农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:2014年10月23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2014年10月22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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银区间收益混合
交易代码	000259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	102,586,935.88份
投资目标	本基金通过调节组合的最大风险资产敞口,从而控制组合风险,实现组合锁定收益的目标。在组合风险敞口确定的前提下,基金管理人将充分发挥选股能力,通过精选个股组合进行风险资产的配置,力争为投资者提供一个能够分享股市系统性收益,并获得一定程度的超额收益的良好投资工具。
投资策略	本基金属于"目标收益型"基金。本基金的股票和非股票类资产在投资组合中的严格按照纪律进行调整,随着参照指数累积到一定阀值之后,本基金将按照纪律逐渐降低股票类资产配置比例,相应增加非股票类资产比例,从而确保基金能够部分锁定收益;在参照指数下跌到下一个阀值的下限时,本基金将按照纪律逐渐增加股票资产配置比例,相应减少非股票类资产比例,从而为基金争取更大的潜在收益。
业绩比较基准	S×沪深300指数+(100%-S)×中证全债指数,具体详情请见本基金基金合同。
风险收益特征	本基金的风险和收益水平随着参考指数的不断上涨,风险不断下降,从而锁定前期收益。 本基金的预期风险和收益在投资初始阶段属于较高水平,随着参考指数的不断上涨,本基金将逐步降低预期风险与收益水平,转变为中等风险的证券投资基金;在临近参考指数最高指数点位以后,本基金将转变为低风险的证券投资基金。
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

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,731,821.47
2.本期利润	16,660,615.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1150
4.期末基金资产净值	115,218,470.63
5.期末基金份额净值	1.1231

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	12.38%	0.99%	12.60%	0.85%	-0.22%	0.14%

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

股票投资比例范围为基金资产的0%-95%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-100%。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(2013年8月21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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2013年8月21日	-	5	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理,农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员,现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

截止2014年9月30日,本基金持有股票总市值高于基金资产净值的95%,基金管理人已在法律法规规定的时间内将此比例调整到规定的范围内。

除此之外,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、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,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》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。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

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

3季度市场风格出现较大波动。三季度前期在沪港通开通、经济企稳的预期下,大盘蓝筹表现亮丽;之后成长股出现明显的补涨行情;而进入9月后,主题类、转型小市值表现良好。综观三季度,宏观经济的表现是弱于市场预期的,但是在改革预期下,国内外资金推动市场出现了较明显的上涨。三季度本基金仍以成长股为主要配置,主要配置新能源、TMT、医药,但针对市场的活跃,适当参与部分主题机会。

本基金的重点配置策略是以业绩驱动为主线,通过自上而下和自下而上相结合,寻找增长优质而估值合理的公司,重点关注移动互联、新能源、医药、环保、传媒等新兴产业,以及部分具备制度红利释放能力和动力的企业

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为12.38%,业绩比较基准收益率为12.60%。

§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	109,478,829.16	92.19
	其中:股票	109,478,829.16	92.19
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,173,946.51	7.73
7	其他资产	97,089.09	0.08
8	合计	118,749,864.76	100.00

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	2,928,363.60	2.54
B	采矿业	5,851,981.07	5.08
C	制造业	62,327,724.62	54.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,936,653.37	3.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,420,233.50	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,398,926.02	15.97
J	金融业	2,402,143.38	2.08
K	房地产业	1,368,412.10	1.19
L	租赁和商务服务业	3,900,135.80	3.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,582,218.80	2.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,362,036.90	2.92
S	综合	-	-
	合计	109,478,829.16	95.02

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	300157	恒泰艾普	225,499	4,043,197.07	3.51
2	300274	阳光电源	201,976	3,978,927.20	3.45
3	600572	康恩贝	234,229	3,970,181.55	3.45
4	600887	伊利股份	134,740	3,489,766.00	3.03
5	002009	天奇股份	206,996	3,479,602.76	3.02
6	300133	华策影视	97,990	3,362,036.90	2.92
7	002022	科华生物	121,038	3,260,763.72	2.83
8	000801	四川九洲	149,774	3,197,674.90	2.78
9	300072	三聚环保	117,420	3,185,604.60	2.76
10	600571	信雅达	138,154	3,181,686.62	2.76

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2014年8月8日,浙江康恩贝制药股份有限公司(下称:康恩贝,股票代码:600572)发布《浙江康恩贝制药股份有限公司关于最近五年公司被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚情况的公告》(公告编号:临2014-077),公告指出2014年3月19日,康恩贝收到上海证券交易所《关于对浙江康恩贝制药股份有限公司2013年年报的事后审核意见函》(上证公函【2014】0155 号),经上海证券交易所对该公司2013 年年度报告的事后审核,要求康恩贝对一些问题作进一步说明和解释。康恩贝经核实后回复了该意见函并落实了整改措施。

2013年11月8日,浙江华策影视股份有限公司(下称:华策影视,股票代码:300133)发布《关于重大资产重组行政许可申请暂停审核的特别风险提示公告》(公告编号:2013-072),指出该公司重大资产重组相关方因涉嫌内幕交易被中国证监会立案调查。2013年12月31日,华策影视发布了《关于现金及发行股份购买资产并募集配套资金事项获得中国证监会正式批复的公告》(公告编号:2013-072)。

对康恩贝、华策影视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。

其余八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。

5.11.2

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,326.33
2	应收证券清算款	29,177.10
3	应收股利	-
4	应收利息	2,151.28
5	应收申购款	24,434.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,089.09

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300157	恒泰艾普	4,043,197.07	3.51	公告重大事项
2	300133	华策影视	3,362,036.90	2.92	公告重大事项
3	300072	三聚环保	3,185,604.60	2.76	公告重大事项
4	600571	信雅达	3,181,686.62	2.76	公告重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	164,646,697.94
报告期期间基金总申购份额	4,852,258.47
减:报告期期间基金总赎回份额	66,912,020.53
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	102,586,935.88

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份额。

§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

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、《农银汇理区间收益混合型证券投资基金基金合同》;

3、《农银汇理区间收益混合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。

8.2 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。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。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制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2014年10月23日

农银汇理中小盘股票型证券投资基金

【2014】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:2014年10月23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2014年10月22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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银中小盘股票
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	790,974,563.37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、成长潜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	中证700指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	48,848,674.06
2.本期利润	164,084,292.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1883
4.期末基金资产净值	1,359,449,897.75
5.期末基金份额净值	1.7187

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	12.72%	0.93%	16.49%	0.69%	-3.77%	0.24%

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

1、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。

2、农银汇理基金管理有限公司根据《农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案后,自2012年11月1日起,将农银汇理中小盘股票型证券投资基金的业绩比较基准由"30%×天相小盘指数+45%×天相中盘指数+25%×中证全债指数"变更为"中证700指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%"。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付娟	本基金经理	2013年3月5日	-	7	会计学博士,具有基金从业资格。历任申银万国证券研究所分析师、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理。

4.2 管理人对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》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。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

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

2014年8月,最新公布的工业增加值大幅降至6.9%,这也是2009年以来的最低水平,对于低迷的经济数据,政府的忍受度已经明显上升,这意味着不大可能出台重大刺激举措。

从分类指数的表现看,年初至三季度末,指数表现分化,风格特征明显,小指数大幅跑赢主板指数。三季度以来,部分大盘股也开始表现,市场风格从完全的中小票逐步过渡到部分低价大盘股和中小票共同表现的状态,这也使得主板指数从反复震荡逐步开始走高。

展望四季度,一方面,经济数据的每况愈下仍将一定程度上刺激市场脆弱的神经;另一方面四中全会即将召开,沪港通、土地流转、混合所有制等方面的改革或将加速,对政策的期待会让一部分行业和个股反复被关注,预计结构性行情和主题投资仍是市场获利的主要方向。这种情况下,四季度的市场或将呈现较为反复的特征。从中期的角度看,股票指数方向的关键决定力量是对系统性风险预期的变化,而非经济指标强弱。为此,我们战略上仍将坚持沿着成长和改革的路线,并特别关注二线蓝筹的机会,创新、成长和改革依然是投资的主旋律。

本基金未来的配置重点将是优质的成长股和二线蓝筹,在深度研究优秀上市公司的基础上进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金份额净值增长12.72%,同期业绩比较基准收益率为16.49%。

§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	1,121,538,291.05	80.49
	其中:股票	1,121,538,291.05	80.49
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	258,064,220.11	18.52
7	其他资产	13,705,004.53	0.98
8	合计	1,393,307,515.69	100.00

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	1,138,320.00	0.08
B	采矿业	59,401,211.43	4.37
C	制造业	715,846,026.05	52.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,868,578.46	6.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	198,390,272.74	14.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	526,264.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,078.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	57,365,540.37	4.22
S	综合	-	-
	合计	1,121,538,291.05	82.50

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	600572	康恩贝	4,032,811	68,356,146.45	5.03
2	300274	阳光电源	3,357,100	66,134,870.00	4.86
3	300147	香雪制药	2,818,801	63,958,594.69	4.70
4	601012	隆基股份	3,053,243	63,354,792.25	4.66
5	000997	新大陆	2,339,431	62,088,498.74	4.57
6	000958	东方热电	4,496,713	60,300,921.33	4.44
7	300157	恒泰艾普	3,312,951	59,401,211.43	4.37
8	600420	现代制药	2,360,122	55,887,688.96	4.11
9	002701	奥瑞金	2,376,449	54,159,272.71	3.98
10	300133	华策影视	1,262,227	43,307,008.37	3.19

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2014年8月8日,浙江康恩贝制药股份有限公司(下称:康恩贝,股票代码:600572)发布《浙江康恩贝制药股份有限公司关于最近五年公司被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚情况的公告》(公告编号:临2014-077),公告指出2014年3月19日,康恩贝收到上海证券交易所《关于对浙江康恩贝制药股份有限公司2013年年报的事后审核意见函》(上证公函【2014】0155 号),经上海证券交易所对该公司2013 年年度报告的事后审核,要求康恩贝对一些问题作进一步说明和解释。康恩贝经核实后回复了该意见函并落实了整改措施。

2013年11月20日,石家庄东方热电股份有限公司(下称:东方能源,股票代码:000958)发布《石家庄东方热电股份有限公司关于近五年监管部门监管关注事项及整改情况的公告》(公告编号:2013-075),指出该公司于2013年11月5日收到河北证监局责令公开说明函(冀证监函[2013]161号),该公司正就相关事项进行认真核查,并进一步与政府有关部门进行沟通。该公司将根据核查情况就《责令公开说明函》的相关要求继续履行信息披露义务。

2013年11月8日,浙江华策影视股份有限公司(下称:华策影视,股票代码:300133)发布《关于重大资产重组行政许可申请暂停审核的特别风险提示公告》(公告编号:2013-072),指出该公司重大资产重组相关方因涉嫌内幕交易被中国证监会立案调查。2013年12月31日,华策影视发布了《关于现金及发行股份购买资产并募集配套资金事项获得中国证监会正式批复的公告》(公告编号:2013-072)。

对康恩贝、东方能源、华策影视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。

其余七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。

5.11.2

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	806,894.96
2	应收证券清算款	11,986,922.73
3	应收股利	-
4	应收利息	33,871.80
5	应收申购款	877,315.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,705,004.53

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300157	恒泰艾普	59,401,211.43	4.37	公告重大事项
2	300133	华策影视	43,307,008.37	3.19	公告重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	920,789,576.06
报告期期间基金总申购份额	50,309,441.84
减:报告期期间基金总赎回份额	180,124,454.53
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	790,974,563.37

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份额。

§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

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准农银汇理中小盘股票型证券投资基金募集的文件;

2、《农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同》;

3、《农银汇理中小盘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、营业执照。

8.2 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。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。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制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2014年10月23日

农银汇理中证500指数证券投资基金

【2014】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月23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2014年10月22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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银中证500指数
交易代码	660011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月29日
报告期末基金份额总额	91,122,600.75份
投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金,通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理,力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在4%以内,日平均跟踪偏离度控制在0.35%以内,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×中证500指数+5%×同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金、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 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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	3,123,879.56
2.本期利润	23,224,296.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2476
4.期末基金资产净值	118,991,704.42
5.期末基金份额净值	1.3058

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。

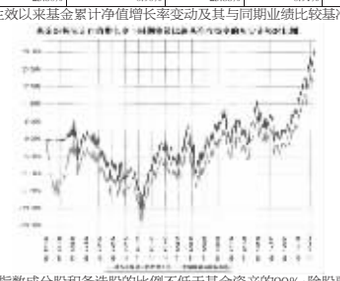
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	23.60%	0.90%	23.88%	0.91%	-0.28%	-0.01%

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



本基金投资于标的指数成分股和备选股的比例不低于基金资产的90%;除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-10%,其中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(2011年11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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金经理	2014年2月10日	-	6	硕士,具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

4.2 管理人对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》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。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

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

本报告