

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:2013年1月21日

重要提示
基金管理人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2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,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。

本报告自2012年10月1日起至12月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金简称, 交易代码, etc.) and Value (农银大盘蓝筹股票, 660006, etc.)

业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。

风险收益特征

本基金为大盘蓝筹股票型证券投资基金,是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。

基金管理人 基金托管人

农银汇理基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (主要财务指标) and Value (报告期(2012年10月1日-2012年12月31日))

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。

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益差④, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金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@农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 2010年9月1日至2012年12月31日



注:本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票资产的80%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的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投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为自2010年9月1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。

4.1 基金经理 或基金经理小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限(任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明

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,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,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,根据指数化投资流程和定量分析,进行了日常运作操作。报告期内基金日均跟踪误差为0.0256%,日均偏离度为0.0156%,符合基金合同约定规定的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在不超过4%。报告期内基金的投资策略和业绩表现说明如下:1)市场整体表现;2)行业轮动的表现;3)个股表现;4)基金资产净值。

本基金作为一只投资于沪深300指数的被动化投资产品,我们将坚持指数化投资策略,运用定量分析工具,在各行业板块轮动造成冲击时,把基金的跟踪误差控制在较低水平,从而为投资者提供一个标准的投资投资工具。

4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.7834元,本报告期基金份额净值增长率为9.66%,业绩比较基准收益率为9.53%。

投资组合报告

3.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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十名资产支持证券投资明细

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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金

2012 第四季度报告

并对新型城镇化相关板块如地产、水泥、工程机械等进行了布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末基金份额净值增长4.41%,同期业绩比较基准收益率为7.68%。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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十名资产支持证券投资明细

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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.52 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.53 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.56 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.57 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.59 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.60 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.61 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.63 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

农银汇理中小盘股票型证券投资基金

2012 第四季度报告

并对新型城镇化相关板块如地产、水泥、工程机械等进行了布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末基金份额净值增长4.41%,同期业绩比较基准收益率为7.68%。

投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 3 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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十名资产支持证券投资明细

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权证投资明细

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.8.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 流通受限部分的公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.30 报告期末前十名股票