

农银汇理中小盘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

61 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。

Table with 2 columns: 基金名称, 交易代码, 基金运作方式, etc.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

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.上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据。

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, etc.

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



1.本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于中小盘股票的比例不低于股票投资的80%。

2.农银汇理基金管理有限公司根据《农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,自2012年11月1日起,将农银汇理中小盘股票型证券投资基金的业绩比较基准由“30%\*天相中证大盘指数+45%\*天相中证中盘指数+25%\*中证全债指数”更改为“70%\*中证大盘指数+75%\*中证全债指数收益率+25%”。

4.1 基金经理

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循《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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年8月,最新公布的投资增加值下降6.0%,这也是2009年以来的最低水平,对于低迷的经济数据,政府的容忍度已经明显上升,这意味着不大可能出现合大刺激举措。

从类资产的表现看,年初前三季度,指数表现分化,风格特征明显,小指数大幅跑赢主板指数。三季度以来,部分大盘股也开始表现,市场风格从完全中小盘逐步过渡到部分低大盘股和中小盘共同表现的状态,这也使得主板指数从反复震荡逐步开始走强。

展望四季度,一方面,经济数据的企稳下仍将一定程度上刺激市场情绪的神经,另一方面四中全会即将召开,粤港澳、土地财政、混合所有制等方面的改革或将加速,对政策的期待将使一部分行业和个股反复交易,预计结构性行情和主题投资将是市场获利的主要方向,这种情况下,四季度的市场或将呈现为即强即弱,从中期角度看,股票投资方向的关键决定因素是对系统性风险预期的变化,而非经济强弱。为此,我们短期内仍将坚持沿着成长和改革的路线,并特别关注二线蓝筹的机会,创新、成长和改革依然是投资的主要方向。

本基金未来的投资重点将是优质的成长和二线蓝筹,在深入研究优质上市公司的基础上进行配置。

4.4.2 报告期内基金的投资业绩和净值表现

报告期内基金净值增长12.72%,同期业绩比较基准收益率为16.49%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元)

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 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,浙江康恩贝制药股份有限公司(下称:康恩贝,股票代码:600572)发布《浙江康恩贝制药股份有限公司关于最近五年公司被监管部门立案调查并采取监管措施或处罚情况的公告》(证监公字[2014]1129号)。

2013年11月20日,石家庄东方热电股份有限公司(下称:东方热电,股票代码:000958)发布《石家庄东方热电股份有限公司关于最近五年监管部门立案调查并采取监管措施或处罚情况的公告》(证监公字[2014]077)。

2013年11月8日,浙江华策影视股份有限公司(下称:华策影视,股票代码:300133)发布《关于重大资产重组事项申请停牌的公告》(公告编号:2013-072)。

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 其他资产明细

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 920,796,563.70

注:总申购份额含红利再投资、转入份额;总赎回份额含转出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

8 备查文件目录

1.中国证监会核准农银汇理中小盘股票型证券投资基金募集的文件;

2.农银汇理中小盘股票型证券投资基金基金合同;

3.农银汇理中小盘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;

5.基金托管人业务资格批件、营业执照;

6.存放地点:基金管理人办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。

7.查阅方式:投资者可至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。

农银汇理基金管理有限公司 2014年10月23日

农银汇理中证500指数证券投资基金

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

61 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。

Table with 2 columns: 基金名称, 交易代码, 基金运作方式, etc.

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

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.上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据。

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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, etc.

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



1.本基金股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,投资于中证500指数的比例不低于股票资产的90%。

2.本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据。

4.1 基金经理

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理时间, 证券从业年限

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循《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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2014年8月,最新公布的投资增加值下降6.0%,这也是2009年以来的最低水平,对于低迷的经济数据,政府的容忍度已经明显上升,这意味着不大可能出现合大刺激举措。

从类资产的表现看,年初前三季度,指数表现分化,风格特征明显,小指数大幅跑赢主板指数。三季度以来,部分大盘股也开始表现,市场风格从完全中小盘逐步过渡到部分低大盘股和中小盘共同表现的状态,这也使得主板指数从反复震荡逐步开始走强。

展望四季度,一方面,经济数据的企稳下仍将一定程度上刺激市场情绪的神经,另一方面四中全会即将召开,粤港澳、土地财政、混合所有制等方面的改革或将加速,对政策的期待将使一部分行业和个股反复交易,预计结构性行情和主题投资将是市场获利的主要方向,这种情况下,四季度的市场或将呈现为即强即弱,从中期角度看,股票投资方向的关键决定因素是对系统性风险预期的变化,而非经济强弱。为此,我们短期内仍将坚持沿着成长和改革的路线,并特别关注二线蓝筹的机会,创新、成长和改革依然是投资的主要方向。

本基金未来的投资重点将是优质的成长和二线蓝筹,在深入研究优质上市公司的基础上进行配置。

4.4.2 报告期内基金的投资业绩和净值表现

报告期内基金净值增长23.60%,同期业绩比较基准收益率为23.88%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元)

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 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,浙江康恩贝制药股份有限公司(下称:康恩贝,股票代码:600572)发布《浙江康恩贝制药股份有限公司关于最近五年公司被监管部门立案调查并采取监管措施或处罚情况的公告》(证监公字[2014]1129号)。

2013年11月20日,石家庄东方热电股份有限公司(下称:东方热电,股票代码:000958)发布《石家庄东方热电股份有限公司关于最近五年监管部门立案调查并采取监管措施或处罚情况的公告》(证监公字[2014]077)。

2013年11月8日,浙江华策影视股份有限公司(下称:华策影视,股票代码:300133)发布《关于重大资产重组事项申请停牌的公告》(公告编号:2013-072)。

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 其他资产明细

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期末基金份额总额, 102,820,783.95

注:总申购份额含红利再投资、转入份额;总赎回份额含转出份额。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

8 备查文件目录

1.中国证监会核准农银汇理中证500指数证券投资基金募集的文件;

2.农银汇理中证500指数证券投资基金基金合同;

3.农银汇理中证500指数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.存放地点:基金管理人办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层。

7.查阅方式:投资者可至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。

农银汇理基金管理有限公司 2014年10月23日

珠海万力达电气股份有限公司 独立董事关于董事长辞职的独立意见
珠海万力达电气股份有限公司(以下简称“公司”)董事会于2014年10月22日收到董事长庞江华先生提交的辞去董事长职务的书面报告,报告称“鉴于公司与珠海赛纳打印科技股份有限公司之间的重大资产重组及发行股份购买资产交易主要事项已实施完毕,公司主营业务在本次重大资产重组完成后发生重大变化,公司董事会、监事会的变更和改选已经完成,为保证未来公司董事会能够高效运作,我申请辞去所担任的董事长职务,而继续担任公司的董事为公司服务。”

珠海万力达电气股份有限公司 独立董事关于董事长辞职的独立意见
根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业上市公司规范运作指引》以及《公司章程》和《公司章程》的有关规定,庞江华先生仍将继续担任公司的董事为公司服务。
庞江华先生辞去董事长职务的事项进行了核查,现就核查情况发表独立意见如下:
经核查,庞江华先生要求辞去公司董事长职务,其辞职原因与实际一致,公司将尽快履行程序选举新的董事长,在董事会推选新的董事长之前,庞江华先生仍将继续担任公司的董事为公司服务,我们认为庞江华先生的辞职行为不会对公司的生产经营和管理造成重大影响。

淄博万昌科技股份有限公司 2014年第三季度报告更正公告
本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
淄博万昌科技股份有限公司(以下简称“公司”)于2014年10月21日在巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)披露了公司2014年第三季度报告全文及正文,因公司相关人员工作失误,造成公司2014年第三季度报告中“2014年第三季度现金流量表中上期数据项目金额与以前披露的2014年第三季度报告中”的相关数据不一致,更正如下:
一、2014年第三季度报告中“第二节主要财务数据及股东变化”-“主要会计数据和财务指标”

吉林亚泰(集团)股份有限公司 重大事项继续停牌公告
特别提示
本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。
2014年10月9日,公司披露了吉林亚泰(集团)股份有限公司重大事项停牌公告,因公司正在商讨调整2014年度非公开发行股票的发行业务,公司股票于2014年10月9日起停牌(公告详见2014年10月9日《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和《证券日报》)。
2014年10月16日,公司披露了吉林亚泰(集团)股份有限公司重大事项继续停牌公告,因公司正在参与与认购的发行对象沟通上述发行价格不低于公司最近一期经审计的每股净资产(经调整后),公司股票于2014年10月16日起继续停牌(公告详见2014年10月16日《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和《证券日报》)。
公司2014年度非公开发行股票募集资金用途仍为偿还银行贷款和补充流动资金,目前,公司正积极推进相关工作。

北京华宇软件股份有限公司 2014年第三季度报告披露提示性公告
本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
北京华宇软件股份有限公司2014年第三季度报告已于2014年10月23日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露,敬请投资者注意查阅。
特此公告
北京华宇软件股份有限公司 董事会
二〇一四年十月二十三日

河南新野纺织股份有限公司 关于子公司获得政府补贴的公告
本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
根据《关于加快自治区纺织业发展有关财税政策的通知》(新政发[2010]99号)、《财政部关于印发纺织工业发展专项资金管理办法》(财建[2011]1160号)精神,中央财政对新疆棉纺织企业出疆棉纱运输费用给予每吨定额补贴500元;自治区财政对棉纺企业32支以上(含32支)的出疆棉纱给予每吨200元的运输费用补贴;32支以下的出疆棉纱补贴给予100元运输费用补贴。我公司全资子公司-阿克苏新发棉业有限公司符合以上两个文件的补贴标准,享受出疆棉纱运输费用补贴的优惠政策。
阿克苏新发棉业有限公司于近日收到阿克苏市财政局拨付中心拨付的2013年度出疆棉纱运输费用补贴901,584.00元。根据《企业会计准则》有关规定进行相应的会计处理,该笔政府补助将确认为营业外收入,增加公司2014年第四季度收益。具体的会计处理将以会计师事务所审计后的结果为准。
特此公告
河南新野纺织股份有限公司 董事会
2014年10月23日

上海科泰电源股份有限公司 2014年第三季度报告披露的提示性公告
本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
上海科泰电源股份有限公司2014年第三季度报告已于2014年10月23日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露,敬请投资者注意查阅。
特此公告。
上海科泰电源股份有限公司 董事会
2014年10月23日

北京华宇软件股份有限公司 2014年第三季度报告披露提示性公告
本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
北京华宇软件股份有限公司2014年第三季度报告已于2014年10月23日在中国证监会指定的创业板信息披露网站巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露,敬请投资者注意查阅。
特此公告
北京华宇软件股份有限公司 董事会
二〇一四年十月二十三日

华夏基金管理有限公司 旗下基金认购关联方承销证券的公告
根据中国证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定,华夏基金管理有限公司将旗下基金本次认购关联方承销证券的情况公告如下:
基金名称: 华夏现金增利证券投资基金
募集总额(万元): 30,000
关联方名称: 中信证券股份有限公司、中国建设银行股份有限公司
关联方与基金的关系: 分别为基金管理人、基金托管人
该证券发行中的承销身份: 承销团成员
特此公告
华夏基金管理有限公司
二〇一四年十月二十三日