农银汇理策略价值混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月27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2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银策略价值混合
交易代码	660004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	233,587,017.20份
投资目标	精选具有较高投资价值的股票,综合运用多种有效的投资策略,力争实现基金资产的理性增值。
投资策略	通过深入的基本面分析发掘股票的内在价值,利用非有效市场的定价偏差实现股票的投资价值。基金管理人将通过自上而下的资产配置和自下而上的个股精选相结合的方法构建投资组合。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-18,350,437.32
2.本期利润	-110,123,505.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4574
4.期末基金资产净值	337,416,685.16
5.期末基金份额净值	1.4445

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-23.11%	3.52%	-21.26%	2.51%	-1.85%	1.01%

注:自2015年10月8日起,75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数'变更为'沪深300指数×75%+中证全债指数×25%'

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中投资于价值型股票的比例不少于股票资产的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低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2009年9月29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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2015年6月6日	-	7	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理、农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员,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》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

三季度市场在证金公司救度救市后出现快速反弹,其后伴随人民币汇率贬值、国企改革预期回落而出现数次较快的回落和再反弹。鉴于市场风险偏好的修复需要一定的时间,本基金采用波段操作,行业和个股选择上更多考虑中短期成长性和估值水平,大体采用均衡配置的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期本基金的份额净值增长-23.11%,同期业绩比较基准收益率为-21.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,宏观经济预计仍将在底部徘徊。出口方面,由于全球经济增长乏力而周边国家竞争加剧,预计起色不大。投资方面,由于房地产的大周期见顶,房地产的新开工未有明显的好转,而制造业投资方面,考虑需求和库存周期,反弹的预期也不强。消费方面,社零数据显示消费基本平稳。总体而言,经济仍处底部蓄力阶段,L型的走势可能将维持相当长的一段时间。

资金面方面,国债收益率的持续下行显示市场的资金仍然充沛,无风险利率仍有下行空间,而经历了年中的暴跌和三季度的反复,市场风险逐步释放,市场的风险偏好有望逐步恢复。但是,盈利不达预期、估值偏高的问题仍普遍存在,因此个股的分化会进一步加剧,积极寻求符合国家产业政策和社会变革潮流并且估值相对合理的成长股,将是我们核心的投资策略。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内,本基金未出现上述情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	231,746,143.45	68.39
	其中:股票	231,746,143.45	68.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	106,104,609.01	31.31
8	其他资产	1,033,366.48	0.30
9	合计	338,884,118.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,772,362.00	1.12
B	采矿业	4,468,560.00	1.32
C	制造业	145,613,757.36	43.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,459,998.53	6.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,022,828.00	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	5,250,804.00	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,014,170.84	4.15
J	金融业	8,039,267.52	2.38
K	房地产业	3,669,008.00	1.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	13,435,387.20	3.98
S	综合	-	-
	合计	231,746,143.45	68.68

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	600271	航天信息	288,869	15,509,376.61	4.60
2	300285	国瓷材料	486,824	15,091,544.00	4.47
3	600856	长百集团	710,310	13,311,209.40	3.95
4	002589	瑞康医药	408,880	13,022,828.00	3.86
5	300336	新文化	358,230	8,970,079.20	2.66
6	300010	立思辰	495,744	8,606,115.84	2.55
7	600285	羚锐制药	724,900	8,343,599.00	2.47
8	601318	中国平安	269,232	8,039,267.52	2.38
9	300043	互动娱乐	552,000	7,722,480.00	2.29
10	600559	老白干酒	126,000	7,423,920.00	2.20

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	342,194.61
2	应收证券清算款	668,418.40
3	应收股利	-
4	应收利息	19,499.32
5	应收申购款	3,254.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,033,366.48

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在在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600856	长百集团	13,311,209.40	3.95	公告重大事项
2	002589	瑞康医药	13,022,828.00	3.86	公告重大事项
3	300010	立思辰	8,606,115.84	2.55	公告重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	261,814,002.27
报告期期间基金总申购份额	12,975,259.38
减:报告期期间基金总赎回份额	41,202,244.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	233,587,017.20

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 影响投资者决策的其他重要信息

一、2015年7月30日,农银汇理基金管理有限公司(以下简称"本公司")发布《农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称的公告》(以下简称"公告"),公告指出"本公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和旗下各股票型基金《基金合同》的相关规定,经对相关风险进行审慎、充分评估,且经与相关基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年8月7日起将'农银汇理策略价值股票型证券投资基金'变更为'农银汇理策略价值混合型证券投资基金',但不变更基金的股票投资比例和基金代码。"

由于本次基金更名不改变基金投资范围,对基金持有人利益无实质性不利影响,且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。因此,按照基金合同的约定,不需要召开持有人大会。

二、2015年9月29日,农银汇理基金管理有限公司发布《农银汇理基金管理有限公司关于变更农银汇理策略价值混合型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》(以下简称"公告"),公告指出"按照本基金基金合同的约定,本基金管理人经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案后,决定自2015年10月8日起,本基金的业绩比较基准由'75%×沪深300指数+25%×中信标普全债指数'变更为'沪深300指数×75%+中证全债指数×25%',并相应修改基金合同"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、《农银汇理策略价值混合型证券投资基金基金合同》;

3、《农银汇理策略价值混合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和营业执照复印件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层。

9.3 查阅方式

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制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2015年10月27日

农银汇理策略精选混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银策略精选混合
交易代码	660010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月6日
报告期末基金份额总额	128,675,957.42份
投资目标	本基金以提高投资组合经风险调整后的超额收益为目标,通过对定量和定性多种投资策略的有效结合,力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金将通过基金管理人在数量化投资上的积累,以多个相关性较低的数量化投资策略为基础,并有机结合由长期投资经验形成的定性投资策略,在投资策略充分分散化的基础上,力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-52,184,672.88
2.本期利润	-27,419,269.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2235
4.期末基金资产净值	97,670,989.69
5.期末基金份额净值	0.7590

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。

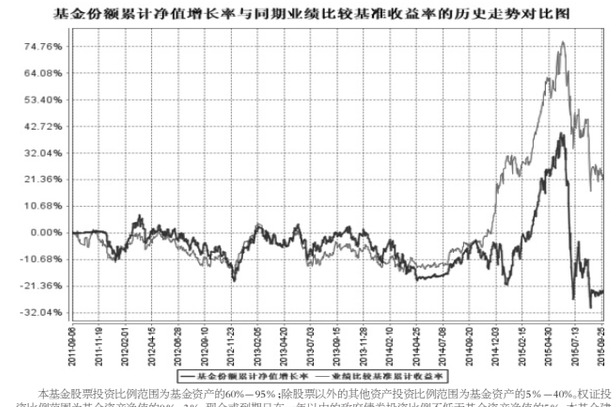
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-23.88%	3.46%	-21.11%	2.51%	-2.77%	0.95%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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资产的5%-40%,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低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2011年9月6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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
赵谦	本基金基金经理	2014年1月28日	-	9	系统工程(金融工程)硕士。历任山东老虎资产管理公司研发部经理、国信证券经济研究所策略研究员、农银汇理基金管理有限公司策略研究员,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》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

3季度本基金操作相对谨慎,保持了较低仓位并配置了金融等防御类品种。

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-23.88%,同期业绩比较基准收益率为-21.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计4季度及未来一段时间中国经济弱势波动,海外股市整体面临美联储加息预期带来的调整压力保持顶部震荡状态。伴随着7月份以来央行不断降息降准,各类资产收益率都下降较多,全市场面临资产配置荒,从收益率比较来看,低估值蓝筹有相对吸引力。一方面是以创业板为代表的成长类公司整体估值偏高且面临业绩下调的风险,在这种背景下选择部分提前调整到位的优质成长股以及有相对比较优势的蓝筹将是不错的选择。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内,本基金未出现上述情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,866,056.08	65.28
	其中:股票	65,866,056.08	65.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,811,788.22	31.53
8	其他资产	3,221,788.73	3.19
9	合计	100,899,633.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,907,626.24	1.95
C	制造业	9,221,826.49	9.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,415,127.42	1.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,284,319.54	2.34
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	4,452,732.59	4.56
J	金融业	35,801,561.35	36.66
K	房地产业	4,015,445.61	4.11
L	租赁和商务服务业	3,596,933.50	3.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	3,170,483.34	3.25
S	综合	-	-
	合计	65,866,056.08	67.44

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	601988	中国银行	1,924,738	7,160,025.36	7.33
2	601398	工商银行	1,626,867	7,028,065.44	7.20
3	601939	建设银行	1,335,867	6,919,791.06	7.08
4	601328	交通银行	1,100,109	6,688,662.72	6.85
5	002019	亿帆鑫富	113,434	2,922,059.84	2.99
6	000002	万 科A	223,057	2,839,515.61	2.91
7	002354	天神娱乐	37,600	2,821,880.00	2.89
8	002425	凯撒股份	174,700	2,458,029.00	2.52
9	600000	浦发银行	131,700	2,190,171.00	2.24
10	601166	兴业银行	136,673	1,989,958.88	2.04

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

2015年2月15日,中国银行间市场交易商协会发布自律处分信息称:"中国工商银行股份有限公司(以下简称"工商银行")作为债务融资工具"13闽建投MTN001"主承销商,在获知发行人浙江省建设投资集团有限公司整合下属子公司少数股东权益事项后未及时组织召开持有人会议,违反了《银行间债券市场非金融企业债务融资工具持有人会议规程》的规定。依据相关自律规定,经自律处分会议审定,给予工商银行诫勉谈话处分,并处责令改正"。

对工商银行股票投资决策程序的说明:该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库,由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断、按照相关投资决策流程投资了该股票。

其余九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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	184,771.82
2	应收证券清算款	2,872,765.32
3	应收股利	-
4	应收利息	5,622.95
5	应收申购款	158,628.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,221,788.73

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在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 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	106,288,267.40
报告期期间基金总申购份额	53,014,631.61
减:报告期期间基金总赎回份额	30,626,941.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	128,675,957.42

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 影响投资者决策的其他重要信息

2015年7月30日,农银汇理基金管理有限公司(以下简称"本公司")发布《农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金名称的公告》(以下简称"公告"),公告指出"本公司根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和旗下各股票型基金《基金合同》的相关规定,经对相关风险进行审慎、充分评估,且经与相关基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年8月7日起将'农银汇理策略精选股票型证券投资基金'变更为'农银汇理策略精选混合型证券投资基金',但不变更基金的股票投资比例和基金代码。"

由于本次基金更名不改变基金投资范围,对基金持有人利益无实质性不利影响,且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化。因此,按照基金合同的约定,不需要召开持有人大会。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准本基金募集的文件;

2、《农银汇理策略精选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《农银汇理策略精选混合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和营业执照复印件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层。

9.3 查阅方式

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制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司
2015年10月27日

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月27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2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银大盘蓝筹混合
交易代码	660006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月1日
报告期末基金份额总额	313,457,617.49份
投资目标	精选具有良好经营业绩和基本面的大盘蓝筹股票,通过扎实的基本面分析和积极的主动管理构建投资组合,以期取得基金资产的长期理性增值。
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。首先根据对宏观经济、政策环境和资金供求等因素的深入分析,对未来股票市场和债券市场的走势进行科学的分析,并以此为基础对大类资产配置进行确定。在"自下而上"的层面,本基金将严格执行备选股票库制度,在建立大盘蓝筹股票库的基础上,综合运用定性和定量的手段,筛选出具有良好基本面和发展前景的蓝筹股票进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%×沪深300指数+25%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-139,177,976.83
2.本期利润	-82,032,599.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2574
4.期末基金资产净值	307,249,567.14
5.期末基金份额净值	0.9802

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。

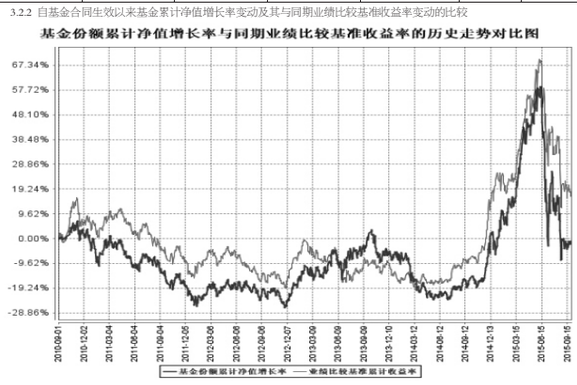
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-20.28%	3.28%	-21.11%	2.51%	0.83%	0.77%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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低于基金资产净值的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 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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
		任职日期	离任日期		
赵谦	本基金基金经理	2014年10月11日	-	9	系统工程(金融工程)硕士。历任山东老虎资产管理公司研发部经理、国信证券经济研究所策略研究员、农银汇理基金管理有限公司策略研究员,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