

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
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 1 月 1 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.....	4
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.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
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.....	11
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.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6	审计报告.....	15
6.1	管理层对财务报表的责任.....	15
6.2	注册会计师的责任.....	15
6.3	审计意见.....	15
§7	年度财务报表.....	16
7.1	资产负债表.....	16
7.2	利润表.....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4	报表附注.....	20
§8	投资组合报告.....	40
8.1	期末基金资产组合情况.....	40
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53

8.9	投资组合报告附注.....	53
§9	基金份额持有人信息.....	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	55
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
§10	开放式基金份额变动.....	55
§11	重大事件揭示.....	56
11.1	基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4	基金投资策略的改变.....	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	57
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8	其他重大事件.....	59
§12	备查文件目录.....	61
12.1	备查文件目录.....	61
12.2	存放地点.....	61
12.3	查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	华安深证 300 指数 (LOF)
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	301,240,008.96 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	2011 年 10 月 18 日

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。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
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,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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	唐州徽
	联系电话	021-38969999	010-66594855
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		李勍	肖钢

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、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	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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	2011 年 9 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-26,737,588.28	-11,002,550.51

本期利润	14,208,864.47	-73,946,301.26
加权平均基金份额本期利润	0.0417	-0.1387
本期加权平均净值利润率	4.77%	-14.47%
本期基金份额净值增长率	3.59%	-16.50%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-40,648,047.62	-65,995,328.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1349	-0.1654
期末基金资产净值	260,591,961.34	333,102,606.76
期末基金份额净值	0.865	0.835
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-13.50%	-16.50%

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、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

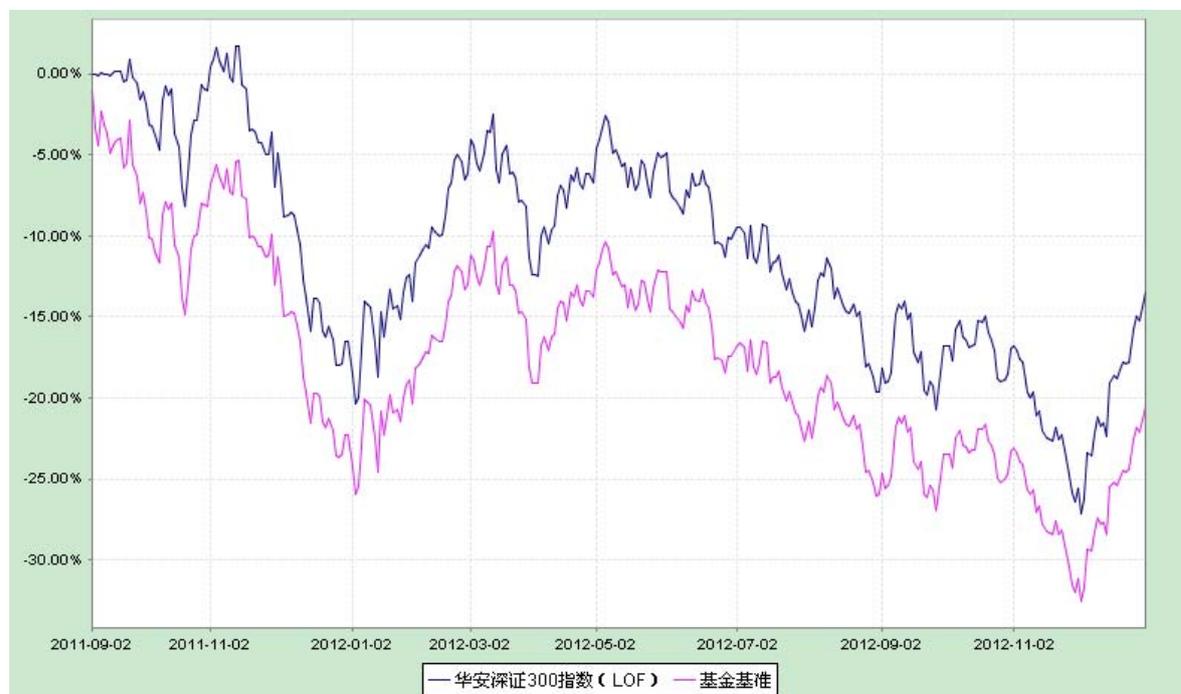
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.97%	1.30%	3.90%	1.28%	0.07%	0.02%
过去六个月	-3.67%	1.33%	-3.81%	1.31%	0.14%	0.02%
过去一年	3.59%	1.37%	2.25%	1.37%	1.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.50%	1.36%	-20.56%	1.40%	7.06%	-0.04%

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

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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

(2011 年 9 月 2 日至 2012 年 12 月 31 日)

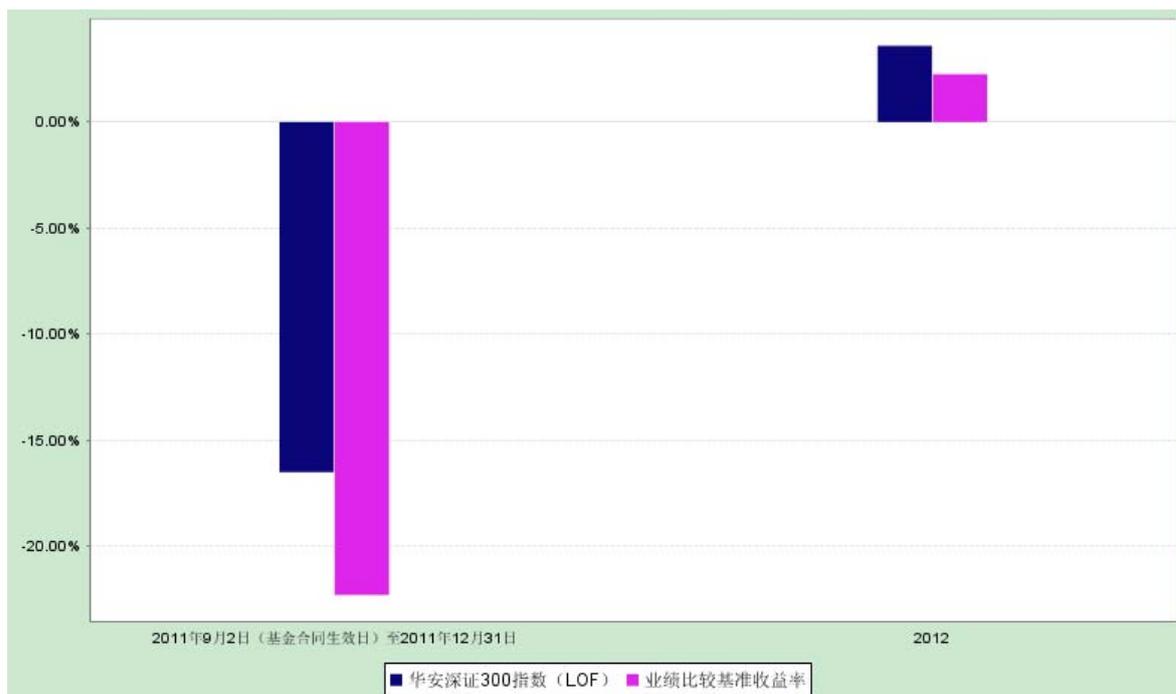


注：根据《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十五部分“基金的投资”中投资范围、投资限制等有关约定。

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

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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 2011 年 9 月 2 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

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年9月2日 (基金合同生效日) 至 2011年12月31日	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 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		
许之彦	本基金的基金经理, 指数投资总监	2011-09-02	-	9 年	理学博士, 8 年证券、基金从业经验, 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, 2008 年 4 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理, 2009 年 9 月起同时担任华安上证 180ETF 及 180ETF 联接基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。
章海默	本基金的基金	2011-09-02	2012-12-22	9 年	复旦大学管理学院工商管理硕士, 复旦大学经济学学士, 7 年基金从业经历。

	经理			曾在安永华明会计师事务所工作，2003 年 9 月加入华安基金管理有限公司，任基金运营部基金核算主管，2009 年 12 月起担任 180ETF 联接基金的基金经理助理。2011 年 9 月起同时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《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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

2012 年，国内经济前三季度经济增长呈现一定下降，上市公司微观层面盈利也出现盈利增长下滑。截止 2012 年 11 月，国内 A 股市场整体呈现较弱的态势，市场情绪较为低落，上证综指一度跌破 2000 点。在国内房地产市场逐步回暖和政府投资需求等拉动下，国内宏观经济数据在 2012 年第四季度出现好转，加上 QFII 和 RQFII 额度增加，海外机构投资者和国内机构投资者的推动，12 月份市场出现了大幅上涨，深 300 指数 12 月份上涨超过了 16%，全年实现了正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内深证 300LOF 基金份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准增长率为 2.25%，基金净值表现领先比较基准 1.34%，截至 2012 年 12 月 31 日，日跟踪误差为 0.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内十八大的召开，我们对国内经济未来中长期保持稳定增长预期得以加强，国内经济将在转型和稳定增长上找到新的平衡，国内城镇化还有较大的空间，随着社会保障体系的逐步建立，我们对内需长期持续增长也更有信心，美国经济温和复苏的进程也将得以加强。整体来看，我们认为 2013 年国内经济增长可能略微超过预期，尽管下半年通胀数据有所抬升，但全年通胀相对温和，整体市场的流动性相对充裕。国内 A 股虽然经历了近期蓝筹股估值修复行情后，其估值依然不高，加上经济增长的预期和国内改革所带来的动力，对国内 A 股市场 2013 年的表现我们依然保持乐观。

作为深证 300LOF 的管理人，我们将秉承既定的投资目标和策略，规范运作、勤勉尽责，充分拟合指数，为投资者提供优势的深证 300 指数投资工具。

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

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 21438 号

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“华安深证 300 指数基金”)的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度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深证 300 指数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。

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。

6.3 审计意见

我们认为,上述华安深证 300 指数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,公允反映了华安深证 300 指数基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度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：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	16,079,147.78	31,295,012.20
结算备付金		93,329.29	296,591.05
存出保证金		24,053.47	747,877.72
交易性金融资产	7.4.7.2	245,428,119.90	316,383,479.61
其中：股票投资		245,379,519.90	316,383,479.61
基金投资		-	-
债券投资		48,600.00	-
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		-	1,702,783.54
应收利息	7.4.7.5	3,942.57	4,588.92
应收股利		-	-
应收申购款		4,954.62	114,039.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		261,633,547.63	350,544,372.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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		-	-
应付赎回款		476,134.73	16,489,032.21
应付管理人报酬		106,347.97	163,055.48
应付托管费		21,269.57	32,611.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	70,068.34	459,622.21
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	367,765.68	297,444.50
负债合计		1,041,586.29	17,441,765.51
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	301,240,008.96	399,097,935.44
未分配利润	7.4.7.10	-40,648,047.62	-65,995,328.68
所有者权益合计		260,591,961.34	333,102,606.76
负债和所有者权益总计		261,633,547.63	350,544,372.27

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.865 元，基金份额总额 301,240,008.96 份。

7.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2012年1月1日至2012年12月31日	2011年9月2日（基金合同生效日）至2011年12月31日

一、收入		18,046,752.82	-70,742,025.91
1.利息收入		300,570.90	966,986.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	100,757.97	161,547.90
债券利息收入		199,812.93	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	805,439.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,538,476.28	-9,083,824.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-26,443,148.62	-9,131,166.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-15,330.00	-
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	2,920,002.34	47,342.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	40,946,452.75	-62,943,750.75
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	338,205.45	318,561.91
减：二、费用		3,837,888.35	3,204,275.35
1. 管理人报酬		1,495,142.13	851,030.46
2. 托管费		299,028.30	170,206.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,444,626.25	1,895,716.92
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	599,091.67	287,321.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,208,864.47	-73,946,301.26

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,208,864.47	-73,946,301.26

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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）	399,097,935.44	-65,995,328.68	333,102,606.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,208,864.47	14,208,864.47
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）	-97,857,926.48	11,138,416.59	-86,719,509.89
其中：1.基金申购款	203,144,329.37	-16,310,518.93	186,833,810.44
2.基金赎回款	-301,002,255.85	27,448,935.52	-273,553,320.33
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）	301,240,008.96	-40,648,047.62	260,591,961.34
项目	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生效日）至2011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）	608,040,554.70	-	608,040,554.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-73,946,301.26	-73,946,301.26
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）	-208,942,619.26	7,950,972.58	-200,991,646.68
其中：1.基金申购款	56,368,493.05	-2,968,391.41	53,400,101.64
2.基金赎回款	-265,311,112.31	10,919,363.99	-254,391,748.32
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)	399,097,935.44	-65,995,328.68	333,102,606.76

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码 (序号) 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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(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]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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人民币 607,830,415.01 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 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额, 其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意, 本基金 146,584,08.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。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, 在封闭期满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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金的本基金投资范围主要为标的指数深证 300 价格指数成份股及其备选成份股, 少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发等)、债券、现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%; 其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{深证 300 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利}$ 。

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》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度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。比较财务报表的实际编制期间为 2011 年 9 月 2 日(基金合同生效日)至 2011 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已宣告但尚未发放的现金股利或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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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。当本基金依法有权抵销债权债务且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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见本基金合同的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	16,079,147.78	31,295,012.20
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	16,079,147.78	31,295,012.20

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		267,376,817.90	245,379,519.90	-21,997,298.00
债券	交易所市场	48,600.00	48,600.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	48,600.00	48,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		267,425,417.90	245,428,119.90	-21,997,298.00
项目		上年度末 2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		379,327,230.36	316,383,479.61	-62,943,750.75
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		379,327,230.36	316,383,479.61	-62,943,750.75

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	上年度末 2011年12月31日

应收活期存款利息	3,888.46	4,445.76
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	42.00	133.50
应收债券利息	6.92	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	5.19	9.66
其他	-	-
合计	3,942.57	4,588.92

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	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	70,068.34	459,622.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	70,068.34	459,622.21

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	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,765.68	62,144.58
应付后端申购费	-	-
应付指数使用费	50,000.00	59,299.92
债券利息税	-	-
银行手续费	-	-
预提信息披露费	260,000.00	120,000.00
预提审计费用	56,000.00	56,000.00
合计	367,765.68	297,444.50

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	399,097,935.44	399,097,935.44
本期申购	203,144,329.37	203,144,329.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-301,002,255.85	-301,002,255.85
本期末	301,240,008.96	301,240,008.96

注:截至 2012 年 12 月 31 日止,本基金于深交所上市的基金份额为 33,909,241.00 份(2011 年 12 月 31 日: 65,575,935.00 份), 托管在场外未上市交易的基金份额为 267,330,767.96 份(2011 年 12 月 31 日: 333,522,000.44 份)。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, 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
上年度末	-11,215,836.38	-54,779,492.30	-65,995,328.68
本期利润	-26,737,588.28	40,946,452.75	14,208,864.47
本期基金份额交易产生的变动数	5,653,899.62	5,484,516.97	11,138,416.59
其中: 基金申购款	-13,765,439.06	-2,545,079.87	-16,310,518.93
基金赎回款	19,419,338.68	8,029,596.84	27,448,935.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,299,525.04	-8,348,522.58	-40,648,047.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年9月2日 (基金合同生 效日) 至2011年12月31日
	活期存款利息收入	91,696.33
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	5,793.63	23,324.05
其他	3,268.01	3,684.68

合计	100,757.97	161,547.90
----	------------	------------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生效日）至2011年12月31日
卖出股票成交总额	510,196,993.51	502,469,443.42
减：卖出股票成本总额	536,640,142.13	511,600,610.00
买卖股票差价收入	-26,443,148.62	-9,131,166.58

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生效日）至2011年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,000,000.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,678,330.00	-
减：应收利息总额	337,000.00	-
债券投资收益	-15,330.00	-

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生效日）至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,920,002.34	47,342.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,920,002.34	47,342.55

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1月1日至2012年12月	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生
------	--------------------------	----------------------------

	31日	效日) 至2011年12月31日
1.交易性金融资产	40,946,452.75	-62,943,750.75
——股票投资	40,946,452.75	-62,943,750.75
——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	40,946,452.75	-62,943,750.75

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年9月2日 (基金合同生效日) 至2011年12月31日
基金赎回费收入	338,205.45	317,991.47
其他收入_其他	-	570.44
合计	338,205.45	318,561.91

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	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年9月2日 (基金合同生效日) 至2011年12月31日
交易所市场交易费用	1,444,451.25	1,895,716.92
银行间市场交易费用	175.00	-
合计	1,444,626.25	1,895,716.92

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年9月2日 (基金合同生效日) 至2011年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00

信息披露费	260,000.00	120,000.00
银行汇划费用	9,591.67	6,121.93
指数使用费	200,000.00	59,299.92
上市年费	60,000.00	45,000.00
帐户维护费	13,500.00	-
其他费用	-	900.00
合计	599,091.67	287,321.85

注：根据《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》及《深证 300 指数使用许可协议书》，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

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。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,495,142.13	851,030.46
其中：支付销售机构的客户 维护费	387,574.57	177,702.99

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 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1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年9月2日（基金合同生 效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托 管费	299,028.30	170,206.12

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 9 月 2 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	16,079,147.78	91,696.33	31,295,012.20	134,539.17
合计	16,079,147.78	91,696.33	31,295,012.20	134,539.17

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行保管，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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
000826	桑德环境	2012-12-31	2013-01-09	配股增发	12.71	22.99	13,448	170,924.08	309,169.52	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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

127001	海直转债	2012-12-24	2013-01-07	网下新债申购	100.00	100.00	486	48,600.00	48,600.00	-
--------	------	------------	------------	--------	--------	--------	-----	-----------	-----------	---

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
000002	万科 A	2012-12-26	重大事项停牌	10.12	2013-01-21	11.13	1,221,118	10,305,549.33	12,357,714.16	-
000527	美的电器	2012-08-27	重大资产重组	9.18	-	-	223,226	3,163,568.08	2,049,214.68	-
000793	华闻传媒	2012-11-23	公告重大事项	6.63	2013-02-28	7.29	121,322	761,508.20	804,364.86	-
000973	佛塑科技	2012-12-28	公告重大事项	4.15	2013-01-18	4.57	87,957	659,743.37	365,021.55	-
000698	沈阳化工	2012-12-24	公告重大事项	4.22	2013-01-31	4.64	61,032	460,746.65	257,555.04	-
000042	深长城	2012-12-18	公告重大事项	20.10	2013-02-05	22.11	10,712	197,401.38	215,311.20	-
002190	成飞集成	2012-10-16	重大资产重组	11.45	2013-01-14	12.60	14,931	236,623.11	170,959.95	-

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

本基金是指数型基金, 采用完全复制策略, 跟踪深证 300 指数, 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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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。本基金完全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。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。

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、监察稽核部和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内。

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, 本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2011 年 12 月 31 日: 无)。

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%。本基金所持大部分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。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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、结算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2012年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,079,147.78	-	-	-	16,079,147.78
结算备付金	93,329.29	-	-	-	93,329.29
存出保证金	-	-	-	24,053.47	24,053.47
交易性金融资产	-	-	48,600.00	245,379,519.90	245,428,119.90
应收利息	-	-	-	3,942.57	3,942.57
应收申购款	596.42	-	-	4,358.20	4,954.62
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	16,173,073.49	-	48,600.00	245,411,874.14	261,633,547.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	476,134.73	476,134.73
应付管理人报酬	-	-	-	106,347.97	106,347.97
应付托管费	-	-	-	21,269.57	21,269.57
应付交易费	-	-	-	70,068.34	70,068.34

用					
其他负债	-	-	-	367,765.68	367,765.68
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,041,586.29	1,041,586.29
利率敏感度缺口	16,173,073.49	-	48,600.00	244,370,287.85	260,591,961.34
上年度末 2011年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,295,012.20	-	-	-	31,295,012.20
结算备付金	296,591.05	-	-	-	296,591.05
存出保证金	-	-	-	747,877.72	747,877.72
交易性金融资产	-	-	-	316,383,479.61	316,383,479.61
应收利息	-	-	-	4,588.92	4,588.92
应收申购款	3,230.62	-	-	110,808.61	114,039.23
应收证券清算款	-	-	-	1,702,783.54	1,702,783.54
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	31,594,833.87	-	-	318,949,538.40	350,544,372.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,489,032.21	16,489,032.21
应付管理人报酬	-	-	-	163,055.48	163,055.48
应付托管费	-	-	-	32,611.11	32,611.11
应付交易费用	-	-	-	459,622.21	459,622.21
其他负债	-	-	-	297,444.50	297,444.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	17,441,765.51	17,441,765.51
利率敏感度缺口	31,594,833.87	-	-	301,507,772.89	333,102,606.76

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2011 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。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。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。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		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	245,379,519.90	94.16	316,383,479.61	94.98
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	245,379,519.90	94.16	316,383,479.61	94.98
----	----------------	-------	----------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 1,304.00 万元	-
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 1,304.00 万元	-

注: 于 2011 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 229,207,978.46 元, 属于第二层级的余额为 16,220,141.44 元, 无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日: 第一层级 310,954,492.43 元, 第二层级 5,428,987.18 元, 无属于第三层级)。

(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	245,379,519.90	93.79
	其中：股票	245,379,519.90	93.79
2	固定收益投资	48,600.00	0.02
	其中：债券	48,600.00	0.02
	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	16,172,477.07	6.18
6	其他各项资产	32,950.66	0.01
7	合计	261,633,547.63	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	3,731,795.81	1.43
B	采掘业	11,708,293.18	4.49
C	制造业	143,091,932.03	54.91

C0	食品、饮料	25,922,341.74	9.95
C1	纺织、服装、皮毛	2,474,278.74	0.95
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,007,312.08	0.39
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,868,953.18	4.94
C5	电子	16,351,028.34	6.27
C6	金属、非金属	22,967,842.09	8.81
C7	机械、设备、仪表	43,018,853.82	16.51
C8	医药、生物制品	18,093,150.80	6.94
C99	其他制造业	388,171.24	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,774,943.81	1.45
E	建筑业	3,408,031.89	1.31
F	交通运输、仓储业	2,552,760.58	0.98
G	信息技术业	7,607,025.66	2.92
H	批发和零售贸易	8,991,872.23	3.45
I	金融、保险业	19,623,652.21	7.53
J	房地产业	24,993,223.53	9.59
K	社会服务业	7,476,461.12	2.87
L	传播与文化产业	4,928,491.13	1.89
M	综合类	3,491,036.72	1.34
	合计	245,379,519.90	94.16

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	000002	万科A	1,221,118	12,357,714.16	4.74
2	000858	五粮液	347,335	9,805,267.05	3.76

3	000651	格力电器	299,304	7,632,252.00	2.93
4	000001	平安银行	410,665	6,578,853.30	2.52
5	000157	中联重科	638,910	5,884,361.10	2.26
6	000776	广发证券	322,808	4,977,699.36	1.91
7	000568	泸州老窖	131,681	4,661,507.40	1.79
8	002024	苏宁电器	657,557	4,372,754.05	1.68
9	000063	中兴通讯	352,846	3,440,248.50	1.32
10	002304	洋河股份	35,518	3,316,315.66	1.27
11	300027	华谊兄弟	211,765	3,017,651.25	1.16
12	000069	华侨城 A	398,037	2,985,277.50	1.15
13	000060	中金岭南	326,415	2,954,055.75	1.13
14	000402	金融街	423,809	2,860,710.75	1.10
15	000895	双汇发展	43,779	2,534,804.10	0.97
16	000338	潍柴动力	99,380	2,515,307.80	0.97
17	000630	铜陵有色	129,981	2,456,640.90	0.94
18	000423	东阿阿胶	60,681	2,452,119.21	0.94
19	000983	西山煤电	172,247	2,395,955.77	0.92
20	000538	云南白药	35,007	2,380,476.00	0.91
21	000725	京东方 A	1,000,000	2,270,000.00	0.87
22	000024	招商地产	70,858	2,117,945.62	0.81
23	000527	美的电器	223,226	2,049,214.68	0.79
24	000629	攀钢钒钛	486,447	2,004,161.64	0.77
25	002142	宁波银行	184,754	1,969,477.64	0.76
26	000970	中科三环	59,979	1,954,715.61	0.75
27	000783	长江证券	200,977	1,889,183.80	0.72
28	002236	大华股份	40,602	1,881,902.70	0.72
29	000100	TCL 集团	810,375	1,774,721.25	0.68
30	000792	盐湖股份	65,845	1,764,646.00	0.68
31	000933	神火股份	233,210	1,756,071.30	0.67
32	000425	徐工机械	148,421	1,711,294.13	0.66
33	000581	威孚高科	53,473	1,705,788.70	0.65

34	000878	云南铜业	109,940	1,663,392.20	0.64
35	000625	长安汽车	246,442	1,638,839.30	0.63
36	000758	中色股份	79,947	1,630,918.80	0.63
37	000623	吉林敖东	94,117	1,599,989.00	0.61
38	002415	海康威视	49,350	1,535,278.50	0.59
39	002155	辰州矿业	73,050	1,466,844.00	0.56
40	000937	冀中能源	98,403	1,360,913.49	0.52
41	000562	宏源证券	71,969	1,356,615.65	0.52
42	000422	湖北宜化	121,674	1,351,798.14	0.52
43	000709	河北钢铁	499,105	1,337,601.40	0.51
44	002422	科伦药业	23,829	1,334,900.58	0.51
45	000768	中航飞机	159,071	1,323,470.72	0.51
46	002152	广电运通	90,303	1,281,399.57	0.49
47	002081	金螳螂	29,040	1,278,340.80	0.49
48	000728	国元证券	112,919	1,257,917.66	0.48
49	000960	锡业股份	60,239	1,197,551.32	0.46
50	002241	歌尔声学	31,542	1,189,133.40	0.46
51	002092	中泰化学	166,656	1,186,590.72	0.46
52	000039	中集集团	100,119	1,154,372.07	0.44
53	002219	独一味	80,000	1,136,000.00	0.44
54	002450	康得新	46,700	1,134,810.00	0.44
55	002038	双鹭药业	27,141	1,073,697.96	0.41
56	000917	电广传媒	104,354	1,040,409.38	0.40
57	000825	太钢不锈	285,751	1,031,561.11	0.40
58	000826	桑德环境	44,827	1,030,572.73	0.40
59	000999	华润三九	41,926	993,646.20	0.38
60	000680	山推股份	203,291	990,027.17	0.38
61	000998	隆平高科	48,280	988,774.40	0.38
62	002250	联化科技	50,000	975,000.00	0.37
63	000963	华东医药	28,568	971,312.00	0.37
64	002146	荣盛发展	69,333	969,968.67	0.37

65	002004	华邦制药	60,000	963,600.00	0.37
66	000816	江淮动力	174,477	949,154.88	0.36
67	000012	南玻 A	115,044	949,113.00	0.36
68	000800	一汽轿车	111,854	930,625.28	0.36
69	002050	三花股份	100,000	904,000.00	0.35
70	002310	东方园林	14,193	889,759.17	0.34
71	002106	莱宝高科	57,443	879,452.33	0.34
72	000503	海虹控股	92,484	876,748.32	0.34
73	300146	汤臣倍健	15,000	873,000.00	0.34
74	000661	长春高新	14,016	856,377.60	0.33
75	002007	华兰生物	40,232	846,481.28	0.32
76	000778	新兴铸管	130,627	843,850.42	0.32
77	002456	欧菲光	20,000	839,400.00	0.32
78	000400	许继电气	33,831	833,934.15	0.32
79	002405	四维图新	70,692	829,217.16	0.32
80	000982	中银绒业	100,000	810,000.00	0.31
81	000793	华闻传媒	121,322	804,364.86	0.31
82	000729	燕京啤酒	142,040	801,105.60	0.31
83	002051	中工国际	26,767	786,949.80	0.30
84	000969	安泰科技	74,193	783,478.08	0.30
85	002001	新和成	41,070	772,116.00	0.30
86	002267	陕天然气	93,400	767,748.00	0.29
87	000511	银基发展	200,000	760,000.00	0.29
88	300024	机器人	28,002	755,213.94	0.29
89	000975	科学城	73,898	744,891.84	0.29
90	002230	科大讯飞	24,460	741,138.00	0.28
91	000900	现代投资	84,370	739,081.20	0.28
92	000799	酒鬼酒	22,501	738,032.80	0.28
93	000690	宝新能源	163,948	734,487.04	0.28
94	000061	农产品	128,530	732,621.00	0.28
95	002202	金风科技	135,423	729,929.97	0.28

96	000528	柳 工	71,379	714,503.79	0.27
97	002008	大族激光	85,572	699,978.96	0.27
98	000877	天山股份	74,286	699,774.12	0.27
99	000540	中天城投	96,667	670,868.98	0.26
100	000839	中信国安	110,874	667,461.48	0.26
101	300070	碧水源	16,617	666,341.70	0.26
102	000786	北新建材	37,705	659,460.45	0.25
103	000876	新 希 望	52,576	656,674.24	0.25
104	000401	冀东水泥	47,418	654,368.40	0.25
105	002407	多氟多	45,654	651,026.04	0.25
106	002428	云南锗业	27,740	650,780.40	0.25
107	000926	福星股份	67,937	642,004.65	0.25
108	000762	西藏矿业	50,278	621,938.86	0.24
109	000426	兴业矿业	48,300	604,233.00	0.23
110	000667	名流置业	268,244	603,549.00	0.23
111	000939	凯迪电力	89,846	600,171.28	0.23
112	000735	罗 牛 山	101,981	594,549.23	0.23
113	002073	软控股份	78,577	594,042.12	0.23
114	000059	辽通化工	86,960	592,197.60	0.23
115	000046	泛海建设	109,007	588,637.80	0.23
116	000616	亿城股份	142,681	584,992.10	0.22
117	000962	东方钨业	46,604	584,414.16	0.22
118	300077	国民技术	40,597	583,378.89	0.22
119	000518	四环生物	150,202	581,281.74	0.22
120	000031	中粮地产	131,966	575,371.76	0.22
121	000869	张 裕 A	12,121	569,687.00	0.22
122	002029	七 匹 狼	29,958	565,607.04	0.22
123	000807	云铝股份	105,957	558,393.39	0.21
124	000961	中南建设	39,477	541,624.44	0.21
125	002233	塔牌集团	63,626	534,458.40	0.21
126	000655	金岭矿业	42,132	522,436.80	0.20

127	002385	大北农	24,145	521,532.00	0.20
128	002204	大连重工	40,500	518,400.00	0.20
129	002065	东华软件	36,637	515,116.22	0.20
130	000652	泰达股份	142,598	507,648.88	0.19
131	002129	中环股份	39,608	505,002.00	0.19
132	000027	深圳能源	84,167	503,318.66	0.19
133	002005	德豪润达	70,806	502,722.60	0.19
134	000006	深振业 A	101,367	501,766.65	0.19
135	000009	中国宝安	56,733	499,250.40	0.19
136	000612	焦作万方	46,008	498,266.64	0.19
137	002022	科华生物	47,208	495,684.00	0.19
138	000996	中国中期	33,569	491,450.16	0.19
139	000636	风华高科	79,032	488,417.76	0.19
140	000718	苏宁环球	61,408	486,965.44	0.19
141	000028	国药一致	13,608	480,362.40	0.18
142	000686	东北证券	28,729	479,774.30	0.18
143	002244	滨江集团	43,569	472,723.65	0.18
144	000598	兴蓉投资	63,368	468,289.52	0.18
145	000541	佛山照明	70,375	466,586.25	0.18
146	002140	东华科技	21,198	465,932.04	0.18
147	000930	中粮生化	95,742	458,604.18	0.18
148	000488	晨鸣纸业	109,574	456,923.58	0.18
149	000968	煤气化	36,900	455,346.00	0.17
150	002167	东方锆业	31,156	451,450.44	0.17
151	000780	平庄能源	46,761	447,970.38	0.17
152	002128	露天煤业	33,209	445,664.78	0.17
153	002041	登海种业	18,618	439,384.80	0.17
154	000726	鲁泰 A	66,142	435,875.78	0.17
155	000848	承德露露	31,661	434,072.31	0.17
156	000650	仁和药业	77,525	432,589.50	0.17
157	000571	新大洲 A	87,436	429,310.76	0.16

158	002500	山西证券	58,250	426,972.50	0.16
159	000417	合肥百货	60,714	424,390.86	0.16
160	002069	獐子岛	26,646	420,473.88	0.16
161	000559	万向钱潮	93,469	419,675.81	0.16
162	002028	思源电气	29,751	415,026.45	0.16
163	000088	盐田港	101,695	411,864.75	0.16
164	000789	江西水泥	33,216	410,217.60	0.16
165	000850	华茂股份	78,684	400,501.56	0.15
166	000683	远兴能源	81,964	395,886.12	0.15
167	002123	荣信股份	45,236	391,743.76	0.15
168	002063	远光软件	26,679	391,114.14	0.15
169	002277	友阿股份	43,037	389,054.48	0.15
170	000608	阳光股份	66,305	386,558.15	0.15
171	002048	宁波华翔	52,637	383,723.73	0.15
172	002056	横店东磁	27,257	382,688.28	0.15
173	000078	海王生物	64,869	377,537.58	0.14
174	000860	顺鑫农业	28,246	377,084.10	0.14
175	000601	韶能股份	105,492	376,606.44	0.14
176	000513	丽珠集团	10,734	373,543.20	0.14
177	002299	圣农发展	34,387	367,253.16	0.14
178	000973	佛塑科技	87,957	365,021.55	0.14
179	000563	陕国投 A	27,956	363,428.00	0.14
180	000537	广宇发展	49,004	360,179.40	0.14
181	000501	鄂武商 A	31,213	358,949.50	0.14
182	000988	华工科技	64,478	357,208.12	0.14
183	001696	宗申动力	60,262	349,519.60	0.13
184	000731	四川美丰	48,150	349,087.50	0.13
185	002479	富春环保	27,600	345,000.00	0.13
186	000592	中福实业	71,900	343,682.00	0.13
187	002408	齐翔腾达	20,490	343,412.40	0.13
188	002262	恩华药业	12,550	341,360.00	0.13

189	002006	精功科技	40,581	340,880.40	0.13
190	000566	海南海药	34,040	339,038.40	0.13
191	000659	珠海中富	122,640	338,486.40	0.13
192	000089	深圳机场	87,897	338,403.45	0.13
193	002292	奥飞动漫	17,900	338,131.00	0.13
194	002122	天马股份	61,203	337,840.56	0.13
195	000550	江铃汽车	18,723	336,639.54	0.13
196	002011	盾安环境	36,566	334,213.24	0.13
197	000823	超声电子	34,941	332,638.32	0.13
198	000036	华联控股	94,247	328,922.03	0.13
199	000887	中鼎股份	35,364	327,117.00	0.13
200	000750	国海证券	27,000	323,730.00	0.12
201	000596	古井贡酒	9,312	319,215.36	0.12
202	000830	鲁西化工	79,786	319,144.00	0.12
203	000525	红太阳	26,928	316,404.00	0.12
204	002161	远望谷	51,346	315,264.44	0.12
205	000931	中关村	55,557	310,563.63	0.12
206	000826	桑德环境	13,448	309,169.52	0.12
207	000021	长城开发	65,032	306,300.72	0.12
208	002223	鱼跃医疗	19,738	305,939.00	0.12
209	000822	山东海化	75,342	303,628.26	0.12
210	002237	恒邦股份	13,039	302,113.63	0.12
211	000159	国际实业	46,233	297,278.19	0.11
212	002104	恒宝股份	31,864	296,016.56	0.11
213	002168	深圳惠程	40,531	295,470.99	0.11
214	000099	中信海直	38,388	294,819.84	0.11
215	000049	德赛电池	9,639	294,664.23	0.11
216	002176	江特电机	38,076	292,423.68	0.11
217	000795	太原刚玉	27,246	284,175.78	0.11
218	000997	新大陆	34,972	283,273.20	0.11
219	002254	泰和新材	30,640	278,824.00	0.11

220	002025	航天电器	24,418	276,900.12	0.11
221	000777	中核科技	15,109	275,437.07	0.11
222	000050	深天马 A	34,223	270,703.93	0.10
223	000301	东方市场	87,074	269,058.66	0.10
224	002013	中航精机	23,552	267,786.24	0.10
225	000987	广州友谊	22,670	264,785.60	0.10
226	002154	报喜鸟	26,282	262,294.36	0.10
227	000698	沈阳化工	61,032	257,555.04	0.10
228	000703	恒逸石化	22,600	251,764.00	0.10
229	002249	大洋电机	36,323	251,718.39	0.10
230	002030	达安基因	32,714	248,626.40	0.10
231	000410	沈阳机床	39,643	245,390.17	0.09
232	000790	华神集团	34,084	238,247.16	0.09
233	000543	皖能电力	31,059	237,601.35	0.09
234	000927	一汽夏利	47,507	236,584.86	0.09
235	002252	上海莱士	17,162	233,746.44	0.09
236	000752	西藏发展	17,669	232,524.04	0.09
237	000090	深天健	30,616	232,375.44	0.09
238	002130	沃尔核材	28,163	231,781.49	0.09
239	000989	九芝堂	20,242	230,758.80	0.09
240	002153	石基信息	10,500	228,060.00	0.09
241	002097	山河智能	33,047	226,041.48	0.09
242	000829	天音控股	57,060	224,245.80	0.09
243	000042	深长城	10,712	215,311.20	0.08
244	002261	拓维信息	26,877	215,016.00	0.08
245	002191	劲嘉股份	23,325	212,257.50	0.08
246	000572	海马汽车	71,669	211,423.55	0.08
247	002218	拓日新能	36,100	210,463.00	0.08
248	002171	精诚铜业	23,225	206,005.75	0.08
249	000928	中钢吉炭	25,387	203,349.87	0.08
250	000977	浪潮信息	14,288	202,460.96	0.08

251	000951	中国重汽	15,729	201,803.07	0.08
252	000713	丰乐种业	18,608	200,594.24	0.08
253	000828	东莞控股	43,160	197,672.80	0.08
254	002064	华峰氨纶	41,535	196,460.55	0.08
255	000708	大冶特钢	25,807	190,713.73	0.07
256	000901	航天科技	19,849	185,191.17	0.07
257	300137	先河环保	13,500	183,600.00	0.07
258	000707	双环科技	34,988	181,937.60	0.07
259	000514	渝开发	36,125	179,902.50	0.07
260	002183	怡亚通	37,266	174,404.88	0.07
261	002079	苏州固得	40,133	172,170.57	0.07
262	002190	成飞集成	14,931	170,959.95	0.07
263	002242	九阳股份	23,877	166,661.46	0.06
264	002594	比亚迪	7,685	156,389.75	0.06
265	000759	中百集团	22,964	151,103.12	0.06
266	300224	正海磁材	9,175	150,837.00	0.06
267	002091	江苏国泰	17,678	149,732.66	0.06
268	002093	国脉科技	33,936	139,816.32	0.05
269	300003	乐普医疗	15,097	138,137.55	0.05
270	000600	建投能源	32,254	136,756.96	0.05
271	002399	海普瑞	7,077	132,693.75	0.05
272	002269	美邦服饰	10,046	131,200.76	0.05
273	002032	苏泊尔	10,092	125,039.88	0.05
274	002136	安纳达	11,251	98,333.74	0.04
275	002601	佰利联	3,800	87,476.00	0.03
276	000022	深赤湾 A	7,814	79,468.38	0.03
277	000539	粤电力 A	12,374	73,254.08	0.03
278	300104	乐视网	3,516	66,065.64	0.03
279	000755	山西三维	10,331	53,617.89	0.02
280	000761	本钢板材	8,980	30,532.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	000001	平安银行	35,701,621.07	10.72
2	000002	万科A	33,241,367.86	9.98
3	000983	西山煤电	29,799,807.50	8.95
4	002024	苏宁电器	27,000,150.01	8.11
5	000858	五粮液	26,448,109.47	7.94
6	000063	中兴通讯	22,835,257.48	6.86
7	002142	宁波银行	21,056,773.79	6.32
8	000024	招商地产	13,217,956.06	3.97
9	000776	广发证券	12,927,399.43	3.88
10	000157	中联重科	11,040,735.55	3.31
11	000402	金融街	9,994,878.08	3.00
12	000630	铜陵有色	9,967,752.32	2.99
13	000651	格力电器	9,704,839.85	2.91
14	000401	冀东水泥	8,874,932.41	2.66
15	000060	中金岭南	8,630,789.43	2.59
16	002304	洋河股份	8,573,505.38	2.57
17	000933	神火股份	8,336,643.00	2.50
18	000422	湖北宜化	8,020,193.35	2.41
19	000568	泸州老窖	6,413,227.87	1.93
20	300027	华谊兄弟	6,047,397.79	1.82

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	000001	平安银行	39,424,589.41	11.84
2	000002	万科A	39,191,665.97	11.77
3	002024	苏宁电器	32,306,323.01	9.70
4	000983	西山煤电	32,192,945.54	9.66
5	000858	五粮液	24,870,705.79	7.47
6	002142	宁波银行	22,927,600.05	6.88
7	000063	中兴通讯	21,550,090.04	6.47
8	000776	广发证券	15,596,870.52	4.68
9	000024	招商地产	14,970,816.49	4.49
10	000157	中联重科	14,640,283.47	4.40
11	000651	格力电器	12,892,183.83	3.87
12	000422	湖北宜化	11,247,445.82	3.38
13	000630	铜陵有色	10,671,614.43	3.20
14	000401	冀东水泥	10,112,640.93	3.04
15	000402	金融街	9,982,374.76	3.00
16	000060	中金岭南	8,163,144.03	2.45
17	000933	神火股份	7,097,662.26	2.13
18	002304	洋河股份	6,266,504.15	1.88
19	000425	徐工机械	6,147,568.94	1.85
20	300002	神州泰岳	6,028,131.11	1.81

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	424,689,729.67
卖出股票的收入（成交）总额	510,196,993.51

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

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	-	-
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	48,600.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	48,600.00	0.02

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

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	127001	海直转债	486	48,600.00	0.02

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 报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	24,053.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,942.57
5	应收申购款	4,954.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,950.66

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	12,357,714.16	4.74	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前五名股票中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

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
2,948	102,184.53	95,604,635.04	31.74%	205,635,373.92	68.26%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比 例
1	姚清福	2,860,556.00	8.44%
2	上海东会财务管理咨询有限 公司	2,200,700.00	6.49%
3	刘素清	990,000.00	2.92%
4	赵钦汇	509,162.00	1.50%
5	何笑容	500,062.00	1.47%
6	董慧	500,055.00	1.47%
7	杜鹃	400,116.00	1.18%
8	周炜	400,072.00	1.18%
9	王霞	400,055.00	1.18%
10	李岩	320,100.00	0.94%

9.3 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
基金管理公司所有从业人员持有本 基金	192,930.69	0.06%

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

基金合同生效日(2011 年 9 月 2 日)基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	399,097,935.44
本报告期基金总申购份额	203,144,329.37
减：本报告期基金总赎回份额	301,002,255.85

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	301,240,008.96

§ 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。

(5).2012 年 12 月 22 日，华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告，章海默女士不再担任本基金的基金经理，许之彦先生继续担任本基金的基金经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。本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情况为人民币 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

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门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	
长江证券股份有限公司	1	494,862,007.28	52.97%	409,946.67	52.99%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	439,377,486.74	47.03%	363,611.82	47.01%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	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	
	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
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上申购基金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	2012-01-04
2	华安基金管理有限公司关于新增财富里昂证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-01-09
3	关于新增中信(浙江)有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-13
4	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
5	关于参加中国工商银行开展个人电子银行基金申购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	2012-04-09
6	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
7	关于旗下部分基金参加邮政储蓄银行	《上海证券报》、	2012-05-02

	手机银行申购基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
8	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
9	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购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	2012-06-29
10	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
11	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
12	关于新增中天证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-08-06
13	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
14	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
15	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
16	关于旗下部分基金参加邮储银行申购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	2012-12-31

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 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 2、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 3、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中国证监会批准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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；

12.2 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>。

12.3 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