

农银汇理沪深 300 指数证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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

送出日期：2014 年 8 月 25 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 2014 年 8 月 22 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 2014 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的说明.....	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.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§11 备查文件目录.....	45
11.1 备查文件目录	45
11.2 存放地点	45
11.3 查阅方式	45

§ 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
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	1,832,536,532.65 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	hejinlong@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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	层	
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	刁钦义	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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-69,145,547.45
本期利润	-86,380,931.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0451
本期加权平均净值利润率	-6.49%
本期基金份额净值增长率	-5.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-558,883,354.79
期末可供分配基金份额利润	-0.3050
期末基金资产净值	1,273,653,177.86
期末基金份额净值	0.6950
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-30.50%

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。

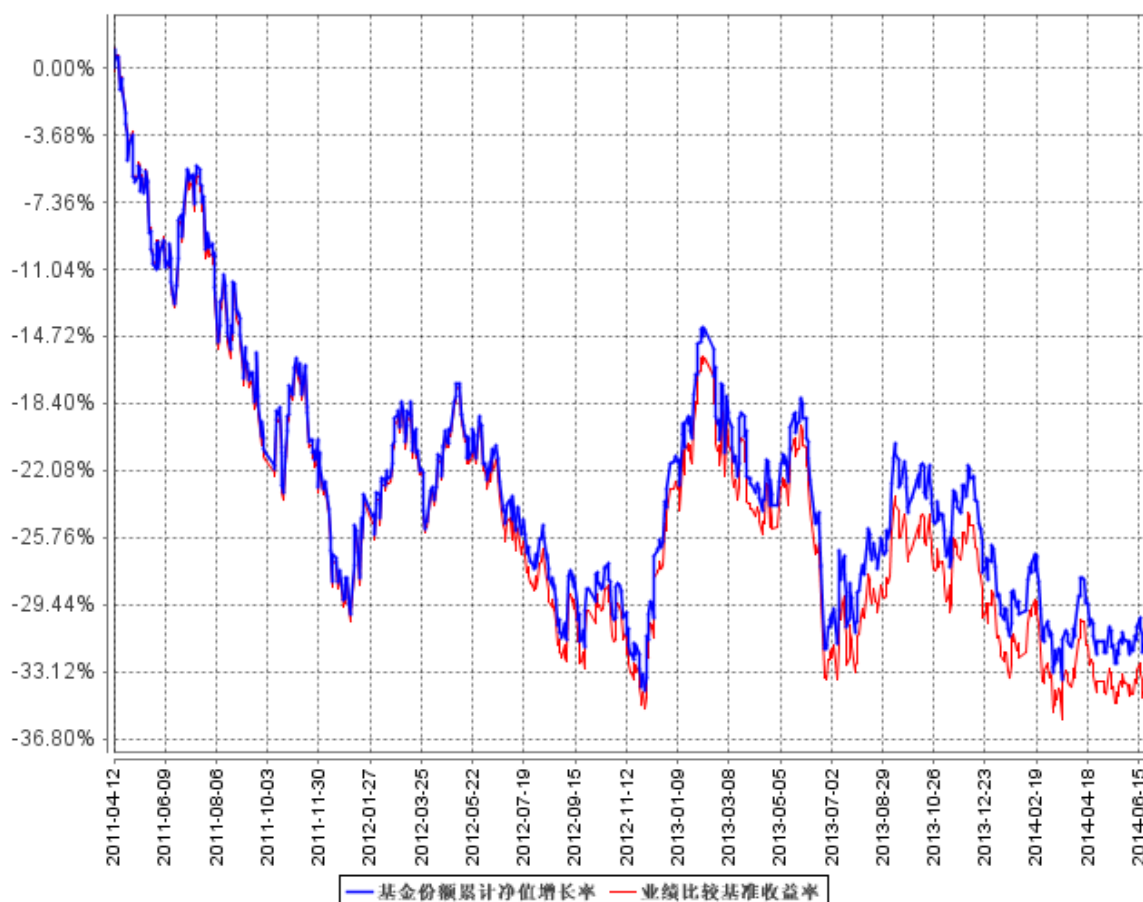
3.2 基金净值表现

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	1.16%	0.74%	0.38%	0.74%	0.78%	0.00%
过去三个月	1.85%	0.84%	0.85%	0.83%	1.00%	0.01%
过去六个月	-5.92%	0.99%	-6.70%	0.99%	0.78%	0.00%
过去一年	0.16%	1.13%	-1.44%	1.11%	1.60%	0.02%
过去三年	-24.51%	1.24%	-27.41%	1.23%	2.90%	0.01%
自基金合同生效起至今	-30.50%	1.23%	-33.40%	1.22%	2.90%	0.01%

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

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



注：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，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刁钦义先生。

截止 2014 年 6 月 30 日, 公司现管理 21 只开放式基金, 分别为农银汇理行业成长股票型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值股票型证券投资基金、农银汇理中小盘股票型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选股票型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题股票型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金、农银汇理行业领先股票型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金和农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
宋永安	本基金基金经理	2012年8月3日	-	6	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。

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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。报告期内，本基金管理人不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》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。

未发生本基金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超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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 0.0287%，日均偏离度为 0.0181%，符合基金合同契约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来源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

报告期内本基金份额净值增长-5.92%，同期业绩比较基准收益率为-6.70%。

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及适用性的情况、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。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的要求，报告期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

本报告期内，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

本报告期内，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。本报告期内，农银汇理沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

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 2013 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,578,048.69	559,443.48
结算备付金		4,556.45	61,698.23
存出保证金		64,130.61	173,191.39
交易性金融资产	6.4.7.2	1,268,235,924.86	1,477,731,535.90
其中：股票投资		1,208,013,924.86	1,403,073,035.90
基金投资		-	-
债券投资		60,222,000.00	74,658,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

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		-	1,155,859.00
应收利息	6.4.7.5	647,076.13	1,886,687.37
应收股利		-	-
应收申购款		5,341.36	275,688.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,277,535,078.10	1,481,844,103.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,411,783.26	2,192,485.83
应付管理人报酬		626,129.51	771,592.49
应付托管费		156,532.40	192,898.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	171,420.81	351,081.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	516,034.26	531,754.75
负债合计		3,881,900.24	4,039,812.39
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,832,536,532.65	2,000,467,969.76
未分配利润	6.4.7.10	-558,883,354.79	-522,663,678.41
所有者权益合计		1,273,653,177.86	1,477,804,291.35
负债和所有者权益总计		1,277,535,078.10	1,481,844,103.74

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6950 元，基金份额总额 1,832,536,532.65 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至	上年度可比期间 2013年1月1日至2013
-----	-----	------------------	---------------------------

		2014 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		-80,614,928.98	-198,871,543.79
1.利息收入		1,116,783.04	1,343,321.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,281.12	99,274.21
债券利息收入		1,062,501.92	1,241,249.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,797.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-64,581,788.53	-50,270,639.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-79,470,365.77	-71,467,105.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	91,810.00	-54,468.16
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	14,796,767.24	21,250,934.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-17,235,383.58	-150,122,565.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	85,460.09	178,340.00
减：二、费用		5,766,002.05	8,655,133.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,964,426.09	5,712,514.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	991,106.56	1,428,128.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	465,468.85	1,080,689.07
5. 利息支出		651.14	28,129.95
其中：卖出回购金融资产支出		651.14	28,129.95
6. 其他费用	6.4.7.20	344,349.41	405,670.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-86,380,931.03	-207,526,677.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-86,380,931.03	-207,526,677.48

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	2,000,467,969.76	-522,663,678.41	1,477,804,291.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-86,380,931.03	-86,380,931.03
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）	-167,931,437.11	50,161,254.65	-117,770,182.46
其中：1.基金申购款	120,716,812.30	-36,352,072.82	84,364,739.48
2.基金赎回款	-288,648,249.41	86,513,327.47	-202,134,921.94
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）	1,832,536,532.65	-558,883,354.79	1,273,653,177.86
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	2,548,277,675.93	-551,833,519.77	1,996,444,156.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-207,526,677.48	-207,526,677.48
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）	-192,987,472.90	38,374,143.15	-154,613,329.75
其中：1.基金申购款	202,948,307.99	-41,803,230.08	161,145,077.91
2.基金赎回款	-395,935,780.89	80,177,373.23	-315,758,407.66
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）	2,355,290,203.03	-720,986,054.10	1,634,304,148.93

报表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：

<u> 施卫 </u>	<u> 杜明华 </u>	<u> 于意 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有

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 2014 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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、国家税务总局财税[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[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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对基金取得的股票股息、红利收入，要求基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	8,578,048.69
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,578,048.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,550,485,567.24	1,208,013,924.86	-342,471,642.38	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	60,083,160.00	60,222,000.00	138,840.00
	合计	60,083,160.00	60,222,000.00	138,840.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,610,568,727.24	1,268,235,924.86	-342,332,802.38	

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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,382.48
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	1.89
应收债券利息	645,665.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	26.01
合计	647,076.13

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 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	171,120.81
银行间市场应付交易费用	300.00
合计	171,420.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	3,030.36
预提费用	198,354.28
指数使用费	64,649.62
合计	516,034.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,000,467,969.76	2,000,467,969.76
本期申购	120,716,812.30	120,716,812.30
本期赎回 (以“-”号填列)	-288,648,249.41	-288,648,249.41
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,832,536,532.65	1,832,536,532.65

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	-364,014,833.28	-158,648,845.13	-522,663,678.41
本期利润	-69,145,547.45	-17,235,383.58	-86,380,931.03
本期基金份额交易产生的变动数	32,638,222.21	17,523,032.44	50,161,254.65
其中：基金申购款	-23,110,992.00	-13,241,080.82	-36,352,072.82
基金赎回款	55,749,214.21	30,764,113.26	86,513,327.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-400,522,158.52	-158,361,196.27	-558,883,354.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,880.34
其他	956.29
合计	54,281.12

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	184,835,534.56
减：卖出股票成本总额	264,305,900.33
买卖股票差价收入	-79,470,365.77

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	77,323,636.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	74,889,390.00
减：应收利息总额	2,342,436.17
债券投资收益	91,810.00

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,796,767.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,796,767.24

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-17,235,383.58
——股票投资	-17,605,113.58
——债券投资	369,730.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-17,235,383.58

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	51,296.57
基金转换费收入	34,163.52
合计	85,460.09

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	465,168.85
银行间市场交易费用	300.00
合计	465,468.85

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
指数使用费	132,147.46
账户服务费	9,000.00
银行汇划费	4,847.67
合计	344,349.41

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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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	本基金管理人
中国工商银行股份有限公司	本基金托管人

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

6.4.10.1.1 股票交易

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。

债券交易

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债券交易。

债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,964,426.09	5,712,514.99
其中：支付销售机构的客户维护费	1,591,457.50	2,211,097.21

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	991,106.56	1,428,128.77

的托管费		
------	--	--

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

本基金本报告期间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	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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	8,578,048.69	51,444.49	3,185,749.88	93,856.61

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 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
600637	百视通	2014年5月29日	公告重大事项	32.03	-	-	168,755	3,296,394.06	5,405,222.65	-
600832	东方明珠	2014年5月29日	公告重大事项	10.98	-	-	401,682	3,339,292.90	4,410,468.36	-
000009	中国宝安	2014年5月28日	公告重大事项	10.21	2014年8月15日	9.33	317,491	5,148,595.42	3,241,583.11	-
000562	宏源证券	2013年10月31日	公告重大事项	8.22	2014年7月28日	8.93	345,832	3,564,077.32	2,842,739.04	-
601669	中国电建	2014年5月13日	公告重大事项	2.79	-	-	984,730	4,270,917.88	2,747,396.70	-
002570	贝因美	2014年6月19日	公告重大事项	14.36	-	-	148,591	1,429,304.16	2,133,766.76	-
600516	方大炭素	2014年6月30日	公告重大事项	9.59	2014年7月2日	9.05	208,218	2,569,653.80	1,996,810.62	-
000960	锡业股份	2014年5月6日	公告重大事项	12.44	2014年8月5日	13.68	117,606	3,514,400.74	1,463,018.64	-
600498	烽火通信	2014年6月30日	公告重大事项	11.91	2014年7月7日	12.10	116,955	1,575,045.76	1,392,934.05	-
000878	云南铜业	2014年4月17日	公告重大事项	7.61	2014年7月17日	7.50	182,364	4,403,344.32	1,387,790.04	-
002252	上海莱士	2014年6月13日	公告重大事项	63.30	-	-	14,972	967,310.11	947,727.60	-
000536	华映科技	2014年5月23日	公告重大事项	23.10	2014年8月20日	25.41	35,800	916,977.19	826,980.00	-

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

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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的证券，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约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。

6.4.13.4.2 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	1,208,013,924.86	94.85	1,403,073,035.90	94.94
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,208,013,924.86	94.85	1,403,073,035.90	94.94

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：人民币元）	
		本期末 （2014 年 6 月 30 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	64,261,675.56	74,480,079.20
	业绩比较基准下降 5%	-64,261,675.56	-74,480,079.20

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。

§ 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	1,208,013,924.86	94.56
	其中：股票	1,208,013,924.86	94.56
2	固定收益投资	60,222,000.00	4.71
	其中：债券	60,222,000.00	4.71
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,582,605.14	0.67
7	其他各项资产	716,548.10	0.06
8	合计	1,277,535,078.10	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,840,016.16	0.30
B	采矿业	72,021,394.77	5.65
C	制造业	437,668,349.03	34.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,167,950.54	3.31
E	建筑业	38,414,142.87	3.02
F	批发和零售业	32,713,883.42	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	29,946,367.46	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,827,885.34	3.76
J	金融业	403,920,463.62	31.71
K	房地产业	55,520,907.39	4.36
L	租赁和商务服务业	11,467,320.29	0.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,341,520.76	0.89
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	10,504,521.24	0.82
S	综合	10,659,201.97	0.84
	合计	1,208,013,924.86	94.85

7.2.2 期末积极投资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	1,159,998	45,634,321.32	3.58
2	600036	招商银行	4,368,868	44,737,208.32	3.51

3	600016	民生银行	6,569,574	40,797,054.54	3.20
4	601166	兴业银行	2,770,596	27,789,077.88	2.18
5	600000	浦发银行	2,712,574	24,548,794.70	1.93
6	600030	中信证券	1,907,665	21,861,840.90	1.72
7	601988	中国银行	7,726,187	19,701,776.85	1.55
8	000002	万科A	2,346,176	19,402,875.52	1.52
9	600837	海通证券	1,957,566	17,911,728.90	1.41
10	601818	光大银行	6,839,267	17,371,738.18	1.36
11	000651	格力电器	582,076	17,142,138.20	1.35
12	601328	交通银行	4,206,610	16,321,646.80	1.28
13	600519	贵州茅台	110,733	15,721,871.34	1.23
14	000001	平安银行	1,381,849	13,694,123.59	1.08
15	601601	中国太保	760,399	13,527,498.21	1.06
16	600887	伊利股份	395,347	13,093,892.64	1.03
17	600104	上汽集团	800,115	12,241,759.50	0.96
18	601088	中国神华	797,854	11,600,797.16	0.91
19	601169	北京银行	1,324,519	10,675,623.14	0.84
20	601668	中国建筑	3,628,535	10,232,468.70	0.80
21	600383	金地集团	1,081,646	9,615,832.94	0.75
22	601939	建设银行	2,320,707	9,584,519.91	0.75
23	600015	华夏银行	1,123,948	9,216,373.60	0.72
24	601006	大秦铁路	1,438,512	9,077,010.72	0.71
25	000858	五粮液	459,133	8,232,254.69	0.65
26	601989	中国重工	1,698,456	8,186,557.92	0.64
27	000333	美的集团	408,425	7,890,771.00	0.62
28	600048	保利地产	1,555,977	7,717,645.92	0.61
29	600585	海螺水泥	484,391	7,614,626.52	0.60
30	600900	长江电力	1,198,875	7,457,002.50	0.59
31	600028	中国石化	1,360,911	7,172,000.97	0.56
32	601857	中国石油	941,808	7,101,232.32	0.56
33	002024	苏宁云商	1,072,954	7,038,578.24	0.55
34	000776	广发证券	716,824	7,024,875.20	0.55
35	600111	包钢稀土	351,937	6,915,562.05	0.54
36	600050	中国联通	2,053,550	6,632,966.50	0.52
37	000538	云南白药	126,091	6,581,950.20	0.52
38	600089	特变电工	766,926	6,511,201.74	0.51
39	600497	驰宏锌锗	684,139	6,300,920.19	0.49
40	000063	中兴通讯	476,068	6,246,012.16	0.49
41	600276	恒瑞医药	181,205	6,008,757.80	0.47

42	600690	青岛海尔	395,373	5,835,705.48	0.46
43	600535	天士力	149,903	5,811,739.31	0.46
44	600011	华能国际	1,017,241	5,757,584.06	0.45
45	000895	双汇发展	159,921	5,723,572.59	0.45
46	600999	招商证券	562,711	5,689,008.21	0.45
47	000625	长安汽车	455,479	5,606,946.49	0.44
48	600196	复星医药	277,342	5,599,534.98	0.44
49	600518	康美药业	372,767	5,572,866.65	0.44
50	600637	百视通	168,755	5,405,222.65	0.42
51	002594	比亚迪	113,458	5,388,120.42	0.42
52	000725	京东方 A	2,466,896	5,353,164.32	0.42
53	600256	广汇能源	758,797	5,326,754.94	0.42
54	601766	中国南车	1,141,126	5,135,067.00	0.40
55	601688	华泰证券	676,807	5,089,588.64	0.40
56	600739	辽宁成大	330,502	5,033,545.46	0.40
57	002415	海康威视	291,848	4,943,905.12	0.39
58	601628	中国人寿	362,288	4,930,739.68	0.39
59	002241	歌尔声学	184,810	4,927,034.60	0.39
60	600019	宝钢股份	1,196,805	4,906,900.50	0.39
61	600018	上港集团	1,102,300	4,905,235.00	0.39
62	601901	方正证券	886,439	4,813,363.77	0.38
63	000157	中联重科	1,064,054	4,713,759.22	0.37
64	600406	国电南瑞	352,981	4,705,236.73	0.37
65	000338	潍柴动力	256,594	4,564,807.26	0.36
66	600795	国电电力	2,086,518	4,527,744.06	0.36
67	600703	三安光电	193,189	4,526,418.27	0.36
68	601299	中国北车	982,171	4,459,056.34	0.35
69	600832	东方明珠	401,682	4,410,468.36	0.35
70	601390	中国中铁	1,655,923	4,272,281.34	0.34
71	601336	新华保险	202,088	4,270,119.44	0.34
72	000423	东阿阿胶	126,730	4,222,643.60	0.33
73	600886	国投电力	821,760	4,190,976.00	0.33
74	600352	浙江龙盛	258,994	4,182,753.10	0.33
75	600315	上海家化	114,000	4,178,100.00	0.33
76	000100	TCL 集团	1,831,477	4,175,767.56	0.33
77	601899	紫金矿业	1,913,862	4,172,219.16	0.33
78	002450	康得新	183,240	4,168,710.00	0.33
79	000069	华侨城 A	880,550	4,129,779.50	0.32
80	601009	南京银行	503,350	4,026,800.00	0.32

81	002304	洋河股份	78,294	3,973,420.50	0.31
82	600309	万华化学	261,904	3,970,464.64	0.31
83	600804	鹏博士	268,793	3,881,370.92	0.30
84	000581	威孚高科	143,696	3,875,481.12	0.30
85	000783	长江证券	401,980	3,859,008.00	0.30
86	002236	大华股份	141,860	3,823,127.00	0.30
87	002353	杰瑞股份	92,958	3,741,559.50	0.29
88	600109	国金证券	188,055	3,736,652.85	0.29
89	600031	三一重工	737,869	3,718,859.76	0.29
90	002230	科大讯飞	135,740	3,610,684.00	0.28
91	002065	东华软件	178,062	3,582,607.44	0.28
92	002008	大族激光	204,549	3,546,879.66	0.28
93	002202	金风科技	372,044	3,530,697.56	0.28
94	600150	中国船舶	166,910	3,515,124.60	0.28
95	600010	包钢股份	969,094	3,508,120.28	0.28
96	600066	宇通客车	215,974	3,485,820.36	0.27
97	601186	中国铁建	745,554	3,437,003.94	0.27
98	600893	航空动力	131,982	3,401,176.14	0.27
99	000503	海虹控股	174,113	3,395,203.50	0.27
100	000768	中航飞机	321,339	3,383,699.67	0.27
101	002456	欧菲光	157,626	3,377,925.18	0.27
102	600600	青岛啤酒	84,247	3,374,934.82	0.26
103	600100	同方股份	372,461	3,318,627.51	0.26
104	601377	兴业证券	377,821	3,256,817.02	0.26
105	000009	中国宝安	317,491	3,241,583.11	0.25
106	600332	白云山	129,800	3,230,722.00	0.25
107	600340	华夏幸福	128,128	3,224,981.76	0.25
108	000402	金融街	586,491	3,196,375.95	0.25
109	600583	海油工程	428,355	3,156,976.35	0.25
110	000793	华闻传媒	268,300	3,152,525.00	0.25
111	601998	中信银行	718,424	3,067,670.48	0.24
112	600079	人福医药	102,408	3,056,878.80	0.24
113	002081	金螳螂	213,429	3,022,154.64	0.24
114	000061	农产品	327,251	3,020,526.73	0.24
115	600009	上海机场	233,322	3,009,853.80	0.24
116	000831	五矿稀土	142,500	2,989,650.00	0.23
117	002038	双鹭药业	66,420	2,960,339.40	0.23
118	000400	许继电气	146,557	2,938,467.85	0.23
119	600674	川投能源	249,464	2,928,707.36	0.23

120	600705	中航投资	180,800	2,905,456.00	0.23
121	600372	中航电子	127,802	2,897,271.34	0.23
122	601607	上海医药	232,924	2,895,245.32	0.23
123	600660	福耀玻璃	339,600	2,852,640.00	0.22
124	000562	宏源证券	345,832	2,842,739.04	0.22
125	000039	中集集团	208,910	2,811,928.60	0.22
126	600718	东软集团	208,098	2,807,242.02	0.22
127	000963	华东医药	51,878	2,801,412.00	0.22
128	000826	桑德环境	122,594	2,801,272.90	0.22
129	600271	航天信息	134,175	2,800,232.25	0.22
130	000568	泸州老窖	169,320	2,773,461.60	0.22
131	600085	同仁堂	158,762	2,767,221.66	0.22
132	600839	四川长虹	894,425	2,754,829.00	0.22
133	002400	省广股份	112,052	2,754,238.16	0.22
134	601669	中国电建	984,730	2,747,396.70	0.22
135	600489	中金黄金	356,390	2,708,564.00	0.21
136	002465	海格通信	169,104	2,693,826.72	0.21
137	000623	吉林敖东	173,278	2,689,274.56	0.21
138	600547	山东黄金	172,330	2,667,668.40	0.21
139	600177	雅戈尔	377,520	2,653,965.60	0.21
140	600118	中国卫星	143,246	2,647,186.08	0.21
141	603000	人民网	67,000	2,625,730.00	0.21
142	000917	电广传媒	171,700	2,614,991.00	0.21
143	000024	招商地产	250,349	2,608,636.58	0.20
144	601991	大唐发电	726,200	2,585,272.00	0.20
145	002142	宁波银行	279,348	2,570,001.60	0.20
146	601168	西部矿业	461,729	2,525,657.63	0.20
147	601808	中海油服	143,439	2,523,092.01	0.20
148	601098	中南传媒	174,000	2,512,560.00	0.20
149	601933	永辉超市	394,104	2,490,737.28	0.20
150	601117	中国化学	477,961	2,490,176.81	0.20
151	600252	中恒集团	211,567	2,481,680.91	0.19
152	600362	江西铜业	201,075	2,467,190.25	0.19
153	601633	长城汽车	97,291	2,461,462.30	0.19
154	600741	华域汽车	250,312	2,448,051.36	0.19
155	601929	吉视传媒	213,300	2,440,152.00	0.19
156	002475	立讯精密	74,283	2,434,996.74	0.19
157	000970	中科三环	204,316	2,427,274.08	0.19
158	002410	广联达	91,114	2,409,054.16	0.19

159	600221	海南航空	1,430,488	2,388,914.96	0.19
160	600642	申能股份	551,296	2,381,598.72	0.19
161	600597	光明乳业	148,300	2,378,732.00	0.19
162	601888	中国国旅	70,926	2,343,395.04	0.18
163	600369	西南证券	273,467	2,338,142.85	0.18
164	000792	盐湖股份	154,130	2,322,739.10	0.18
165	002422	科伦药业	58,088	2,314,806.80	0.18
166	600649	城投控股	361,797	2,279,321.10	0.18
167	600867	通化东宝	173,700	2,263,311.00	0.18
168	000728	国元证券	237,905	2,245,823.20	0.18
169	600153	建发股份	412,039	2,245,612.55	0.18
170	000729	燕京啤酒	340,082	2,210,533.00	0.17
171	002385	大北农	194,230	2,206,452.80	0.17
172	000012	南玻 A	317,910	2,171,325.30	0.17
173	000629	攀钢钒钛	1,040,247	2,163,713.76	0.17
174	601800	中国交建	569,044	2,139,605.44	0.17
175	002570	贝因美	148,591	2,133,766.76	0.17
176	601018	宁波港	930,061	2,111,238.47	0.17
177	600549	厦门钨业	82,586	2,097,684.40	0.16
178	600108	亚盛集团	377,300	2,086,469.00	0.16
179	601333	广深铁路	821,400	2,086,356.00	0.16
180	600166	福田汽车	408,300	2,082,330.00	0.16
181	000598	兴蓉投资	434,000	2,070,180.00	0.16
182	601555	东吴证券	290,600	2,069,072.00	0.16
183	600068	葛洲坝	557,617	2,068,759.07	0.16
184	000425	徐工机械	299,808	2,053,684.80	0.16
185	600827	友谊股份	186,816	2,051,239.68	0.16
186	601618	中国中冶	1,179,960	2,017,731.60	0.16
187	000983	西山煤电	381,653	2,011,311.31	0.16
188	600516	方大炭素	208,218	1,996,810.62	0.16
189	600588	用友软件	141,126	1,985,642.82	0.16
190	600029	南方航空	850,464	1,964,571.84	0.15
191	000778	新兴铸管	521,799	1,935,874.29	0.15
192	600873	梅花生物	376,375	1,930,803.75	0.15
193	600875	东方电气	161,231	1,913,811.97	0.15
194	000709	河北钢铁	1,028,700	1,913,382.00	0.15
195	000876	新希望	168,290	1,899,994.10	0.15
196	000800	一汽轿车	197,137	1,892,515.20	0.15
197	600880	博瑞传播	158,900	1,881,376.00	0.15

198	600060	海信电器	190,200	1,835,430.00	0.14
199	000060	中金岭南	269,719	1,834,089.20	0.14
200	600648	外高桥	67,900	1,808,856.00	0.14
201	600267	海正药业	121,909	1,807,910.47	0.14
202	002007	华兰生物	69,158	1,805,023.80	0.14
203	600655	豫园商城	243,692	1,793,573.12	0.14
204	601898	中煤能源	443,299	1,786,494.97	0.14
205	600316	洪都航空	104,177	1,780,384.93	0.14
206	601179	中国西电	496,600	1,772,862.00	0.14
207	600208	新湖中宝	606,396	1,770,676.32	0.14
208	600863	内蒙华电	468,842	1,767,534.34	0.14
209	600027	华电国际	575,488	1,766,748.16	0.14
210	601118	海南橡胶	285,594	1,753,547.16	0.14
211	600688	上海石化	530,800	1,746,332.00	0.14
212	000999	华润三九	94,858	1,744,438.62	0.14
213	000839	中信国安	227,866	1,731,781.60	0.14
214	601928	凤凰传媒	184,933	1,716,178.24	0.13
215	000686	东北证券	237,018	1,699,419.06	0.13
216	601699	潞安环能	222,917	1,691,940.03	0.13
217	002344	海宁皮城	135,616	1,691,131.52	0.13
218	002292	奥飞动漫	45,252	1,660,748.40	0.13
219	600415	小商品城	329,628	1,658,028.84	0.13
220	601958	金钼股份	234,419	1,654,998.14	0.13
221	600008	首创股份	266,400	1,646,352.00	0.13
222	600348	阳泉煤业	291,273	1,642,779.72	0.13
223	600143	金发科技	372,066	1,640,811.06	0.13
224	002001	新和成	131,864	1,633,794.96	0.13
225	002129	中环股份	85,100	1,622,857.00	0.13
226	601866	中海集运	768,500	1,621,535.00	0.13
227	002310	东方园林	96,775	1,597,755.25	0.13
228	000750	国海证券	167,885	1,586,513.25	0.12
229	002500	山西证券	244,001	1,583,566.49	0.12
230	600663	陆家嘴	98,700	1,563,408.00	0.12
231	000630	铜陵有色	172,203	1,542,938.88	0.12
232	601238	广汽集团	204,500	1,539,885.00	0.12
233	600436	片仔癀	19,508	1,512,455.24	0.12
234	601231	环旭电子	49,038	1,512,331.92	0.12
235	002375	亚厦股份	66,316	1,496,088.96	0.12
236	601992	金隅股份	262,673	1,476,222.26	0.12

237	000960	锡业股份	117,606	1,463,018.64	0.11
238	600216	浙江医药	158,726	1,452,342.90	0.11
239	600664	哈药股份	232,182	1,444,172.04	0.11
240	600062	华润双鹤	83,126	1,428,935.94	0.11
241	002294	信立泰	47,500	1,425,950.00	0.11
242	600115	东方航空	616,278	1,423,602.18	0.11
243	000758	中色股份	143,083	1,422,245.02	0.11
244	600219	南山铝业	281,082	1,411,031.64	0.11
245	600498	烽火通信	116,955	1,392,934.05	0.11
246	000878	云南铜业	182,364	1,387,790.04	0.11
247	000883	湖北能源	259,100	1,365,457.00	0.11
248	601111	中国国航	412,781	1,358,049.49	0.11
249	002106	莱宝高科	118,560	1,339,728.00	0.11
250	000413	东旭光电	175,000	1,312,500.00	0.10
251	002146	荣盛发展	137,540	1,302,503.80	0.10
252	600123	兰花科创	166,060	1,248,771.20	0.10
253	600895	张江高科	187,564	1,222,917.28	0.10
254	600157	永泰能源	513,724	1,217,525.88	0.10
255	002051	中工国际	74,980	1,214,676.00	0.10
256	002429	兆驰股份	155,200	1,201,248.00	0.09
257	600376	首开股份	271,514	1,172,940.48	0.09
258	601666	平煤股份	285,929	1,155,153.16	0.09
259	600259	广晟有色	30,199	1,154,507.77	0.09
260	601158	重庆水务	232,485	1,148,475.90	0.09
261	600170	上海建工	262,096	1,124,391.84	0.09
262	600058	五矿发展	103,895	1,096,092.25	0.09
263	002399	海普瑞	58,116	1,085,606.88	0.09
264	000027	深圳能源	192,000	1,079,040.00	0.08
265	000401	冀东水泥	130,500	1,060,965.00	0.08
266	600998	九州通	78,000	1,044,420.00	0.08
267	002653	海思科	52,300	1,004,160.00	0.08
268	600188	兖州煤业	143,429	992,528.68	0.08
269	000937	冀中能源	168,054	979,754.82	0.08
270	002470	金正大	50,827	975,370.13	0.08
271	601216	内蒙君正	92,600	975,078.00	0.08
272	002252	上海莱士	14,972	947,727.60	0.07
273	002673	西部证券	87,200	941,760.00	0.07
274	000718	苏宁环球	197,924	892,637.24	0.07
275	600783	鲁信创投	54,044	867,946.64	0.07

276	600023	浙能电力	191,490	865,534.80	0.07
277	600546	山煤国际	240,094	859,536.52	0.07
278	601258	庞大集团	190,500	836,295.00	0.07
279	600809	山西汾酒	62,931	835,723.68	0.07
280	000536	华映科技	35,800	826,980.00	0.06
281	002603	以岭药业	27,325	803,901.50	0.06
282	000869	张裕 A	32,915	793,580.65	0.06
283	000656	金科股份	112,202	773,071.78	0.06
284	600096	云天化	109,358	768,786.74	0.06
285	600395	盘江股份	120,276	766,158.12	0.06
286	600633	浙报传媒	57,600	764,352.00	0.06
287	002416	爱施德	48,400	718,740.00	0.06
288	603699	纽威股份	36,300	706,761.00	0.06
289	601918	国投新集	250,915	700,052.85	0.05
290	600277	亿利能源	101,200	657,800.00	0.05
291	601139	深圳燃气	94,273	629,743.64	0.05
292	600403	大有能源	115,735	612,238.15	0.05
293	002269	美邦服饰	73,500	610,785.00	0.05
294	000961	中南建设	84,786	553,652.58	0.04
295	601225	陕西煤业	121,100	500,143.00	0.04
296	000156	华数传媒	17,000	477,530.00	0.04
297	603993	洛阳钼业	58,500	391,950.00	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	002008	大族激光	3,461,123.93	0.23
2	000503	海虹控股	3,383,125.59	0.23
3	002400	省广股份	2,708,981.83	0.18
4	601818	光大银行	2,694,853.00	0.18
5	600030	中信证券	2,655,117.33	0.18

6	601929	吉视传媒	2,585,743.00	0.17
7	000917	电广传媒	2,573,326.70	0.17
8	002465	海格通信	2,561,417.89	0.17
9	002475	立讯精密	2,388,730.47	0.16
10	002410	广联达	2,292,832.06	0.16
11	000001	平安银行	2,244,947.19	0.15
12	601988	中国银行	2,205,198.00	0.15
13	600867	通化东宝	2,159,301.02	0.15
14	600880	博瑞传播	1,990,677.32	0.13
15	601989	中国重工	1,854,477.50	0.13
16	601179	中国西电	1,776,365.18	0.12
17	002292	奥飞动漫	1,589,256.72	0.11
18	600887	伊利股份	1,536,285.50	0.10
19	000413	东旭光电	1,480,207.90	0.10
20	002456	欧菲光	1,433,262.21	0.10

注：买入金额按买入成交金额（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	600036	招商银行	6,342,558.39	0.43
2	601318	中国平安	6,080,395.86	0.41
3	600016	民生银行	5,443,151.91	0.37
4	601988	中国银行	4,331,639.10	0.29
5	601166	兴业银行	3,504,499.00	0.24
6	600000	浦发银行	3,341,860.00	0.23
7	600837	海通证券	2,496,728.28	0.17
8	000002	万科A	2,367,574.59	0.16
9	000651	格力电器	2,228,616.54	0.15
10	601818	光大银行	2,200,110.00	0.15
11	600694	大商股份	2,154,668.44	0.15
12	601328	交通银行	2,134,054.85	0.14
13	600030	中信证券	2,122,915.39	0.14
14	600519	贵州茅台	1,968,329.78	0.13
15	601099	太平洋	1,954,960.98	0.13
16	600811	东方集团	1,916,786.56	0.13

17	601989	中国重工	1,779,525.00	0.12
18	601601	中国太保	1,671,496.69	0.11
19	000001	平安银行	1,668,418.00	0.11
20	000046	泛海控股	1,631,787.52	0.11

注：卖出金额按卖出成交金额（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

买入股票成本（成交）总额	86,851,902.87
卖出股票收入（成交）总额	184,835,534.56

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,222,000.00	4.73
	其中：政策性金融债	60,222,000.00	4.73
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	60,222,000.00	4.73

7.6 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

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	140429	14 农发 29	600,000	60,222,000.00	4.73

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	64,130.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	647,076.13
5	应收申购款	5,341.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	716,548.10

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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
60,232	30,424.63	117,989,980.79	6.44%	1,714,546,551.86	93.56%

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
基金管理人所有从业人员 持有本基金	6,348.42	0.0004%

注：从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份
额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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
本报告期期初基金份额总额	2,000,467,969.76
本报告期基金总申购份额	120,716,812.30
减:本报告期基金总赎回份额	288,648,249.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,832,536,532.65

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，基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2014 年 3 月 5 日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，许红波不再担任农银汇理基金管理有限公司总经理职务，施卫代为履行总经理职务。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。 本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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

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

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的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	
申银万国	2	270,123,666.27	100.00%	245,921.45	100.00%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
申银万国	3,981,200.00	100.00%	1,800,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	农银沪深 300 指数基金招募说明书（更新）（2014 年第 1 次）	中国证券报、基金管理人网站	2014 年 5 月 23 日

§ 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；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

11.2 存放地点

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
2014 年 8 月 25 日