

## 农银汇理深证100指数增强型证券投资基金

## 2012第四季度报告

2012年12月31日

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2013年1月21日

## §1 重要提示

基金管理人和基金托管人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，并对本报告的内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金的合同规定，于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理承诺:勤勉尽责地按照合同约定管理基金，但不保证基金一定盈利。

基金经理过往业绩并不代表未来表现。投资人选择基金时应仔细阅读基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	农银深证100指数
交易代码	660014
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月14日
报告期基金总资产	102,129,304.04亿元
本基金主要投资于深证100指数成份股，即股票类走势的指基指数，通过股票资产的配置和适当的现金持有，以求得一定的风险调整后的收益。	
本基金的投资目标是实现基金资产的长期增值，为投资者提供稳定的收入。	
本基金的投资策略是通过股票资产的配置和适当的现金持有，以求得一定的风险调整后的收益。	
本基金的业绩比较基准是深证100指数收益率×4.5%+银行活期存款利率(税后)。	
本基金为较高风险、较高收益的基金产品。	
基金管理人:农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人:中国光大银行股份有限公司	

## §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	
1.本期已实现收益	6,836,949.22
2.本期利润	18,670,600.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0547
4.期末基金份额净值	120,294,876.90
5.期末基金资产净值	11,129.29

注:1.本公司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,本期利润为期初至本期末收入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,计价费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.1.1 报告期按基金的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	业绩比较基准收益差率③	业绩比较基准收益率差率④	①-③	②-④
过去三个月	12.14%	0.72%	4.94%	1.28%	7.20%	-0.56%

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



注:1.本基金成立日为2012年9月14日,至2012年12月31日不高于1%。

2.本基金投资比例为基金资产的90%-95%,投资的标的指数成分股及其备选股的比例不高于股票投资的50%,现金类资产比例不高于5%。

3.根据法律法规规定,本基金合同生效日起六个月内,至本报告期末尚未处于建仓期。

3.3 其他指标

## §4 管理人报告

4.1 基金经理/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
宋永安	本基金基金经理	2012年9月4日	-	5 硕士,具有证券从业资格,曾任农银汇理基金管理公司金融研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司研究员、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守纪律情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的治理原则和内部控制制度,并根据基金份额持有人的利益的原则,履行诚实守信、谨慎勤勉的义务。

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,基金管理人严格执行了《证券投资基金管理办法》公平交易制度的规定,遵循了公平交易的原则,未发现不公平交易的情况。

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 报告期内基金的绩效评估说明

4.4.1 报告期内基金净值增长率和排名

本基金期内,基于仓位调整,根据定性和定量的分析采取了审慎的仓位操作。本基金为指数增强基金,跟踪指数收益同时强调操作来获得超额收益。

我国经济在去年开始触底企稳,房地产和基建投资首先底回升,然后消费和出口也小幅反弹,因此带动整体经济企稳。在经济企稳之后,水泥、钢铁、煤炭等原材料价格开始企稳,相关原材料和公司产品库存开始抬升,随后企业进入了一个不存坏账的阶段。经济基本面的阶段大概率几个季度才能见底,在这期间内中国经济会是相对稳定的。

深证100基金定价定投的方式进行风险管理,通过定性和定量的手段进行个股的选择和行业的配置,以期获得超越基准的收益。

4.4.2 报告期内基金业绩评价

截至本报告期末基金净值增长率为1.1229%;本报告期基金份额净值增长率为12.14%,业绩比较基准收益率为4.94%。

## §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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	109,519,072.50	81.06
2	固定收益投资	4,415,400.00	3.27
3	资产支持证券投资	4,415,400.00	3.27
4	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.74
5	银行存款和结算备付金合计	16,711,903.07	12.37
6	其他资产	3,468,628.65	2.57
7	合计	135,115,004.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本报告期无股票投资。

## §6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	报告期初基金资产总额	413,666,247.37	
2	报告期基金申购金额	1,752,030.94	
3	报告期基金赎回金额	308,288,973.37	
4	报告期基金持有的现金及现金等价物	-	
5	报告期期末基金资产总额	107,129,304.04	

注:总申购的金额扣除申购费用;赎回金额扣除赎回费用。

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

-

## §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予本基金募集的文件;

2.《农银汇理深证100指数增强型证券投资基金基金合同》;

3.《农银汇理深证100指数增强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;

6.基金产品资料概要;

7.基金募集申请报告;

8.基金上市公告书;

9.基金定期报告、临时公告及澄清公告;

10.基金半年报、年报。

11.基金估值报告;

12.基金资产净值和份额净值的计算方法及程序;

13.基金会计制度、报表格式及主要会计政策;

14.基金转换份额的核算方法及程序;

15.基金申购、赎回、转换、转托管的核算方法及程序;

16.基金费用的收取、支付及处理方法;

17.基金收益分配的原则、方法及程序;

18.基金客户服务和投诉的受理与处理方法;

19.基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则;

20.基金投资中小企业私募债的管理制度;

21.基金投资股指期货的管理制度;

22.基金投资国债期货的管理制度;

23.基金投资资产支持证券的管理制度;

24.基金投资期权的管理制度;

25.基金投资商品期货的管理制度;

26.基金投资黄金的管理制度;

27.基金投资外汇的管理制度;

28.基金投资境外证券的管理制度;

29.基金投资香港上市股票的管理制度;

30.基金投资权证的管理制度;

31.基金投资资产支持证券的管理制度;

32.基金投资柜台交易的管理制度;

33.基金投资集合资产管理计划的管理制度;

34.基金投资资产支持专项计划的管理制度;

35.基金投资资产支持计划的管理制度;

36.基金投资资产支持计划的管理制度;

37.基金投资资产支持计划的管理制度;

38.基金投资资产支持计划的管理制度;

39.基金投资资产支持计划的管理制度;

40.基金投资资产支持计划的管理制度;

41.基金投资资产支持计划的管理制度;

42.基金投资资产支持计划的管理制度;

43.基金投资资产支持计划的管理制度;

44.基金投资资产支持计划的管理制度;

45.基金投资资产支持计划的管理制度;

46.基金投资资产支持计划的管理制度;

47.基金投资资产支持计划的管理制度;

48.基金投资资产支持计划的管理制度;

49.基金投资资产支持计划的管理制度;

50.基金投资资产支持计划的管理制度;

51.基金投资资产支持计划的管理制度;

52.基金投资资产支持计划的管理制度;

53.基金投资资产支持计划的管理制度;

54.基金投资资产支持计划的管理制度;