

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
7	投资组合报告.....	26
7.1	期末基金资产组合情况.....	26
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	27
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	28
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	37

7.9	投资组合报告附注.....	38
8	基金份额持有人信息.....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
9	开放式基金份额变动.....	39
10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	41
11	备查文件目录.....	41
11.1	备查文件目录.....	41
11.2	存放地点.....	42
11.3	查阅方式.....	42

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理沪深300指数证券投资基金
基金简称	农银沪深300指数
基金主代码	660008
交易代码	660008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月12日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,747,764,687.76份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在4%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，以实现沪深300指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将按照标的指数的成分股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。基金管理人将根据中证指数公司提供的成分股及权重数据进行相应的买入或卖出操作，使跟踪组合的构成基本与标的指数一致。
业绩比较基准	95%×沪深300指数+5%×同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	农银汇理基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 翟爱东	赵会军

	联系电话	021-61095588	010—66105799
	电子邮箱	duanzhuoli@abc-ca.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95588
传真		021-61095556	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		杨琨	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	http://www.abc-ca.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆 家嘴商务广场 7 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-71,723,378.77
本期利润	122,262,187.00
加权平均基金份额本期利润	0.0436
本期加权平均净值利润率	5.59%
本期基金份额净值增长率	5.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-657,736,631.00
期末可供分配基金份额利润	-0.2394
期末基金资产净值	2,090,028,056.76
期末基金份额净值	0.7606

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-23.94%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

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

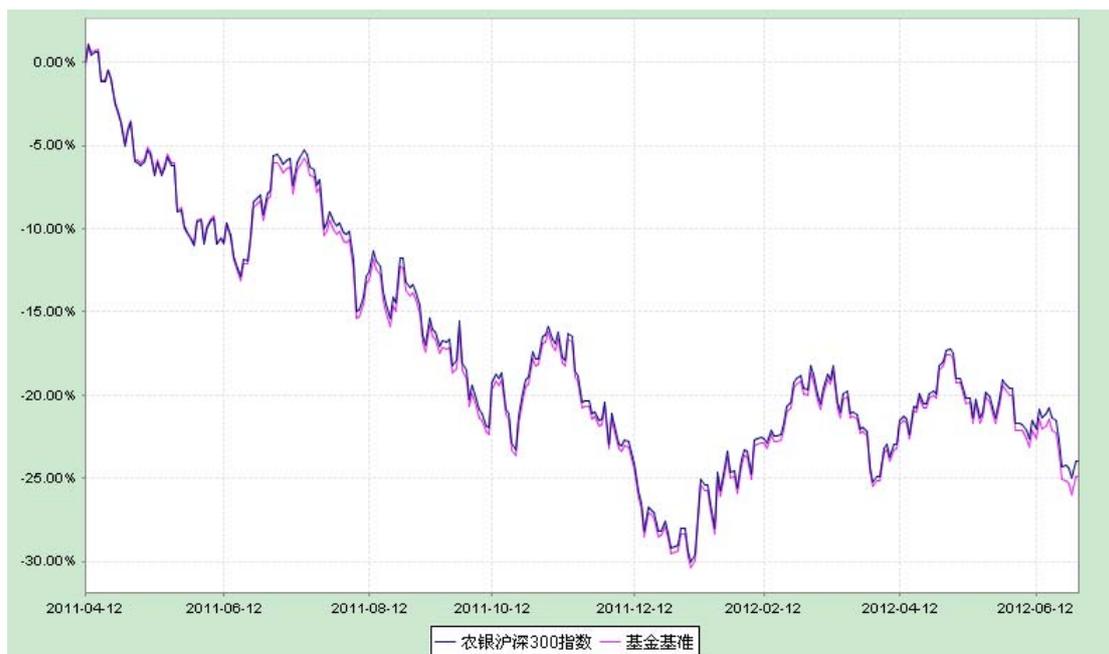
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.41%	1.04%	-6.15%	1.04%	0.74%	0.00%
过去三个月	1.25%	1.06%	0.28%	1.07%	0.97%	-0.01%
过去六个月	5.62%	1.26%	4.75%	1.26%	0.87%	0.00%
过去一年	-17.39%	1.28%	-18.17%	1.28%	0.78%	0.00%
自基金成立起至今	-23.94%	1.24%	-24.92%	1.24%	0.98%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 4 月 12 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：1、本基金的基金合同于 2011 年 4 月 12 日生效，至 2011 年 6 月 30 日不满一年。

2、本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中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 4 月 12 日）起六个月，本基金将按规定在合同生效后六个月内达到基金合同规定的投资比例。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中国铝业股份有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层。公司法定代表人为董事长杨琨先生。

截至 2012 年 6 月 30 日，公司管理 13 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长股票型基金、农银汇理恒久增利债券型基金、农银汇理平衡双利混合型基金、农银汇理策略价值股票型基金、农银汇理中小盘股票型基金、农银汇理大盘蓝筹股票型基金、农银汇理货币市场基金、农银汇理沪深 300 指数基金、农银汇理增强收益债券型基金、农银汇理策略精选股票型基金、农银汇理中证 500 指数基金、农银汇理消费主题股票型基金、农银汇理信用添利债

券型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张惟	本基金基金经理、公司 投资副总监	2011-04-12	-	10	CFA, FRM, 金融学硕士，管理学硕士。历任法国里昂信贷银行资产管理公司金融工程师、东方汇理资产管理公司基金经理、雷曼兄弟欧洲数量基金管理公司基金经理，具有多年海外指数基金投资管理经验。现任农银汇理基金管理有限公司投资副总监、基金经理。
程涛	本基金基金经理、公司 投资部总经理	2011-04-12	-	9	金融学硕士，具有基金从业资格。历任联合证券公司投资银行部高级经理、泰信基金管理公司研究员及基金经理助理、农银汇理基金管理有限公司行业研究员及基金经理助理，现任农银汇理基金管理有限公司投资部总经理、基金经理。
宋永安	本基金经理 助理	2011-09-07	-	5	数学硕士，具有基金从业资格。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，现任农银汇理基金管理公司基金经理助理。

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

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，没有存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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》和《农银汇理基金管理有限公司公平交易管理办法》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基金和组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现异常交易情况。

4.4 管理人对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

本报告期内，根据指数化投资流程和定量分析，进行了日常运行操作。报告期内基金日均跟踪误差为 0.029%，日均偏离度为 0.017%，符合基金合同规定的日均偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制不超过 4%。报告期内基金跟踪误差主要是由以下几点造成：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响；2) 申购赎回的影响；3) 成份股票的停牌；4) 指数中成份股票的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长 5.62%，同期业绩比较基准收益率为 4.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动化指数产品，我们将坚持指数被动化投资理念，运用定量分析技术，减少各种因素对基金跟踪误差造成的冲击，把基金的跟踪误差控制在较低的水平，从而为投资者提供一个标准化的指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责：公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化，书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部，运营部参考测算结果对估值调整进行试算，并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督，根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员，均具有基金从业资格，具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求，但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵守少数服从多数的原则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同要求，报告期内本基金不需分配利润。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年上半年，本基金托管人在对农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年，农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的管理人——农银汇理基金管理有限公司在农银汇理沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对农银汇理基金管理有限公司编制和披露的农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,501,322.99	9,521,089.76
结算备付金		259,370.07	61,300.17
存出保证金		500,000.00	500,000.00

交易性金融资产	6.4.7.2	2,072,979,313.08	2,056,658,698.39
其中：股票投资		1,985,596,313.08	1,959,918,698.39
基金投资		-	-
债券投资		87,383,000.00	96,740,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,554,375.43	19,347,453.32
应收利息	6.4.7.5	1,055,618.62	2,289,211.11
应收股利		3,398,234.53	-
应收申购款		238,988.26	267,514.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,098,487,222.98	2,088,645,267.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,700,000.00	-
应付证券清算款		-	10,720,617.07
应付赎回款		2,268,420.47	4,358,830.65
应付管理人报酬		1,039,217.08	1,098,915.24
应付托管费		259,804.26	274,728.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	359,860.86	268,131.08
应交税费		-	-
应付利息		318.61	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	831,544.94	722,831.54
负债合计		8,459,166.22	17,444,054.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,747,764,687.76	2,876,460,664.68
未分配利润	6.4.7.10	-657,736,631.00	-805,259,451.69
所有者权益合计		2,090,028,056.76	2,071,201,212.99
负债和所有者权益总计		2,098,487,222.98	2,088,645,267.33

注：1、本基金的基金合同于 2011 年 4 月 12 日生效，上年度实际报告期间为 2011 年 4 月 12 日至 2011 年 12 月 31 日。

2、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7606 元，基金份额总额 2,747,764,687.76 份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 4 月 12 日（基金 合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		131,953,090.51	-252,307,173.53
1.利息收入		1,649,687.24	1,069,239.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	65,275.75	254,375.71
债券利息收入		1,584,411.49	814,863.40
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-63,943,015.04	-942,737.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-87,437,448.24	-26,016,064.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	66,586.53	-1,173.33
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	23,427,846.67	25,074,500.62
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	193,985,565.77	-252,598,430.31
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	260,852.54	164,754.80
减：二、费用		9,690,903.51	9,162,918.08
1. 管理人报酬		6,523,627.09	3,988,356.31
2. 托管费		1,630,906.80	997,089.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,054,524.46	3,924,260.73
5. 利息支出		29,865.02	18,587.61
其中：卖出回购金融资产支出		29,865.02	18,587.61
6. 其他费用	6.4.7.19	451,980.14	234,624.35
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		122,262,187.00	-261,470,091.61

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		122,262,187.00	-261,470,091.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,876,460,664.68	-805,259,451.69	2,071,201,212.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	122,262,187.00	122,262,187.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-128,695,976.92	25,260,633.69	-103,435,343.23
其中：1. 基金申购款	201,585,518.61	-44,578,667.67	157,006,850.94
2. 基金赎回款	-330,281,495.53	69,839,301.36	-260,442,194.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,747,764,687.76	-657,736,631.00	2,090,028,056.76
项目	上年度可比期间 2011 年 4 月 12 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,297,550,055.44	0.00	3,297,550,055.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-261,470,091.61	-261,470,091.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,297,550,055.44	-261,470,091.61	3,036,079,963.83

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：许红波，主管会计工作负责人：杜明华，会计机构负责人：于意

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 125 号《关于核准农银汇理沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,296,561,559.84 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 123 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,297,550,055.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 988,495.60 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股和新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成份股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中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%。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数+5%×同期银行活期存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴

20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	16,501,322.99
定期存款	-
其他存款	-
合计	16,501,322.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,533,001,676.07	1,985,596,313.08	-547,405,362.99
债券	交易所市场	8,020,800.00	8,080,000.00	59,200.00
	银行间市场	79,019,040.00	79,303,000.00	283,960.00
	合计	87,039,840.00	87,383,000.00	343,160.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,620,041,516.07	2,072,979,313.08	-547,062,202.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,108.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	105.12
应收债券利息	1,050,405.49
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,055,618.62

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	358,648.56
银行间市场应付交易费用	1,212.30
合计	359,860.86

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	4,710.72
应付指数使用费	108,037.46
预提费用	218,796.76
合计	831,544.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,876,460,664.68	2,876,460,664.68
本期申购	201,585,518.61	201,585,518.61
本期赎回（以“-”号填列）	-330,281,495.53	-330,281,495.53
本期末	2,747,764,687.76	2,747,764,687.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-114,024,042.43	-691,235,409.26	-805,259,451.69
本期利润	-71,723,378.77	193,985,565.77	122,262,187.00
本期基金份额交易产生的变动数	6,675,119.60	18,585,514.09	25,260,633.69
其中：基金申购款	-10,307,889.84	-34,270,777.83	-44,578,667.67
基金赎回款	16,983,009.44	52,856,291.92	69,839,301.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-179,072,301.60	-478,664,329.40	-657,736,631.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	61,783.27
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,489.93
其他	2.55
合计	65,275.75

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	365,655,727.03
减：卖出股票成本总额	453,093,175.27
买卖股票差价收入	-87,437,448.24

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	121,181,043.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	117,598,703.47
减：应收利息总额	3,515,753.52
债券投资收益	66,586.53

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	23,427,846.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,427,846.67

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	193,985,565.77
——股票投资	193,581,039.10
——债券投资	404,526.67
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	193,985,565.77

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	252,740.61
转换费收入	8,111.93
合计	260,852.54

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	1,053,624.46
银行间市场交易费用	900.00
合计	1,054,524.46

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	169,070.72
银行汇划费	6,729.12
账户服务费	9,000.00
指数使用费	217,454.26
合计	451,980.14

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
农银汇理基金管理有限公司	本基金的管理人
中国工商银行股份有限公司	本基金的托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易、权证交易、债券交易和债券回购交易。本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金，期末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年4月12日（基金合同生效日） 至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,523,627.09	3,988,356.31
其中：支付销售机构的客户 维护费	2,590,821.23	1,561,061.87

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前

一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年4月12日（基金合同生效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,630,906.80	997,089.08

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年4月12日（基金合同生效日）至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	16,501,322.99	61,783.27	26,851,154.88	211,006.96

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002500	山西证券	2012-05-15	公告重大事 项	8.19	-	-	199,901	1,816,270.81	1,637,189.19	-
000059	辽通化工	2012-06-26	公告重大事 项	7.91	2012-07-03	8.15	246,300	3,119,503.09	1,948,233.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 3,700,000.00 元,于 2012 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股和新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险,并通过设定相应的风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统,有效的控制和跟踪上述各类风险。

本基金的基金管理人的风险管理机构由董事会稽核及风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部以及各个业务部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放于本基金的托管人 - 中国工商银行，本基金认为与中国工商银行相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金为全被动的指数基金，其主要资产都将用于跟踪组合的构建。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，其中投资于标的指数成分股的比例不低于股票投资的 80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中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%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期对基金所面临的潜在价格风险进行度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,985,596,313.08	95.00	1,959,918,698.39	94.63
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,985,596,313.08	95.00	1,959,918,698.39	94.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加约10,471.31万元	-
	业绩比较基准下降5%	减少约10,471.31万元	-

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。为保证该方法所得结果的参考价值，一般需要至少 1 年的基金净值数据。截止至上年度末，本基金运营期小于 1 年，无足够的经验数据进行市场价格风险分析。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	1,985,596,313.08	94.62
	其中：股票	1,985,596,313.08	94.62
2	固定收益投资	87,383,000.00	4.16
	其中：债券	87,383,000.00	4.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	16,760,693.06	0.80
6	其他各项资产	8,747,216.84	0.42
7	合计	2,098,487,222.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,636,019.42	0.60
B	采掘业	202,139,626.59	9.67
C	制造业	695,329,098.70	33.27
C0	食品、饮料	147,314,389.52	7.05
C1	纺织、服装、皮毛	7,549,765.42	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	43,183,102.96	2.07
C5	电子	34,778,212.58	1.66
C6	金属、非金属	153,871,278.06	7.36
C7	机械、设备、仪表	213,535,004.94	10.22
C8	医药、生物制品	94,463,811.22	4.52
C99	其他制造业	633,534.00	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	50,296,427.53	2.41
E	建筑业	65,261,700.52	3.12
F	交通运输、仓储业	58,009,399.38	2.78
G	信息技术业	57,580,894.49	2.76
H	批发和零售贸易	54,373,373.65	2.60
I	金融、保险业	626,803,138.25	29.99
J	房地产业	108,145,142.09	5.17
K	社会服务业	16,961,581.30	0.81

L	传播与文化产业	6,666,803.05	0.32
M	综合类	31,393,108.11	1.50
	合计	1,985,596,313.08	95.00

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
1	601318	中国平安	1,351,736	61,828,404.64	2.96
2	601328	交通银行	13,110,865	59,523,327.10	2.85
3	600016	民生银行	9,115,812	54,603,713.88	2.61
4	600036	招商银行	4,990,680	54,498,225.60	2.61
5	600519	贵州茅台	167,576	40,075,800.40	1.92
6	601166	兴业银行	3,047,170	39,552,266.60	1.89
7	600000	浦发银行	4,516,839	36,721,901.07	1.76
8	600030	中信证券	2,779,390	35,103,695.70	1.68
9	000002	万科A	3,906,691	34,808,616.81	1.67
10	601939	建设银行	7,987,107	33,545,849.40	1.61
11	600837	海通证券	3,265,793	31,449,586.59	1.50
12	601088	中国神华	1,331,118	29,923,532.64	1.43
13	601601	中国太保	1,268,578	28,137,060.04	1.35
14	601988	中国银行	8,899,358	25,096,189.56	1.20
15	000858	五粮液	765,995	25,093,996.20	1.20
16	600111	包钢稀土	586,480	23,142,500.80	1.11
17	601668	中国建筑	6,053,570	20,218,923.80	0.97
18	600048	保利地产	1,728,440	19,600,509.60	0.94
19	000157	中联重科	1,772,986	17,783,049.58	0.85
20	000651	格力电器	849,698	17,716,203.30	0.85
21	002304	洋河股份	130,833	17,603,580.15	0.84
22	601169	北京银行	1,775,753	17,349,106.81	0.83
23	600031	三一重工	1,225,827	17,063,511.84	0.82
24	601006	大秦铁路	2,399,939	16,871,571.17	0.81
25	000001	深发展A	1,033,750	15,671,650.00	0.75
26	002024	苏宁电器	1,694,111	14,213,591.29	0.68
27	601818	光大银行	4,895,500	13,903,220.00	0.67

28	600900	长江电力	1,997,730	13,584,564.00	0.65
29	600887	伊利股份	645,220	13,278,627.60	0.64
30	600015	华夏银行	1,382,199	13,089,424.53	0.63
31	601857	中国石油	1,407,800	12,740,590.00	0.61
32	600050	中国联通	3,421,767	12,728,973.24	0.61
33	600104	上汽集团	889,944	12,717,299.76	0.61
34	601899	紫金矿业	3,188,987	12,373,269.56	0.59
35	600585	海螺水泥	807,071	11,960,792.22	0.57
36	000568	泸州老窖	281,223	11,898,545.13	0.57
37	600383	金地集团	1,804,567	11,693,594.16	0.56
38	600256	广汇股份	848,598	11,430,615.06	0.55
39	000063	中兴通讯	793,968	11,083,793.28	0.53
40	601628	中国人寿	605,358	11,078,051.40	0.53
41	600999	招商证券	940,571	10,920,029.31	0.52
42	600028	中国石化	1,712,154	10,786,570.20	0.52
43	000776	广发证券	358,348	10,689,520.84	0.51
44	000983	西山煤电	635,853	9,919,306.80	0.47
45	600518	康美药业	621,114	9,577,577.88	0.46
46	600547	山东黄金	287,230	9,432,633.20	0.45
47	000069	华侨城 A	1,467,284	9,361,271.92	0.45
48	601989	中国重工	1,775,856	9,216,692.64	0.44
49	600019	宝钢股份	2,120,211	9,159,311.52	0.44
50	000338	潍柴动力	305,436	9,068,394.84	0.43
51	000527	美的电器	819,522	9,055,718.10	0.43
52	000792	盐湖股份	256,835	8,673,317.95	0.41
53	600739	辽宁成大	550,783	8,592,214.80	0.41
54	600489	中金黄金	395,912	8,520,026.24	0.41
55	000423	东阿阿胶	211,176	8,449,151.76	0.40
56	600795	国电电力	3,106,472	8,387,474.40	0.40
57	000538	云南白药	139,998	8,299,081.44	0.40
58	600011	华能国际	1,271,322	8,200,026.90	0.39
59	600362	江西铜业	334,973	8,009,204.43	0.38
60	601699	潞安环能	371,450	7,703,873.00	0.37
61	600690	青岛海尔	650,180	7,620,109.60	0.36
62	000629	攀钢钒钛	1,155,517	7,603,301.86	0.36
63	000895	双汇发展	122,325	7,569,471.00	0.36
64	600348	阳泉煤业	485,297	7,425,044.10	0.36
65	601788	光大证券	551,802	7,267,232.34	0.35
66	600089	特变电工	1,063,560	7,200,301.20	0.34
67	600276	恒瑞医药	249,496	7,163,030.16	0.34
68	000425	徐工机械	499,322	7,160,277.48	0.34

69	601009	南京银行	838,747	7,146,124.44	0.34
70	600406	国电南瑞	381,508	7,130,384.52	0.34
71	601688	华泰证券	678,043	7,119,451.50	0.34
72	000100	TCL 集团	3,420,800	6,944,224.00	0.33
73	000024	招商地产	278,097	6,821,719.41	0.33
74	601669	中国水电	1,549,800	6,772,626.00	0.32
75	601299	中国北车	1,665,954	6,680,475.54	0.32
76	601168	西部矿业	769,429	6,586,312.24	0.32
77	000725	京东方 A	3,441,696	6,573,639.36	0.31
78	600029	南方航空	1,417,064	6,532,665.04	0.31
79	601377	兴业证券	621,548	6,513,823.04	0.31
80	601766	中国南车	1,426,078	6,502,915.68	0.31
81	000402	金融街	977,263	6,381,527.39	0.31
82	601998	中信银行	1,560,710	6,242,840.00	0.30
83	601111	中国国航	1,008,344	6,201,315.60	0.30
84	000783	长江证券	669,893	6,096,026.30	0.29
85	600309	烟台万华	436,289	5,824,458.15	0.28
86	601898	中煤能源	738,699	5,717,530.26	0.27
87	000630	铜陵有色	286,885	5,536,880.50	0.26
88	601186	中国铁建	1,242,354	5,528,475.30	0.26
89	600068	葛洲坝	844,517	5,514,696.01	0.26
90	600535	天士力	124,830	5,457,567.60	0.26
91	600600	青岛啤酒	141,675	5,410,568.25	0.26
92	600100	同方股份	641,666	5,402,827.72	0.26
93	600456	宝钛股份	284,774	5,345,207.98	0.26
94	601390	中国中铁	2,069,399	5,318,355.43	0.25
95	600369	西南证券	468,667	5,300,623.77	0.25
96	600642	申能股份	1,144,996	5,278,431.56	0.25
97	000878	云南铜业	285,773	5,115,336.70	0.24
98	600150	中国船舶	222,510	5,111,054.70	0.24
99	600010	宝钢股份	1,036,958	5,060,355.04	0.24
100	000060	中金岭南	582,835	5,024,037.70	0.24
101	600009	上海机场	393,821	5,017,279.54	0.24
102	000623	吉林敖东	288,804	5,007,861.36	0.24
103	002241	歌尔声学	136,939	4,996,904.11	0.24
104	600123	兰花科创	276,560	4,994,673.60	0.24
105	601958	金钼股份	390,664	4,949,712.88	0.24
106	600315	上海家化	126,700	4,942,567.00	0.24
107	601618	中国中冶	1,966,060	4,875,828.80	0.23
108	600549	厦门钨业	110,086	4,833,876.26	0.23
109	601666	平煤股份	476,529	4,822,473.48	0.23

110	600875	东方电气	268,631	4,813,867.52	0.23
111	600583	海油工程	784,751	4,779,133.59	0.23
112	000012	南玻A	529,847	4,768,623.00	0.23
113	002081	金螳螂	125,469	4,767,822.00	0.23
114	600196	复星医药	461,113	4,754,075.03	0.23
115	000709	河北钢铁	1,714,200	4,679,766.00	0.22
116	002142	宁波银行	465,510	4,645,789.80	0.22
117	000039	中集集团	348,010	4,628,533.00	0.22
118	601117	中国化学	796,276	4,594,512.52	0.22
119	600085	同仁堂	262,665	4,583,504.25	0.22
120	600177	雅戈尔	539,220	4,577,977.80	0.22
121	601991	大唐发电	806,700	4,541,721.00	0.22
122	600188	兖州煤业	238,929	4,534,872.42	0.22
123	002422	科伦药业	96,942	4,523,313.72	0.22
124	600143	金发科技	744,166	4,442,671.02	0.21
125	600660	福耀玻璃	565,800	4,424,556.00	0.21
126	000009	中国宝安	440,152	4,401,520.00	0.21
127	002415	海康威视	161,364	4,389,100.80	0.21
128	600005	武钢股份	1,629,371	4,383,007.99	0.21
129	000581	威孚高科	159,746	4,377,040.40	0.21
130	600066	宇通客车	192,628	4,326,424.88	0.21
131	000728	国元证券	396,305	4,323,687.55	0.21
132	601919	中国远洋	924,519	4,289,768.16	0.21
133	600415	小商品城	549,228	4,283,978.40	0.20
134	000937	冀中能源	279,950	4,274,836.50	0.20
135	600271	航天信息	223,575	4,227,803.25	0.20
136	600881	亚泰集团	764,726	4,205,993.00	0.20
137	002155	辰州矿业	216,523	4,191,885.28	0.20
138	601607	上海医药	387,972	4,139,661.24	0.20
139	600166	福田汽车	567,000	4,054,050.00	0.19
140	600376	首开股份	301,575	3,992,853.00	0.19
141	002202	金风科技	620,044	3,974,482.04	0.19
142	600694	大商股份	118,476	3,963,022.20	0.19
143	600809	山西汾酒	104,792	3,949,610.48	0.19
144	601808	中海油服	239,007	3,946,005.57	0.19
145	000528	柳工	317,866	3,944,717.06	0.19
146	600115	东方航空	942,213	3,938,450.34	0.19
147	601717	郑煤机	338,930	3,931,588.00	0.19
148	000768	西飞国际	499,965	3,924,725.25	0.19
149	601018	宁波港	1,549,261	3,919,630.33	0.19
150	600252	中恒集团	356,131	3,903,195.76	0.19

151	000562	宏源证券	235,851	3,900,975.54	0.19
152	600153	建发股份	541,947	3,880,340.52	0.19
153	600058	五矿发展	172,996	3,863,000.68	0.18
154	600703	三安光电	282,736	3,848,036.96	0.18
155	601901	方正证券	738,500	3,751,580.00	0.18
156	600741	华域汽车	417,012	3,740,597.64	0.18
157	600497	驰宏锌锗	264,421	3,720,403.47	0.18
158	000729	燕京啤酒	509,042	3,716,006.60	0.18
159	000933	神火股份	406,802	3,710,034.24	0.18
160	000625	长安汽车	758,861	3,703,241.68	0.18
161	000869	张裕 A	54,915	3,693,582.90	0.18
162	600655	豫园商城	464,092	3,657,044.96	0.17
163	000960	锡业股份	182,906	3,603,248.20	0.17
164	002353	杰瑞股份	74,155	3,596,517.50	0.17
165	600395	盘江股份	133,564	3,590,200.32	0.17
166	000800	一汽轿车	328,437	3,566,825.82	0.17
167	600267	海正药业	203,260	3,552,984.80	0.17
168	000422	湖北宣化	289,910	3,551,397.50	0.17
169	000758	中色股份	185,633	3,521,458.01	0.17
170	600827	友谊股份	311,222	3,519,920.82	0.17
171	600832	东方明珠	643,013	3,452,979.81	0.17
172	000999	华润三九	157,960	3,451,426.00	0.17
173	002106	莱宝高科	169,560	3,403,069.20	0.16
174	601333	广深铁路	1,140,500	3,353,070.00	0.16
175	600779	水井坊	138,048	3,350,424.96	0.16
176	600649	城投控股	463,721	3,348,065.62	0.16
177	601106	中国一重	1,055,400	3,335,064.00	0.16
178	600259	广晟有色	50,299	3,316,213.07	0.16
179	601118	海南橡胶	475,987	3,270,030.69	0.16
180	600804	鹏博士	540,223	3,208,924.62	0.15
181	000825	太钢不锈	906,800	3,201,004.00	0.15
182	000876	新希望	210,386	3,151,582.28	0.15
183	600839	四川长虹	1,490,425	3,144,796.75	0.15
184	002385	大北农	161,786	3,138,648.40	0.15
185	600219	南山铝业	468,345	3,137,911.50	0.15
186	600125	铁龙物流	368,812	3,127,525.76	0.15
187	600208	新湖中宝	751,942	3,105,520.46	0.15
188	002001	新和成	146,541	3,096,411.33	0.15
189	000401	冀东水泥	217,500	3,058,050.00	0.15
190	600588	用友软件	197,555	3,014,689.30	0.14
191	600320	振华重工	712,751	3,007,809.22	0.14

192	601888	中国国旅	106,513	3,005,796.86	0.14
193	600718	东软集团	346,784	2,985,810.24	0.14
194	002038	双鹭药业	92,210	2,969,162.00	0.14
195	601001	大同煤业	270,203	2,958,722.85	0.14
196	600811	东方集团	538,050	2,948,514.00	0.14
197	000898	鞍钢股份	744,508	2,903,581.20	0.14
198	601633	长城汽车	162,171	2,886,643.80	0.14
199	600372	中航电子	159,200	2,864,008.00	0.14
200	600893	航空动力	219,882	2,860,664.82	0.14
201	002007	华兰生物	116,277	2,858,088.66	0.14
202	002310	东方园林	48,644	2,855,889.24	0.14
203	002092	中泰化学	372,651	2,850,780.15	0.14
204	600971	恒源煤电	201,703	2,809,722.79	0.13
205	601179	中国西电	703,334	2,799,269.32	0.13
206	600216	浙江医药	110,370	2,775,805.50	0.13
207	601101	昊华能源	161,430	2,763,681.60	0.13
208	600674	川投能源	398,064	2,754,602.88	0.13
209	601918	国投新集	224,039	2,735,516.19	0.13
210	600266	北京城建	179,413	2,725,283.47	0.13
211	600108	亚盛集团	550,000	2,711,500.00	0.13
212	600331	宏达股份	333,225	2,679,129.00	0.13
213	600895	张江高科	312,464	2,677,816.48	0.13
214	000718	苏宁环球	329,808	2,671,444.80	0.13
215	601928	凤凰传媒	308,200	2,650,520.00	0.13
216	600062	华润双鹤	138,426	2,641,168.08	0.13
217	600997	开滦股份	249,081	2,607,878.07	0.12
218	000061	农产品	446,551	2,589,995.80	0.12
219	000778	新兴铸管	386,805	2,587,725.45	0.12
220	000969	安泰科技	208,916	2,555,042.68	0.12
221	600859	王府井	93,379	2,554,849.44	0.12
222	000839	中信国安	379,673	2,551,402.56	0.12
223	600664	哈药股份	386,882	2,549,552.38	0.12
224	600132	重庆啤酒	117,208	2,530,520.72	0.12
225	601933	永辉超市	93,001	2,520,327.10	0.12
226	601992	金隅股份	377,073	2,507,535.45	0.12
227	600863	内蒙华电	312,495	2,468,710.50	0.12
228	002146	荣盛发展	225,636	2,459,432.40	0.12
229	000046	泛海建设	548,999	2,454,025.53	0.12
230	601866	中海集运	960,400	2,429,812.00	0.12
231	600550	天威保变	277,136	2,419,397.28	0.12
232	600169	太原重工	684,750	2,403,472.50	0.11

233	002069	獐子岛	114,800	2,393,580.00	0.11
234	600352	浙江龙盛	414,794	2,376,769.62	0.11
235	600498	烽火通信	89,367	2,369,119.17	0.11
236	600118	中国卫星	185,043	2,329,691.37	0.11
237	600221	海南航空	477,113	2,328,311.44	0.11
238	600109	国金证券	161,355	2,321,898.45	0.11
239	000703	恒逸石化	139,605	2,321,631.15	0.11
240	600160	巨化股份	228,740	2,310,274.00	0.11
241	601158	重庆水务	387,373	2,281,626.97	0.11
242	601558	华锐风电	324,500	2,274,745.00	0.11
243	600316	洪都航空	173,577	2,261,708.31	0.11
244	600516	方大炭素	258,148	2,204,583.92	0.11
245	000807	云铝股份	372,746	2,195,473.94	0.11
246	601336	新华保险	64,000	2,191,360.00	0.10
247	600432	吉恩镍业	163,721	2,174,214.88	0.10
248	600873	梅花集团	320,075	2,160,506.25	0.10
249	000680	山推股份	367,663	2,150,828.55	0.10
250	601555	东吴证券	242,100	2,140,164.00	0.10
251	600598	北大荒	286,997	2,138,127.65	0.10
252	002299	圣农发展	147,007	2,122,781.08	0.10
253	600508	上海能源	116,728	2,116,278.64	0.10
254	600812	华北制药	332,062	2,111,914.32	0.10
255	002128	露天煤业	160,617	2,100,870.36	0.10
256	601098	中南传媒	217,400	2,082,692.00	0.10
257	600770	综艺股份	178,316	2,047,067.68	0.10
258	600970	中材国际	176,522	2,037,063.88	0.10
259	600170	上海建工	280,010	2,021,672.20	0.10
260	002073	软控股份	239,714	2,008,803.32	0.10
261	600022	山东钢铁	779,300	2,002,801.00	0.10
262	600528	中铁二局	294,418	1,990,265.68	0.10
263	600418	江淮汽车	364,050	1,969,510.50	0.09
264	600500	中化国际	290,115	1,961,177.40	0.09
265	601566	九牧王	70,078	1,951,672.30	0.09
266	000059	辽通化工	246,300	1,948,233.00	0.09
267	600037	歌华有线	256,785	1,933,591.05	0.09
268	601369	陕鼓动力	198,421	1,837,378.46	0.09
269	000686	东北证券	103,209	1,769,002.26	0.08
270	002344	海宁皮城	67,758	1,767,128.64	0.08
271	000961	中南建设	141,386	1,761,669.56	0.08
272	000780	平庄能源	163,702	1,715,596.96	0.08
273	600595	中孚实业	305,697	1,705,789.26	0.08

274	601099	太平洋	242,630	1,674,147.00	0.08
275	600546	山煤国际	79,963	1,672,825.96	0.08
276	002405	四维图新	139,600	1,666,824.00	0.08
277	002500	山西证券	199,901	1,637,189.19	0.08
278	000559	万向钱潮	321,493	1,617,109.79	0.08
279	002431	棕榈园林	61,978	1,598,412.62	0.08
280	000968	煤气化	103,700	1,581,425.00	0.08
281	002122	天马股份	239,654	1,548,164.84	0.07
282	600096	云天化	111,958	1,484,563.08	0.07
283	600183	生益科技	287,076	1,478,441.40	0.07
284	601718	际华集团	467,016	1,475,770.56	0.07
285	600783	鲁信创投	90,144	1,438,698.24	0.07
286	000021	长城开发	266,181	1,432,053.78	0.07
287	002493	荣盛石化	89,800	1,376,634.00	0.07
288	002399	海普瑞	64,616	1,369,859.20	0.07
289	601258	庞大集团	211,600	1,290,760.00	0.06
290	002603	以岭药业	44,625	1,229,418.75	0.06
291	600307	酒钢宏兴	330,200	1,145,794.00	0.05
292	002378	章源钨业	34,599	1,095,404.34	0.05
293	601216	内蒙君正	154,922	1,079,806.34	0.05
294	601233	桐昆股份	116,718	1,020,115.32	0.05
295	601268	二重重装	136,400	836,132.00	0.04
296	002570	贝因美	34,388	692,918.20	0.03
297	002594	比亚迪	31,900	633,534.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	33,284,532.45	1.61
2	601939	建设银行	31,223,871.76	1.51
3	600000	浦发银行	16,672,362.00	0.80
4	601818	光大银行	12,722,110.84	0.61
5	601988	中国银行	9,058,869.74	0.44
6	600011	华能国际	8,346,922.67	0.40

7	600219	南山铝业	7,387,205.94	0.36
8	601669	中国水电	6,854,857.80	0.33
9	000725	京东方 A	6,486,469.80	0.31
10	000807	云铝股份	5,142,998.08	0.25
11	002241	歌尔声学	4,828,984.43	0.23
12	600016	民生银行	4,787,822.00	0.23
13	600315	上海家化	4,740,023.00	0.23
14	002081	金螳螂	4,732,531.07	0.23
15	601377	兴业证券	4,610,831.54	0.22
16	600036	招商银行	4,193,982.00	0.20
17	600456	宝钛股份	3,957,580.06	0.19
18	601168	西部矿业	3,939,100.70	0.19
19	601901	方正证券	3,754,807.00	0.18
20	600827	友谊股份	3,597,854.92	0.17

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	30,695,348.21	1.48
2	600000	浦发银行	24,408,642.18	1.18
3	600016	民生银行	22,090,393.28	1.07
4	601939	建设银行	13,534,126.78	0.65
5	601818	光大银行	11,739,376.37	0.57
6	600219	南山铝业	11,088,459.85	0.54
7	600036	招商银行	11,073,462.89	0.53
8	601988	中国银行	10,110,874.53	0.49
9	601318	中国平安	5,903,461.62	0.29
10	000807	云铝股份	5,368,969.51	0.26
11	601168	西部矿业	4,371,336.80	0.21
12	601166	兴业银行	4,367,733.44	0.21
13	601727	上海电气	4,283,240.87	0.21
14	600519	贵州茅台	4,171,414.61	0.20
15	600837	海通证券	3,847,163.26	0.19
16	601088	中国神华	3,650,566.86	0.18
17	600030	中信证券	3,617,122.49	0.17
18	000002	万科 A	3,442,876.26	0.17
19	600635	大众公用	2,873,644.73	0.14
20	000858	五粮液	2,821,746.35	0.14

注：卖出金额按卖出的成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	285,189,750.86
卖出股票的收入（成交）总额	365,655,727.03

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,080,000.00	0.39
2	央行票据	29,088,000.00	1.39
3	金融债券	50,215,000.00	2.40
	其中：政策性金融债	50,215,000.00	2.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	87,383,000.00	4.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120216	12 国开 16	500,000	50,215,000.00	2.40
2	1101094	11 央票 94	300,000	29,088,000.00	1.39
3	019202	12 国债 02	80,000	8,080,000.00	0.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告期编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	3,554,375.43
3	应收股利	3,398,234.53
4	应收利息	1,055,618.62
5	应收申购款	238,988.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,747,216.84

7.9.4 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。

7.9.5.1 期末指数投资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。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
88,529	31,038.02	239,856,974.04	8.73%	2,507,907,713.72	91.27%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	541,710.21	0.0197%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 4 月 12 日）基金份额总额	3,297,550,055.44
本报告期初基金份额总额	2,876,460,664.68
本报告期基金总申购份额	201,585,518.61
减：本报告期基金总赎回份额	330,281,495.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,747,764,687.76

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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内管理人聘任翟爱东为公司督察长，孙昌海不再担任督察长。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据中国农业银行 2012 年 5 月 31 日的公告,农银汇理基金管理有限公司时任董事长杨琨先生正协助有关部门调查。截至 2012 年 6 月底,本基金管理人没有获知该事项的原因和结论。

报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	529,728,591.75	81.63%	454,151.12	82.17%	-
申银万国	2	119,229,004.96	18.37%	98,571.72	17.83%	-

注: 1、公司租用交易席位的证券公司应同时满足以下基本条件:

- (1) 实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2) 市场形象及财务状况良好。
- (3) 经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (4) 内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (5) 研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	37,300,000.00	79.19%	-	-
申银万国	18,818,386.80	100.00%	9,800,000.00	20.81%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于海通证券开通基金定投公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-29
2	关于新增广发证券为代销机构的公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-30
3	关于新增东方证券为代销机构的公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-12
4	关于中信银行开通基金定投的公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-07
5	关于中信银行电子银行基金申购费率优惠的公告	管理人网站、中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《农银汇理沪深 300 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和营业执照复印件。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号陆家嘴商务广场 7 层。

11.3 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
二〇一二年八月二十九日