

# 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  
报告送出日期：2016年1月21日

§1 重要提示  
基金管理人的董事会及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责任。  
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2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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、勤勉尽责的原则履行管理和运用基金资产义务，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自2015年10月1日起至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	600060
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2010年3月26日
报告期末基金份额总额	646,308,046.76份
投资目标	精选优质个股，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实现基金资产的增值，以充分分享中小市值上市公司成长所带来的增值收益。
投资策略	本基金在投资上遵循“自下而上”和“自下而上”相结合的方法进行股票投资。基金管理人将自下而上地选择股票资产，在中小盘股票中挑选具有良好成长潜力的个股，在基本面、估值、成长性、流动性等方面进行综合考量，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×70%+中证全指指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于股票型基金、债券型基金。
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	
3.1 主要财务指标	
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）
1.本期已实现收益	106,341,467.96
2.本期利润	516,119,886.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.8040
4.期末基金资产净值	1,026,611,006.23
5.期末基金份额净值	2.0817

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。  
2.本期基金净值增长率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率水平要低于所列数字。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	40.26%	2.17%	17.46%	1.51%	22.80%	0.66%

注：1.本基金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  
2.本基金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



3.2.2 自基金合同生效以来基金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  
本基金自2010年3月26日成立以来的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。本基金自成立以来，净值增长率一直高于业绩比较基准收益率，说明本基金的投资策略是有效的。



4.1 基金管理人（或基金托管人）简介  
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

姓名	职务	任本基金基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
付刚	本基金基金经理、农银汇理基金管理有限公司投资部总经理	2013年3月5日 -	9	会计专业，具有基金从业资格，从事证券行业多年，曾任农银汇理基金管理有限公司投资部总经理，现任农银汇理基金管理有限公司投资部总经理。
谢朝晖	本基金基金经理	2015年3月3日	4	工学硕士，历任交通银行基金部研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理，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  
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，恪尽职守，勤勉尽责，安全合规地开展管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度的执行和监控情况  
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，通过系统化工人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。  
报告期内，所有投资组合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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析  
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，通过系统化工人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。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

4.4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
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，通过系统化工人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。

序号	项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	1,699,037,820.96	86.01
2	其中：股票	1,699,037,820.96	86.01
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	270,877,730.43	13.71
11	其他资产	5,468,282.76	0.28
12	合计	1,975,373,848.14	100.00

代码	行业名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、渔、业	16,318,150.00	0.85
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,030,378,628.52	53.43
D	电力、热力、燃气及生产供应业	14,000,740.00	0.77
E	建筑业	61,187,020.00	3.17
F	批发和零售业	22,064,144.00	1.45
G	交通运输、仓储和邮政业	28,097,011.99	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,853,88.28	14.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,088,036.10	4.57
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	97,761,739.27	5.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育、卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	62,411,612.00	2.72
R	综合	-	-
合计		1,699,037,820.96	86.01

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	000224	三力士	4,621,600	100,381,162.00	5.20
2	600240	大佳士	1,902,263	97,768,827.27	5.07
3	002474	顺祥股份	3,847,777	92,154,263.16	4.78
4	002127	麦迪数字	3,582,410	82,389,420.00	4.27
5	600271	航发信息	957,041	68,390,149.86	3.56
6	002717	岭南园林	1,383,840	61,187,020.00	3.17
7	002125	荣信股份	2,132,028	54,688,896.28	2.84
8	300228	耀客股份	1,113,200	63,469,896.00	2.77
9	002162	宗申动力	3,138,017	50,584,804.04	2.62
10	300299	雷尚通信	1,024,769	48,236,876.63	2.50

5.4 报告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。

5.5 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  
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
5.9.1 报告期内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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
5.10.1 本期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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注  
5.11.1 投资组合报告附注  
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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 投资组合报告附注  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 投资组合报告附注  
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.4 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.5 报告期末前十名股票公允价值变动情况的说明  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.7 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.8 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.9 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.10 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.11 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.12 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.13 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.14 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.15 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.16 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.17 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.18 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.19 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.20 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.21 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.22 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.23 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.24 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.25 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.26 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.27 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.28 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.29 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.30 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.31 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.32 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.33 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

5.11.34 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股票投资明细  
本基金本报告期末未持有股票。

# 农银汇理中证500指数证券投资基金

## 2015 第四季度报告

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  
报告送出日期：2016年1月21日

§1 重要提示  
基金管理人的董事会及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责任。  
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2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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、勤勉尽责的原则履行管理和运用基金资产义务，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	农银中证500指数
交易代码	600011
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2011年11月29日
报告期末基金份额总额	49,013,000.02份
投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律和数量化的风险管理，力争基金净值收益率长期稳定地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将采用完全复制法跟踪标的指数的成分股及其权重进行投资以拟合标的指数的收益表现。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+中证500指数×5%×同期银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为被动化投资，跟踪标的指数的股票型基金，其风险收益水平高于货币型基金，低于股票型基金和混合型基金。
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  
3.1 主要财务指标  
单位：人民币元

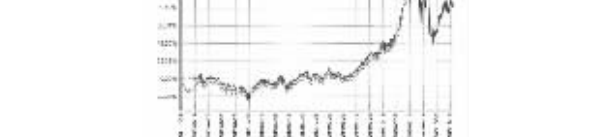
主要财务指标	报告期（2015年10月1日 - 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	2,680,490.50
2.本期利润	10,974,617.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2824
4.期末基金资产净值	94,017,581.42

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。  
2.本期基金净值增长率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率水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现  
3.2.1 本报告期末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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.34%	1.80%	23.13%	0.94%	1.21%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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  
本基金自2011年11月29日成立以来的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较。本基金自成立以来，净值增长率一直高于业绩比较基准收益率，说明本基金的投资策略是有效的。



本基金投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产的95%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-10%，其中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后（2011年11月29日）起六个月，建仓期间内，本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

4.1 基金管理人（或基金托管人）简介  
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

宋永安	本基金基金经理	2014年2月10日	-	8	硕士,具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。
-----	---------	------------	---	---	--