

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2013年3月5日9时

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的董事、监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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月2日复核了该报告，并对基金的投资组合情况、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，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述、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。投资人认购、投资本基金，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。

本年度报告摘要节录自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:农银汇理策略精选股票型证券投资基金

基金主代码:660010

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年9月6日

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告期末基金份额总额:424,264,687.01份

基金合同存续期间:不定期

2.2 基金产品说明

本基金为积极投资组合经风险调整后的超额收益为目标，通过定量和定性两种投资策略的有效结合，力争为基金份额创造超越业绩基准的绝对回报。

本基金将通过基金管理人在数量化投资方面的积累，以长期投资理念为基础，结合长期投资经验，形成有效的投资策略，在充分分散风险的基础上，力争为投资者创造超越业绩基准的绝对回报。

本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。

本基金为较高风险、较高预期收益的股票型基金产品，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人员和基金托管人

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 中信银行股份有限公司

姓名 翟爱东 朱义明

信息披露负责人 联系电话 021-61095588 (010)65556899

电子邮件 hejinlong@abc-ca.com zhuyiming@ctiechink.com

客户服务电话 021-61095599 95558

传真 021-61095556 (010)65550847

2.4 信息披露方式

登载本基金年度报告摘要的管理人互联网网址 http://www.abc-ca.com

基金年度报告备置地点 上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7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 2012年 2011年9月6日(基金合同生效日)-2011年12月31日 2010年

本期已实现收益 -45,246,160.23 -73,636,659.50 -

本期平均基金份额本期利润 45,747,454.92 -68,670,723.48 -

加权平均基金份额本期利润 0.0851 -0.0563 -

本期平均净值增长率 8.87% -5.66% -

本期基金份额净值增长率 1.46% -7.01% -

3.1.2 期末数据和指标 2012年末 2011年末 2010年末

期末可供分配利润 -47,269,213.27 -63,774,981.03 -

期末可供分配基金份额利润 -0.114 -0.0701 -

期末资产净值 400,271,850.59 845,385,338.67 -

期末基金份额净值 0.9435 0.9299 -

3.1.3 期末未指定期 2012年末 2011年末 2010年末

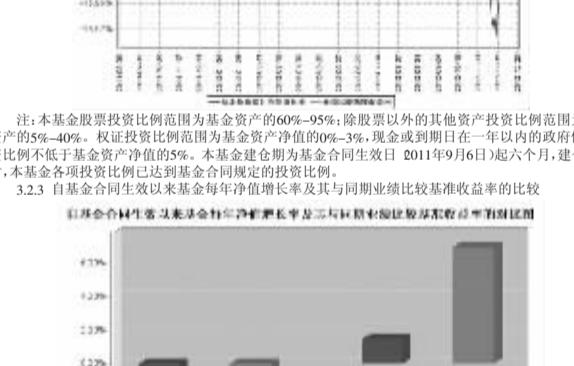
基金份额累计净值增长率 -5.65% -7.01% -

注:1.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期已实现收入加上本期公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期可供分配包括持有人认购或申购基金时产生的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所述基金绩效指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.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”均指报告期最后一日,即12月31日。
4.本基金的基金合同于2011年9月6日生效,上年度实际报告期为2011年9月6日至2011年12月31日。
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.89%	1.21%	7.68%	0.96%	-5.79%	0.25%
过去六个月	-3.80%	1.16%	2.15%	0.93%	-5.95%	0.23%
过去一年	1.46%	1.22%	6.94%	0.96%	-5.48%	0.26%
自基金合同生效起至今	-5.65%	1.10%	-3.55%	0.98%	-2.10%	0.12%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金投资比例范围为基金资产的60%-95%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-40%。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内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金在基金合同生效日 2011年9月6日起六个月,建仓期内及时,本基金投资比例已达至基金合同规定的投资比例。

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其主要负责人的基本情况

农银汇理基金管理有限公司成立于2008年3月18日,是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币1亿元,其中中国农业银行股份有限公司出资比例为51.67%,东方汇理资产管理有限公司出资比例为33.33%,中国农业银行的有限公司出资比例为15%。公司办公地址为上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场一层,公司法定代表人为董事长翟爱东先生。

4.1.2 基金经理的从业情况

翟爱东,男,经济学学士,具有基金从业资格,现任农银汇理基金管理有限公司总经理助理兼基金经理,农银汇理基金管理有限公司执行董事,农银汇理基金管理有限公司金融产品部总监,农银汇理基金管理有限公司固定收益部总监,农银汇理基金管理有限公司量化投资部总监,农银汇理基金管理有限公司权益投资部总监,农银汇理基金管理有限公司风险管理部总监,农银汇理基金管理有限公司客户服务部总监。

截至本报告期末,本公司管理人翟爱东先生分别为农银汇理行业成长股票型证券投资基金、农银汇理行业配置股票型证券投资基金、农银汇理行业增强型股票型证券投资基金、农银汇理行业主题股票型证券投资基金、农银汇理深证100指数增强型证券投资基金、农银汇理深证100指数型证券投资基金、农银汇理信用利滚利债券型证券投资基金、农银汇理深证100指数型证券投资基金和农银汇理行业轮动型股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理小组及基金经理助理简介

姓名 职务 任期本基金的基金经理(助理)期限 证券从业年限 说明

翟爱东 本基金总经理 2011年9月6日 - 10 系统工程师(金融)、理财规划师、金融工程硕士,具有基金从业资格,现任农银汇理基金管理有限公司总经理助理兼基金经理,农银汇理基金管理有限公司执行董事,农银汇理基金管理有限公司金融产品部总监,农银汇理基金管理有限公司固定收益部总监,农银汇理基金管理有限公司量化投资部总监,农银汇理基金管理有限公司权益投资部总监,农银汇理基金管理有限公司风险管理部总监,农银汇理基金管理有限公司客户服务部总监。

赵谦 本基金基金经理 2012年11月2日 - 6 系统工程师(金融)、理财规划师、金融工程硕士,具有基金从业资格,现任农银汇理基金管理有限公司执行董事,农银汇理基金管理有限公司金融产品部总监,农银汇理基金管理有限公司固定收益部总监,农银汇理基金管理有限公司量化投资部总监,农银汇理基金管理有限公司权益投资部总监,农银汇理基金管理有限公司风险管理部总监,农银汇理基金管理有限公司客户服务部总监。

4.2 管理人对报告期内基金运作的合规性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行和控制情况

本基金管理人依据《证券投资基金公平交易制度指引》等法律、法规,制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理制度》,严格控制不公平交易,并专门成立了公平交易小组,对公平交易小组成员进行定期培训,并组织定期评估。

本基金管理人通过事前审批、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的制度是制定业务流程、设置监控预警系统,并定期对公平交易情况进行评估;事中控制的制度是确保公司授权、研究、投资、交易等环节为控制事前设定的范围之内,各项业务操作根据制度和业务流程进行;事后检查,对于事前设定的流程、限额等无偏差,编制投资组合公平交易报告,分析事中控制的效果,并将评价结果报告给基金管理人。

4.4 报价公平原则的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金交易制度指引》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组合得到公平对待。

4.5 异常交易行为的专项说明

本基金管理人依据《证券投资基金交易行为管理规范》,对异常交易行为进行监控,并定期向中国证监会报告。

4.6 报告期内基金投资运作情况的说明

报告期内,本基金管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.7 管理人对报告期内基金运作的合规性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.8 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

本基金管理人依据《证券投资基金公平交易制度指引》等法律、法规,制定了《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理制度》,严格控制不公平交易,并专门成立了公平交易小组,对公平交易小组成员进行定期培训,并组织定期评估。

本基金管理人通过事前审批、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的制度是制定业务流程、设置监控预警系统,并定期对公平交易情况进行评估;事中控制的制度是确保公司授权、研究、投资、交易等环节为控制事前设定的范围之内,各项业务操作根据制度和业务流程进行;事后检查,对于事前设定的流程、限额等无偏差,编制投资组合公平交易报告,分析事中控制的效果,并将评价结果报告给基金管理人。

4.9 报价公平原则的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金交易制度指引》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组合得到公平对待。

4.10 报告期内基金投资运作情况的说明

报告期内,本基金管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.11 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.12 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.13 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.14 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.15 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.16 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.17 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.18 管理人对报告期内基金运作的公平性情况的说明

报告期内,本公司管理人遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售行为管理规范》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则和规范运作资金,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.19 管理人对报告期内基金运作