

农银汇理中小盘混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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:2015年10月27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。

基金托管人和报告编制机构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。

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告书日期为2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:农银中小盘混合

交易代码:660006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年3月26日

报告期末基金份额总额:610,642,748.98份

基金总资产:人民币610,642,748.98元

基金总负债:人民币610,642,748.98元

基金份额净值:1.00元

投资目标:精选具有良好成长潜力的中小股票，在严格控制风险的前提下运用积极主动的投资管理手段，以充分分享中小市值上市公司的成长收益。

基金的投资策略:本基金主要通过“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。在中小股票范围内通过对企业基本面、估值水平、成长性、流动性的深入分析，以期在把握市场整体趋势的基础上精选个股，力争实现基金资产的长期增值。

投资范围:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板等)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

业绩比较基准:中证全债指数收益率×6%+中证中小股指数收益率×25%

风险收益特征:本基金为混合型基金，属于中高风险收益的理财产品，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金。

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

单位:人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1. 主要财务指标

2. 本期利润

3. 加权平均基金份额本期利润

4. 期末基金份额净值

5. 期末基金份额百分比

注:1.本期已实现收益指基金本期收入，即利息收入、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，本期利润为已实现收益加上本期公允价值变动收益；2.本期的公允价值变动收益，计价费用和实际利息收入水平要低于所列示的数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 累计净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -22.79% 37.3% -23.31% 2.97% 0.52% 0.76%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 累计净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -22.79% 37.3% -23.31% 2.97% 0.52% 0.76%

3.3 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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。

4.6 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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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。

4.6 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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

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 报告期内所有投资组合参与的交易公开公平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%。

4.5 基金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，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、安全高效的治理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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《证券投资基金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在交易机会上的公平对待，当发现不同投资组合之间存在不公平交易时，及时调整投资组合持仓比例，使不同投资组合之间的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.2