

农银汇理中小盘混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金托管人:农银汇理基金管理有限公司

基金代销机构:中银国际证券股份有限公司

报告送出日期:2016年1月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人对本基金定期报告、中期报告、年度报告等文本内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售代理人承认以诚信信用，勤勉尽责的原则履行基金销售职责，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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司在财务报告中对本基金的财务状况进行了全面评估。

本基金报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:农银中小盘混合

交易代码:660006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年3月26日

报告期末基金份额总额:646,800,046.76份

投资目标:精选具有良好成长潜力的中小板股票，在严格控制风险的前提下运用积极主动的管理手段，以充分分享中小市值上市公司带来的投资收益。

投资策略:本基金主要投资于具有良好成长潜力的中小板股票，在严格控制风险的前提下运用积极主动的管理手段，以充分分享中小市值上市公司带来的投资收益。

业绩比较基准:中证中小板指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%

风险收益特征:本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日) 106,341,467.96

本期现金收益 收益 516,119,396.28

加权平均基金份额本期利润 0.9540

期末基金份额净值 1,928,611,006.23

期末总资产净值 2,981.67

注:1.本公司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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所列基金业报酬率包括持有人买入或卖出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.基金净值表现

与同期行业比较基准收益的比较

3.21 报告期内基金份额净值增长率为负值且与同期行业比较基准收益变动的比较

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 002224 三力士 4,621,600 100,381,152.00 5.20

2 600595 大连圣亚 1,902,293 97,758,837.27 5.07

3 002474 森源电气 3,847,777 92,194,256.15 4.78

4 002137 铁汉生态 3,569,410 82,396,430.00 4.27

5 600271 航天信息 967,041 68,300,149.06 3.56

6 002717 岭南园林 1,393,800 61,187,820.00 3.17

7 002123 荣信股份 2,132,039 64,690,800.35 2.84

8 300339 高能环境 1,113,300 53,460,660.00 2.77

9 002122 云海金属 3,138,017 50,584,834.04 2.62

10 300295 国瓷科技 1,024,769 48,238,976.03 2.50

5.4 报告期根据品种类型的基金资产投资组合

本基金的报告期末持有债券。

5.5 报告期根据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

本基金的报告期末未持有债券。

5.6 报告期根据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

本基金的报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期根据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

本基金的报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期根据公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及权证投资组合

本基金的报告期末未持有权证。

5.9 报告期根据公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金的报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期根据公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金的报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

本基金的报告期末无特别说明。

5.12 公平交易专项说明

报告期内，本基金基金经理严格执行了《证券投资基金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，通过设置不同账户等方式各环节严格控制公平交易执行，确保旗下管理的所有投资组合公平对待。

5.13 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

5.14 报告期内未持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金的报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.15 报告期末未名前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期内，所有投资组合均与交易对手所约定的交货时间向反向交易较少的单边交易量未超过该证券当日报量的5%。

5.16 报告期内基金的投资组合情况说明

本基金的报告期末净资产增长率为-26.26%，同期业绩比较基准收益率增长率为17.46%。

5.17 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金的报告期末不存在违反法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、

勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

5.18 公平交易专项说明

报告期内，本基金基金经理严格执行了《证券投资基金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，通过设置不同账户等方式各环节严格控制公平交易执行，确保旗下管理的所有投资组合公平对待。

5.19 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

5.20 报告期内基金的费用情况说明

本基金的报告期末未出现应收申购款余额或应付赎回款余额为零的情况。

5.21 报告期内基金的利润分配情况说明

本基金的报告期末未进行利润分配。

5.22 报告期内基金的组合类金融产品投资情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.23 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.24 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.25 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.26 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.27 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.28 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.29 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.30 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.31 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.32 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.33 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.34 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.35 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.36 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.37 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.38 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.39 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.40 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.41 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.42 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.43 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.44 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.45 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.46 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.47 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.48 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.49 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.50 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.51 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.52 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.53 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.54 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.55 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.56 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.57 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.58 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.59 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.60 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.61 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况

本基金的报告期末未持有组合类金融产品。

5.62 报告期内基金的组合类金融产品投资的偏离度情况