

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:2014年10月23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2014年10月22日复核了本报告中涉及基金资产净值、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、误导性陈述或重大遗漏。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 农银大盘蓝筹股票; 交易代码, 600027; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2010年9月25日; 报告期末基金份额总额, 200,048,435.21份; 投资目标, 本基金将通过投资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...; 投资策略, 本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合...; 业绩比较基准, 本基金业绩比较基准为75%*沪深300指数+25%*中证红利指数; 风险收益特征, 本基金为较高风险、较高收益的股票型证券投资基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金; 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

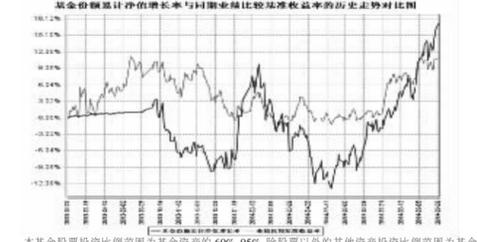
3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日至2014年9月30日); 1.本期已实现收益, 35,542,477.89; 2.本期利润, 68,641,153.22; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.3407; 4.期末基金份额净值, 1.0987; 5.期末基金份额净值, 1.0794

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。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①; 净值增长率②; 业绩比较基准收益率③; ①-③; ②-④; 最近3个月, 22.45%, 1.00%, 10.23%, 0.67%, 12.22%, 0.33%

3.2 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



本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,除股票以外的其他资产投资比例范围为基金

农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月23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2014年10月22日复核了本报告中涉及基金资产净值、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先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。
本报告自2014年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 农银大盘蓝筹股票; 交易代码, 600006; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日期, 2010年9月1日; 报告期末基金份额总额, 1,299,573,851.16份; 投资目标, 本基金通过投资受益于中国经济发展的行业,通过投资于本基金分析和挖掘具有良好成长性的上市公司,以取得基金资产的长期增值; 投资策略, 本基金采用传统的“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建投资组合...; 业绩比较基准, 本基金业绩比较基准为75%*沪深300指数+25%*中证红利指数; 风险收益特征, 本基金为较高风险、较高收益的股票型证券投资基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金; 基金管理人, 农银汇理基金管理有限公司; 基金托管人, 中国建设银行股份有限公司

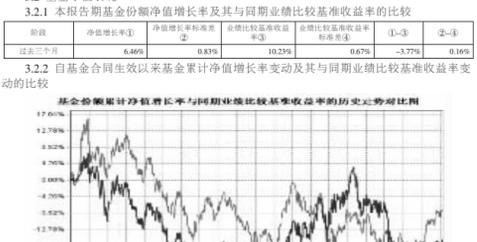
3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日至2014年9月30日); 1.本期已实现收益, -11,892,109.89; 2.本期利润, 68,641,153.22; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0507; 4.期末基金份额净值, 1.0987; 5.期末基金份额净值, 0.8456

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。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率①; 净值增长率②; 业绩比较基准收益率③; ①-③; ②-④; 最近3个月, 6.46%, 0.83%, 10.23%, -3.77%, 0.16%

3.2 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



本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于大盘蓝筹股票的比例不少于股票投资的80%,除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%-40%,其中权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不超过基金资产净值的5%,本基金建仓期为基金合同生效日(2010年9月1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

Table with 2 columns: 姓名, 李勇; 职务, 本基金基金经理; 任职日期, 2010年11月4日; 离任日期, -; 证券从业年限, 10; 说明, 经济学硕士,CFA,具有基金从业资格,历任东北证券研究员,国信证券研究员,国信基金研究员,国信基金基金经理,国信基金基金经理,农银汇理基金基金经理,农银汇理基金基金经理,农银汇理基金基金经理,农银汇理基金基金经理

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》和其他有关法律法规、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
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司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运作分析
今年经济下滑最大的压力来自于地产,伴随着9月底地产政策的实质性放松,预计未来地产销售将开始企稳,这种背景下经济失速的风险已经解除。
随着利率的不断下降,改革带来的效益提升以及主要产业产能去化的主要阶段结束,未来市场逐渐上行可期。从渗透率的角度而言,低渗透率的新兴成长行业仍是未来主要的盈利来源,比如新能源汽车、机器人等。

针对4季度而言,鉴于目前市值成长股估值已经很高,低估值没有增长缺陷的白马成长股、医药以及缩量调整的地产预计将有不错的相对收益,本基金未来的投资重点仍将集中在医药及区间个股的部分行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期本基金份额净值增长6.46%,同期业绩比较基准收益率为10.23%。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 2 columns: 序号, 1; 股票代码, 000071; 股票名称, 中航飞机; 数量(股), 32,235,600.00; 公允价值(元), 32,235,600.00; 占基金资产净值比例(%), 2.93; 占股票市值比例(%), 0.29

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, A; 行业名称, 农林、牧、渔业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, B; 行业名称, 采矿业; 公允价值(元), 49,966,172.08; 占基金资产净值比例(%), 4.50

Table with 2 columns: 代码, C; 行业名称, 制造业; 公允价值(元), 508,209,915.04; 占基金资产净值比例(%), 46.26

Table with 2 columns: 代码, D; 行业名称, 电力、热力、燃气及水生产和供应业; 公允价值(元), 113,913,390.68; 占基金资产净值比例(%), 10.37

Table with 2 columns: 代码, E; 行业名称, 建筑业; 公允价值(元), 57,052,139.53; 占基金资产净值比例(%), 5.19

Table with 2 columns: 代码, F; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), 31,132,066.60; 占基金资产净值比例(%), 2.83

Table with 2 columns: 代码, G; 行业名称, 交通运输、仓储和邮政业; 公允价值(元), 35,356,920.03; 占基金资产净值比例(%), 3.25

Table with 2 columns: 代码, H; 行业名称, 住宿和餐饮业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, I; 行业名称, 信息传输、软件和信息技术服务业; 公允价值(元), 95,076,696.34; 占基金资产净值比例(%), 8.62

Table with 2 columns: 代码, J; 行业名称, 金融业; 公允价值(元), 35,356,920.03; 占基金资产净值比例(%), 3.25

Table with 2 columns: 代码, K; 行业名称, 房地产业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, L; 行业名称, 租赁和商务服务业; 公允价值(元), 70,720,040.82; 占基金资产净值比例(%), 6.44

Table with 2 columns: 代码, M; 行业名称, 科学研究和技术服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, N; 行业名称, 水利、环境和公共设施管理业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, O; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, P; 行业名称, 教育; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, Q; 行业名称, 卫生和社会工作; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, R; 行业名称, 文化、体育和娱乐业; 公允价值(元), 23,086,276.63; 占基金资产净值比例(%), 2.10

Table with 2 columns: 代码, S; 行业名称, 综合; 公允价值(元), 1,120,739,225.49; 占基金资产净值比例(%), 100.00

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

Table with 2 columns: 序号, 1; 股票代码, 600018; 股票名称, 华鲁恒升; 数量(股), 1,080,000; 公允价值(元), 49,484,178.00; 占基金资产净值比例(%), 4.50

Table with 2 columns: 序号, 2; 股票代码, 002400; 股票名称, 明胶股份; 数量(股), 1,565,336; 公允价值(元), 39,352,547.04; 占基金资产净值比例(%), 3.58

Table with 2 columns: 序号, 3; 股票代码, 600271; 股票名称, 航天信息; 数量(股), 1,371,704; 公允价值(元), 34,553,223.76; 占基金资产净值比例(%), 3.14

Table with 2 columns: 序号, 4; 股票代码, 000997; 股票名称, 新大陆; 数量(股), 1,230,700; 公允价值(元), 32,662,778.00; 占基金资产净值比例(%), 2.97

Table with 2 columns: 序号, 5; 股票代码, 300228; 股票名称, 富瑞特科; 数量(股), 555,709; 公允价值(元), 32,142,263.80; 占基金资产净值比例(%), 2.94

Table with 2 columns: 序号, 6; 股票代码, 000768; 股票名称, 中航飞机; 数量(股), 2,041,520; 公允价值(元), 32,235,600.00; 占基金资产净值比例(%), 2.93

Table with 2 columns: 序号, 7; 股票代码, 601877; 股票名称, 华信国际; 数量(股), 4,094,300; 公允价值(元), 31,094,597.00; 占基金资产净值比例(%), 2.85

Table with 2 columns: 序号, 8; 股票代码, 000270; 股票名称, 华数传媒; 数量(股), 1,277,328; 公允价值(元), 31,779,721.60; 占基金资产净值比例(%), 2.89

Table with 2 columns: 序号, 9; 股票代码, 601888; 股票名称, 中国国旅; 数量(股), 828,294; 公允价值(元), 31,367,493.76; 占基金资产净值比例(%), 2.85

Table with 2 columns: 序号, 10; 股票代码, 000963; 股票名称, 华冠国际; 数量(股), 519,734; 公允价值(元), 31,132,066.60; 占基金资产净值比例(%), 2.83

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 1; 资产名称, 存出保证金; 金额(元), 291,628.90; 占基金资产净值比例(%), 0.27

Table with 2 columns: 序号, 2; 资产名称, 应收证券清算款; 金额(元), 39,065,203.02; 占基金资产净值比例(%), 3.56

Table with 2 columns: 序号, 3; 资产名称, 应收股利; 金额(元), 15,723.35; 占基金资产净值比例(%), 0.14

Table with 2 columns: 序号, 4; 资产名称, 应收利息; 金额(元), 228,576.19; 占基金资产净值比例(%), 0.21

Table with 2 columns: 序号, 5; 资产名称, 其他应收款; 金额(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 序号, 6; 资产名称, 预付账款; 金额(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 序号, 7; 资产名称, 其他流动资产; 金额(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 序号, 8; 资产名称, 其他资产; 金额(元), 39,600,531.46; 占基金资产净值比例(%), 3.60

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 2 columns: 序号, 1; 股票代码, 000778; 股票名称, 中航飞机; 流通受限部分的公允价值(元), 32,235,600.00; 占基金资产净值比例(%), 2.93; 流通受限情况说明, 无

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, A; 行业名称, 农林、牧、渔业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, B; 行业名称, 采矿业; 公允价值(元), 399,830,942.79; 占基金资产净值比例(%), 36.12

Table with 2 columns: 代码, C; 行业名称, 制造业; 公允价值(元), 399,830,942.79; 占基金资产净值比例(%), 36.12

Table with 2 columns: 代码, D; 行业名称, 电力、热力、燃气及水生产和供应业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, E; 行业名称, 建筑业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, F; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, G; 行业名称, 交通运输、仓储和邮政业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, H; 行业名称, 住宿和餐饮业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, I; 行业名称, 信息传输、软件和信息技术服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, J; 行业名称, 金融业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, K; 行业名称, 房地产业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, L; 行业名称, 租赁和商务服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, M; 行业名称, 科学研究和技术服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, N; 行业名称, 水利、环境和公共设施管理业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, O; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, P; 行业名称, 教育; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, Q; 行业名称, 卫生和社会工作; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, R; 行业名称, 文化、体育和娱乐业; 公允价值(元), 51,708,600.99; 占基金资产净值比例(%), 4.74

Table with 2 columns: 代码, S; 行业名称, 其他; 公允价值(元), 2,172,619.98; 占基金资产净值比例(%), 0.20

Table with 2 columns: 代码, T; 行业名称, 综合; 公允价值(元), 453,712,154.76; 占基金资产净值比例(%), 41.60

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 2 columns: 代码, A; 行业名称, 农林、牧、渔业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, B; 行业名称, 采矿业; 公允价值(元), 16,325,885.38; 占基金资产净值比例(%), 1.49

Table with 2 columns: 代码, C; 行业名称, 制造业; 公允价值(元), 5,849,921.00; 占基金资产净值比例(%), 0.54

Table with 2 columns: 代码, D; 行业名称, 电力、热力、燃气及水生产和供应业; 公允价值(元), 5,849,921.00; 占基金资产净值比例(%), 0.54

Table with 2 columns: 代码, E; 行业名称, 建筑业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, F; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, G; 行业名称, 交通运输、仓储和邮政业; 公允价值(元), 9,518,915.90; 占基金资产净值比例(%), 0.88

Table with 2 columns: 代码, H; 行业名称, 住宿和餐饮业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, I; 行业名称, 信息传输、软件和信息技术服务业; 公允价值(元), 54,613,857.77; 占基金资产净值比例(%), 5.02

Table with 2 columns: 代码, J; 行业名称, 金融业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, K; 行业名称, 房地产业; 公允价值(元), 5,385,460.33; 占基金资产净值比例(%), 0.49

Table with 2 columns: 代码, L; 行业名称, 租赁和商务服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, M; 行业名称, 科学研究和技术服务业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, N; 行业名称, 水利、环境和公共设施管理业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, O; 行业名称, 批发和零售业; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, P; 行业名称, 教育; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, Q; 行业名称, 卫生和社会工作; 公允价值(元), -; 占基金资产净值比例(%), -

Table with 2 columns: 代码, R; 行业名称, 文化、体育和娱乐业; 公允价值(元), 4,497,800.00; 占基金资产净值比例(%), 0.41

Table with 2 columns: 代码, S; 行业名称, 综合; 公允价值(元), 279,268,964.01; 占基金资产净值比例(%), 25.52

5.4 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

Table with 2 columns: 序号, 1; 股票代码, 600584; 股票名称, 春兴科技; 数量(股), 1,221,356; 公允价值(元), 14,582,990.64; 占基金资产净值比例(%), 4.78

Table with 2 columns: 序号, 2; 股票代码, 600794; 股票名称, 伊泰煤炭; 数量(股), 796,562; 公允价值(元), 9,518,915.90; 占基金资产净值比例(%), 3.02

Table with 2 columns: 序号, 3; 股票代码, 002588; 股票名称, 丰林集团; 数量(股), 336,551; 公允价值(元), 9,234,410.64; 占基金资产净值比例(%), 3.13

Table with 2 columns: 序号, 4; 股票代码, 002153; 股票名称, 石基信息; 数量(股), 131,100; 公允价值(元), 9,199,287.00; 占基金资产净值比例(%), 3.01

Table with 2 columns: 序号, 5; 股票代码, 00555; 股票名称, 鼎泰新材; 数量(股), 212,801; 公允价值(元), 8,884,441.75; 占基金资产净值比例(%), 2.91

Table with 2 columns: 序号, 6; 股票代码, 300072; 股票名称, 三钢闽光; 数量(股), 315,120; 公允价值(元), 8,549,265.60; 占基金资产净值比例(%), 2.80

Table with 2 columns: 序号, 7; 股票代码, 002363; 股票名称, 隆基机械; 数量(股), 601,130; 公允价值(元), 8,289,582.70; 占基金资产净值比例(%), 2.72

Table with 2 columns: 序号, 8; 股票代码, 002019; 股票名称, 鑫富药业; 数量(股), 222,231; 公允价值(元), 7,762,528.83; 占基金资产净值比例(%), 2.54

Table with 2 columns: 序号, 9; 股票代码, 000625; 股票名称, 长安汽车; 数量(股), 551,200; 公允价值(元), 7,531,440.00; 占基金资产净值比例(%), 2.47

Table with 2 columns: 序号, 10; 股票代码, 002470; 股票名称, 金正大; 数量(股), 286,272; 公允价值(元), 7,122,447.36; 占基金资产净值比例(%), 2.33

5.4 报告