农银汇理沪深 300 指数证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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 2026 年 10 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 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		
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	607,160,182.08 份		
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。		
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		
下属分级基金的基金简称	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 Y
下属分级基金的交易代码	660008	005152	027109
报告期末下属分级基金的份额总额	357,610,262.12 份	248,574,620.90 份	975,299.06 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）		
	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 Y
1.本期已实现收益	6,207,874.10	3,306,546.10	14,983.06
2.本期利润	-74,233,442.83	-41,999,892.02	-161,119.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2162	-0.1908	-0.2006
4.期末基金资产净值	610,895,721.78	411,032,415.89	1,669,030.21
5.期末基金份额净值	1.7083	1.6536	1.7113

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 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

农银沪深 300 指数 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-11.38%	1.21%	-11.88%	1.22%	0.50%	-0.01%
过去六个月	-0.96%	1.21%	-1.92%	1.22%	0.96%	-0.01%
过去一年	-4.53%	1.07%	-5.72%	1.08%	1.19%	-0.01%
过去三年	22.82%	1.09%	17.44%	1.09%	5.38%	0.00%
过去五年	-2.01%	1.06%	-9.57%	1.07%	7.56%	-0.01%
过去七年	29.09%	1.12%	14.22%	1.12%	14.87%	0.00%
过去十年	59.39%	1.10%	33.20%	1.10%	26.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	70.83%	1.28%	31.35%	1.27%	39.48%	0.01%

农银沪深 300 指数 C

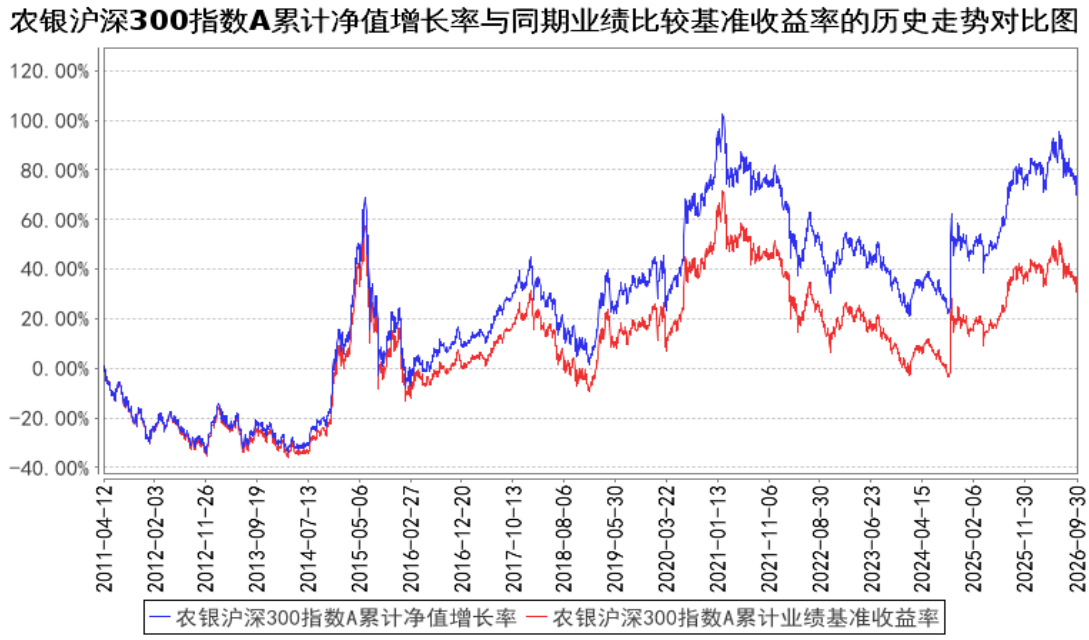
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

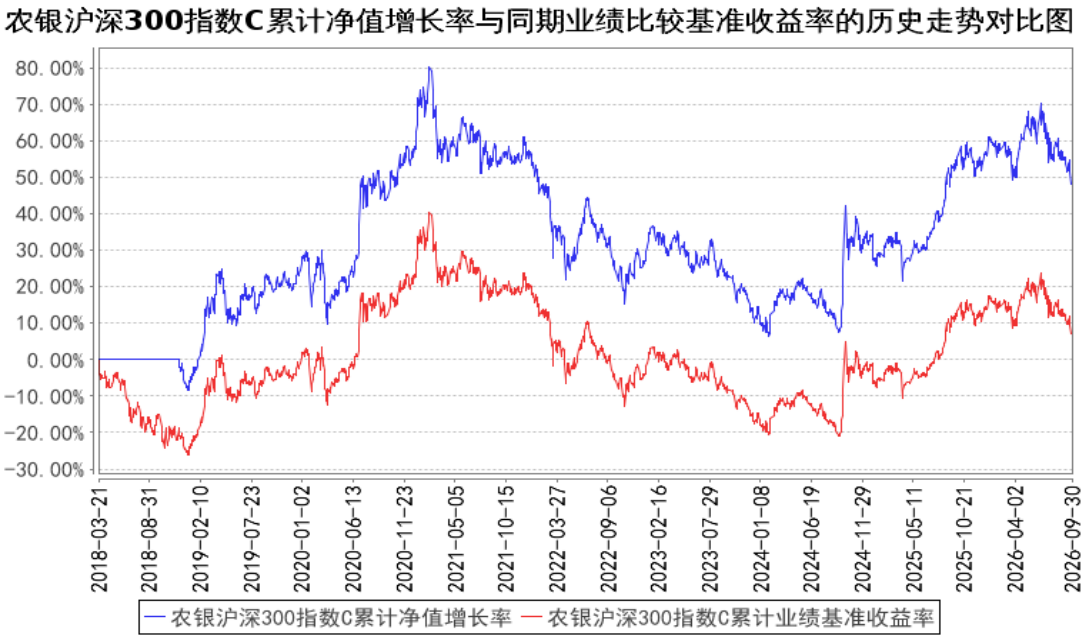
				④		
过去三个月	-11.46%	1.21%	-11.88%	1.22%	0.42%	-0.01%
过去六个月	-1.15%	1.21%	-1.92%	1.22%	0.77%	-0.01%
过去一年	-4.90%	1.07%	-5.72%	1.08%	0.82%	-0.01%
过去三年	21.37%	1.09%	17.44%	1.09%	3.93%	0.00%
过去五年	-3.97%	1.06%	-9.57%	1.07%	5.60%	-0.01%
过去七年	25.48%	1.12%	14.22%	1.12%	11.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	48.66%	1.08%	7.41%	1.16%	41.25%	-0.08%

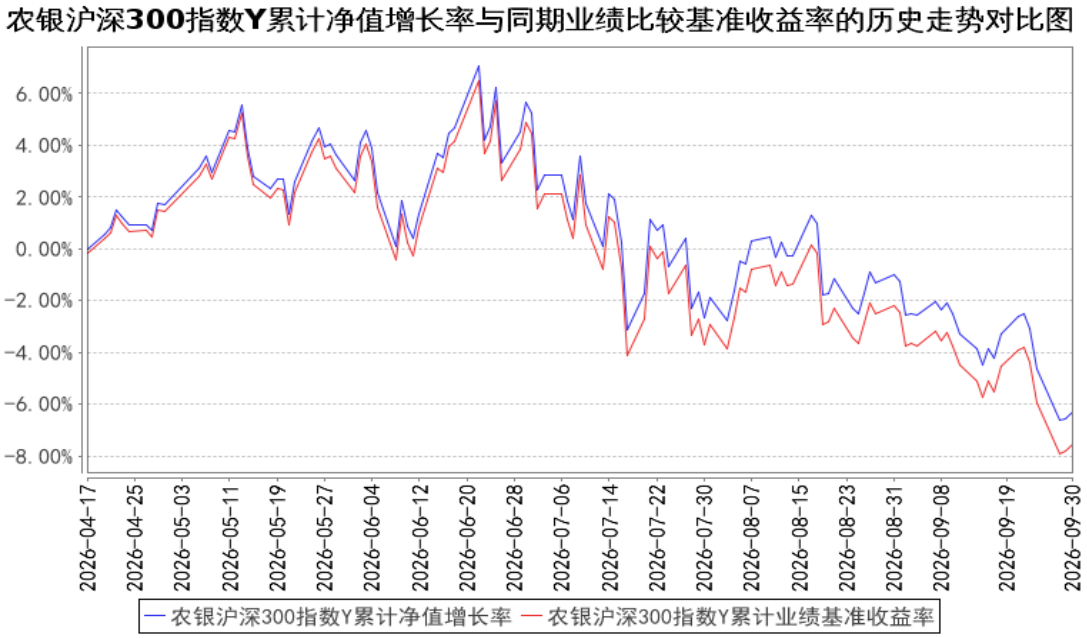
农银沪深 300 指数 Y

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-11.29%	1.21%	-11.88%	1.22%	0.59%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-6.29%	1.19%	-7.57%	1.20%	1.28%	-0.01%

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







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。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋永安	本基金的基金经理	2012 年 8 月 3 日	-	19 年	硕士研究生。历任长信基金管理公司金融工程研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，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，本产品管理人严格执行了《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。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，通过对交易价差做专项分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易的现象。

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 0.0233%，日均偏离度为 0.0149%，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。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末农银沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.7083 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.38%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；截至本报告期末农银沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.6536 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.46%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；截至本报告期末农银沪深 300 指数 Y 基金份额净值为 1.7113 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.29%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	970,556,745.19	93.33
	其中：股票	970,556,745.19	93.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,336,321.92	3.59
	其中：债券	37,336,321.92	3.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,514,397.51	3.03
8	其他资产	536,214.90	0.05
9	合计	1,039,943,679.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	7,705,451.40	0.75

B	采矿业	54,652,629.24	5.34
C	制造业	555,035,722.53	54.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,183,174.02	2.85
E	建筑业	12,645,211.63	1.24
F	批发和零售业	1,660,807.91	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	28,245,465.51	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,089,318.78	4.70
J	金融业	205,591,156.43	20.09
K	房地产业	4,384,197.19	0.43
L	租赁和商务服务业	5,035,633.87	0.49
M	科学研究和技术服务业	16,239,342.96	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,460,052.72	0.14
R	文化、体育和娱乐业	628,581.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	970,556,745.19	94.82

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	43,741	35,361,974.04	3.45
2	600519	贵州茅台	24,551	30,900,379.62	3.02
3	300750	宁德时代	103,715	30,192,473.65	2.95
4	601318	中国平安	418,238	22,287,903.02	2.18
5	300502	新易盛	54,720	21,286,080.00	2.08
6	600036	招商银行	485,573	20,034,741.98	1.96
7	601899	紫金矿业	646,562	19,261,081.98	1.88
8	603259	药明康德	97,044	16,239,342.96	1.59
9	000333	美的集团	190,782	15,281,638.20	1.49

10	600900	长江电力	479,975	13,698,486.50	1.34

5.3.2 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	37,336,321.92	3.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,336,321.92	3.65

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	240,000	24,320,896.44	2.38
2	019846	26 国债 14	130,000	13,015,425.48	1.27

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 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投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监管总局的处罚。

本基金管理人经研究分析认为上述处罚未对该发行人发行的证券的投资价值产生重大的实质性影响。本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金投资的其余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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	254,792.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	281,422.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	536,214.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 Y
报告期期初基金份额总额	329,453,930.36	170,716,152.52	537,247.79
报告期期间基金总申购份额	64,877,846.18	191,588,642.68	495,135.87
减:报告期期间基金总赎回份额	36,721,514.42	113,730,174.30	57,084.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	357,610,262.12	248,574,620.90	975,299.06

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	农银沪深 300 指数 A	农银沪深 300 指数 C	农银沪深 300 指数 Y
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,795,886.40	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,795,886.40	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.02	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末，基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址免费查阅备查文件。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

2026 年 10 月 26 日