农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31日
基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期日2016年5月4日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	农银物联网混合
基金主代码	002191
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年5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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	203,849,289.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极把握物联网主题的投资机会,精选受益于万物互联大趋势的相关上市公司,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。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金基于对宏观经济、政策面、市场资金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在股票、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 本基金主要投资物联网主题相关上市公司,并将定性分析和定量分析相结合,对获利公司质量和增长潜力的指标进行综合评估,甄选成长空间大的物联网主题上市公司。 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,以期实现收益。 4.权证投资策略 本基金将以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权证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。 5.资指期货投资策略 本基金将根据资指期货投资中所通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用跟动性好、交易活跃的期货合约,并优分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,主要遵循避险和有效管理两项基础原则:1)避险,在市场风险大幅累积时,减小基金投资组合资产的不了解风险变化的市场风险;2)有效管理,利用股指期货成功交易,以期实现基金管理人的目的。
业绩比较基准	中证800指数×65%+中证全债指数×35%
风险收益特征	本基金为股票型基金,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、债券型基金、低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	霍俊伟	郭明
	联系电话	021-61009588	010-66105799
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61009599	95588
传真		021-61009556	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年5月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日	2015年	2014年
本期已实现收益	-12,092,889.78	-	-
本期利润	-10,155,868.48	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0399	-	-
本期加权平均净值利润率	-4.02%	-	-
本期基金份额净值增长率	-4.92%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	-10,755,362.06	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0528	-	-
期末基金资产净值	193,816,022.38	-	-
期末基金份额净值	0.9508	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	-4.92%	-	-

注:1.本基金的基金合同于2016年5月4日生效,至2016年12月31日不满一年。

2.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。

3.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。

4.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12月31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
过去三个月	-2.99%	0.59%	-0.01%	0.48%	-2.98%	0.11%
过去六个月	-5.87%	0.57%	2.89%	0.51%	-8.76%	0.06%
自基金合同生效起至今	-4.92%	0.52%	2.31%	0.59%	-7.23%	-0.07%

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