

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20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2016年7月18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。
本报告自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	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	2015年7月13日
报告期末基金份额总额	186,190,817.77份
投资目标	精选具有良好投资价值的国内大盘蓝筹股,通过扎实的基金分析和个股的主动管理构建投资组合,以期取得基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行资产配置,并依据宏观经济、政策环境、市场估值、行业景气度等因素,对个股进行基本面分析,对个股进行基本面分析,并在此基础上进行个股的主动管理,在严格控制风险的前提下,力争取得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证红利指数收益率×40%
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

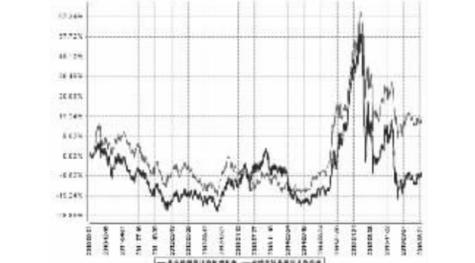
3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2016年4月1日—2016年6月30日)
1.本期已实现收益	1,133,675.82
2.本期利润	3,599,464.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0120
4.期末基金份额净值	27.08421490

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.基金净值表现
3.1 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对比

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	3.28%	0.92%	-1.39%	0.76%	2.69%	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对比



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的5%。本基金建仓期为自2015年9月11日起六个月内,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	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
宋克安	本基金基金经理	2015年12月21日	9	硕士,具有证券从业资格,历任长城基金资产管理部副经理、研究员,农银汇理基金资产管理部研究员,农银汇理基金资产管理部基金经理,现任农银汇理基金资产管理部基金经理。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期,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 报告期内基金投资策略和运作分析
本季度内本基金操作主要从个股入手,按照产业发展思路,寻找符合国家经济战略方向的政策以及业绩稳定的白酒医药等消费类进行配置,来获得较好的收益。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末,本基金净值增长率为1.33%,业绩比较基准收益率为-1.35%。
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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,920,683.36	71.62
2	其中:股票	190,920,683.36	71.62
3	固定收益投资	18,608,702.60	7.30
4	其中:债券	18,608,702.60	7.30
5	资产支持证券	—	—
6	衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其他资产	84,018,316.74	20.08
9	合计	305,547,702.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	167,433.00	0.06
B	采矿业	57,133,856.56	2.38
C	制造业	75,620,729.41	27.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,523,596.00	2.28
E	建筑业	5,417,252.48	1.96
F	批发和零售业	4,234,246.80	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,929,270.02	1.82
H	住宿和餐饮业	—	—
I	房地产业	16,770,929.79	6.11
J	金融业	191,145,432.32	21.57
K	房地产业	8,962,190.00	3.27
L	租赁和商务服务业	2,550,231.37	0.93
M	科学研究和技术服务业	522,720.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,309,438.48	0.50
O	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	277,628.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	5,019,428.48	1.84
S	综合	832,220.00	0.30
合计		190,920,683.36	72.27

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
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

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	601318	中国平安	208,300	6,672,932.60	2.44
2	600893	新华保险	13,700	4,291,221.00	1.57
3	600516	民生证券	454,600	4,659,578.00	1.73
4	601166	兴业银行	257,500	3,924,300.00	1.43
5	601398	工商银行	857,800	3,808,632.00	1.39
6	600936	招商银行	196,400	3,472,000.00	1.27
7	601328	交通银行	528,400	2,974,892.40	1.10
8	600042	万科A	154,000	2,904,620.00	1.09
9	600488	中信集团	132,500	2,729,660.00	0.99
10	601988	中国银行	843,000	2,706,030.00	0.99

5.3.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	14,236,702.60	5.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,820,000.00	2.17
4	企业债券	5,020,000.00	1.97
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	25,076,702.60	9.33

5.3.2 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对比

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%,其中权证投资比例范围为基金资产的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的5%。本基金建仓期为自2015年9月11日起六个月内,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
宋克安	本基金基金经理	2015年7月13日	9	硕士,具有证券从业资格,历任长城基金资产管理部副经理、研究员,农银汇理基金资产管理部研究员,农银汇理基金资产管理部基金经理,现任农银汇理基金资产管理部基金经理。

5.4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期,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。
5.4.3 公平交易专项说明
5.4.3.1 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。
5.4.3.2 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%。
5.4.4 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末,本基金净值增长率为1.33%,业绩比较基准收益率为-1.35%。
5.4.5 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。

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,920,683.36	71.62
2	其中:股票	190,920,683.36	71.62
3	固定收益投资	18,608,702.60	7.30
4	其中:债券	18,608,702.60	7.30
5	资产支持证券	—	—
6	衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其他资产	84,018,316.74	20.08
9	合计	305,547,702.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	167,433.00	0.06
B	采矿业	57,133,856.56	2.38
C	制造业	75,620,729.41	27.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,523,596.00	2.28
E	建筑业	5,417,252.48	1.96
F	批发和零售业	4,234,246.80	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,929,270.02	1.82
H	住宿和餐饮业	—	—
I	房地产业	16,770,929.79	6.11
J	金融业	191,145,432.32	21.57
K	房地产业	8,962,190.00	3.27
L	租赁和商务服务业	2,550,231.37	0.93
M	科学研究和技术服务业	522,720.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,309,438.48	0.50
O	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	277,628.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	5,019,428.48	1.84
S	综合	832,220.00	0.30
合计		190,920,683.36	72.27

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
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

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	601318	中国平安	208,300	6,672,932.60	2.44
2	600893	新华保险	13,700	4,291,221.00	1.57
3	600516	民生证券	454,600	4,659,578.00	1.73
4	601166	兴业银行	257,500	3,924,300.00	1.43
5	601398	工商银行	857,800	3,808,632.00	1.39
6	600936	招商银行	196,400	3,472,000.00	1.27
7	601328	交通银行	528,400	2,974,892.40	1.10
8	600042	万科A	154,000	2,904,620.00	1.09
9	600488	中信集团	132,500	2,729,660.00	0.99
10	601988	中国银行	843,000	2,706,030.00	0.99

5.3.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	14,236,702.60	5.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,820,000.00	2.17
4	企业债券	5,020,000.00	1.97
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	25,076,702.60	9.33

5.3.2 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对比

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%,其中权证投资比例范围为基金资产的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的5%。本基金建仓期为自2015年9月11日起六个月内,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

5.4 管理人报告

5.4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
宋克安	本基金基金经理	2015年7月13日	9	硕士,具有证券从业资格,历任长城基金资产管理部副经理、研究员,农银汇理基金资产管理部研究员,农银汇理基金资产管理部基金经理,现任农银汇理基金资产管理部基金经理。

5.4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期,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。
5.4.3 公平交易专项说明
5.4.3.1 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。
5.4.3.2 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%。
5.4.4 报告期内基金的投资表现
截至本报告期末,本基金净值增长率为1.33%,业绩比较基准收益率为-1.35%。
5.4.5 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。

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	190,920,683.36	71.62
2	其中:股票	190,920,683.36	71.62
3	固定收益投资	18,608,702.60	7.30
4	其中:债券	18,608,702.60	7.30
5	资产支持证券	—	—
6	衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其他资产	84,018,316.74	20.08
9	合计	305,547,702.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	167,433.00	0.06
B	采矿业	57,133,856.56	2.38
C	制造业	75,620,729.41	27.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,523,596.00	2.28
E	建筑业	5,417,252.48	1.96
F	批发和零售业	4,234,246.80	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	4,929,270.02	1.82
H	住宿和餐饮业	—	—
I	房地产业	16,770,929.79	6.11
J	金融业	191,145,432.32	21.57
K	房地产业	8,962,190.00	3.27
L	租赁和商务服务业	2,550,231.37	0.93
M	科学研究和技术服务业	522,720.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,309,438.48	0.50
O	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	277,628.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	5,019,428.48	1.84
S	综合	832,220.00	0.30
合计		190,920,683.36	72.27

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
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

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	601318	中国平安	208,300	6,672,932.60	2.44
2	600893	新华保险	13,700	4,291,221.00	1.57
3	600516	民生证券	454,600	4,659,578.00	1.73
4	601166	兴业银行	257,500	3,924,300.00	1.43
5	601398	工商银行	857,800	3,808,632.00	1.39
6	600936	招商银行	196,400	3,472,000.00	1.27
7	601328	交通银行	528,400	2,974,892.40	1.10
8	600042	万科A	154,000	2,904,620.00	1.09
9	600488	中信集团	132,500	2,729,660.00	0.99
10	601988	中国银行	843,000	2,706,030.00	0.99

5.3.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	14,236,702.60	5.19
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,820,000.00	2.17
4	企业债券	5,020,000.00	1.97
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	25,076,702.60	9.33

5.3.2 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对比

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%,其中权证投资比例范围为基金资产的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的5%。本基金建仓期为自2015年9月11日起六个月内,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示