



农银汇理深证100指数增强型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013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2013年7月1日起至9月30止。

基金简称	
基金代码	660014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月4日
报告期末基金份额总额	41,376,154.06份
投资目标	本基金采用指数增强型投资策略,在被动复制指数的基础上结合主动管理的增强手段,力争基金净值增长率超越比较基准的长期期望收益率7.75%以内,且日跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,以期获得超越指数的指数业绩水平。
投资策略	深证100指数是综合反映深圳证券交易市场上股票整体走势的权重指数,本基金通过对深证100指数的有效跟踪和主动增强,力争为投资者提供一个能够分享深圳证券交易所上市股票系统性收益,并获取一定程度的超额收益的良好投资工具。
业绩比较基准	95%×深证100指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的基金品种。
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

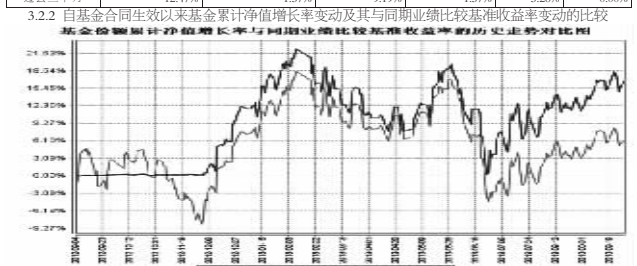
3.1 主要财务指标		3.2 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元		单位:人民币元	
报告期间(2013年7月1日至2013年9月30日)		报告期间(2013年7月1日至2013年9月30日)	
1.本期已实现收益	3,227,519.83	1.本期已实现收益	3,227,519.83
2.本期利润	5,954,786.17	2.本期利润	5,954,786.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.1235	3.加权平均基金份额本期利润	0.1235
4.期末基金资产净值	48,581,519.28	4.期末基金资产净值	48,581,519.28
5.期末基金份额净值	1.0888	5.期末基金份额净值	1.0888

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 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



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

基金合同于2012年9月4日(2012年9月4日)起六个月,建仓期满时,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介		4.2 基金管理人	
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限
宋永安	本基金经理	2012年9月4日	6
		说明	
		硕士,具有证券从业资格,历任长安基金管理公司金融工程部研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理、现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。	

农银汇理行业领先股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013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。

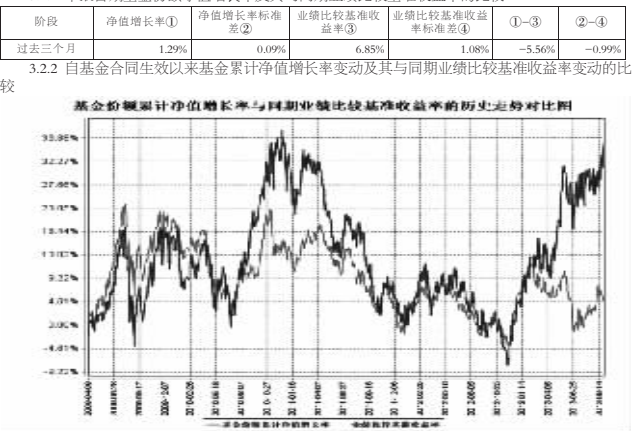
本报告期自2013年7月1日起至9月30止。

§2 基金产品概况	
基金简称	农银行业领先股票
交易代码	600022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月25日
报告期末基金份额总额	732,979,041.33份
投资目标	本基金将通过寻找受益于中国经济发展、在所属行业处于领先地位的上市公司,进一步优化投资组合,在严格控制风险的前提下,力争为投资者创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用传统的“自下而上”和“自上而下”相结合的方法构建投资组合。具体投资策略分为两个层次:首先是“自下而上”的大类资产配置,决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例;其次是在“自下而上”的个股企业选股策略,该策略对资产配置策略方向的具体实现,是本基金的核心投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证金融地产指数
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金品种,其风险收益水平高于货币型基金、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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标		3.2 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元		单位:人民币元	
报告期间(2013年7月1日至2013年9月30日)		报告期间(2013年7月1日至2013年9月30日)	
1.本期已实现收益	8,399,991.72	1.本期已实现收益	8,399,991.72
2.本期利润	10,502,398.91	2.本期利润	10,502,398.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0122	3.加权平均基金份额本期利润	0.0122
4.期末基金资产净值	744,002,307.22	4.期末基金资产净值	744,002,307.22
5.期末基金份额净值	1.0152	5.期末基金份额净值	1.0152

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



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

基金合同于2013年6月25日(2013年6月25日)起六个月,建仓期满时,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介		4.2 基金管理人	
姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限
徐勇	本基金基金经理	2013年6月25日	5
		说明	
		北京大学中国经济研究中心经济学硕士,具有基金从业资格,曾任交通银行资产管理部研究员、农银汇理基金管理有限公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理,现任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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则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

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理人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。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

今年三季度在一系列关于预期的宏观数据推出后市场出现一波反弹行情,上证指数涨幅10%,创业板表现更是抢眼,单季涨幅超过35%,从市场风格来看,以银行地产为代表的蓝筹股表现相对疲弱,而以信息服务、信息设备为代表的成长股表现强劲。传统行业中商业、交通运输等也因为出现一些催化因素而产生估值修复行情。

展望4季度,在经济转型的大背景下结构性行情依旧延续,依然坚持看好消费升级板块中的医疗保健、品牌消费、能源和移动互联等行业。同时,受益于通胀抬升的原材料、高端装备和消费品等行业也是本基金最关注的对象。本基金将把握业绩成长的主线,精选估值合理增长确定的上述领域的成长股,同时参与估值便宜、有催化因素的价值型公司的投资仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为1.29%,业绩比较基准收益率为0.85%。

5.1 报告期末基金资产组合情况		5.2 投资组合报告	
单位:份		单位:份	
报告期初基金份额总额	863,696,776.13	报告期初基金份额总额	863,696,776.13
报告期间基金份额申购份额	7,625,729.29	报告期间基金份额申购份额	7,625,729.29
报告期间基金份额赎回份额	138,343,464.09	报告期间基金份额赎回份额	138,343,464.09
报告期间基金份额净变动	732,979,041.33	报告期间基金份额净变动	732,979,041.33
报告期末基金份额总额	732,979,041.33	报告期末基金份额总额	732,979,041.33
注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换转出份额。		注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换转出份额。	
5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况		5.4 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况	
本报告期内无公司固有资金投资本基金管理基金情况。		本报告期内无公司固有资金投资本基金管理基金情况。	
5.5 备查文件目录		5.6 备查文件目录	
1.中国证监会核准本基金募集的文件;		1.中国证监会核准本基金募集的文件;	
2.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》;		2.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》;	
3.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金托管协议》;		3.《农银汇理行业领先股票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;		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和营业执照复印件。		5.基金托管人业务资格批件和营业执照复印件。	
5.7 查阅方式		5.8 查阅方式	
备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。		备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。	
投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。		投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。	

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	183,852,426.70	21.29
	其中:股票	183,852,426.70	21.29
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,000,000.00	46.31
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	278,699,677.37	32.20
6	其他资产	1,732,984.68	0.20
	合计	863,695,088.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		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十名股票投资明细	
代码		公允价值(元)	
A	农林、牧、渔	229,956.00	0.51
B	采矿业	1,287,317.00	2.86
C	制造业	22,001,370.67	48.84
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	221,732.00	0.49
E	建筑业	443,216.00	0.98
F	批发和零售业	1,923,645.00	4.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,499,314.00	3.33
J	金融业	4,026,432.00	8.94
K	房地产业	3,670,116.00	8.59
L	租赁和商务服务业	209,024.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,461,171.90	3.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	629,885.00	1.40
S	综合	352,115.80	0.78
合计		38,155,295.45	84.69

序号		股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601607	上海医药	862,991	13,436,709.87	1.81
2	000301	巨能股份	1,642,093	13,268,111.44	1.78
3	600420	现代制药	764,414	12,681,573.86	1.64
4	002020	京新药业	804,915	12,681,462.25	1.70
5	000538	云南白药	99,819	11,684,812.14	1.57
6	300347	菲林格尔	175,376	11,180,220.00	1.50
7	300206	理邦仪器	334,603	10,081,588.39	1.35
8	002202	金风科技	1,397,100	9,807,642.00	1.32
9	600527	江南高纤	1,065,800	7,822,972.00	1.05
10	600261	阳光照明	661,000	7,806,410.00	1.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.1 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 其他资产构成

3.10.1 其他资产构成		金额(元)
序号	名称	
1	存出保证金	132,456.42
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	287,167.00
5	应收申购款	1,313,361.26
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,732,984.68

5.10.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金金额变动

5.10.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细		5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。		本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	
5.10.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明		5.10.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。		本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。	
5.6 开放式基金份额变动		5.6 开放式基金份额变动	
单位:份		单位:份	
报告期初基金份额总额	863,696,776.13	报告期初基金份额总额	863,696,776.13
报告期间基金份额申购份额	7,625,729.29	报告期间基金份额申购份额	7,625,729.29
报告期间基金份额赎回份额	138,343,464.09	报告期间基金份额赎回份额	138,343,464.09
报告期间基金份额净变动	732,979,041.33	报告期间基金份额净变动	732,979,041.33
报告期末基金份额总额	732,979,041.33	报告期末基金份额总额	732,979,041.33
注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换转出份额。		注:总申购份额含红利再投资、转换入份额;总赎回份额含转换转出份额。	
5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况		5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况	
本报告期内无公司固有资金投资本基金管理基金情况。		本报告期内无公司固有资金投资本基金管理基金情况。	
5.5 备查文件目录		5.5 备查文件目录	
1.中国证监会核准本基金募集的文件;		1.中国证监会核准本基金募集的文件;	
2.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》;		2.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金基金合同》;	
3.《农银汇理行业领先股票型证券投资基金托管协议》;		3.《农银汇理行业领先股票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;		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和营业执照复印件。		5.基金托管人业务资格批件和营业执照复印件。	
5.7 查阅方式		5.8 查阅方式	
备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。		备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。	
投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。		投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。	

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	091907	11国债07	18,000	1,799,100.00	3.99

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 其他资产构成

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		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十名股票投资明细	
代码		公允价值(元)	
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,843,384.00	4.09
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	781,495.00	1.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	268,082.88	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	158,100.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,422,118.00	3.16
S	综合	-	-
合计		4,473,179.88	9.93

5.2 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股票投资明细		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十名股票投资明细			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	263,700	2,072,381.00	5.34
2	002024	苏宁云商	149,700	1,923,645.00	4.27
3	000651	格力电器	70,301	1,867,194.56	4.14
4	000333	美的集团	31,123	1,345,758.52	2.99
5	000001	平安银行	104,900	1,246,212.00	2.77
6	002241	聚龙声学	26,400	1,116,192.00	2.48
7	000663	中兴通讯	65,400	1,085,640.00	2.41
8	002415	康顺药业	38,500	1,016,600.00	2.26
9	000538	云南白药	8,557	1,001,682.42	2.22