

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
送单日期:2014年8月25日

5.1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、董事保证本报告不存在虚假记载、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

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2014年8月22日复核了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

5.2 基金简介

5.2.1 基金基本情况

基金名称：农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金

基金简称：农银汇理大盘股

基金主代码：660006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010年9月1日

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

报告期末基金份额总额：1,396,683,466.59份

基金合同生效日期：不定期

5.2.2 基金产品说明

精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股，通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合，以期获得基金资产的长期稳健增值。

本基金主要投资于具有良好经营业绩、政策环境和资金供求等因素的公司的股票，优先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析，选择具有较好发展前景的股票进行配置，在“自下而上”的分析框架内，本基金将严格挑选个股并进行配置，在建立大盘

股票配置的基础上，综合运用定量和定性的手段，筛选出具有良好的基本面和成长前景的股票进行投资。

业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为75%沪深300指数+25%中国债券指数。

风险收益特征：本基金为大盘蓝筹股票型证券投资基金，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。

5.2.3 基金管理人和基金托管人

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 中国建设银行股份有限公司

姓名 费国强 田晋

信息披露负责人 021-61095588 010-67595096

电子邮箱 hebingyihul@cboc.com zhongtang@cboc.com

客户服务电话 021-61095599 010-67595096

传真 021-61095556 010-66275883

5.2.4 信息披露方式

登载基金半年报和正文的管理人互联网网址 http://www.abc.com

基金半年报书面报告地点 上海浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1.1 本期份额变动情况

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日) -29,088,871.87

本期已实现收益 -217,202,499.90

加权平均基金份额本期利润 -0.1504

本期已分配现金股利 -17.93%

本期基金份额净值增长率 -15.74%

1.2 本期份额变动情况

报告期(2014年6月30日) -20.57%

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、所列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、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”即指本期最后一日,即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 各期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 份额净值增长 率 业绩比较基 准收益率差额 (%) ①-③ ②-④

过去一个月 1.60% 0.72% 0.51% 0.58% 1.09% 0.14%

过去二个月 0.20% 0.83% 1.43% 0.65% -1.23% 0.18%

过去三个月 -15.74% 1.08% -3.92% 0.78% -11.28% 0.30%

过去一年 -9.59% 1.17% -0.39% 0.88% -9.26% 0.29%

过去三年 -13.91% 1.14% -19.19% 0.97% 5.26% 0.17%

自基金合同生效起至今 -20.57% 1.13% -16.15% 0.99% -4.42% 0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金净值累计增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

注:本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,也不保证最低收益。

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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壹亿零壹元,其中中国农业银行股份有限公司出资比例为1.67%,

东方汇理资产管理公司出资比例为33.33%,中国铝业股份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7层。

公司法定代表人为童承志,执行人为童承志。

截至2014年6月30日,公司现管理21只开放式基金,分别为农银汇理行业成长股票型证券投资基金、农银汇理久盈债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理策略精选股票型证券投资基金、农银汇理中证500指数增强型证券投资基金、农银汇理指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、农银汇理7天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高成长股票型证券投资基金、农银汇理行业领先股票型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金和农银汇理14天理财型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理助理)及基金经理助理简介

姓名 职务 日本法定的基金经理(助理)期间 证券从业年限 任期日期 说明

费国强 基金经理 经济学硕士, CFA, 具有基金从业资格, 时任农银汇理基金管理有限公司研究员, 国研院基金管理有限公司高级研究员, 兼任农银汇理基金管理有限公司投资部副总经理, 兼任农银汇理基金管理有限公司基金经理助理, 兼任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

季晴国 副总经理 10年 2010年11月4日 -

管理经验:万里扬, 先任农银汇理基金管理有限公司投资部副总经理, 兼任农银汇理基金管理有限公司基金经理助理, 兼任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

注:1、任职、离任日期由公司作出决定之日起,基金成立后担任基金经理和基金经理助理的任职日期为基金经理任职日期。

2、证券从业人员是指证券从业人员资格管理办法规定的从业人员,也包括在其他金融机构从事证券投资研究工作的从业人员。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金管理人严格按照《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》、《证券投资基金销售行为管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的部门规章的规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原則管理运用基金资产。

本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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的规定》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执行公平交易,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。

未发生本基金管理人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交易成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和操作分析

回顾上半年,拉动经济增长的三驾马车都出现了不同程度的放缓,经济政策也出现了预调微调,经济增长在寻找新的平衡点,市场也处在结构性调整过程中,兼并收购和主题投资是结构性行情中的领航者,从行业看,计算机、通信、餐饮旅游涨幅居前,军工、新能源汽车、医药生物涨幅居后,整体呈现震荡走势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金的净值增长率为-15.74%,同期业绩比较基准收益率为-3.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望下半年,我们认为市场的格局在逐步演绎,高成长在稳增长中促进转型的大方向是坚定的,我们能够承载国家对基础设施建设,能够取得突破性应用,能够对民生产生重大影响或者对社会福利改善产生更广泛的影响,技术、商业模式将成为投资的重要方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证监会协会于2007年6月15日颁布的《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会计字[2007]15号)、《证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第1号)、《证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第20号)、《关于同意农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会计字[2010]第22号)、《关于同意农银汇理货币市场基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第23号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第24号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第25号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第26号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第27号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第28号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第29号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第30号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第31号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第32号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第33号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第34号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第35号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第36号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第37号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第38号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第39号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第40号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第41号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第42号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第43号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第44号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第45号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第46号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第47号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第48号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第49号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第50号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第51号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第52号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第53号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第54号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第55号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第56号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第57号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第58号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第59号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第60号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第61号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第62号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第63号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第64号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第65号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第66号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第67号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第68号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第69号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第70号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第71号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第72号)、《关于同意农银汇理债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第73号)、《关于同意农银汇理股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第74号)、《关于同意农银汇理混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第75号)、《关于同意农银汇理定期开放型股票型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第76号)、《关于同意农银汇理定期开放型债券型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第77号)、《关于同意农银汇理定期开放型混合型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会公告[2010]第78号)、《关于同意农银汇理货币型证券投资基金会计核算办法(企业会计准则)》(证监会