

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构... 基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

1.2 基金概况

基金名称:农银汇理行业轮动股票型证券投资基金

基金代码:660115

基金运作方式:契约开放式

基金合同生效日:2012年11月14日

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告期末基金份额总额:341,379,052.33份

报告期末基金份额持有人户数:不定期

基金资产规模:总资产 427,426,263.62元
净资产 338,767,432.33元

1.4 基金产品说明

基金的投资目标:本基金将通过对宏观经济周期和行业景气度的分析判断,充分利用股票和债券两类资产之间的联动效应,优化投资组合的资产配置,在有效控制风险的前提下,力争为基金份额持有人取得超越业绩比较基准的投资回报。

基金的投资策略:本基金注重我国宏观经济周期波动力机制和周期现象,研究我国宏观经济运行规律,捕捉经济周期波动中的投资机会,在充分分散投资的基础上,寻求行业轮动带来的投资机会,行业轮动策略是本基金的核心投资策略,其在策略上的表现为:根据对宏观经济周期波动趋势的判断,在策略上选择轮动周期中的优势行业进行配置,并选择行业景气度上升的个股进行重点投资。

2.1 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中证国债指数收益率

2.2 基金业绩比较基准

阶段	业绩比较基准	基金净值增长率	业绩比较基准
过去一个月	-2.72%	2.19%	-11.94%
过去三个月	15.81%	2.19%	-8.60%
过去六个月	27.18%	1.72%	-8.98%
自基金合同生效起至今	27.52%	1.51%	0.61%

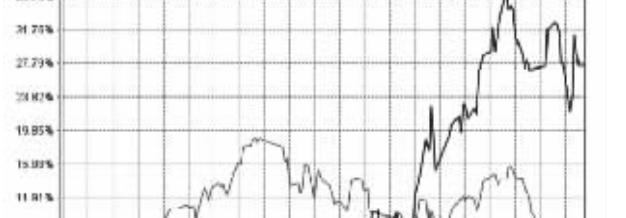
2.2.1 主要会计数据和财务指标

项目	本期	上期
营业收入	47,631,776.60	47,631,776.60
净利润	2,967,980.31	2,967,980.31
总资产	427,426,263.62	534,517,879.76
净资产	338,767,432.33	3,050,548.00

2.2.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段	业绩比较基准	基金净值增长率	业绩比较基准
过去一个月	-2.72%	2.19%	-11.94%
过去三个月	15.81%	2.19%	-8.60%
过去六个月	27.18%	1.72%	-8.98%
自基金合同生效起至今	27.52%	1.51%	0.61%

基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.1 基金管理人及基金基本情况

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

3.2 基金管理人主要人员情况

基金管理人主要人员情况:基金管理人高级管理人员、基金经理、基金业务、基金销售、基金运营、基金会计、基金法律、基金信息技术等部门负责人情况。

3.3 基金管理人内部控制情况

姓名	职位	任职日期
李进	董事长	2012年11月14日
王彬	总经理	2012年11月14日

3.4 基金管理人内部控制制度

基金管理人内部控制制度:基金管理人建立了完善的内部控制制度,包括:投资管理、风险控制、合规管理、信息技术、基金销售、基金运营、基金会计、基金法律、基金人力资源等。

3.5 基金管理人内部控制执行情况

基金管理人内部控制执行情况:基金管理人严格执行内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

3.6 基金管理人内部控制评价

基金管理人内部控制评价:基金管理人内部控制制度完善,执行情况良好,能够有效防范和控制风险。

3.7 基金管理人内部控制缺陷及整改措施

基金管理人内部控制缺陷及整改措施:基金管理人不存在内部控制缺陷,如有发现,将立即采取整改措施。

4.1 基金投资组合报告

基金投资组合报告:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资组合进行报告。

4.2 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

5.1 资产负债表

项目	本期	上期
总资产	427,426,263.62	534,517,879.76
净资产	338,767,432.33	3,050,548.00

农银汇理行业轮动股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6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:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

基金投资组合报告

项目	本期	上期
股票	338,767,432.33	3,050,548.00
债券	47,631,776.60	47,631,776.60
货币市场基金	2,967,980.31	2,967,980.31
其他	2,967,980.31	2,967,980.31

6.1 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

6.2 基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

6.3 基金管理人内部控制

基金管理人内部控制:基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.4 基金管理人内部控制执行情况

基金管理人内部控制执行情况:基金管理人严格执行内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.5 基金管理人内部控制评价

基金管理人内部控制评价:基金管理人内部控制制度完善,执行情况良好,能够有效防范和控制风险。

6.6 基金管理人内部控制缺陷及整改措施

基金管理人内部控制缺陷及整改措施:基金管理人不存在内部控制缺陷,如有发现,将立即采取整改措施。

6.7 基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60

6.8 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

6.9 基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

6.10 基金管理人内部控制

基金管理人内部控制:基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.11 基金管理人内部控制执行情况

基金管理人内部控制执行情况:基金管理人严格执行内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.12 基金管理人内部控制评价

基金管理人内部控制评价:基金管理人内部控制制度完善,执行情况良好,能够有效防范和控制风险。

6.13 基金管理人内部控制缺陷及整改措施

基金管理人内部控制缺陷及整改措施:基金管理人不存在内部控制缺陷,如有发现,将立即采取整改措施。

6.14 基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2013年8月27日

基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60

6.1 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

6.2 基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

6.3 基金管理人内部控制

基金管理人内部控制:基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.4 基金管理人内部控制执行情况

基金管理人内部控制执行情况:基金管理人严格执行内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.5 基金管理人内部控制评价

基金管理人内部控制评价:基金管理人内部控制制度完善,执行情况良好,能够有效防范和控制风险。

6.6 基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60

6.7 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

6.8 基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

6.9 基金管理人内部控制

基金管理人内部控制:基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.10 基金管理人内部控制执行情况

基金管理人内部控制执行情况:基金管理人严格执行内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.11 基金管理人内部控制评价

基金管理人内部控制评价:基金管理人内部控制制度完善,执行情况良好,能够有效防范和控制风险。

6.12 基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60

6.13 基金业绩表现

基金业绩表现:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的投资业绩进行报告。

6.14 基金风险控制

基金风险控制:基金管理人将按照法律法规和基金合同的约定,对基金资产的风险控制进行报告。

6.15 基金管理人内部控制

基金管理人内部控制:基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全和投资者利益的最大化。

6.16 基金投资组合报告

代码	名称	数量(股)	公允价值
002456	广田股份	617,963	29,452,116.58
300058	蓝色光标	681,028	28,398,867.60