

农银汇理行业成长股票型证券投资基金

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年四月二十三日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	农银行业成长股票
基金主代码	660001
交易代码	660001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月4日
报告期末基金份额总额	3,626,669,326.02份
投资目标	在控制风险的前提下,重点投资成长性行业,力求为投资者取得长期稳定的资本增值。
投资策略	借助中国经济高速发展的动力,自上而下精选增长长期良好或景气复苏的行业,深入挖掘目标行业的上市公司基本面,并自上而下挑选个股,充分分享中国经济快速增长的成果。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其风险和收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-266,870,291.34
2.本期利润	-145,364,183.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0405
4.期末基金资产净值	3,444,270,959.41
5.期末基金份额净值	0.9497

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;

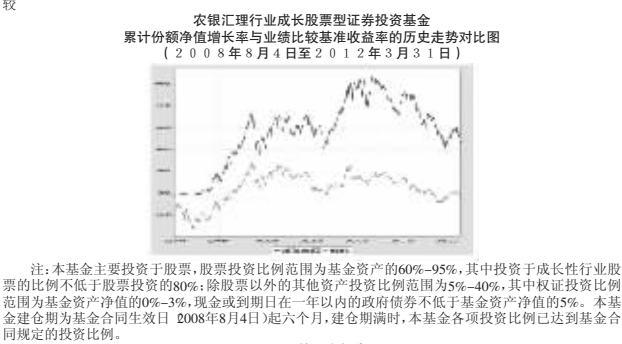
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.06%	1.59%	3.82%	1.14%	-7.88%	0.45%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本基金主要投资于股票,股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于成长性行业股票的比例不低于股票投资总资产60%;除股票以外的其他资产投资比例范围为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不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2008年8月4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					
姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹凯飞	本基金基金经理、公司投副总监	2008-8-4	-	8	统计学硕士、经济学硕士,具有基金从业资格,历任长江证券和泰信证券投资总部分析岗,泰信基金管理有限公司研究部,华安兴业基金管理有限公司研究部高级研究员,华安基金先进成长基金经理助理,现任农银汇理基金公司投资副总监、基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、中国证监会的相关规定,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。报告期内,本基金未违反法律法规及基金合同的规定,也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

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》和《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》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基金和组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度通胀水平呈现回落趋势但基础不稳固,经济增速回落但货币和财政政策并没有如市场预期得那么宽松,股票市场制度改革预期虽利在长远但短期有一定压力。去年制约市场的各种因素今年正在发生变化,但市场需要更加明确的信号。

4.4.2 基金的投资策略是重点配置估值合理增长确定的消费和科技等成长股,同时关注金融地产汽车家电等低估值大盘蓝筹股的估值修复机会。

4.4.3 报告期内基金的投资策略

报告期内本基金净值增长率为-4.06%,比较基准收益率为3.82%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,208,006,685.29	91.57
	其中:股票	3,208,006,685.29	91.57
2	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	269,040,732.05	7.68
6	其他各项资产	26,251,383.26	0.75
7	合计	3,503,298,800.60	100.00

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:二〇一二年四月二十三日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	农银策略价值股票
基金主代码	660004
交易代码	660004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	1,265,685,323.02份
投资目标	精选具有较高投资价值的股票,综合运用多种有效的投资策略,力争实现基金资产的理性增值。
投资策略	通过深入的基金基本面分析发掘股票的内在价值,利用非有效市场的定价偏差实现股票的投资价值。基金管理人将通过自上而下的资产配置和自下而上的个股精选相结合的方法构建投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其风险和收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-27,084,177.23
2.本期利润	-9,596,760.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0075
4.期末基金资产净值	1,173,830,289.85
5.期末基金份额净值	0.9274

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。

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 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.55%	1.72%	3.82%	1.14%	-4.37%	0.58%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

农银汇理策略价值股票型证券投资基金

累计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

(2009年9月29日至2012年3月31日)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	43,465,063.05	1.26
B	采掘业	181,087,853.68	5.26
C	制造业	1,987,439,108.46	57.70
C0	食品、饮料	627,555,635.83	18.22
C1	纺织、服装、皮毛	99,271,735.74	2.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	80,546,633.04	2.34
C5	电子	573,494,900.20	16.65
C6	金属、非金属	79,760,000.00	2.32
C7	机械、设备、仪表	86,945,379.01	2.52
C8	医药、生物制品	375,529,808.55	10.90
C9	其他制造业	64,335,016.09	1.87
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	115,080,616.75	3.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	201,528,433.93	5.85
H	批发和零售贸易	185,515,678.85	5.39
I	金融、保险业	3,012,511.59	0.09
J	房地产业	163,914,453.70	4.76
K	社会服务业	312,433,662.72	9.07
L	传播与文化产业	14,529,302.56	0.42
M	综合类	-	-
	合计	3,208,006,685.29	93.14

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					
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(%)
1	300115	长盈精密	5,600,000	192,360,000.00	5.58
2	300070	碧水源	4,500,067	170,552,539.30	4.95
3	002236	大华股份	3,505,562	168,547,420.96	4.89
4	600518	康美药业	11,999,897	152,398,691.90	4.42
5	600809	山西汾酒	2,000,746	122,785,782.02	3.56
6	002241	歌尔声学	4,630,882	120,171,387.90	3.49
7	002024	苏宁电器	10,000,000	97,500,000.00	2.83
8	600395	盘江股份	3,499,366	92,733,199.00	2.69
9	002038	双鹭药业	3,475,746	92,315,813.76	2.68
10	000858	五粮液	2,664,217	87,492,886.28	2.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2011年4月29日,中国证券监督管理委员会发布《中国证监会行政处罚决定书》【2011】【7】号),对宜兴五粮液股份有限公司(下称:五粮液,股票代码:000858)、唐桥等8名责任人员的 撤清公告)存在重大遗漏、信息披露不及时、不完整等行为,作出警告、罚款等行政处罚。

对五粮液股票投资决策程序的说明:该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库,由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断,按照相关投资决策流程投资了该股票。该行政处罚事件发生后,本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和他分析,认为此事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此没有改变本基金对该上市公司的投资判断。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,136,061.46
2	应收证券清算款	14,821,872.73
3	应收股利	-
4	应收利息	85,464.50
5	应收申购款	7,207,984.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,251,383.26

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动	
单位:份	
本报告期初基金份额总额	3,603,910,190.10
本报告期基金总申购份额	495,262,413.09
减:本报告期基金总赎回份额	472,503,277.17
本报告期基金净变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,626,669,326.02

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出的份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金合同》;

3、《农银汇理行业成长股票型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件。

7.2 存放地点

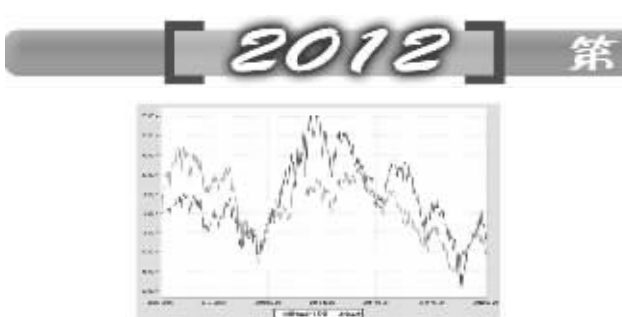
备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
二〇一二年四月二十三日

农银汇理策略价值股票型证券投资基金



注:本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于价值型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高于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2009年9月29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 管理人报告				
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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
程涛	本基金基金经理、 公司投资部总经理	2010-4-15 -	8	金融学硕士,具有基金从业资格。历任联合证券证券公司投资银行部高级经理,泰信基金管理公司研究员及基金基金经理助理,农银汇理基金管理有限公司行业研究员及基金基金经理助理,现任农银汇理基金管理有限公司投资部

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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》和《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》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基金和组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共发生1次:农银策略价值股票型基金认为该证券“价值严重低估,择机买入”,农银策略精选股票基金卖出该证券原因为“仓位调整”。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

全球资本市场在一季度都走出一轮上涨行情,A股市场总体涨幅低于全球平均水平。板块来看,有色、地产、家电、食品饮料取得明显超额收益,医药、通讯、计算机大幅跑输。总结一季度市场走势,主导市场力量主要体现在以下几个方面:

第一、流动性改善预期。从外围看,去年底以来全球央行联手释放流动性推动欧美及新兴市场大幅上涨,美国经济复苏预期不断增强。国内来看,政策会进一步微调微调的预期不断增强,且市场预期通胀趋势性回落落后信贷数据能够较快增长。市场资金面出现预期,票据贴现利率持续回落。

第二、经济基本面底部徘徊。投资增速回落,工业增加值下滑,企业盈利继续下滑。

第三、国内经济新一轮周期启动预期。市场预期以房地产、家电、汽车等为代表的早期周期可选消费行业率先启动。

综上所述,市场交易对国内经济不同解读的分歧以及各种力量的此消彼长。本基金针对1季度的宏观形势,采取相对均衡的配置策略,超配基本面盈利情况较好的部分消费板块,适时适度参与周期性的反弹,整体组合均衡,保持了组合的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内本基金净值增长率为-0.55%,同期业绩比较基准收益率为3.82%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

农银汇理中小盘股票型证券投资基金

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
报告送出日期:二〇一二年四月二十三日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况	
基金简称	农银中小盘股票
基金主代码	660005
交易代码	660005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月25日
报告期末基金份额总额	1,477,027,068.61份
投资目标	精选基本面优良且具有良好成长潜力的中小盘股票,在严格控制风险的前提下采用积极主动的管理手段,以充分分享中小市值上市公司成长过程所带来的收益。
投资策略	本基金在投资上遵循“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合。基金管理人将严格遵循股票库的制度,在中小盘股票库内通过对个股基本面、估值水平、成长能力等因素的深入分析,以筛选出符合本基金投资要求的股票。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为30%×天相中小盘指数+45%×天相中盘指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为中小盘股票型证券投资基金,是高风险、高收益的基金品种,其风险和收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于股票型基金中风险和收益水平较高的品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-16,103,164.72
2.本期利润	-4,865,613.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0033
4.期末基金资产净值	1,411,145,568.73
5.期末基金份额净值	0.9554

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;

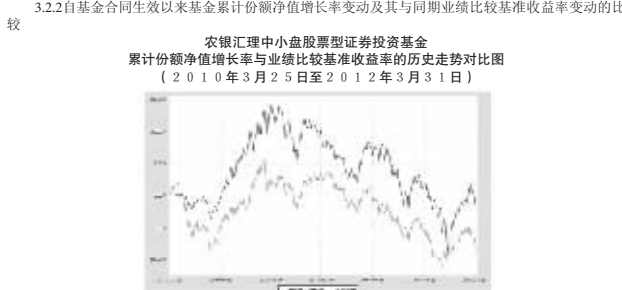
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.46%	1.71%	3.58%	1.29%	-4.04%	0.42%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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



注:本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于中小盘股票的比例不少于股票投资的60%;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%。本基金建仓期为基金合同生效日(2010年3月25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			§ 4 管理人报告	
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
程涛	本基金基金经理 公司投资部总经理	2010-10-19 -	8	金融学硕士,具有基金从业资格。历任联合证券证券投资银行部高级经理、泰信基金管理公司研究员及基金基金经理助理、农银汇理基金管理有限公司行业研究员及基金基金经理助理,现任农银汇理基金管理有限公司

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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》和《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》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基金和组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共发生1次:农银中小盘股票型基金认为该证券“价值严重低估,择机买入”,农银策略精选股票基金卖出该证券原因为“仓位调整”。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

全球资本市场在一季度都走出一轮上涨行情,A股市场总体涨幅低于全球平均水平。板块来看,有色、地产、家电、食品饮料取得明显超额收益,医药、通讯、计算机大幅跑输。总结一季度市场走势,主导市场力量主要体现在以下几个方面:

第一、流动性改善预期。从外围看,去年底以来全球央行联手释放流动性推动欧美及新兴市场大幅上涨,美国经济复苏预期不断增强。国内来看,政策会进一步微调微调的预期不断增强,且市场预期通胀趋势性回落落后信贷数据能够较快增长。市场资金面出现预期,票据贴现利率持续回落。

第二、经济基本面底部徘徊。投资增速回落,工业增加值下滑,企业盈利继续下滑。

第三、国内经济新一轮周期启动预期。市场预期以房地产、家电、汽车等为代表的早期周期可选消费行业率先启动。

综上所述,市场交易对国内经济不同解读的分歧以及各种力量的此消彼长。本基金针对1季度的宏观形势,采取相对均衡的配置策略,超配基本面盈利情况较好的部分消费板块,适时适度参与周期性的反弹,整体组合均衡,保持了组合小盘成长股的配置。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内本基金净值增长率为-0.46%,同期业绩比较基准收益率为3.58%。

票型证券投资基金			
一 季 度 报 告			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	986,588,565.46	83.61
	其中:股票	986,588,565.46	83.61
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	190,388,068.73	16.13
6	其他各项资产	3,049,770.81	0.26
7	合计	1,180,026,405.00	100.00