了杠杆不断爆仓清盘，市场暴跌的局面。

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 58.41%，同期业绩比较基准收益率为 20.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。监管

部门的救市努力有助于缓解市场的极端情绪,我们预计将打破杠杆资金负反馈式地持续下跌循环,有助股指企稳回升。

我们判断,长期来看本轮牛市的根基并未动摇,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,在深入研究优秀上市公司的基础上进行配置。

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、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

2015 年上半年度，基金托管人在农银汇理行业成长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

2015 年上半年度，农银汇理基金管理有限公司在农银汇理行业成长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

2015 年上半年度，由农银汇理基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关农银汇理行业成长股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理行业成长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	附注号	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	6.4.7.1	3, 204, 682. 35	27, 811, 240. 56

结算备付金		579,415,372.06	290,371,520.22
存出保证金		5,158,682.50	3,411,153.57
交易性金融资产	6.4.7.2	2,518,227,451.87	2,205,737,605.82
其中：股票投资		2,518,227,451.87	2,205,737,605.82
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	42,634,398.84
应收利息	6.4.7.5	205,345.97	128,623.11
应收股利		-	-
应收申购款		7,546,000.67	2,412,809.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,113,757,535.42	2,572,507,351.49
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		117,291,634.02	41,419,910.42
应付赎回款		158,601,355.30	18,914,460.00
应付管理人报酬		4,711,601.06	3,324,094.57
应付托管费		785,266.87	554,015.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	15,006,907.33	15,638,813.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	716,487.16	477,460.53
负债合计		297,113,251.74	80,328,754.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	982,932,774.51	1,377,674,490.00
未分配利润	6.4.7.10	1,833,711,509.17	1,114,504,107.13
所有者权益合计		2,816,644,283.68	2,492,178,597.13
负债和所有者权益总计		3,113,757,535.42	2,572,507,351.49

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.8656 元，基金份额总额 982,932,774.51 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理行业成长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	附注号	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		1,423,772,830.06	-25,637,366.28
1.利息收入		3,445,188.44	4,965,251.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,439,160.00	4,622,110.27
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		6,028.44	343,140.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,530,511,440.12	239,474,432.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,522,630,746.64	227,768,203.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,880,693.48	11,706,229.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-112,211,716.07	-272,443,978.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,027,917.57	2,366,927.86
减：二、费用		75,346,518.92	48,560,120.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,912,554.97	25,793,778.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,818,759.23	4,298,962.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	48,497,130.73	18,357,071.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	118,073.99	110,307.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,348,426,311.14	-74,197,486.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,348,426,311.14	-74,197,486.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理行业成长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)	1,377,674,490.00	1,114,504,107.13	2,492,178,597.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,348,426,311.14	1,348,426,311.14
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)	-394,741,715.49	-629,218,909.10	-1,023,960,624.59
其中：1.基金申购款	607,769,308.03	1,143,059,470.42	1,750,828,778.45
2.基金赎回款	-1,002,511,023.52	-1,772,278,379.52	-2,774,789,403.04
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)	982,932,774.51	1,833,711,509.17	2,816,644,283.68
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)	2,663,765,973.91	1,598,170,331.46	4,261,936,305.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-74,197,486.36	-74,197,486.36
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)	-606,615,582.23	-438,179,074.39	-1,044,794,656.62
其中：1.基金申购款	858,866,610.62	539,337,148.06	1,398,203,758.68
2.基金赎回款	-1,465,482,192.85	-977,516,222.45	-2,442,998,415.30
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)	2,057,150,391.68	1,085,793,770.71	3,142,944,162.39

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

农银汇理行业成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]784 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 6,843,060,875.61 份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(08)第 0019 号验资报告。《农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2008 年 8 月 4 日正式生效。本基金的管理人为农银汇理基金管理有限公司,托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及于 2012 年 9 月 12 日公告的《农银汇理行业成长股票型证券投资基金招募说明书(更新)》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,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合为:股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%,其中投资于成长性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 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不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准采用:75%×沪深 300 指数+25%×中信标普全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除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。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最

大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

- 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 \times 1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 \times 0.25%的年费率逐日计提。

交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资),基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金方式;

2) 每一基金份额享有同等分配权;

3) 基金当期收益先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

4) 如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配;

5) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多6次;

6) 每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的 20%。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

7) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间及上年度可比期间无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，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》（以下简称“估值处理标准”），本基金自 2015 年 3 月 24 日起，对所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于 2015 年 3 月 24 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操

作，主要税项列示如下：

1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3 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) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	3,204,682.35
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,204,682.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,564,243,314.81	2,518,227,451.87	-46,015,862.94
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券		-	-
基金		-	-
其他		-	-
合计	2,564,243,314.81	2,518,227,451.87	-46,015,862.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	4,911.93
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	198,316.72
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	28.06
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,089.26
合计	205,345.97

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	15,006,542.78
银行间市场应付交易费用	364.55
合计	15,006,907.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	367,310.02
预提费用	99,177.14
合计	716,487.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,377,674,490.00	1,377,674,490.00
本期申购	607,769,308.03	607,769,308.03
本期赎回(以“-”号填列)	-1,002,511,023.52	-1,002,511,023.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	982,932,774.51	982,932,774.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,372,919,564.45	-258,415,457.32	1,114,504,107.13
本期利润	1,460,638,027.21	-112,211,716.07	1,348,426,311.14
本期基金份额交易产生的变动数	-624,768,809.02	-4,450,100.08	-629,218,909.10
其中：基金申购款	1,002,201,143.57	140,858,326.85	1,143,059,470.42
基金赎回款	-1,626,969,952.59	-145,308,426.93	-1,772,278,379.52
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,208,788,782.64	-375,077,273.47	1,833,711,509.17
-----	------------------	-----------------	------------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	83,073.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,318,634.13
其他	37,452.11
合计	3,439,160.00

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	16,312,820,498.58
减：卖出股票成本总额	14,790,189,751.94
买卖股票差价收入	1,522,630,746.64

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,880,693.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,880,693.48

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-112,211,716.07
——股票投资	-112,211,716.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-112,211,716.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,913,581.67
基金转换费收入	114,335.90
合计	2,027,917.57

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	48,497,130.73
银行间市场交易费用	-
合计	48,497,130.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	49,588.57
账户服务费	9,000.00
清算所账户服务费	9,000.00
银行汇划费	696.85
其他	200.00
合计	118,073.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		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	22,912,554.97		25,793,778.06	
其中：支付销售机构的客户维护费	4,002,354.02		4,317,423.29	

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		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	3,818,759.23		4,298,962.96	

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		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
交通银行	3,204,682.35	83,073.76	554,879.82	348,039.84

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600310	桂东电力	2015年6月30日	公告重大事项	31.53	2015年7月13日	34.68	590,640	26,976,669.66	18,622,879.20	-
600654	中安消	2015年6月29日	公告重大事项	30.11	-	-	4,572,617	178,529,705.06	137,681,497.87	-
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	1,639,952	38,482,422.92	46,591,036.32	-
002001	新和成	2015年6月30日	公告重大事项	17.09	2015年7月13日	18.49	4,494,216	120,763,561.35	76,806,151.44	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	公告重大事项	37.29	-	-	1,843,552	44,141,959.77	68,746,054.08	-
002522	浙江众成	2015年6月22日	公告重大事项	26.63	2015年7月13日	27.54	1,948,854	79,623,022.80	51,897,982.02	-
300094	国联水产	2015年6月29日	公告重大事项	30.18	-	-	5,067,402	133,143,671.35	152,934,192.36	-

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	1,034,615	61,853,099.80	55,455,364.00	-
300188	美亚柏科	2015年5月14日	公告重大事项	29.91	-	-	2,636,030	73,831,190.67	78,843,657.30	-
300373	扬杰科技	2015年6月9日	公告重大事项	64.92	2015年7月14日	74.25	662,779	58,097,714.64	43,027,612.68	-
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	873,351	108,898,558.54	126,443,757.78	-
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	566,717	103,190,827.58	119,832,309.65	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常

通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,204,682.35	-	-	-	3,204,682.35
结算备付金	579,415,372.06	-	-	-	579,415,372.06
存出保证金	5,158,682.50	-	-	-	5,158,682.50
交易性金融资产	-	-	-	2,518,227,451.87	2,518,227,451.87
应收利息	-	-	-	205,345.97	205,345.97
应收申购款	17,724.69	-	-	7,528,275.98	7,546,000.67
资产总计	587,796,461.60	-	-	2,525,961,073.82	3,113,757,535.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	117,291,634.02	117,291,634.02
应付赎回款	-	-	-	158,601,355.30	158,601,355.30
应付管理人报酬	-	-	-	4,711,601.06	4,711,601.06
应付托管费	-	-	-	785,266.87	785,266.87
应付交易费用	-	-	-	15,006,907.33	15,006,907.33
其他负债	-	-	-	716,487.16	716,487.16
负债总计	-	-	-	297,113,251.74	297,113,251.74
利率敏感度缺口	587,796,461.60	-	-	2,228,847,822.08	2,816,644,283.68
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	27,811,240.56	-	-	-	27,811,240.56
结算备付金	290,371,520.22	-	-	-	290,371,520.22
存出保证金	3,411,153.57	-	-	-	3,411,153.57
交易性金融资产	-	-	-	2,205,737,605.82	2,205,737,605.82
应收证券清算款	-	-	-	42,634,398.84	42,634,398.84
应收利息	-	-	-	128,623.11	128,623.11
应收申购款	29,688.27	-	-	2,383,121.10	2,412,809.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	321,623,602.62	-	-	2,250,883,748.87	2,572,507,351.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41,419,910.42	41,419,910.42
应付赎回款	-	-	-	18,914,460.00	18,914,460.00
应付管理人报酬	-	-	-	3,324,094.57	3,324,094.57
应付托管费	-	-	-	554,015.77	554,015.77
应付交易费用	-	-	-	15,638,813.07	15,638,813.07
其他负债	-	-	-	477,460.53	477,460.53

负债总计	-	-	-	80,328,754.36	80,328,754.36
利率敏感度缺口	321,623,602.62	-	-	2,170,554,994.51	2,492,178,597.13

上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本基金股票投资比例范围为基金资产的 60% - 95%，其中投资于成长性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 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不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对本基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,518,227,451.87	89.41	2,205,737,605.82	88.51
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,518,227,451.87	89.41	2,205,737,605.82	88.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其它变量不变
----	-----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	130,436,838.35	100,259,117.26
业绩比较基准下降5%	-130,436,838.35	-100,259,117.26	

本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,518,227,451.87	80.87
	其中：股票	2,518,227,451.87	80.87
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	582,620,054.41	18.71
7	其他各项资产	12,910,029.14	0.41
8	合计	3,113,757,535.42	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	192,797,808.36	6.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,495,853,111.22	53.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,622,879.20	0.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	31,372,616.00	1.11

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	667,772,243.09	23.71
J	金融业	111,799,836.00	3.97
K	房地产业	-	-
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	8,958.00	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,518,227,451.87	89.41

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300397	天和防务	1,077,280	194,987,680.00	6.92
2	300094	国联水产	5,067,402	152,934,192.36	5.43
3	600654	中安消	4,572,617	137,681,497.87	4.89
4	300418	昆仑万维	873,351	126,443,757.78	4.49
5	300431	暴风科技	566,717	119,832,309.65	4.25
6	002339	积成电子	3,531,426	117,949,628.40	4.19
7	000587	金叶珠宝	3,928,696	90,870,738.48	3.23
8	002543	万和电气	3,471,892	86,033,483.76	3.05
9	300329	海伦钢琴	2,316,847	81,089,645.00	2.88
10	300188	美亚柏科	2,636,030	78,843,657.30	2.80
11	002001	新和成	4,494,216	76,806,151.44	2.73
12	002418	康盛股份	2,305,749	71,754,908.88	2.55
13	002292	奥飞动漫	1,843,552	68,746,054.08	2.44
14	600446	金证股份	534,890	66,037,519.40	2.34
15	600570	恒生电子	516,781	57,905,311.05	2.06
16	300059	东方财富	908,210	57,298,968.90	2.03

17	601318	中国平安	689,400	56,489,436.00	2.01
18	300018	中元华电	1,243,465	56,204,618.00	2.00
19	300113	顺网科技	1,034,615	55,455,364.00	1.97
20	601166	兴业银行	3,206,400	55,310,400.00	1.96
21	002157	正邦科技	2,989,195	53,357,130.75	1.89
22	002522	浙江众成	1,948,854	51,897,982.02	1.84
23	002664	信质电机	1,377,335	49,597,833.35	1.76
24	300053	欧比特	1,059,469	49,371,255.40	1.75
25	300299	富春通信	1,852,785	49,247,025.30	1.75
26	000700	模塑科技	1,639,952	46,591,036.32	1.65
27	300086	康芝药业	1,673,358	45,180,666.00	1.60
28	300373	扬杰科技	662,779	43,027,612.68	1.53
29	002169	智光电气	1,599,047	42,470,688.32	1.51
30	002657	中科金财	415,612	38,244,616.24	1.36
31	300186	大华农	853,903	37,230,170.80	1.32
32	002456	欧菲光	1,101,408	37,161,505.92	1.32
33	600628	新世界	1,872,992	31,372,616.00	1.11
34	002477	雏鹰农牧	1,537,780	29,525,376.00	1.05
35	300198	纳川股份	2,089,117	27,889,711.95	0.99
36	600310	桂东电力	590,640	18,622,879.20	0.66
37	300010	立思辰	646,480	18,437,609.60	0.65
38	300368	汇金股份	492,844	13,429,999.00	0.48
39	002714	牧原股份	176,000	10,338,240.00	0.37
40	600198	大唐电信	254,500	9,019,480.00	0.32
41	603308	应流股份	210,400	6,152,096.00	0.22
42	002380	科远股份	20,900	1,226,412.00	0.04
43	603268	松发股份	2,110	90,434.60	0.00
44	002376	新北洋	1,938	34,690.20	0.00
45	300025	华星创业	1,053	26,103.87	0.00
46	000888	峨眉山 A	600	8,958.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	379,281,454.79	15.22

2	601318	中国平安	372,126,556.28	14.93
3	000829	天音控股	269,528,634.95	10.81
4	002657	中科金财	263,467,039.42	10.57
5	600446	金证股份	260,483,288.65	10.45
6	601989	中国重工	256,052,875.40	10.27
7	001696	宗申动力	219,282,499.54	8.80
8	600588	用友网络	216,722,881.26	8.70
9	600271	航天信息	207,859,896.49	8.34
10	300094	国联水产	199,150,839.50	7.99
11	600654	中安消	193,385,651.40	7.76
12	300178	腾邦国际	183,950,158.67	7.38
13	601688	华泰证券	182,609,661.60	7.33
14	300397	天和防务	180,576,960.92	7.25
15	600048	保利地产	168,692,468.27	6.77
16	601788	光大证券	163,518,009.51	6.56
17	601628	中国人寿	160,642,295.15	6.45
18	601336	新华保险	152,642,137.06	6.12
19	300373	扬杰科技	149,106,977.40	5.98
20	300018	中元华电	146,732,069.41	5.89
21	002001	新 和 成	146,038,020.75	5.86
22	300025	华星创业	138,198,508.95	5.55
23	600770	综艺股份	132,466,243.75	5.32
24	600259	广晟有色	132,297,593.79	5.31
25	300392	腾信股份	128,617,806.89	5.16
26	600112	天成控股	125,255,505.84	5.03
27	002236	大华股份	123,831,276.20	4.97
28	002400	省广股份	123,643,056.21	4.96
29	300086	康芝药业	122,126,751.11	4.90
30	600570	恒生电子	118,624,162.20	4.76
31	002339	积成电子	116,007,317.18	4.65
32	002376	新北洋	115,921,499.43	4.65
33	300226	上海钢联	115,085,592.29	4.62
34	300431	暴风科技	115,044,579.76	4.62
35	000587	金叶珠宝	111,961,871.71	4.49
36	600029	南方航空	110,803,884.95	4.45
37	300418	昆仑万维	108,898,558.54	4.37

38	600180	瑞茂通	107,092,790.70	4.30
39	000831	五矿稀土	105,629,735.73	4.24
40	300356	光一科技	104,796,872.35	4.21
41	603555	贵人鸟	104,021,659.50	4.17
42	000997	新大陆	103,013,992.38	4.13
43	300329	海伦钢琴	102,261,481.98	4.10
44	002543	万和电气	102,000,624.70	4.09
45	600079	人福医药	100,518,519.62	4.03
46	300147	香雪制药	98,963,303.55	3.97
47	600687	刚泰控股	97,309,735.56	3.90
48	002649	博彦科技	96,930,062.41	3.89
49	000998	隆平高科	96,644,691.94	3.88
50	300273	和佳股份	96,206,395.51	3.86
51	300059	东方财富	96,071,776.38	3.85
52	600999	招商证券	94,051,024.70	3.77
53	601377	兴业证券	93,518,577.66	3.75
54	300372	欣泰电气	93,515,614.95	3.75
55	600582	天地科技	91,848,240.00	3.69
56	300028	金亚科技	85,082,472.76	3.41
57	002284	亚太股份	83,103,297.76	3.33
58	300155	安居宝	82,660,017.57	3.32
59	300053	欧比特	81,520,611.80	3.27
60	002065	东华软件	81,033,245.73	3.25
61	600643	爱建股份	80,369,751.22	3.22
62	300299	富春通信	80,218,153.84	3.22
63	002522	浙江众成	79,623,022.80	3.19
64	002664	信质电机	78,020,866.02	3.13
65	300248	新开普	77,529,996.25	3.11
66	600028	中国石化	77,256,614.35	3.10
67	600153	建发股份	76,618,490.02	3.07
68	300188	美亚柏科	75,903,818.11	3.05
69	600682	南京新百	74,142,534.92	2.98
70	300274	阳光电源	73,220,349.67	2.94
71	600547	山东黄金	72,643,769.73	2.91
72	300253	卫宁软件	72,425,452.16	2.91
73	600310	桂东电力	71,850,319.92	2.88

74	601169	北京银行	71,240,617.74	2.86
75	002363	隆基机械	70,075,813.00	2.81
76	601000	唐山港	69,538,121.31	2.79
77	002115	三维通信	66,837,897.75	2.68
78	002214	大立科技	65,360,293.81	2.62
79	002108	沧州明珠	65,333,647.77	2.62
80	002292	奥飞动漫	65,327,587.30	2.62
81	002213	特尔佳	64,786,359.79	2.60
82	601700	风范股份	64,387,695.41	2.58
83	002402	和而泰	63,142,275.19	2.53
84	300378	鼎捷软件	63,023,488.57	2.53
85	300295	三六五网	62,169,220.27	2.49
86	300006	莱美药业	61,940,673.66	2.49
87	300113	顺网科技	61,853,099.80	2.48
88	300075	数字政通	60,825,189.66	2.44
89	002642	荣之联	60,039,329.00	2.41
90	002189	利达光电	59,785,995.02	2.40
91	600312	平高电气	59,373,944.59	2.38
92	300333	兆日科技	59,236,771.60	2.38
93	300010	立思辰	59,034,126.32	2.37
94	600420	现代制药	58,278,704.98	2.34
95	002052	同洲电子	58,275,591.11	2.34
96	300246	宝莱特	57,792,969.83	2.32
97	600399	抚顺特钢	57,607,977.59	2.31
98	600391	成发科技	55,464,356.27	2.23
99	002157	正邦科技	54,769,433.94	2.20
100	600415	小商品城	54,606,401.42	2.19
101	002244	滨江集团	54,117,903.69	2.17
102	600277	亿利能源	53,645,406.29	2.15
103	300005	探路者	53,253,854.71	2.14
104	600704	物产中大	53,134,502.36	2.13
105	600436	片仔癀	53,005,375.75	2.13
106	002311	海大集团	52,636,056.18	2.11
107	601021	春秋航空	51,623,462.42	2.07
108	002022	科华生物	51,302,033.83	2.06
109	300183	东软载波	51,229,375.60	2.06

110	000970	中科三环	50,705,659.61	2.03
111	002488	金固股份	50,539,907.62	2.03
112	600115	东方航空	50,152,794.02	2.01
113	002350	北京科锐	50,030,113.03	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超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	601318	中国平安	443,794,225.26	17.81
2	601166	兴业银行	401,516,134.14	16.11
3	002657	中科金财	347,278,784.20	13.93
4	600588	用友网络	325,967,499.10	13.08
5	000829	天音控股	311,043,836.96	12.48
6	601989	中国重工	304,381,330.52	12.21
7	001696	宗申动力	300,052,220.90	12.04
8	600446	金证股份	286,076,588.61	11.48
9	600271	航天信息	268,834,424.02	10.79
10	600048	保利地产	241,177,925.62	9.68
11	300178	腾邦国际	230,095,752.17	9.23
12	601628	中国人寿	208,254,115.93	8.36
13	601336	新华保险	205,390,830.04	8.24
14	000831	五矿稀土	188,208,810.76	7.55
15	600259	广晟有色	186,081,694.59	7.47
16	300392	腾信股份	183,610,408.04	7.37
17	000997	新大陆	176,523,391.54	7.08
18	601688	华泰证券	175,109,858.97	7.03
19	601788	光大证券	169,721,126.95	6.81
20	600770	综艺股份	169,529,284.33	6.80
21	300147	香雪制药	156,938,214.72	6.30
22	600180	瑞茂通	139,196,620.01	5.59
23	300356	光一科技	133,535,331.23	5.36
24	300028	金亚科技	130,871,634.41	5.25
25	002236	大华股份	130,165,762.59	5.22
26	002400	省广股份	128,081,653.23	5.14
27	600029	南方航空	126,041,337.11	5.06
28	000540	中天城投	121,675,367.43	4.88

29	600112	天成控股	118,974,359.69	4.77
30	002284	亚太股份	115,989,036.68	4.65
31	002649	博彦科技	112,790,149.99	4.53
32	300373	扬杰科技	110,427,404.12	4.43
33	300273	和佳股份	110,393,540.57	4.43
34	300333	兆日科技	109,679,558.56	4.40
35	300025	华星创业	108,925,116.47	4.37
36	300226	上海钢联	108,855,088.20	4.37
37	002009	天奇股份	108,612,772.79	4.36
38	600682	南京新百	108,299,948.54	4.35
39	600079	人福医药	108,057,780.43	4.34
40	300253	卫宁软件	106,819,192.71	4.29
41	300010	立思辰	106,187,589.41	4.26
42	601169	北京银行	105,151,843.06	4.22
43	000998	隆平高科	104,615,588.03	4.20
44	601377	兴业证券	101,030,992.91	4.05
45	601700	风范股份	100,432,840.66	4.03
46	002376	新北洋	98,758,247.96	3.96
47	600582	天地科技	98,714,593.64	3.96
48	002358	森源电气	97,581,815.58	3.92
49	601668	中国建筑	96,793,869.13	3.88
50	600687	刚泰控股	96,617,715.03	3.88
51	600999	招商证券	95,484,489.27	3.83
52	300018	中元华电	94,891,729.31	3.81
53	000001	平安银行	93,220,849.58	3.74
54	603555	贵人鸟	92,966,071.63	3.73
55	300086	康芝药业	91,798,644.71	3.68
56	300372	欣泰电气	89,444,758.15	3.59
57	600643	爱建股份	88,559,900.36	3.55
58	601988	中国银行	86,749,430.98	3.48
59	600153	建发股份	85,853,431.85	3.44
60	002065	东华软件	84,683,491.97	3.40
61	300155	安居宝	83,462,604.55	3.35
62	002363	隆基机械	80,868,993.49	3.24
63	002496	辉丰股份	79,404,423.13	3.19
64	600028	中国石化	79,185,067.62	3.18
65	300295	三六五网	77,524,860.55	3.11
66	300094	国联水产	76,849,326.56	3.08

67	600547	山东黄金	75,430,227.79	3.03
68	300368	汇金股份	74,329,525.55	2.98
69	002171	楚江新材	73,820,483.18	2.96
70	300053	欧比特	71,449,177.82	2.87
71	000002	万科A	71,441,508.73	2.87
72	600570	恒生电子	71,316,881.75	2.86
73	300248	新开普	70,865,379.73	2.84
74	002068	黑猫股份	70,651,855.01	2.83
75	002488	金固股份	70,166,949.33	2.82
76	601000	唐山港	69,960,864.51	2.81
77	300075	数字政通	68,270,257.06	2.74
78	002108	沧州明珠	67,777,503.17	2.72
79	300274	阳光电源	67,726,538.74	2.72
80	600115	东方航空	64,440,350.10	2.59
81	600391	成发科技	64,239,831.11	2.58
82	002642	荣之联	64,165,291.00	2.57
83	002213	特尔佳	62,612,316.86	2.51
84	300378	鼎捷软件	62,535,137.04	2.51
85	002311	海大集团	62,508,083.83	2.51
86	002432	九安医疗	61,895,987.11	2.48
87	600415	小商品城	61,549,454.35	2.47
88	002115	三维通信	61,136,959.56	2.45
89	002117	东港股份	60,944,612.32	2.45
90	600312	平高电气	60,490,642.17	2.43
91	002285	世联行	60,392,005.08	2.42
92	002052	同洲电子	60,248,713.20	2.42
93	002244	滨江集团	60,042,700.73	2.41
94	300005	探路者	59,691,019.72	2.40
95	002214	大立科技	59,457,408.32	2.39
96	300207	欣旺达	58,997,441.00	2.37
97	600704	物产中大	58,799,224.14	2.36
98	002318	久立特材	58,149,974.71	2.33
99	300144	宋城演艺	58,005,183.49	2.33
100	600420	现代制药	57,855,932.76	2.32
101	002189	利达光电	56,127,036.97	2.25
102	600212	江泉实业	55,887,095.31	2.24
103	300183	东软载波	55,745,918.72	2.24
104	600436	片仔癀	55,673,766.76	2.23

105	002402	和而泰	54,203,667.72	2.17
106	600518	康美药业	53,741,693.81	2.16
107	000625	长安汽车	53,675,525.38	2.15
108	300006	莱美药业	53,550,305.58	2.15
109	600399	抚顺特钢	53,270,085.51	2.14
110	600277	亿利能源	52,895,037.53	2.12
111	600310	桂东电力	52,512,662.19	2.11
112	002350	北京科锐	52,484,014.34	2.11
113	002364	中恒电气	51,747,989.83	2.08
114	600280	中央商场	51,731,155.38	2.08
115	601021	春秋航空	51,444,553.86	2.06
116	000970	中科三环	51,263,653.59	2.06
117	300013	新宁物流	51,170,972.55	2.05
118	002089	新海宜	50,263,452.46	2.02
119	600061	国投安信	49,984,808.25	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	15,214,891,314.06
卖出股票收入（成交）总额	16,312,820,498.58

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	5,158,682.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	205,345.97
5	应收申购款	7,546,000.67
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,910,029.14

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	300094	国联水产	152,934,192.36	5.43	公告重大事项
2	600654	中安消	137,681,497.87	4.89	公告重大事项
3	300418	昆仑万维	126,443,757.78	4.49	公告重大事项
4	300431	暴风科技	119,832,309.70	4.25	公告重大事项
5	300188	美亚柏科	78,843,657.30	2.80	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
233,303	4,213.12	16,052,572.98	1.63%	966,880,201.53	98.37%

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	742,511.10	0.0755%

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	0~10
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（2008年8月4日）基金份额总额	6,843,060,875.61
本报告期期初基金份额总额	1,377,674,490.00
本报告期基金总申购份额	607,769,308.03
减：本报告期基金总赎回份额	1,002,511,023.52
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	982,932,774.51

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	
招商证券	2	4,706,968,636.66	14.93%	4,285,229.03	14.93%	-
中信证券	2	4,024,185,320.09	12.77%	3,663,609.85	12.77%	-
银河证券	1	3,073,690,689.14	9.75%	2,798,289.87	9.75%	-
安信证券	2	2,939,178,548.99	9.32%	2,675,827.69	9.32%	-
中信建投	1	2,672,031,274.87	8.48%	2,432,621.70	8.48%	-
华创证券	2	2,378,982,539.65	7.55%	2,165,822.55	7.55%	-
平安证券	1	2,336,027,799.80	7.41%	2,126,727.28	7.41%	-
联合证券	1	2,160,203,273.90	6.85%	1,966,652.07	6.85%	-
方正证券	2	2,104,768,731.65	6.68%	1,916,180.18	6.68%	-
长江证券	2	1,735,887,750.16	5.51%	1,580,351.07	5.51%	-
东方证券	1	1,440,593,976.24	4.57%	1,311,508.08	4.57%	-
海通证券	2	1,284,330,884.94	4.07%	1,169,254.24	4.07%	-
光大证券	1	259,525,680.36	0.82%	236,271.68	0.82%	-
国泰君安	2	186,261,659.37	0.59%	169,570.94	0.59%	-
中金公司	2	109,654,966.02	0.35%	99,829.89	0.35%	-
申银万国	1	109,496,898.65	0.35%	99,685.96	0.35%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件：

- (1) 实力雄厚, 注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2) 市场形象及财务状况良好。
- (3) 经营行为规范, 内控制度健全, 最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (4) 内部管理规范、严格, 具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (5) 研究实力较强, 具有专门的研究机构和专职研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2014 年年度资产净值公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 1 日
2	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
3	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 20 日
4	农银汇理行业成长股票型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 21 日
5	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 21 日
6	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 1 月 23 日

	的公告		
7	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
8	农银行业成长股票一招募说明书更新—2015 年第 1 次	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 3 月 18 日
9	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
10	农银汇理行业成长股票型证券投资基金 2014 年度报告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
11	农银汇理行业成长股票型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 4 月 20 日
12	关于工商银行开通农银汇理基金转换业务日期的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 6 月 3 日

§ 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‘农银汇理行业成长股票型证券投资基金’变更为‘农银汇理行业成长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。

§ 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、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理行业成长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

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日