农银汇理沪深300指数证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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：2013年8月27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2013年8月26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2013 年1月1日起至6月30日止。

1.2 基金简介

1.3 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	2,355,290,203.03份
基金合同存续期	不定期

1.4 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，以实现对沪深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。

1.5 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

1.6 信息披露方式

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 主要财务指标和基金净值表现

2.1 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(2013年1月1日 － 2013年6月30日)
本期已实现收益	-57,404,112.18
本期利润	-207,526,677.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0856
本期加权平均净值利润率	-10.83%
本期基金份额净值增长率	-11.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-720,986,054.10
期末可供分配基金份额利润	-0.3061
期末基金资产净值	1,634,304,148.93
期末基金份额净值	0.6939
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-30.61%

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。

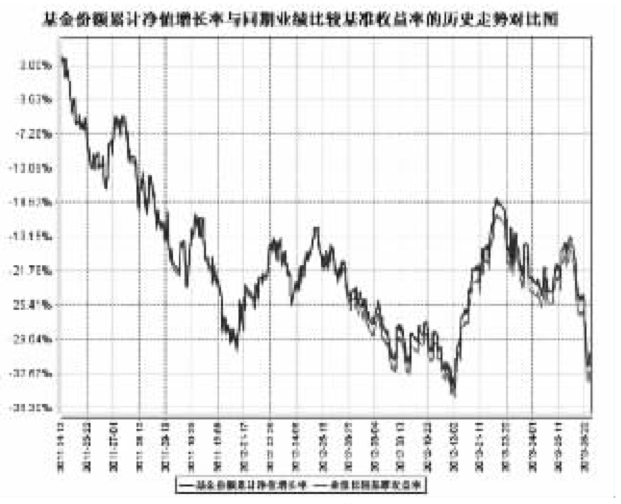
3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的"期末"均指本报告期最后一日，即6月30日。

2.2 基金净值表现

2.2.1 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	-14.11%	1.78%	-14.83%	1.77%	0.72%	0.01%
过去三个月	-10.44%	1.38%	-11.22%	1.38%	0.78%	0.00%
过去六个月	-11.42%	1.43%	-12.12%	1.42%	0.70%	0.01%
过去一年	-8.77%	1.31%	-9.99%	1.30%	1.22%	0.01%
自基金合同生效起至今	-30.61%	1.27%	-32.42%	1.26%	1.81%	0.01%

2.2.2 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



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。

§3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 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2013年6月30日，公司现管理18 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和农银汇理行业领先股票型证券投资基金。

3.1.2 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。

3.2 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，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。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 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。

3.3.2 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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 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0.0388%，日均偏离度为0.025%，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。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长-11.42%，同期业绩比较基准收益率为-12.12%。

3.5 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。

3.6 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。

3.7 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。

§4 托管人报告

4.1 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。

4.2 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。

4.3 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。

§5 半年度财务会计报告（未经审计）

5.1 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：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款		3,185,749.88	21,667,646.30
结算备付金		565,605.84	141,134.82
存出保证金		170,206.90	500,000.00
交易性金融资产		1,627,789,733.57	1,974,638,355.48
其中：股票投资		1,549,250,676.57	1,896,611,155.48
基金投资		-	-
债券投资		78,539,057.00	78,027,200.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,179,647.65	2,957,881.86
应收利息		875,858.78	1,496,506.57
应收股利		4,242,557.54	-
应收申购款		461,132.90	68,748.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,639,470,493.06	2,001,470,273.98
负债和所有者权益		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,423,069.37	-
应付赎回款		1,481,394.30	2,885,724.44
应付管理人报酬		875,357.94	947,017.67
应付托管费		218,839.51	236,754.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		374,305.81	306,062.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		793,377.20	650,558.48
负债合计		5,166,344.13	5,026,117.82
所有者权益：			
实收基金		2,355,290,203.03	2,548,277,675.93
未分配利润		-720,986,054.10	-551,833,519.77
所有者权益合计		1,634,304,148.93	1,996,444,156.16
负债和所有者权益总计		1,639,470,493.06	2,001,470,273.98

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.6939元，基金份额总额2,355,290,203.03份。

5.2 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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-198,871,543.79	131,953,090.51
1.利息收入	1,343,321.45	1,649,687.24
其中：存款利息收入	99,274.21	65,275.75
债券利息收入	1,241,249.30	1,584,411.49
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)	-50,270,639.94	-63,943,015.04
其中：股票投资收益	-71,467,105.87	-87,437,448.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-54,468.16	66,586.53
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	21,250,934.09	23,427,846.67
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-150,122,565.30	193,985,565.77
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	178,340.00	260,852.54
减：二、费用	8,655,133.69	9,690,903.51
1.管理人报酬	5,712,514.99	6,523,627.09
2.托管费	1,428,128.77	1,630,906.80
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,080,689.07	1,054,524.46
5.利息支出	28,129.95	29,865.02
其中：卖出回购金融资产支出	28,129.95	29,865.02
6.其他费用	405,670.91	451,980.14
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-207,526,677.48	122,262,187.00
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-207,526,677.48	122,262,187.00

5.3 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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 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

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：

______许红波______　　______杜明华______　　____于意____
基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

5.4 报表附注

5.4.1 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。

5.4.2 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。

5.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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。

5.4.4 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

本基金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。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 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。

5.4.5.2 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。

5.4.5.3 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。

5.4.6 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。

5.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

5.4.7.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

5.4.7.2 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。

5.4.8 关联方关系

5.4.8.1 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。

5.4.8.2 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
中国工商银行股份有限公司	本基金的托管人
农银汇理基金管理有限公司	本基金的管理人

5.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.9.1 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。

5.4.9.2 关联方报酬

5.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,712,514.99	6,523,627.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,211,097.21	2,590,821.23

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。

5.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,428,128.77	1,630,906.80

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。

5.4.9.3 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。

5.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

5.4.9.4.1 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。

5.4.9.4.2 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。

5.4.9.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	3,185,749.88	93,856.61	16,501,322.99	61,783.27

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。

5.4.9.6 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。

5.4.9.7 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。

5.4.10 利润分配情况

5.4.10.1 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。

5.4.11 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

5.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600436	片仔癀	2013年7月1日	2013年7月11日	配股	37.14	136.82	23,050	3,103,194.59	3,153,701.00	-

5.4.11.2 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
600547	山东黄金	2013年4月3日	公告重大事项	32.13	2013年7月1日	28.77	245,430	12,413,325.51	7,885,665.90	-
601989	中国重工	2013年5月17日	公告重大事项	4.52	-	-	1,483,456	12,814,865.46	6,705,221.12	-
000999	华润三九	2013年6月3日	公告重大事项	29.60	2013年8月19日	26.51	133,258	2,908,735.06	3,944,436.80	-
600598	北大荒	2013年5月27日	公告重大事项	8.35	2013年7月19日	8.35	244,997	3,551,339.51	2,045,724.95	-
601918	国投新集	2013年5月16日	公告重大事项	7.55	2013年8月23日	5.05	185,939	2,842,877.99	1,403,839.45	-

5.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.11.3.1 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。

5.4.11.3.2 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 投资组合报告

6.1 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	1,549,250,676.57	94.50
	其中：股票	1,549,250,676.57	94.50
2	固定收益投资	78,539,057.00	4.79
	其中：债券	78,539,057.00	4.79
	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	3,751,355.72	0.23
6	其他各项资产	7,929,403.77	0.48
7	合计	1,639,470,493.06	100.00

6.2 期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 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	9,132,772.39	0.56
B	采矿业	115,115,821.67	7.04
C	制造业	556,133,992.10	34.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,320,694.16	3.08
E	建筑业	62,377,276.02	3.82
F	批发和零售业	40,477,817.33	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	33,140,010.40	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,373,156.32	1.98
J	金融业	518,868,241.59	31.75
K	房地产业	87,996,246.55	5.38
L	租赁和商务服务业	9,804,165.55	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,252,348.32	0.57
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	4,180,291.53	0.26
S	综合	20,077,842.64	1.23
	合计	1,549,250,676.57	94.80

6.2.2 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。

6.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

6.3.1 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前十名股票投资明细

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	600016	民生银行	7,555,636	64,751,800.52	3.96
2	600036	招商银行	4,791,354	55,579,706.40	3.40
3	601318	中国平安	1,122,157	39,006,177.32	2.39
4	601166	兴业银行	2,559,331	37,801,318.87	2.31
5	600000	浦发银行	4,474,874	37,051,956.72	2.27
6	000002	万 科A	3,250,976	32,022,113.60	1.96
7	601988	中国银行	11,168,052	30,265,420.92	1.85
8	600519	贵州茅台	139,414	26,819,071.18	1.64
9	601328	交通银行	6,320,110	25,722,847.70	1.57
10	600837	海通证券	2,717,566	25,490,769.08	1.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于农银汇理基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

6.3.2 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

6.4 报告期内股票投资组合的重大变动

6.4.1 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	601988	中国银行	18,276,415.20	0.92
2	600036	招商银行	11,934,162.71	0.60
3	601818	光大银行	11,298,322.90	0.57
4	600219	南山铝业	10,275,614.44	0.51
5	600000	浦发银行	10,208,572.00	0.51
6	000001	平安银行	9,977,187.63	0.50
7	601328	交通银行	7,962,765.68	0.40
8	600362	江西铜业	7,885,821.25	0.39
9	600256	广汇能源	7,749,577.89	0.39
10	600332	广州药业	6,103,866.79	0.31
11	002450	康得新	5,168,758.98	0.26
12	000060	中金岭南	5,094,023.56	0.26
13	601991	大唐发电	5,008,050.10	0.25
14	600016	民生银行	4,861,558.00	0.24
15	000562	宏源证券	4,558,188.51	0.23
16	000807	云铝股份	4,181,205.28	0.21
17	601336	新华保险	3,569,632.05	0.18
18	601169	北京银行	3,408,295.28	0.17
19	601166	兴业银行	3,160,511.63	0.16
20	600436	片仔癀	3,103,194.59	0.16

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。

6.4.2 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	27,131,822.94	1.36
2	600036	招商银行	23,885,012.99	1.20
3	600016	民生银行	19,913,881.72	1.00
4	601818	光大银行	17,373,448.83	0.87
5	000001	平安银行	10,671,279.31	0.53
6	600219	南山铝业	9,768,486.29	0.49
7	600256	广汇能源	8,600,723.74	0.43
8	601988	中国银行	8,304,215.06	0.42
9	600362	江西铜业	7,814,631.04	0.39
10	000002	万 科A	7,525,997.22	0.38
11	601318	中国平安	7,289,561.64	0.37
12	601166	兴业银行	7,102,053.14	0.36
13	600000	浦发银行	6,773,394.72	0.34
14	600837	海通证券	4,483,749.24	0.22
15	600030	中信证券	4,436,274.25	0.22
16	000562	宏源证券	4,350,656.64	0.22
17	600887	伊利股份	3,808,279.06	0.19
18	601088	中国神华	3,767,039.10	0.19
19	600519	贵州茅台	3,729,941.79	0.19
20	600028	中国石化	3,500,073.16	0.18

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。

6.4.3 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	268,304,856.16
卖出股票收入(成交)总额	394,438,251.04

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。

6.5 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	8,934,057.00	0.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,605,000.00	4.26
	其中：政策性金融债	69,605,000.00	4.26
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	78,539,057.00	4.81

6.6 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	130218	13国开18	500,000	49,715,000.00	3.04
2	130201	13国开01	200,000	19,890,000.00	1.22
3	010308	03国债(8)	89,430	8,934,057.00	0.55

6.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.8 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。

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

6.10 投资组合报告附注

6.10.1

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。

6.10.2 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	170,206.90
2	应收证券清算款	2,179,647.65
3	应收股利	4,242,557.54
4	应收利息	875,858.78
5	应收申购款	461,132.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,929,403.77

6.10.3 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。

6.10.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

6.10.4.1 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。

6.10.4.2 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。

§7 基金份额持有人信息

7.1 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
74,054	31,805.04	281,045,940.97	11.93%	2,074,244,262.06	88.07%

7.2 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	36,742.99	0.0016%

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。

§8 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	2,548,277,675.93
本报告期基金总申购份额	202,948,307.99
减:本报告期基金总赎回份额	395,935,780.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,355,290,203.03

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。

§9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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

报告期内基金管理人无重大人事变动。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。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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	557,304,774.04	84.23%	506,279.58	84.20%	-
中金公司	2	104,365,180.08	15.77%	95,014.66	15.80%	-

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。

9.7.2 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总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	19,069,277.70	100.00%	33,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

9.8 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	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金销售为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2013年4月23日
2	农银汇理基金管理有限公司关于旗下部分基金增加数米基金销售为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2013年3月29日
3	农银汇理基金管理有限公司旗下基金关于新增民生银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2013年2月5日
4	农银汇理关于旗下基金资产估值方法调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2013年1月30日
5	农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金资产估值方法调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2013年1月4日

农银汇理基金管理有限公司
2013年8月27日