

农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年9月30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...

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2018年7月1日起至9月30日止

基金名称:农银研究驱动混合

基金代码:005492

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2018年11月24日

报告期末基金份额总额:881,847,208.69份

投资目标:本基金通过采用研究驱动策略,精选具有良好成长性和竞争优势的上市公司股票进行投资...

投资策略:本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略...

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率\*65%+沪深300指数收益率\*35%

风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,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:浙商银行股份有限公司

重要财务指标:单位:人民币元

1.本期已实现收益: -60,378,238.00

2.本期利润: -76,106,211.80

3.加权平均基金份额本期利润: -0.0845

4.期末基金资产净值: 803,142,938.04

5.期末基金份额总额: 891,018

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...

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。

3.2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

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 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -8.37% 0.89% -0.21% 0.67% -1.61% 0.32%

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

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%

4.1基金经理(或基金经理小组)简介:姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

今年以来,A股震荡走低,上证综指从1月份高位回调整近25%

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

4.5.3 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

4.5.4 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

4.5.5 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资产支持证券投资明细

4.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

4.5.7 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

4.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.5.10 本期国债期货投资评价

4.5.11 衍生品投资评价

4.5.12 2018年7月12日,招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)受到中国银行保险监督管理委员会(以下简称“银保监会”)行政处罚

4.5.13 2018年7月12日,招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主期的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等

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:2018年10月26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...

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2018年7月1日起至9月30日止

基金名称:农银精选混合

基金代码:000336

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2013年11月5日

报告期末基金份额总额:196,134,328.25份

投资目标:本基金通过扎实的深入的基本面研究,发掘优质上市公司,通过积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略:本基金坚持“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股选择策略...

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:65%\*沪深300指数收益率+35%\*中证500指数收益率

风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,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

重要财务指标:单位:人民币元

1.本期已实现收益: -9,311,154.33

2.本期利润: -3,209,360.76

3.加权平均基金份额本期利润: -0.0166

4.期末基金资产净值: 218,830,647.34

5.期末基金份额总额: 1,157

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...

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。

3.2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

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 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.34% 1.67% -0.74% 0.88% -1.60% 0.79%

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

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%

4.1基金经理(或基金经理小组)简介:姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年三季度市场进入半年报业绩披露期,整体市场在外部环境不确定性加大的情况下,整体市场均出现了一定的调整...

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

4.5.3 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

4.5.4 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

4.5.5 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资产支持证券投资明细

4.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

4.5.7 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

4.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.5.10 本期国债期货投资评价

4.5.11 衍生品投资评价

4.5.12 2018年7月12日,招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)受到中国银行保险监督管理委员会(以下简称“银保监会”)行政处罚

4.5.13 2018年7月12日,招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主期的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等

农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月26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...

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2018年7月1日起至9月30日止

基金名称:农银研究驱动混合

基金代码:005492

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2018年11月24日

报告期末基金份额总额:881,847,208.69份

投资目标:本基金通过采用研究驱动策略,精选具有良好成长性和竞争优势的上市公司股票进行投资...

投资策略:本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略...

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率\*65%+沪深300指数收益率\*35%

风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,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:浙商银行股份有限公司

重要财务指标:单位:人民币元

1.本期已实现收益: -9,311,154.33

2.本期利润: -3,209,360.76

3.加权平均基金份额本期利润: -0.0166

4.期末基金资产净值: 218,830,647.34

5.期末基金份额总额: 1,157

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...

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。

3.2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

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 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.34% 1.67% -0.74% 0.88% -1.60% 0.79%

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

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%

4.1基金经理(或基金经理小组)简介:姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年三季度市场进入半年报业绩披露期,整体市场在外部环境不确定性加大的情况下,整体市场均出现了一定的调整...

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

4.5.3 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

4.5.4 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

4.5.5 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资产支持证券投资明细

4.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

4.5.7 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

4.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.5.10 本期国债期货投资评价

4.5.11 衍生品投资评价

4.5.12 2018年7月12日,招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)受到中国银行保险监督管理委员会(以下简称“银保监会”)行政处罚

4.5.13 2018年7月12日,招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主期的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等

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:2018年10月26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...

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2018年7月1日起至9月30日止

基金名称:农银研究驱动混合

基金代码:005492

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2018年11月24日

报告期末基金份额总额:881,847,208.69份

投资目标:本基金通过采用研究驱动策略,精选具有良好成长性和竞争优势的上市公司股票进行投资...

投资策略:本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略...

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率\*65%+沪深300指数收益率\*35%

风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金,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:浙商银行股份有限公司

重要财务指标:单位:人民币元

1.本期已实现收益: -9,311,154.33

2.本期利润: -3,209,360.76

3.加权平均基金份额本期利润: -0.0166

4.期末基金资产净值: 218,830,647.34

5.期末基金份额总额: 1,157

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...

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。

3.2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

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 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.34% 1.67% -0.74% 0.88% -1.60% 0.79%

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

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%

4.1基金经理(或基金经理小组)简介:姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年三季度市场进入半年报业绩披露期,整体市场在外部环境不确定性加大的情况下,整体市场均出现了一定的调整...

4.5 报告期内基金的投资组合和资产分布

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

4.5.3 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

4.5.4 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

4.5.5 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资产支持证券投资明细

4.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

4.5.7 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

4.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

4.5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

4.5.10 本期国债期货投资评价

4.5.11 衍生品投资评价

4.5.12 2018年7月12日,招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)受到中国银行保险监督管理委员会(以下简称“银保监会”)行政处罚

4.5.13 2018年7月12日,招商银行存在内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主期的不良贷款及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等

问题,对招商银行给予罚款的行政处罚。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 报告期末本基金资产投资组合情况

5.11.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准本基金募集的文件;

2.《农银汇理研究驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》