

## 农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

## [2015] 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:2015年10月27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2015年10月26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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 农银汇理大盘蓝筹混合      |
| 基金代码       | 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 313,467,617.49份 |

精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票，通过合理的资产配置，以获取基金资产的长期理性增长。

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的分析法构造投资组合，首先通过宏观经济、政策面、资金面等宏观指标的分析，判断宏观经济运行趋势，从而确定资产配置比例；其次通过行业比较分析，精选具有较好盈利能力的行业；最后通过深入研究个股，精选具有良好基本面和发展前景的股票进行投资。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×30%+恒生企业指数×70%。

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的资产组合，其预期风险和预期收益水平均高于股票型基金，低于债券型基金。

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

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日) |
|-----------------|-----------------------------|
| 1.本期已实现收益       | -139,177,976.03             |
| 2.期初现金持有        | -62,032,599.43              |
| 3.报告期平均基金份额期间利润 | -0.26794                    |
| 4.期末基金份额净值      | 307,349,367.14              |
| 5.期末基金份额总额      | 313,467,617.49              |

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)扣减相关费用后的余额，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。

3.2.1 基金净值的表现

3.2.1 本基金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(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) | ①-③   | ②-④   |
|-------|----------|-------------|--------------|-----------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -20.28%  | 2.11%       | -21.11%      | 2.01%           | 0.83% | 0.77% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 管理人报告

3.4.1 基金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，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，经仔细阅读，未发现本基金管理人存在损害基金持有人利益的行为。

3.4.2 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，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，经仔细阅读，未发现本基金管理人存在损害基金持有人利益的行为。

3.4.3 公平交易制度的执行情况

3.4.4 公平交易制度的公平性分析

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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。

3.4.5 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。

3.4.6 报告期内所投资组合的交易对手方按公允价值日均反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券市值的1%。

3.4.7 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

赵诚，本基金基金经理，2010年10月11日任职，期间管理的基金资产净值增长率为19.20%。

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，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，经仔细阅读，未发现本基金管理人存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4.1 公平交易制度的公平性分析

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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。

4.4.2 报告期内基金的定期报告

4.4.3 报告期内基金的定期报告

4.4.4 报告期内基金的定期报告

4.4.5 报告期内基金的定期报告

4.4.6 报告期内基金的定期报告

4.4.7 报告期内基金的定期报告

4.4.8 报告期内基金的定期报告

4.4.9 报告期内基金的定期报告

4.4.10 报告期内基金的定期报告

4.4.11 报告期内基金的定期报告

4.4.12 报告期内基金的定期报告

4.4.13 报告期内基金的定期报告

4.4.14 报告期内基金的定期报告

4.4.15 报告期内基金的定期报告

4.4.16 报告期内基金的定期报告

4.4.17 报告期内基金的定期报告

4.4.18 报告期内基金的定期报告

4.4.19 报告期内基金的定期报告

4.4.20 报告期内基金的定期报告

4.4.21 报告期内基金的定期报告

4.4.22 报告期内基金的定期报告

4.4.23 报告期内基金的定期报告

4.4.24 报告期内基金的定期报告

4.4.25 报告期内基金的定期报告

4.4.26 报告期内基金的定期报告

4.4.27 报告期内基金的定期报告

4.4.28 报告期内基金的定期报告

4.4.29 报告期内基金的定期报告

4.4.30 报告期内基金的定期报告

4.4.31 报告期内基金的定期报告

4.4.32 报告期内基金的定期报告

4.4.33 报告期内基金的定期报告

4.4.34 报告期内基金的定期报告

4.4.35 报告期内基金的定期报告

4.4.36 报告期内基金的定期报告

4.4.37 报告期内基金的定期报告

4.4.38 报告期内基金的定期报告

4.4.39 报告期内基金的定期报告

4.4.40 报告期内基金的定期报告

4.4.41 报告期内基金的定期报告

4.4.42 报告期内基金的定期报告

4.4.43 报告期内基金的定期报告

4.4.44 报告期内基金的定期报告

4.4.45 报告期内基金的定期报告

4.4.46 报告期内基金的定期报告

4.4.47 报告期内基金的定期报告

4.4.48 报告期内基金的定期报告

4.4.49 报告期内基金的定期报告

4.4.50 报告期内基金的定期报告

4.4.51 报告期内基金的定期报告

4.4.52 报告期内基金的定期报告

4.4.53 报告期内基金的定期报告

4.4.54 报告期内基金的定期报告

4.4.55 报告期内基金的定期报告

4.4.56 报告期内基金的定期报告

4.4.57 报告期内基金的定期报告

4.4.58 报告期内基金的定期报告

4.4.59 报告期内基金的定期报告

4.4.60 报告期内基金的定期报告

4.4.61 报告期内基金的定期报告

4.4.62 报告期内基金的定期报告

4.4.63 报告期内基金的定期报告

4.4.64 报告期内基金的定期报告

4.4.65 报告期内基金的定期报告

4.4.66 报告期内基金的定期报告

4.4.67 报告期内基金的定期报告

4.4.68 报告期内基金的定期报告

4.4.69 报告期内基金的定期报告

4.4.70 报告期内基金的定期报告

4.4.71 报告期内基金的定期报告

4.4.72 报告期内基金的定期报告

4.4.73 报告期内基金的定期报告

4.4.74 报告期内基金的定期报告

4.4.75 报告期内基金的定期报告

4.4.76 报告期内基金的定期报告

4.4.77 报告期内基金的定期报告

4.4.78 报告期内基金的定期报告

4.4.79 报告期内基金的定期报告

4.4.80 报告期内基金的定期报告

4.4.81 报告期内基金的定期报告

4.4.82 报告期内基金的定期报告

4.4.83 报告期内基金的定期报告

4.4.84 报告期内基金的定期报告

4.4.85 报告期内基金的定期报告

4.4.86 报告期内基金的定期报告

4.4.87 报告期内基金的定期报告

4.4.88 报告期内基金的定期报告

4.4.89 报告期内基金的定期报告

4.4.90 报告期内基金的定期报告

4.4.91 报告期内基金的定期报告

4.4.92 报告期内基金的定期报告

4.4.93 报告期内基金的定期报告

4.4.94 报告期内基金的定期报告

4.4.95 报告期内基金的定期报告

4.4.96 报告期内基金的定期报告

4.4.97 报告期内基金的定期报告

4.4.98 报告期内基金的定期报告

4.4.99 报告期内基金的定期报告

4.4.100 报告期内基金的定期报告