

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
2012 年年度报告
2012 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 20 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。

本报告期自 2012 年 6 月 25 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6	审计报告	16
6.1	管理层对财务报表的责任	17
6.2	注册会计师的责任	17
6.3	审计意见	17
§7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	21
§8	投资组合报告	44
8.1	期末基金资产组合情况	44
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	44
8.2.1	指数投资期末按行业分类的股票投资组合	44
8.2.2	积极投资期末按行业分类的股票投资组合	45
8.3	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	45
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
8.6	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	55

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	55
8.8	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	55
8.9	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2	期末上市基金前十名持有人	57
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
§10	开放式基金份额变动	59
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
11.2	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	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8	其他重大事件	66
§12	影响投资者决策的其他重要信息	68
§13	备查文件目录	69
13.1	备查文件目录	69
13.2	存放地点	69
13.3	查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	华安沪深 300 指数分级		
基金主代码	160417		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 25 日		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	124,614,553.20 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳		
上市日期	2012 年 7 月 23 日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深 300 指数分级 A	华安沪深 300 指数分级 B	华安沪深 300 指数分级
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	36,955,620.00	36,955,620.00	50,703,313.20

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，

(160417)	其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
风 险 收 益 特 征 (150104)	华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。
风 险 收 益 特 征 (150105)	华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		李勃	王洪章

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-11,168,539.83
本期利润	-4,047,556.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0138
本期加权平均净值利润率	-1.41%
本期基金份额净值增长率	4.9%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末可供分配利润	-7,617,400.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0611
期末基金资产净值	130,702,914.70
期末基金份额净值	1.049
3.1.3 累计期末指标	2012 年末
基金份额累计净值增长率	4.90%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于 2012 年 6 月 25 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

5、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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

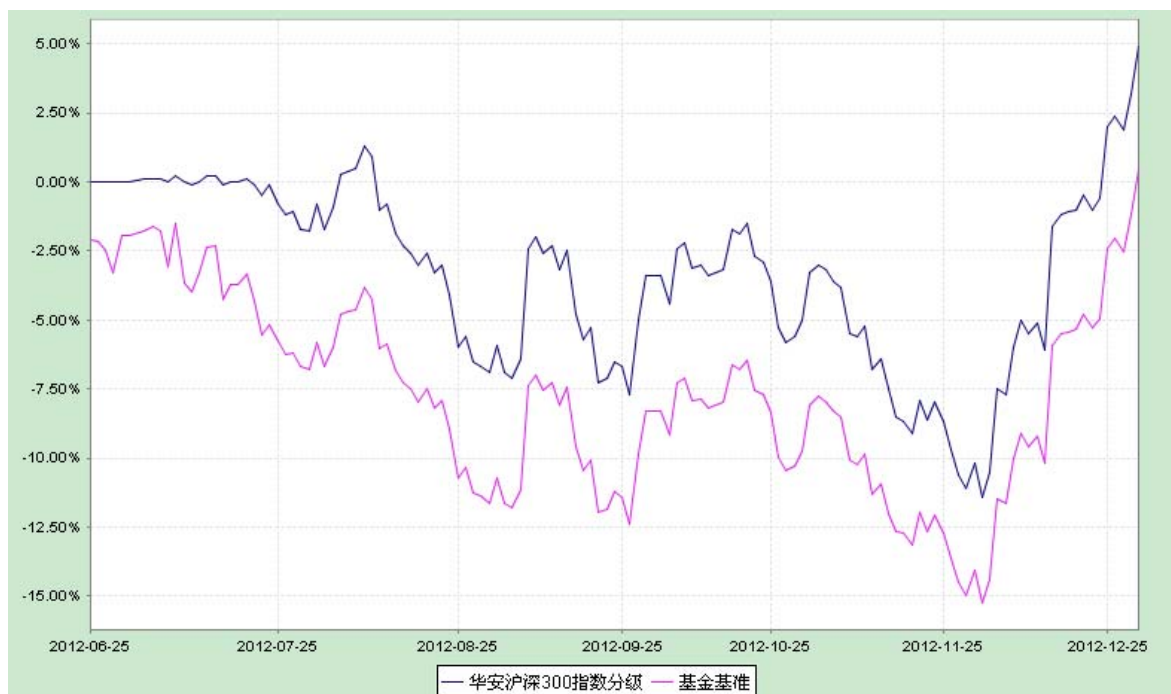
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个 月	8.59%	1.22%	9.53%	1.22%	-0.94%	0.00%
过去六个 月	4.90%	1.11%	2.38%	1.18%	2.52%	-0.07%
自基金合 同生效起 至今	4.90%	1.09%	0.42%	1.17%	4.48%	-0.08%

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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 6 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日)



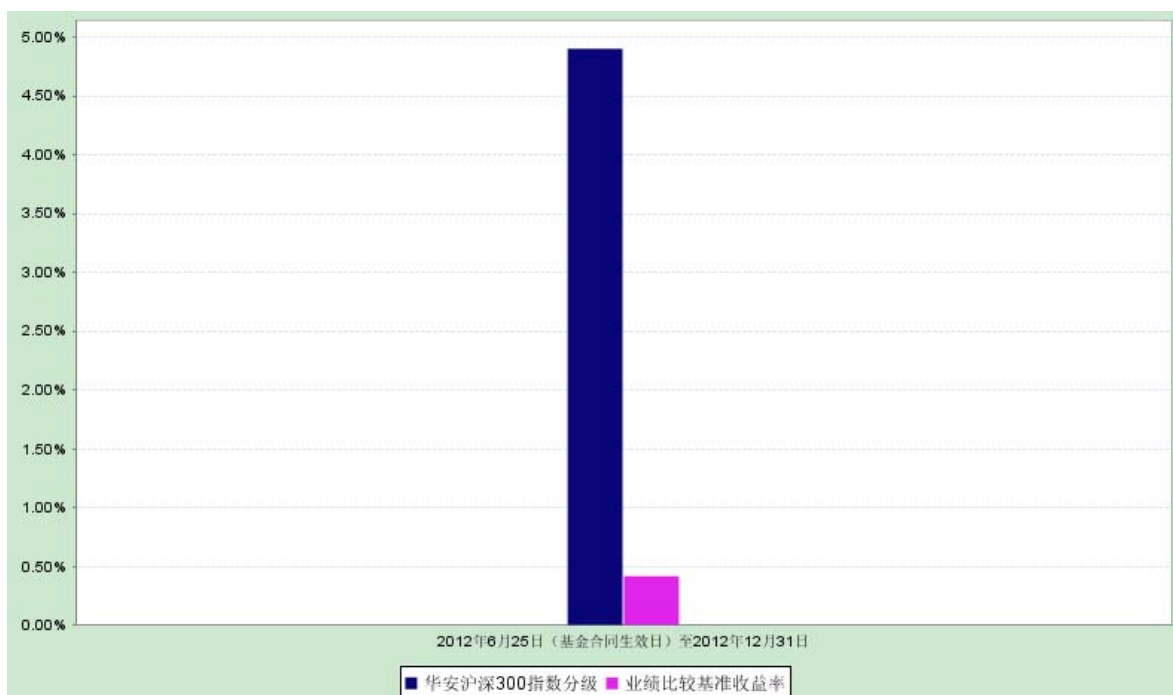
注：1) 本基金于 2012 年 6 月 25 日成立，截止本报告期末，本基金成立未满一年。

2) 根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应

当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十六部分“基金的投资”中投资范围、投资限制等有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 25 日，合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同，本基金不进行收益分配。

§ 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2012 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券等 34 只开放式基金。管理资产规模达到 955.90 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
牛勇	本基金的基金经理	2012-06-25	-	8 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），8 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 6 月至 2012 年 12 月担任上证 180 交易型开放式

					指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2012 年 6 月起同时担任本基金的基金经理。
张昊	本基金的基金经理	2012-06-25	-	5 年	密歇根大学金融工程专业硕士，5 年证券金融从业经历，曾在 Treflelet Delta 基金担任量化风控分析师。2009 年 6 月加入华安基金管理有限公司，任风险管理与金融工程部高级金融工程师。现任指数投资部基金经理。2012 年 6 月起担任本基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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有关法律法规及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳

入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监

察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

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

本基金于 2012 年 6 月 25 日成立，并于 2012 年 7 月 23 日开放申购赎回，本基金子份额于同日在深圳证券交易所挂牌交易。基于对市场下跌风险的判断，本基金在封闭期内保持了低仓位运作，并取得了一定的超额收益。自开放申购赎回及上市交易后，本基金在短时间内结束建仓，并以完全复制标的指数的方法紧密跟踪标的指数走势，严格控制跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.049 元。本报告期内，华安沪深 300 指数分级份额净值增长率为 4.90%，同期业绩比较基准增长率为 0.42%，基金净值表现领先比较基准 4.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年，国内经济潜在增速下移，GDP 连续三个季度下滑，经济结构的转型变革已经切实发生。投资者对经济、政策、企业盈利预期的不断摇摆，使得 A 股市场在 2012 年前三季度总体呈现出震荡下跌的局面。然而，伴随着十八大的顺利召开，领导层顺利交接，并确立了惠及民生的各项改革、新型城镇化建设等利民政策措施，政策导向逐渐清晰，市场也在年末强周期权重板块的带动下取得了较大幅度的快速上

涨。

自第三季度以来，规模以上工业增加值、PPI、PMI 指数都已企稳向上，主要经济指标均显示出国内经济进入稳步复苏阶段。2013 年，国内经济有望在新的均衡点之上呈现出相对高增长和相对低通胀的有利局面；而企业的毛利率、收入增速和盈利增速随着本轮去库存的结束，也将在 2013 年出现回升。

从市场表现来看，管理层提出的改革方案是最大的政策红利，有助于刺激投资者中长期信心的恢复。十八大报告中明确提出了“新四化”的概念，即新型工业化、信息化、城镇化、农业现代化；尤其是新型城镇化作为我国应对“中等收入陷阱”的重要发展战略，已成为“未来几十年中国最大的发展潜力”。2013 年两会以后，各项政策措施的细节将会进一步明朗并逐渐落实，与之相关的公共服务、社会保障、建筑建材及部分消费行业有望存在较大机会。

在操作上，本基金仍将坚持被动投资的原则，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司从维护基金份额持有人利益，保障基金合规运作出发，强化公司制度流程的落实，合规监察稽核部对公司产品开发、基金投资、基金销售、后台运行、员工行为的合规性进行定期和不定期检查，根据相关法规的变化和业务发展的需要，深化员工的合规意识，推动公司内部风险控制机制的完善与优化。监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

（1）继续深化“主动合规”的管理理念，坚守“三条底线”，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密等方面的合规培训和检查，保持公司良好的内控环境和合规文化。

（2）进一步提高在新基金产品开发、新投资品种、新业务推进中法律、合规及风险控制方面的支持力度，加强了对新产品的风险评估。

（3）坚持做好投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司首席投资官。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任投资研究部总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理,指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

（2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 21433 号
华安沪深 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“华安沪深 300 分级基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安沪深 300 分级基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

6.3 审计意见

我们认为，上述华安沪深 300 分级基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华安沪深 300 分级基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册会计师 汪 棣 庄 贤

上海市湖滨路 202

号普华永道中心 11 楼

2013-03-22

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	9,783,170.19
结算备付金		8,681.80
存出保证金		100,039.00
交易性金融资产	7.4.7.2	124,070,568.15
其中：股票投资		124,070,568.15
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,489,702.23
应收利息	7.4.7.5	1,574.32
应收股利		-
应收申购款		49,407.11
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

资产总计		135,503,142.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		129,465.59
应付赎回款		4,085,244.34
应付管理人报酬		110,588.95
应付托管费		24,329.55
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	119,203.05
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	331,396.62
负债合计		4,800,228.10
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	124,614,553.20
未分配利润	7.4.7.10	6,088,361.50
所有者权益合计		130,702,914.70
负债和所有者权益总计		135,503,142.80

注：1. 报告截止日 2012 年 12 月 31 日，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额净值 1.049 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值 1.036 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值 1.062 元；基金份额总额 124,614,553.20 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 50,703,313.20 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额 36,955,620.00 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额 36,955,620.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日，无上年度可比数据。

7.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012 年12月31日
一、收入		-528,579.92
1.利息收入		1,342,771.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	185,783.63
债券利息收入		761.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,156,226.43
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,606,519.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,677,509.59
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	8,335.00
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	1,062,655.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,120,983.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	614,184.30
减：二、费用		3,518,976.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,439,401.76
2. 托管费	7.4.10.2.2	316,668.33
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,330,805.42
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	432,101.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,047,556.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”		-4,047,556.71

号填列		
-----	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31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）	607,313,857.99	-	607,313,857.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,047,556.71	-4,047,556.71
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）	-482,699,304.79	10,135,918.21	-472,563,386.58
其中：1.基金申购款	18,754,497.23	-862,751.47	17,891,745.76
2.基金赎回款	-501,453,802.02	10,998,669.68	-490,455,132.34
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）	124,614,553.20	6,088,361.50	130,702,914.70

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：
陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 指数分级证券投资基金(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 [2012]第 278 号《关于核准华安沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由华安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《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金

利息共募集人民币 607,221,793.60 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(2012)第 201 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 607,313,857.99 份，其中认购资金利息折合 92,064.39 份，场外认购的全部份额确认为华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华安沪深 300 份额”)212,734,025.99 份，场内认购部分按照基金合同约定的 1:1 比例份额确认为华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“华安沪深 300A 份额”)197,289,916.00 份和华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“华安沪深 300B 份额”)197,289,916.00 份。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间的份额配对转换业务，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算并对折算后的华安沪深 300 份额的场内份额按照 1:1 的比例拆分为预期收益与风险不同的两个份额类别，即低风险且预期收益相对稳定的基金份额(即“华安沪深 300A 份额”)和高风险且预期收益相对较高的基金份额(即“华安沪深 300B 份额”)，两类基金份额的基金资产合并运作。本基金 1 份华安沪深 300A 份额与 1 份华安沪深 300B 份额构成一对份额组合，一对华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的份额组合的份额参考净值之和将等于 2 份华安沪深 300 份额的净值。华安沪深 300A 份额的约定收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3.5%”。华安沪深 300B 份额的份额参考净值根据华安沪深 300 份额的份额净值、华安沪深 300A 份额的份额参考净值以及华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额净值关系计算。每个会计年度的第一个工作日，在满足一定条件的情况下，本基金的基金管理人将根据基金合同约定，对华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算，华安沪深 300 份额持有人持有的每 2 份华安沪深 300 份额将获得按照 1 份华安沪深 300A 份额分配的新增华安沪深 300 份额；当华安 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元或华

安 300B 份额的参考净值小于或等于 0.300 元，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的比例为 1:1，份额折算后华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。具体基金份额折算政策请参见本基金合同的相关章节。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 235 号文审核同意，本基金 394,579,832.00 份基金份额于 2012 年 7 月 23 日在深圳证券交易所挂牌交易(其中华安沪深 300A 份额为 197,289,916.00 份，华安沪深 300B 份额为 197,289,916.00 份)。华安沪深 300 份额开放场内和场外申购、赎回，上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额上市交易但不可单独申购、赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2013 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日 。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的

合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1)

具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金(包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额)在存续期内不进行收益分配。经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配规则。具体的收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。
- (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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	9,783,170.19
定期存款	-
其他存款	-
合计	9,783,170.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	116,949,585.03	124,070,568.15	7,120,983.12

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		116,949,585.03	124,070,568.15	7,120,983.12

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应收活期存款利息	1,570.42
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	3.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,574.32

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	119,203.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	119,203.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,396.62
应付后端申购费	-
债券利息税	-
应付指数使用费	50,000.00
预提信息披露费	210,000.00
预提审计费用	56,000.00
合计	331,396.62

7.4.7.9 实收基金

华安沪深 300 指数分级

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	607,313,857.99	607,313,857.99
本期申购	18,754,497.23	18,754,497.23
本期赎回（以“-”号填列）	-501,453,802.02	-501,453,802.02
本期末	124,614,553.20	124,614,553.20

1. 本基金自 2012 年 6 月 1 日至 2012 年 6 月 18 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 607,221,793.60 元。根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 92,064.39 元(其中场内募集资金产生利息 33,832.00 元，场外募集资金产生利息 58,232.39 元)，在本基金成立后，折算为 92,064.39 份基金份额(其中华安沪深 300 份额 58,232.39 份，华安沪深 300A 份额 16,916.00 份，华安沪深 300B 份额 16,916.00 份)，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2012 年 6 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 7 月 22 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回交易自 2012 年 7 月 23 日起开始办理。

3. 截至 2012 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 73,911,240.00 份(其中华安沪深 300A 份额 36,955,620.00 份，华安沪深 300B 份额 36,955,620.00 份)，托管在场内未上市交易的基金份额为 1,504,021.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 49,199,292.20 份，均为华安沪深 300 份额。场内的

华安沪深 300 份额登记在证券登记结算系统，场外的华安沪深 300 份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-11,168,539.83	7,120,983.12	-4,047,556.71
本期基金份额交易产生的变动数	3,551,139.40	6,584,778.81	10,135,918.21
其中：基金申购款	-238,822.91	-623,928.56	-862,751.47
基金赎回款	3,789,962.31	7,208,707.37	10,998,669.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,617,400.43	13,705,761.93	6,088,361.50

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
活期存款利息收入	168,737.07
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	17,044.58
其他	1.98
合计	185,783.63

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
卖出股票成交总额	390,124,060.88
减：卖出股票成本总额	400,801,570.47
买卖股票差价收入	-10,677,509.59

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑	198,096.90

付) 成交总额	
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成本总额	189,000.00
减: 应收利息总额	761.90
债券投资收益	8,335.00

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2012年6月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,062,655.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,062,655.29

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2012年6月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
1.交易性金融资产	7,120,983.12
——股票投资	7,120,983.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	7,120,983.12

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2012年6月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日
基金赎回费收入	613,070.51
募集期间认购资金产生的利息收入	1,113.79
合计	614,184.30

注: 本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%, 场外赎回费率按持有期间递减, 赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
交易所市场交易费用	1,330,805.42
银行间市场交易费用	-
合计	1,330,805.42

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
审计费用	56,000.00
信息披露费	210,000.00
其他	900.00
银行汇划费用	3,541.82
指数使用费	101,659.46
上市年费	60,000.00
合计	432,101.28

注：根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人 与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

$$\text{日指数许可使用费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.02\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(以下简称“通知”), 要求个人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。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

2. 根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定以及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金以 2013 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对在该日登记在册的华安沪深 300A 份额办理定期份额折算业务。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管	1,439,401.76

理费	
其中：支付销售机构的客户维护费	124,670.95

注：支付基金管理人 华安基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月25日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	316,668.33

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 2012 年 6 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	9,783,170.19	168,737.07
合计	9,783,170.19	168,737.07

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行 保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 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
600100	同方股份	2012-12-27	重大事项 停牌	7.48	2013-01-10	7.90	40,145	320,809.65	300,284.60	-
000002	万科 A	2012-12-26	重大事项 停牌	10.12	2013-01-21	11.13	246,371	2,278,502.02	2,493,274.52	-
000527	美的电器	2012-08-27	重大事项 停牌	9.18	-	-	105,129	1,047,810.15	965,084.22	-
601618	中国中冶	2012-12-28	重大事项 停牌	2.26	2013-01-04	2.33	122,990	286,335.62	277,957.40	

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指

标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持所有证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2012 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	9,783,170.19	-	-	-	9,783,170.19
结算备付金	8,681.80	-	-	-	8,681.80
存出保证金	-	-	-	100,039.00	100,039.00
交易性金融资产	-	-	-	124,070,568.15	124,070,568.15
应收证券清算款	-	-	-	1,489,702.23	1,489,702.23
应收利息	-	-	-	1,574.32	1,574.32
应收申购款	-	-	-	49,407.11	49,407.11
资产总计	9,791,851.99	-	-	125,711,290.81	135,503,142.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	129,465.59	129,465.59
应付赎回款	-	-	-	4,085,244.34	4,085,244.34
应付管理人报酬	-	-	-	110,588.95	110,588.95
应付托管费	-	-	-	24,329.55	24,329.55
应付交易费用	-	-	-	119,203.05	119,203.05
其他负债	-	-	-	331,396.62	331,396.62
负债总计	-	-	-	4,800,228.10	4,800,228.10
利率敏感度缺口	9,791,851.99	-	-	120,911,062.71	130,702,914.70

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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

所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，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，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	124,070,568.15	94.93
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	124,070,568.15	94.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 120,033,967.41 元，属于第二层级的余额为 4,036,600.74 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	124,070,568.15	91.56
	其中：股票	124,070,568.15	91.56
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	9,791,851.99	7.23
6	其他各项资产	1,640,722.66	1.21
7	合计	135,503,142.80	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	732,500.73	0.56
B	采掘业	12,410,658.54	9.50
C	制造业	41,106,567.66	31.45
C0	食品、饮料	7,812,000.93	5.98
C1	纺织、服装、皮毛	306,509.16	0.23
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,422,167.51	1.85
C5	电子	2,764,805.17	2.12
C6	金属、非金属	9,199,730.95	7.04

C7	机械、设备、仪表	12,932,895.52	9.89
C8	医药、生物制品	5,629,447.47	4.31
C99	其他制造业	39,010.95	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,176,703.97	2.43
E	建筑业	4,518,730.12	3.46
F	交通运输、仓储业	3,023,600.51	2.31
G	信息技术业	2,891,236.79	2.21
H	批发和零售贸易	2,833,601.08	2.17
I	金融、保险业	42,179,223.20	32.27
J	房地产业	7,765,228.72	5.94
K	社会服务业	1,231,763.26	0.94
L	传播与文化产业	560,138.24	0.43
M	综合类	1,640,615.33	1.26
	合计	124,070,568.15	94.93

8.2.2 积极投资期末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股票。

8.3 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

8.3.1 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	600016	民生银行	571,131	4,489,089.66	3.43
2	600036	招商银行	312,683	4,299,391.25	3.29
3	601318	中国平安	81,294	3,681,805.26	2.82
4	601166	兴业银行	190,915	3,186,371.35	2.44
5	601328	交通银行	595,478	2,941,661.32	2.25
6	600000	浦发银行	282,993	2,807,290.56	2.15
7	000002	万科A	246,371	2,493,274.52	1.91
8	600030	中信证券	167,101	2,232,469.36	1.71
9	600519	贵州茅台	10,076	2,106,085.52	1.61
10	601088	中国神华	80,025	2,028,633.75	1.55
11	600837	海通证券	196,342	2,012,505.50	1.54
12	601288	农业银行	637,980	1,786,344.00	1.37
13	601601	中国太保	76,268	1,716,030.00	1.31
14	601398	工商银行	391,067	1,622,928.05	1.24
15	601668	中国建筑	363,949	1,419,401.10	1.09

16	600048	保利地产	103,915	1,413,244.00	1.08
17	600111	包钢稀土	35,260	1,320,487.00	1.01
18	000651	格力电器	51,086	1,302,693.00	1.00
19	000858	五 粮 液	46,051	1,300,019.73	0.99
20	601169	北京银行	133,508	1,241,624.40	0.95
21	000001	平安银行	64,772	1,037,647.44	0.79
22	000157	中联重科	106,592	981,712.32	0.75
23	601006	大秦铁路	144,287	975,380.12	0.75
24	000527	美的电器	105,129	965,084.22	0.74
25	600104	上汽集团	53,503	943,792.92	0.72
26	601818	光大银行	306,720	935,496.00	0.72
27	600015	华夏银行	86,598	896,289.30	0.69
28	600585	海螺水泥	48,523	895,249.35	0.68
29	600887	伊利股份	38,788	852,560.24	0.65
30	600256	广汇能源	51,016	836,152.24	0.64
31	600900	长江电力	120,103	825,107.61	0.63
32	600031	三一重工	73,699	780,472.41	0.60
33	601628	中国人寿	36,395	778,853.00	0.60
34	601857	中国石油	84,641	765,154.64	0.59
35	600383	金地集团	108,493	761,620.86	0.58
36	601899	紫金矿业	191,726	734,310.58	0.56
37	002304	洋河股份	7,861	733,981.57	0.56
38	600050	中国联通	205,720	720,020.00	0.55
39	002024	苏宁电器	107,482	714,755.30	0.55
40	600028	中国石化	102,941	712,351.72	0.55
41	000776	广发证券	43,086	664,386.12	0.51
42	000069	华侨城 A	88,215	661,612.50	0.51
43	600547	山东黄金	17,264	658,794.24	0.50
44	600019	宝钢股份	124,631	609,445.59	0.47
45	000568	泸州老窖	16,963	600,490.20	0.46
46	600999	招商证券	56,547	596,570.85	0.46
47	600489	中金黄金	35,706	593,790.78	0.45
48	000538	云南白药	8,423	572,764.00	0.44
49	000338	潍柴动力	22,034	557,680.54	0.43
50	600011	华能国际	76,429	545,703.06	0.42
51	000983	西山煤电	38,229	531,765.39	0.41
52	600690	青岛海尔	39,090	523,806.00	0.40
53	000423	东阿阿胶	12,695	513,004.95	0.39
54	601989	中国重工	106,766	509,273.82	0.39
55	000024	招商地产	16,717	499,671.13	0.38
56	601988	中国银行	170,420	497,626.40	0.38

57	600739	辽宁成大	33,112	496,348.88	0.38
58	600795	国电电力	186,765	491,191.95	0.38
59	600518	康美药业	37,344	490,700.16	0.38
60	601699	潞安环能	22,333	488,869.37	0.37
61	601009	南京银行	52,549	483,450.80	0.37
62	600362	江西铜业	20,141	480,564.26	0.37
63	000725	京东方 A	206,918	469,703.86	0.36
64	601788	光大证券	33,173	467,739.30	0.36
65	000063	中兴通讯	47,734	465,406.50	0.36
66	000895	双汇发展	8,009	463,721.10	0.35
67	601377	兴业证券	37,365	458,842.20	0.35
68	601299	中国北车	100,159	451,717.09	0.35
69	600276	恒瑞医药	15,002	451,560.20	0.35
70	000100	TCL 集团	205,661	450,397.59	0.34
71	601186	中国铁建	74,691	438,436.17	0.34
72	000629	攀钢钒钛	104,208	429,336.96	0.33
73	601766	中国南车	85,739	425,265.44	0.33
74	600348	阳泉煤业	29,177	423,941.81	0.32
75	600535	天士力	7,518	415,519.86	0.32
76	000792	盐湖股份	15,436	413,684.80	0.32
77	600089	特变电工	63,947	413,097.62	0.32
78	600309	烟台万华	26,233	409,497.13	0.31
79	601688	华泰证券	40,762	399,467.60	0.31
80	000402	金 融 街	58,757	396,609.75	0.30
81	601117	中国化学	47,876	394,498.24	0.30
82	600315	上海家化	7,615	388,288.85	0.30
83	000783	长江证券	40,274	378,575.60	0.29
84	601390	中国中铁	124,416	378,224.64	0.29
85	600406	国电南瑞	22,937	367,680.11	0.28
86	601111	中国国航	60,629	363,774.00	0.28
87	601168	西部矿业	46,256	362,647.04	0.28
88	601600	中国铝业	69,736	357,745.68	0.27
89	601669	中国水电	93,171	355,913.22	0.27
90	601898	中煤能源	44,411	347,294.02	0.27
91	000425	徐工机械	30,030	346,245.90	0.26
92	600123	兰花科创	16,631	337,442.99	0.26
93	600010	包钢股份	62,343	336,652.20	0.26
94	000970	中科三环	10,300	335,677.00	0.26
95	600029	南方航空	85,196	333,116.36	0.25
96	002081	金 螳 螂	7,545	332,130.90	0.25
97	002422	科伦药业	5,823	326,204.46	0.25

98	000630	铜陵有色	17,246	325,949.40	0.25
99	000060	中金岭南	35,038	317,093.90	0.24
100	002236	大华股份	6,800	315,180.00	0.24
101	002142	宁波银行	29,167	310,920.22	0.24
102	600150	中国船舶	13,375	310,835.00	0.24
103	002241	歌尔声学	8,230	310,271.00	0.24
104	000581	威孚高科	9,600	306,240.00	0.23
105	600642	申能股份	68,841	304,277.22	0.23
106	000625	长安汽车	45,626	303,412.90	0.23
107	002415	海康威视	9,747	303,229.17	0.23
108	600066	宇通客车	11,979	301,870.80	0.23
109	600100	同方股份	40,145	300,284.60	0.23
110	601998	中信银行	69,595	298,562.55	0.23
111	600660	福耀玻璃	34,019	298,346.63	0.23
112	000623	吉林敖东	17,362	295,154.00	0.23
113	600009	上海机场	23,377	291,277.42	0.22
114	600196	复星医药	27,724	290,824.76	0.22
115	600085	同仁堂	15,796	281,484.72	0.22
116	600741	华域汽车	25,071	280,293.78	0.21
117	600600	青岛啤酒	8,443	279,125.58	0.21
118	600068	葛洲坝	50,770	278,727.30	0.21
119	601618	中国中冶	122,990	277,957.40	0.21
120	600583	海油工程	47,185	276,975.95	0.21
121	000709	河北钢铁	103,057	276,192.76	0.21
122	601958	金钼股份	23,486	275,021.06	0.21
123	000562	宏源证券	14,458	272,533.30	0.21
124	600005	武钢股份	97,963	271,357.51	0.21
125	000768	中航飞机	32,195	267,862.40	0.20
126	000728	国元证券	23,828	265,443.92	0.20
127	000012	南玻 A	31,852	262,779.00	0.20
128	600809	山西汾酒	6,302	262,541.32	0.20
129	600188	兖州煤业	14,364	261,855.72	0.20
130	002155	辰州矿业	13,016	261,361.28	0.20
131	000878	云南铜业	17,183	259,978.79	0.20
132	601607	上海医药	23,329	259,185.19	0.20
133	600549	厦门钨业	6,619	258,008.62	0.20
134	600177	雅戈尔	32,415	256,078.50	0.20
135	600369	西南证券	28,176	251,611.68	0.19
136	600694	大商股份	7,127	251,369.29	0.19
137	601666	平煤股份	28,645	244,628.30	0.19
138	600340	华夏幸福	8,600	242,778.00	0.19

139	000039	中集集团	20,923	241,242.19	0.18
140	600143	金发科技	44,743	241,164.77	0.18
141	600703	三安光电	17,518	239,646.24	0.18
142	601018	宁波港	93,171	239,449.47	0.18
143	600376	首开股份	18,133	237,904.96	0.18
144	601808	中海油服	14,366	235,602.40	0.18
145	000009	中国宝安	26,465	232,892.00	0.18
146	000937	冀中能源	16,835	232,828.05	0.18
147	601633	长城汽车	9,750	231,075.00	0.18
148	600881	亚泰集团	45,972	230,779.44	0.18
149	600166	福田汽车	34,086	229,398.78	0.18
150	600153	建发股份	32,577	229,016.31	0.18
151	000758	中色股份	11,161	227,684.40	0.17
152	600108	亚盛集团	33,067	225,847.61	0.17
153	000999	华润三九	9,501	225,173.70	0.17
154	600497	驰宏锌锗	15,894	224,900.10	0.17
155	600875	东方电气	16,148	224,295.72	0.17
156	002038	双鹭药业	5,542	219,241.52	0.17
157	600415	小商品城	33,018	219,239.52	0.17
158	000960	锡业股份	10,998	218,640.24	0.17
159	600832	东方明珠	38,655	214,921.80	0.16
160	600637	百视通	13,500	214,245.00	0.16
161	002353	杰瑞股份	4,457	212,331.48	0.16
162	002385	大北农	9,725	210,060.00	0.16
163	601717	郑煤机	20,059	207,008.88	0.16
164	600395	盘江股份	12,047	205,039.94	0.16
165	002202	金风科技	37,273	200,901.47	0.15
166	600655	豫园商城	27,899	200,314.82	0.15
167	601333	广深铁路	68,571	200,227.32	0.15
168	600674	川投能源	23,932	200,071.52	0.15
169	000825	太钢不锈	55,284	199,575.24	0.15
170	600271	航天信息	13,443	199,225.26	0.15
171	600115	东方航空	56,647	198,830.97	0.15
172	600649	城投控股	36,244	198,254.68	0.15
173	600886	国投电力	34,100	196,416.00	0.15
174	600208	新湖中宝	45,558	196,354.98	0.15
175	601901	方正证券	44,402	195,812.82	0.15
176	000422	湖北宜化	17,428	193,625.08	0.15
177	600804	鹏博士	32,477	193,562.92	0.15
178	600252	中恒集团	21,191	193,473.83	0.15
179	600219	南山铝业	28,157	192,030.74	0.15

180	000528	柳 工	19,111	191,301.11	0.15
181	002146	荣盛发展	13,625	190,613.75	0.15
182	600062	华润双鹤	8,323	188,932.10	0.14
183	600839	四川长虹	89,604	184,584.24	0.14
184	601992	金隅股份	22,669	183,618.90	0.14
185	002310	东方园林	2,925	183,368.25	0.14
186	600267	海正药业	12,224	182,015.36	0.14
187	000401	冀东水泥	13,078	180,476.40	0.14
188	000046	泛海建设	33,173	179,134.20	0.14
189	601106	中国一重	63,453	178,937.46	0.14
190	600058	五矿发展	10,403	178,619.51	0.14
191	600259	广晟有色	3,026	176,960.48	0.14
192	600811	东方集团	32,354	175,682.22	0.13
193	601888	中国国旅	6,406	175,652.52	0.13
194	000898	鞍钢股份	44,759	173,664.92	0.13
195	000933	神火股份	23,056	173,611.68	0.13
196	000729	燕京啤酒	30,603	172,600.92	0.13
197	600027	华电国际	43,200	170,208.00	0.13
198	600109	国金证券	9,420	168,052.80	0.13
199	600893	航空动力	13,218	166,943.34	0.13
200	002001	新 和 成	8,807	165,571.60	0.13
201	000800	一汽轿车	19,744	164,270.08	0.13
202	002375	亚厦股份	6,200	164,176.00	0.13
203	601118	海南橡胶	28,615	162,533.20	0.12
204	600157	永泰能源	17,200	161,852.00	0.12
205	600779	水井坊	8,298	160,732.26	0.12
206	600266	北京城建	10,787	160,618.43	0.12
207	600827	友谊股份	18,716	160,583.28	0.12
208	600718	东软集团	20,850	160,336.50	0.12
209	002092	中泰化学	22,406	159,530.72	0.12
210	600125	铁龙物流	22,173	159,423.87	0.12
211	000876	新 希 望	12,648	157,973.52	0.12
212	000718	苏宁环球	19,830	157,251.90	0.12
213	600971	恒源煤电	12,132	156,260.16	0.12
214	002106	莱宝高科	10,197	156,116.07	0.12
215	000750	国海证券	13,000	155,870.00	0.12
216	000869	张 裕 A	3,301	155,147.00	0.12
217	601101	昊华能源	11,646	155,124.72	0.12
218	600997	开滦股份	14,978	153,075.16	0.12
219	000061	农 产 品	26,851	153,050.70	0.12
220	600352	浙江龙盛	24,940	151,385.80	0.12

221	000778	新兴铸管	23,255	150,227.30	0.11
222	601001	大同煤业	16,244	150,094.56	0.11
223	600169	太原重工	41,169	149,443.47	0.11
224	601179	中国西电	42,286	147,155.28	0.11
225	002007	华兰生物	6,990	147,069.60	0.11
226	600664	哈药股份	23,262	143,759.16	0.11
227	600316	洪都航空	10,440	143,236.80	0.11
228	601933	永辉超市	5,590	140,923.90	0.11
229	600863	内蒙华电	18,789	140,917.50	0.11
230	601866	中海集运	57,738	140,880.72	0.11
231	600598	北大荒	17,253	140,784.48	0.11
232	600516	方大炭素	15,517	137,790.96	0.11
233	000839	中信国安	22,826	137,412.52	0.11
234	600118	中国卫星	11,120	135,997.60	0.10
235	600859	王府井	5,614	134,511.44	0.10
236	600331	宏达股份	20,032	134,014.08	0.10
237	600582	天地科技	11,800	133,930.00	0.10
238	600498	烽火通信	5,852	133,191.52	0.10
239	600432	吉恩镍业	9,840	132,840.00	0.10
240	000969	安泰科技	12,561	132,644.16	0.10
241	600216	浙江医药	6,309	132,615.18	0.10
242	600895	张江高科	18,788	131,891.76	0.10
243	600170	上海建工	16,834	131,473.54	0.10
244	600970	中材国际	10,611	130,727.52	0.10
245	002128	露天煤业	9,657	129,596.94	0.10
246	601918	国投新集	13,469	128,898.33	0.10
247	002500	山西证券	17,468	128,040.44	0.10
248	600160	巨化股份	13,752	127,068.48	0.10
249	601928	凤凰传媒	18,524	125,592.72	0.10
250	601158	重庆水务	23,293	123,685.83	0.09
251	600221	海南航空	28,662	121,240.26	0.09
252	000686	东北证券	7,123	118,954.10	0.09
253	600528	中铁二局	17,702	118,249.36	0.09
254	000807	云铝股份	22,407	118,084.89	0.09
255	601555	东吴证券	14,558	117,337.48	0.09
256	600588	用友软件	11,878	117,117.08	0.09
257	601098	中南传媒	13,073	116,872.62	0.09
258	000961	中南建设	8,501	116,633.72	0.09
259	600508	上海能源	7,014	112,855.26	0.09
260	601336	新华保险	3,847	110,870.54	0.08
261	002073	软控股份	14,410	108,939.60	0.08

262	002069	獐子岛	6,902	108,913.56	0.08
263	600550	天威保变	16,657	108,437.07	0.08
264	002344	海宁皮城	4,076	108,340.08	0.08
265	600132	重庆啤酒	7,046	108,297.02	0.08
266	601369	陕鼓动力	11,929	107,599.58	0.08
267	601800	中国交建	20,300	107,590.00	0.08
268	600873	梅花集团	19,713	107,041.59	0.08
269	600372	中航电子	6,567	104,086.95	0.08
270	600037	歌华有线	15,437	103,427.90	0.08
271	601558	华锐风电	19,510	102,622.60	0.08
272	600022	山东钢铁	46,850	102,601.50	0.08
273	600770	综艺股份	16,081	99,541.39	0.08
274	000059	辽通化工	14,564	99,180.84	0.08
275	002405	四维图新	8,390	98,414.70	0.08
276	600546	山煤国际	4,810	97,883.50	0.07
277	000596	古井贡酒	2,800	95,984.00	0.07
278	002299	圣农发展	8,841	94,421.88	0.07
279	000780	平庄能源	9,844	94,305.52	0.07
280	000703	恒逸石化	8,397	93,542.58	0.07
281	600456	宝钛股份	5,220	92,602.80	0.07
282	601099	太平洋	16,049	87,788.03	0.07
283	600096	云天化	6,732	87,246.72	0.07
284	000559	万向钱潮	19,329	86,787.21	0.07
285	002431	棕榈园林	3,727	85,721.00	0.07
286	002673	西部证券	5,800	84,970.00	0.07
287	002122	天马股份	14,412	79,554.24	0.06
288	000968	煤气化	6,233	76,915.22	0.06
289	002399	海普瑞	3,883	72,806.25	0.06
290	601258	庞大集团	12,721	65,767.57	0.05
291	002603	以岭药业	2,681	62,386.87	0.05
292	600783	鲁信创投	5,418	59,868.90	0.05
293	601216	内蒙君正	9,317	57,951.74	0.04
294	002378	章源钨业	2,078	50,620.08	0.04
295	601233	桐昆股份	7,014	50,430.66	0.04
296	002570	贝因美	2,067	45,639.36	0.03
297	601238	广汽集团	7,000	42,770.00	0.03
298	002594	比亚迪	1,917	39,010.95	0.03
299	000883	湖北能源	4,600	31,970.00	0.02

8.3.2 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

本基金本报告期末持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	16,184,356.70	12.38
2	600016	民生银行	14,507,013.97	11.10
3	600036	招商银行	14,314,887.74	10.95
4	601288	农业银行	11,794,373.00	9.02
5	601328	交通银行	10,874,423.44	8.32
6	600519	贵州茅台	10,450,020.22	8.00
7	601166	兴业银行	10,041,580.32	7.68
8	000002	万 科 A	9,476,832.10	7.25
9	600000	浦发银行	9,250,053.09	7.08
10	600030	中信证券	9,188,426.85	7.03
11	600837	海通证券	8,427,917.36	6.45
12	601088	中国神华	7,881,853.94	6.03
13	601601	中国太保	7,771,314.73	5.95
14	000858	五 粮 液	7,230,474.10	5.53
15	601398	工商银行	6,380,875.30	4.88
16	600111	包钢稀土	6,204,698.50	4.75
17	600104	上汽集团	5,435,361.97	4.16
18	600048	保利地产	5,254,987.05	4.02
19	601668	中国建筑	5,229,491.62	4.00
20	002304	洋河股份	4,922,024.04	3.77
21	000651	格力电器	4,765,534.85	3.65
22	000157	中联重科	4,288,336.88	3.28
23	601169	北京银行	4,196,017.90	3.21
24	000001	平安银行	4,033,195.65	3.09
25	601006	大秦铁路	3,973,758.00	3.04
26	600031	三一重工	3,859,658.09	2.95
27	601818	光大银行	3,635,229.00	2.78
28	600900	长江电力	3,492,051.49	2.67
29	600050	中国联通	3,404,150.00	2.60
30	600887	伊利股份	3,354,849.44	2.57
31	601857	中国石油	3,351,452.24	2.56
32	600015	华夏银行	3,235,802.00	2.48

33	002024	苏宁电器	3,208,034.79	2.45
34	601899	紫金矿业	3,160,290.64	2.42
35	600585	海螺水泥	3,064,869.91	2.34
36	601628	中国人寿	3,056,864.50	2.34
37	600256	广汇能源	3,054,761.86	2.34
38	000568	泸州老窖	3,050,893.35	2.33
39	600383	金地集团	2,903,794.00	2.22
40	600028	中国石化	2,704,531.83	2.07
41	000776	广发证券	2,700,068.00	2.07
42	600999	招商证券	2,675,699.62	2.05

注：本项“买入金额”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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	11,873,024.86	9.08
2	600016	民生银行	11,327,349.95	8.67
3	600036	招商银行	11,255,077.37	8.61
4	601288	农业银行	10,242,435.73	7.84
5	601328	交通银行	8,258,372.68	6.32
6	600519	贵州茅台	8,007,039.52	6.13
7	601166	兴业银行	7,830,101.41	5.99
8	600000	浦发银行	7,080,286.24	5.42
9	000002	万 科 A	6,834,336.82	5.23
10	600030	中信证券	6,748,710.05	5.16
11	600837	海通证券	6,379,516.21	4.88
12	601088	中国神华	6,115,742.78	4.68
13	601601	中国太保	5,519,994.71	4.22
14	000858	五 粮 液	5,413,223.72	4.14
15	601398	工商银行	4,878,086.77	3.73
16	600104	上汽集团	4,708,564.04	3.60
17	600111	包钢稀土	4,504,124.13	3.45
18	600048	保利地产	3,951,575.94	3.02
19	601668	中国建筑	3,922,470.78	3.00
20	000651	格力电器	3,700,875.86	2.83
21	002304	洋河股份	3,551,314.81	2.72
22	000157	中联重科	3,221,785.25	2.46
23	601169	北京银行	3,157,007.05	2.42

24	601006	大秦铁路	3,012,087.84	2.30
25	000001	平安银行	2,977,184.20	2.28
26	600031	三一重工	2,767,575.42	2.12
27	601818	光大银行	2,736,156.10	2.09
28	600900	长江电力	2,667,637.03	2.04
29	600887	伊利股份	2,649,609.51	2.03

注：本项“卖出金额”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。

8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	517,751,155.50
卖出股票的收入（成交）总额	390,124,060.88

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 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	100,039.00
2	应收证券清算款	1,489,702.23
3	应收股利	-
4	应收利息	1,574.32
5	应收申购款	49,407.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,640,722.66

8.9.4 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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	2,493,274.52	1.91	重大事项停牌

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资股票不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份	持有	户均持有的	持有人结构
---	----	-------	-------

额 级 别	人户 数(户)	基金份额	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
华 安 沪 深 300 指 数 分 级 A	484	76354.59	21855926.00	59.14%	15099694.00	40.86%
华 安 沪 深 300 指 数 分 级 B	564	65524.15	11130925.00	30.12%	25824695.00	69.88%
华 安 沪 深 300 指 数 分 级	224	226354.08	31064751.00	61.27%	19638562.20	38.73%
合 计	1272	97967.42	64051602.00	51.40%	60562951.20	48.60%

9.2 期末上市基金前十名持有人

华安沪深300指数分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新光海航人寿保险有限责任公司 分红保险帐户	8,961,993.00	24.25%
2	山西潞安矿业	3,834,413.00	10.38%

	(集团) 有限责任公司企业年金计划—中国工商银行		
3	中信证券股份有限公司	3,350,000.00	9.06%
4	兵器装备集团财务有限责任公司	2,500,194.00	6.77%
5	招商银行股份有限公司企业年金计划—招商银行	1,692,259.00	4.58%
6	长江证券—建行—长江证券超越理财主题精选集合资产管理计划	956,477.00	2.59%
7	王健	495,533.00	1.34%
8	江苏省国信资产管理集团有限公司企业年金计划—招商银行	444,297.00	1.20%
9	窦习章	400,144.00	1.08%
10	段雅莉	300,000.00	0.81%

华安沪深300指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中钢投资有限公司	4,465,103.00	12.08%
2	中信证券股份有限公司	3,350,000.00	9.06%
3	中信证券股份有限公司	3,147,520.00	8.52%
4	周文辉	1,472,000.00	3.98%
5	张玉麟	1,080,902.00	2.92%
6	马永玲	1,077,000.00	2.91%
7	杨明雄	1,000,078.00	2.71%
8	张文军	700,102.00	1.89%
9	陈月甜	525,064.00	1.42%
10	张兴致	509,800.00	1.38%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从	华安沪深		

业人员持有本基金	300 指数分 级 A		
	华安沪深 300 指数分 级 B	-	-
	华安沪深 300 指数分 级	-	-
	合计	-	-

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 指数分 级 A	华安沪深 300 指数分 级 B	华安沪深 300 指数 分级
基金合同生效日(2012 年 6 月 25 日)基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	18,754,497.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	501,453,802.02
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-160,334,296.00	-160,334,296.00	320,668,592.00
本报告期期末基金份额总额	36,955,620	36,955,620	50,703,313.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2012 年 2 月 3 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(2) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，秦军先生任华安基金管理有限公司副总经理。秦军先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(3) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，章国富先生不再担任华安基金管理有限公司督察长，转任华安基金管理有限公司副总经理。章国富先生经中国证监会核准去的高管任职资格。

(4) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，薛珍女士任华安基金管理有限公司督察长。薛珍女士经中国证监会核准去的高管任职资格。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036 号）。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 56,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	232,401,775.49	25.60%	198,183.54	25.03%	-
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限 责任公司	1	4,030,470.24	0.44%	3,669.20	0.46%	-
中国国际金融 有限公司	1	348,633,045.09	38.40%	308,061.79	38.90%	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	1	317,270,696.43	34.95%	276,977.99	34.97%	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	5,539,229.13	0.61%	5,042.90	0.64%	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

（3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

(5) 通知托管人

通知基金托管人。

11.7.2 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		回购交易		权证交易		股指期货交易	
	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	成交金额	占当期成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公司								
宏源证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万 国证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券有 限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
财富证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君	-	-	-	-	-	-	-	-

安证券股份有限公司								
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	198,096.90	100.00%	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	1,494,600,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证	-	-	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公司								
中银国 际证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于住所变更公告,住所变更为上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
2	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-16
3	关于基金电子交易平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-02
4	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-29
5	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-29

6	华安沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-29
7	华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-29
8	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金份额上网发售提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-01
9	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-01
10	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-05
11	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-13
12	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-18
13	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-26
14	关于电子直销平台开通“智能再平衡”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-03
15	华安沪深 300 分级指数基金开放日常申购（赎回、定期定额投资）业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-18
16	华安沪深 300 指数分级证券投资基金上市交易公告书	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-18

17	关于电子直销平台开通“农行机构电子直销”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-20
18	华安沪深 300 指数分级证券投资基金上市交易提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-23
19	关于旗下部分基金新增浙商银行股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-08-06
20	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-11-03
21	关于电子直销平台开通“货币通”货币基金份额电子支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-03
22	关于电子直销平台开通“支付宝”资金结算方式的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-12
23	华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-25
24	关于华安沪深 300A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的提示公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-27
25	华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-27

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012 年 1 月 16 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的

公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012 年 11 月 15 日，根据工作需要，中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 指数分级证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一三年三月二十七日