

农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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：2024 年 4 月 18 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 2024 年 4 月 16 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	农银大盘蓝筹混合
基金主代码	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	92,654,613.35 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，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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-4,032,386.10
2. 本期利润	231,460.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0025
4. 期末基金资产净值	108,054,987.12
5. 期末基金份额净值	1.1662

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。

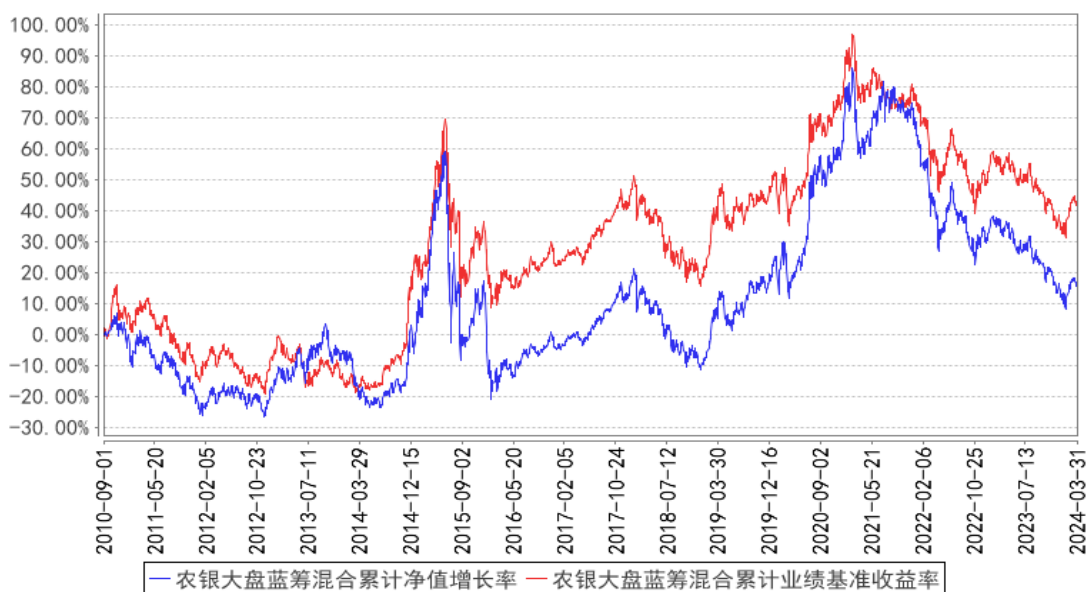
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	0.25%	0.83%	2.97%	0.77%	-2.72%	0.06%
过去六个月	-5.16%	0.73%	-2.10%	0.68%	-3.06%	0.05%
过去一年	-13.31%	0.73%	-8.03%	0.66%	-5.28%	0.07%
过去三年	-27.31%	0.91%	-19.78%	0.79%	-7.53%	0.12%
过去五年	7.28%	1.05%	0.56%	0.88%	6.72%	0.17%
自基金合同 生效起至今	16.62%	1.24%	42.60%	1.03%	-25.98%	0.21%

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

农银大盘蓝筹混合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



注：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。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
宋永安	本基金的基金经理	2015 年 12 月 2 日	-	16 年	硕士，具有证券从业资格。历任长信基金管理公司金融工程研究员、农银汇理基金管理公司研究员、农银汇理基金管理公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理公司基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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运作分析

一季度市场震荡为主，市场结构分化比较严重，银行、石油石化、煤炭上涨，医药生物、计算机、电子等下跌较多。一季度经济整体平稳，春节前市场对宏观比较悲观，市场下跌较多，春节后数据显示经济尚可，超出市场悲观预期，市场缓慢修复；从行业涨跌幅看，市场还是以价值为主，期间主题波动较大。本基金主要投资于大盘股，在运作期内配置了部分中低估值的股票，取得了一定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1662 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.25%，业绩比较基准收益率为 2.97%。

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	92,119,555.02	84.80
	其中：股票	92,119,555.02	84.80

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,058,386.85	4.66
	其中：债券	5,058,386.85	4.66
	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	11,433,352.87	10.53
8	其他资产	16,240.29	0.01
9	合计	108,627,535.03	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）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	873,135.00	0.81
B	采矿业	5,670,483.12	5.25
C	制造业	47,197,482.18	43.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,471,636.00	4.14
E	建筑业	1,641,881.00	1.52
F	批发和零售业	184,232.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	2,971,383.22	2.75
H	住宿和餐饮业	49,086.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,521,346.16	4.18
J	金融业	20,472,088.45	18.95
K	房地产业	641,098.00	0.59
L	租赁和商务服务业	676,527.60	0.63
M	科学研究和技术服务业	990,625.29	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	89,768.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	238,400.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,430,383.00	1.32
S	综合	-	-
	合计	92,119,555.02	85.25

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	3,000	5,108,700.00	4.73
2	300750	宁德时代	10,540	2,004,286.40	1.85
3	000001	平安银行	188,720	1,985,334.40	1.84
4	000858	五粮液	12,746	1,956,638.46	1.81
5	601318	中国平安	44,800	1,828,288.00	1.69
6	600036	招商银行	51,800	1,667,960.00	1.54
7	601398	工商银行	305,900	1,615,152.00	1.49
8	601166	兴业银行	98,900	1,560,642.00	1.44
9	002371	北方华创	4,300	1,314,080.00	1.22
10	601988	中国银行	295,200	1,298,880.00	1.20

5.4 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	国家债券	5,058,386.85	4.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,058,386.85	4.68

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

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	019709	23 国债 16	20,000	2,022,402.74	1.87
2	019733	24 国债 02	20,000	2,010,488.22	1.86
3	102243	国债 2315	10,000	1,025,495.89	0.95

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投资。

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2023 年 7 月 7 日，平安银行股份有限公司因 1. 违反账户管理规定；2. 其他危及支付机构稳健运行、损害客户合法权益或危害支付服务市场的违法违规行为；3. 违反反假货币业务管理规定；4. 占压财政存款或资金；5. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；6. 未按规定履行客户身份识别义务；7. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；8. 与身份不明的客户进行交易；9. 违反消费者金融信息保护管理规定；10. 违反金融营销宣传管理规定，被中国人民银行处以警告，没收违法所得 1848.67 元，罚款 3492.5 万元。

2023 年 9 月 13 日，平安银行股份有限公司因销售误导被国家金融监督管理总局常州监管分局处以罚款 8 万元。

2023 年 12 月 12 日，平安银行因考评机制不当，贷款业务操作不规范，小微企业划型不准确，被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 170 万元。

2023 年 6 月 14 日，兴业银行股份有限公司因衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格、对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务、代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理、债券交易超授权、通过资产管理产品开展不正当交易、超比例投资本行主承销的债券、债券投资五级分类不准确、债券投资风险管理未独立于当地分支行、通过金融交易市场进行电子化交易的同业业务委托分支机构询价和项目发起、市场风险资本计量严重不审慎，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局要求责令改正，并处罚款共计 400 万元。

2023 年 12 月 13 日，招商银行因未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足，被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 160 万元。

2023 年 11 月 27 日，招商银行股份有限公司因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查行为、违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为，被国家外汇管理局深圳市分局罚款 475.00 万元，没收违法所得 89.03 万元。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

其余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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	14,638.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,602.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,240.29

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

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	93,486,540.55
报告期期间基金总申购份额	1,736,733.99
减：报告期期间基金总赎回份额	2,568,661.19
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	92,654,613.35

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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、《农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理大盘蓝筹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；

6、本报告期内公开披露的临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址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

2024 年 4 月 18 日