农银汇理现代农业加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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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。

本报告期自 2016 年 1 月 29 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	农银现代农业加灵活
基金主代码	001940
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月29日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,655,234.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入研究现代农业发展的趋动因以及农业产业和科技不断渗透和融合的发展新空间,精选上市公司,在产业链和风险收益比较成功胜出的前提下,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、市场参与因素的综合分析,结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征和趋势的研究,形成对各类投资产未来表现的预期,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 (1)"现代农业加"主题的界定 现代农业是以现代科学技术、现代工业装备以及现代经营理念在农业领域的运用。现代农业加"的界定:中国基金业协会(以下简称"中国基金业协会")将现代农业定义为现代农业产业和新技术新业态相融合的发展新空间,精选在产业链和风险收益比较成功胜出的上市公司。 (2)行业配置策略 按照"现代农业加"主题相关上市公司所提供的产品与服务类别不同,可划分为不同的细分子行业,本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素,进行股票资产的"现代农业加"各细分子行业间动态配置。 (3)个股精选策略 在细分子行业配置的基础上,本基金将定性研究方法和定量研究方法相结合,对"现代农业加"相关上市公司的投资价值进行综合评估,精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的。 3.债券投资策略 本基金将在经济周期识别优化资产配置的基础上,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。本基金将根据投资策略主要采取久期预计利率水平,灵活调整组合久期,科学配置投资品种,通过品种分散和个券的策略。 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、权证综合波动率等多个角度对股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。
业绩比较基准	中证大农业指数× 65%+中证全债指数× 35%。
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、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	戴曦东	田春
	联系电话	021-61095588	010- 67595096
	电子邮箱	lijianfeng@abc- caom	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021- 61095599	010- 67595096
传真		021- 61095556	010- 66275853

2.4 信息披露方式

信息披露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1月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日	2015年	2014年
本期已实现收益	12,903,269.77	-	-
本期利润	12,028,231.94	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0274	-	-
本期加权平均净值利润率	2.71%	-	-
本期基金份额净值增长率	0.93%	-	-
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	2,255,106.40	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0093	-	-
期末基金资产净值	245,910,340.40	-	-
期末基金份额净值	1.0093	-	-
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	0.93%	-	-

注:1、本基的基金合同于 2016 年 1 月 29 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①1	份额净值增长率标准差②2	业绩比较基准收益率③3	业绩比较基准收益率标准差④4	①-③	②-④
过去三个月	-1.42%	0.64%	0.31%	0.52%	-1.73%	0.12%
过去六个月	-1.58%	0.58%	1.21%	0.57%	-2.79%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.46%	7.04%	0.89%	-6.11%	-0.43%

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