

农银汇理沪深300指数证券投资基金

2014 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:2014年7月18日

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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预示其未来表现。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2014年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, type, and investment objectives.

3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -47,488,906.52

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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。

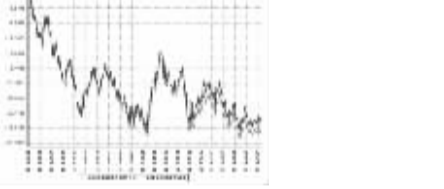
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



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份股的比例不低于股票资产的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%。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name, Position, Tenure, and Description. Lists the fund manager.

4.2 管理人对本报告期内基金遵守法律法规的情况说明

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,恪尽职守,勤勉尽责,安全高效的开展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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,根据指数化投资流程和资产配置,进行了日常运作管理。报告期内,日均跟踪误差为0.0264%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不得超过0.3%以内,在误差限控制未超过4%。

4.4.2 报告期内基金的投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: Item, Amount, and Percentage. Shows asset allocation by category.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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。

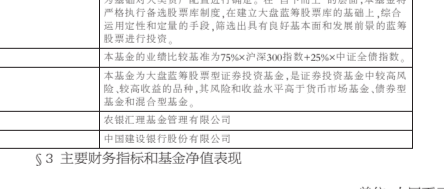
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table comparing fund performance with benchmark over 3 months.

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



5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Amount, and Percentage. Shows industry breakdown of stock holdings.

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益 -16,432,852.17

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the period.

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。