

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 农银汇理策略价值混合型证券投资基金

交易代码 660004

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2009年7月29日

报告期末基金份额总额 199,878,911.08份

基金投资目标 通过精选具有较高投资价值的股票,综合运用多种有效投资策略,力求实现基金资产的稳健增长。

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2017年7月1日起至9月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2017年7月1日—2017年9月30日)

1.本期已实现收益 11,328,358.83

2.本期利润 26,289,303.00

3.加权平均基金份额净值 0.9301

4.期末基金份额净值 0.96238

5.期末可供分配基金份额净值 0.9624

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,计价费用后实际收益率水平将低于所列示数字。

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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 7.07% 0.81% 3.26% 0.04% 3.43% 0.37%

自2015年10月8日起,“沪深300指数+75%中证全债指数”=“中信标普全债指数”变更为“沪深300指数+75%中证全债指数+25%”。

3.2.2本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

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,计价费用后实际收益率水平将低于所列示数字。

3.2.3基金净值表现

3.2.1.1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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券A

3.2.2.1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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券B

3.2.2.2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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券C

3.2.2.3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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券D

3.2.2.4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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券E

3.2.2.5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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券F

3.2.2.6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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券G

3.2.2.7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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券H

3.2.2.8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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券I

3.2.2.9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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券J

3.2.2.10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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券K

3.2.2.11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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券L

3.2.2.12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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券M

3.2.2.13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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券N

3.2.2.14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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券O

3.2.2.15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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券P

3.2.2.16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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券Q

3.2.2.17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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券R

3.2.2.18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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③

过去三个月 0.0286% 0.0012% 0.3450% 0.0000% 0.0645% 0.0012%

本基金收益分配是按日结转份额。

农银14天理财债券S

3.2.2.19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 净值收益率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率差额③ ①-② ④-③