

农银汇理策略精选股票型证券投资基金

[2015] 第一季度报告

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2015年4月20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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月17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。

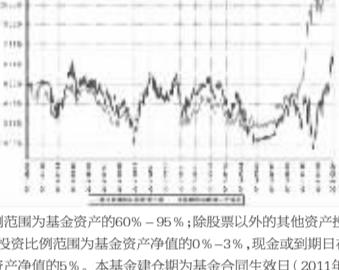
本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	农银策略精选股票
交易代码	660010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月6日
报告期末基金份额总额	167,348,467.51份
投资目标	本基金将通过精选个股或行业配置的选股收益为由衷，通过对定量和定性两种投资策略的有效结合，力争为投资者创造超越业绩基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过筛选具有较好基本面的股票，在充分考虑估值的基础上，以多个相关性较低的量化因子为基准，进行动态的组合管理，力争在长期投资经验形成一定的投资风格。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证价值指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，较高预期风险的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§ 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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)			
1.本期已实现收益	24,034,743.21			
2.本期利润	62,613,335.26			
3.期末可供分配基金份额利润	208,515,226.88			
4.期末基金资产净值	208,515,226.88			
5.期末基金份额净值	1.1130			
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 报告期内基金份额净值增长率为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
过去三个月	38.93%	1.70%	11.26%	1.37%
	27.67%	0.38%		
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较				
				
本基金股权投资比例范围为基金资产的60%~95%，除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%~40%。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政府债券投资比例不高于基金资产净值的5%。本基金建仓时间为基金合同生效日(2011年9月6日)起六个月，建仓期间，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
赵谦	本基金基金经理	2014年1月28日	-	8
赵谦	基金经理	任本基金的基金经理，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				
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、安全高效的原則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 平等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。				
4.4 报告期内基金的业绩表现				
报告期本基金份额净值增长38.93%，同期业绩比较基准收益率为11.26%。				
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望				
报告期内，本基金管理人严格按照《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得到公平对待。				
4.6 报告期内基金净值波动预警说明				
报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。				
§ 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	190,579,613.66	87.86	
其中:股票		190,579,613.66	87.86	
2	固定收益投资	-	-	
其中:债券		-	-	
3	贵金属投资	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-	
5	买入返售金融资产	-	-	
6	银行存款和结算备付金合计	9,722,199.77	4.48	
7	其他资产	16,605,518.86	7.66	
8	合计	216,907,532.29	100.00	
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合				
代碼	行業類別	公允價值(元)	占基金資產淨值比例(%)	
A	农林、牧、漁業	-	-	
B	礦業	-	-	
C	製造業	124,082,987.35	55.71	
D	電力、熱力、氣水生产和供應業	-	-	
E	建築業	42,683,034.92	5.40	
F	批發和零售業	39,603,184.75	5.01	
G	交通運輸、倉儲和郵政業	1,000.28	0.00	
H	住宿和餐飲業	-	-	
I	信息傳輸、軟件和信息技术服務業	92,766,908.20	11.75	
J	金融業	232,076,276.30	29.39	
K	房地產業	169,315,469.82	21.44	
L	租赁和商務服務業	26,349,689.22	3.34	
M	科學研究、技術服務業	-	-	
N	水利、環境和公共設施管理業	-	-	
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-	
P	教育	-	-	
Q	衛生、社會工作	-	-	
R	文化、體育和娛樂業	820.26	0.00	
S	其他	-	-	
合計		726,873,371.30	92.04	
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一名股票投资明细				
序號	股票代碼	股票名稱	公允價值(元)	占基金資產淨值比例(%)
1	660006	农銀大盤藍籌股票	164,455,300	5.76
2	600023	天業集團	34,253,610.00	4.34
3	000224	前海灘	12,033,345	4.31
4	600804	鵬博士	31,586,720.10	4.00
5	600048	保利地產	25,786,368	3.75
6	600271	航天信息	38,327,458.48	3.66
7	600300	中信證券	875,600	0.36
8	002081	金銀輪	793,876	0.34
9	000022	新華聯	2,040,200	0.00
10	600208	新華聯	3,144,400	0.00
合計		726,873,371.30	92.04	
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十名债券投资组合				
序號	債券代碼	債券名稱	公允價值(元)	占基金資產淨值比例(%)
1	164,455,300	农銀大盤藍籌債券	164,455,300	5.76
2	34,253,610.00	天業集團債券	34,253,610.00	4.34
3	12,033,345	前海灘債券	12,033,345	4.31
4	31,586,720.10	鵬博士債券	31,586,720.10	4.00
5	25,786,368	保利地產債券	25,786,368	3.75
6	38,327,458.48	航天信息債券	38,327,458.48	3.66
7	875,600	中信證券債券	875,600	0.36
8	2,040,200	新華聯債券	2,040,200	0.00
9	3,144,400	新華聯債券	3,144,400	0.00
合計		726,873,371.30	92.04	
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十名资产支持证券投资组合				
序號	資本工具代碼	資本工具名稱	公允價值(元)	占基金資產淨值比例(%)
1	660006	农銀大盤藍籌資本工具	164,455,300	5.76
2	34,253,610.00	天業集團資本工具	34,253,610.00	4.34
3	12,033,345	前海灘資本工具	12,033,345	4.31
4	31,586,720.10	鵬博士資本工具	31,586,720.10	4.00
5	25,786,368	保利地產資本工具	25,786,368	3.75
6	38,327,458.48	航天信息資本工具	38,327,458.48	3.66
7	875,600	中信證券資本工具	875,600	0.36
8	2,040,200	新華聯資本工具	2,040,200	0.00
9	3,144,400	新華聯資本工具	3,144,400	0.00
合計		726,873,371.30	92.04	
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贵金属投资组合				
序號	資本工具代碼	資本工具名稱	公允價值(元)	占基金資產淨值比例(%)
1	660006	农銀大盤藍籌資本工具	164,455,300	5.76
2	34,253,610.00	天業集團資本工具	34,253,610.00	4.34
3	12,033,345	前海灘資本工具	12,033,345	4.31
4	31,586,720.10			