

农银汇理沪深300指数证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月十八日

重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2012年7月17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，保证报告不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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

报告期末基金份额总额:2,747,764,687.76份

基金投资目标:本基金为被动管理的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在3%以内，以实现对沪深300指数的有效跟踪。

基金投资策略:本基金原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将按照指数的成分股与其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。

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。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -40,488,672.93

2.本期利润 31,593,736.62

3.加权平均基金份额本期利润 0.0115

4.期末基金份额净值 2,090,028,056.76

5.期末基金份额净值 0.76006

注:1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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，本期利润为持有人本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；扣除相关费用后的余额，本期利润为持有人本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现**3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

阶段 净值增长 率① 净值增 长率差 ② 业绩比 较基 准收益 率③ 业绩比 较基 准收益 率差 ④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.25% 1.06% 0.28% 1.07% 0.97% -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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**累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图**

(2011年4月12日至2012年6月30日)



注:本基金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银行存款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日起至6个月，建仓期间，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/基金经理助理简介**

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

张惟 本基金基金经理 2011-4-12 - 10 GFA,FRM,金融学硕士，具有基金从业资格，历任法国巴黎信贷银行资产管理公司基金经理、雷曼兄弟欧洲数基银汇理基金管理有限公司基金经理，现任农银汇理基金管理有限公司投资总监、基金经理。

程涛 本基金基金经理/公司投资总监 经理 2011-4-12 - 8 具备硕士学位，具有基金从业资格，历任国泰君安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，历任农银汇理基金管理有限公司投资总监、基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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，基金管理人严格按照《证券投资基金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制度办法》的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格执行交易公平执行，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，不存在内幕交易、利益输送等异常交易情况。

4.4 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.1 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.2 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.3 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.4 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.5 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.6 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.7 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.8 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.9 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.10 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.11 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.12 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.13 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.14 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.15 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.16 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.17 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.18 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.19 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.20 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.21 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.22 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.23 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.24 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.25 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.26 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.27 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.28 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.29 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.30 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.31 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.32 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.33 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.34 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.35 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.36 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.37 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.38 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.39 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.40 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.41 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.42 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.43 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.44 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.45 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.46 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.47 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.48 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.49 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.50 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.51 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.52 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.53 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.54 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.55 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.56 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.57 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.58 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.59 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.60 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.61 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.62 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.63 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.64 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.65 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.66 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.67 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.68 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.69 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.70 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.71 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.72 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.73 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.74 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.75 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.76 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.77 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.78 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.79 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.80 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.81 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.82 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.83 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.84 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.85 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.86 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.87 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.88 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4.89 报告期内基金投资组合的重大关联交易说明

4.4