

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 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：二〇一四年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	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	15
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	19
7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3	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	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12	投资组合报告附注	46
8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末上市基金前十名持有人	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
9	开放式基金份额变动	48
10	大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
10.2	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	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	54
11	备查文件目录	55
11.1	备查文件目录	55
11.2	存放地点	55
11.3	查阅方式	55

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（场内简称：华安300）		
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	45,996,193.98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（场内简称：华安300A）	华安沪深300指数分级 B（场内简称：华安300B）	华安沪深300指数分级 （场内简称：华安300）
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	16152496.00	16152496.00	13691201.98

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，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。

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	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-759,807.60
本期利润	-3,161,145.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0670
本期加权平均净值利润率	-7.75%
本期基金份额净值增长率	-6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,171,213.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0907
期末基金资产净值	39,480,230.58
期末基金份额净值	0.858
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-9.60%

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）。

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
过去一个月	0.82%	0.74%	0.38%	0.74%	0.44%	0.00%
过去三个月	1.30%	0.84%	0.84%	0.83%	0.46%	0.01%
过去六个月	-6.88%	0.99%	-6.71%	0.99%	-0.17%	0.00%
过去一年	-2.59%	1.13%	-1.52%	1.11%	-1.07%	0.02%
自基金成立起至今	-9.60%	1.19%	-13.09%	1.21%	3.49%	-0.02%

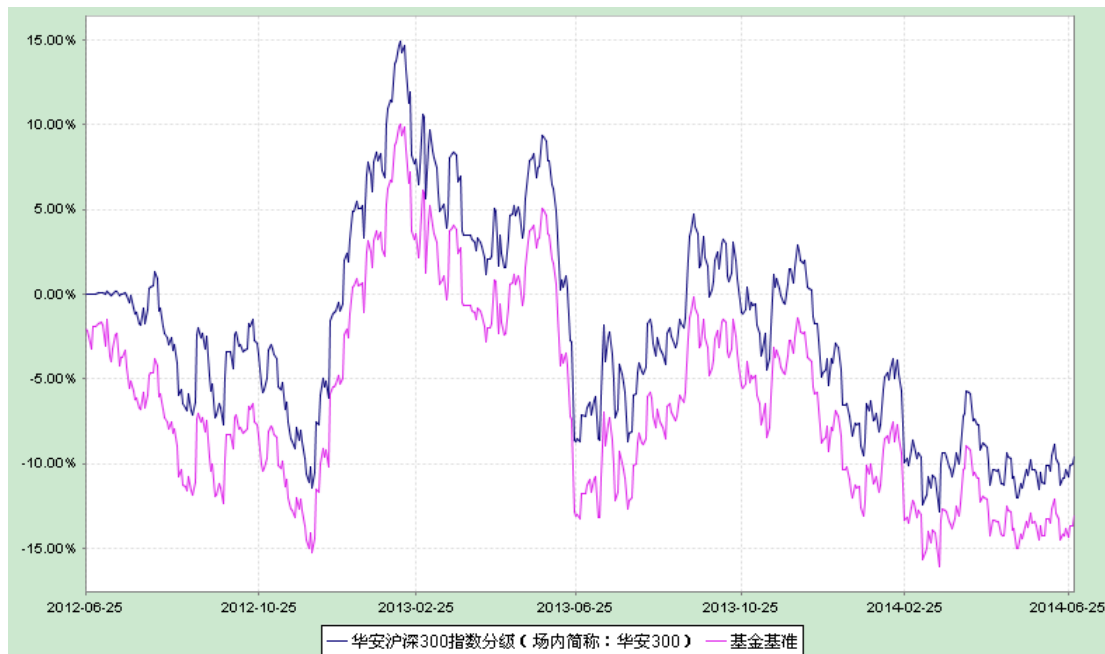
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

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 2014 年 6 月 30 日)



注：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。

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 2014 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安创新混合、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、华安月安鑫短期理财债券、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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺混合等 49 只开放式基金。管理资产规模达到 688.13 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	-	9 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	2014-04-23	6 年	密歇根大学金融工程专业硕士，6 年证券金融从业经历，曾在 Trafelet 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。2013 年 12 月起同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月从华安基金离职。

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 公平交易制度的执行情况

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中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。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 1 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单只股票的数量较小，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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济增速先回落或企稳，政策底部确认。尽管地产投资增速大幅下降，但基建投资拉动稳定了整体投资增速，工业增加值增速企稳；货币政策通过定向降准与再贷款进行微刺激，代表实际经济需求的 PMI 指数低位回升至 50 以上，并且逐月回升，十八大确定的改革方针政策在逐步推进。市场的悲观情绪缓解并逐步转暖，市场参与者既追逐成长主题，同时蓝筹周期板块估值得到一定修复，市场的底部在抬升。本基金在报告期内操作以跟踪指数为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.858 元，本报告期份额净值增长率为 -6.88%，同期业绩比较基准增长率为 -6.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年将是实现全年 GDP 增速目标的重要阶段，三季度地产销售情况以及后续相关信贷政策的跟进值得关注，在此之前沪港通落地或将蓝筹股的估值修复达到顶峰。尽管上市公司中报业绩存在局部风险，但在市场情绪转暖中已不是市场主要关注面，调整后的优质成长股仍然具备中长期配置价值，传统周期板块估值修复的轮动行情值得把握。作为本基金的管理人，我们继续坚持积极基金回报与指数相拟合的原则，控制跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 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，现任华安安顺混合、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利和华安大国新经济股票基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

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，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理，固定收益部副总监。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在存续期内，本基金(包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额)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合规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,878,571.88	2,889,812.18
结算备付金		-	-
存出保证金		2,372.73	10,112.67
交易性金融资产	6.4.7.2	37,346,539.73	44,346,086.61
其中：股票投资		37,337,355.73	44,346,086.61
基金投资		-	-
债券投资		9,184.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	514.88	639.15
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,227,999.22	47,246,650.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		388,889.87	-
应付赎回款		9,381.51	-
应付管理人报酬		32,166.99	41,100.06
应付托管费		7,076.73	9,041.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,686.79	10,610.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	306,566.75	346,000.00
负债合计		747,768.64	406,753.02
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	43,651,443.63	48,225,111.63
未分配利润	6.4.7.10	-4,171,213.05	-1,385,214.04
所有者权益合计		39,480,230.58	46,839,897.59
负债和所有者权益总计		40,227,999.22	47,246,650.61

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额净值 0.858 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值 1.032 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值 0.684 元；基金份额总额 45,996,193.98 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 13,691,201.98 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额 16,152,496.00 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额 16,152,496.00 份。

6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		-2,612,521.77	-5,507,198.25
1.利息收入		9,185.17	20,082.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,180.96	20,023.84
债券利息收入		4.21	58.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-226,212.87	5,997,085.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-682,570.14	5,173,552.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	12,588.72
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	456,357.27	810,944.12
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-2,401,338.09	-11,609,329.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	5,844.02	84,962.99
减：二、费用		548,623.92	939,383.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	202,725.87	422,028.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,599.69	92,846.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	15,313.76	134,294.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	285,984.60	290,213.91
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		-3,161,145.69	-6,446,582.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号 填列）		-3,161,145.69	-6,446,582.22

6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	48,225,111.63	-1,385,214.04	46,839,897.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,161,145.69	-3,161,145.69
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）	-4,573,668.00	375,146.68	-4,198,521.32
其中：1.基金申购款	690,627.03	-46,925.15	643,701.88
2.基金赎回款	-5,264,295.03	422,071.83	-4,842,223.20
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）	43,651,443.63	-4,171,213.05	39,480,230.58
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	124,614,553.20	6,088,361.50	130,702,914.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,446,582.22	-6,446,582.22
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）	-59,539,790.85	-4,303,991.55	-63,843,782.40
其中：1.基金申购款	3,818,626.35	307,191.51	4,125,817.86
2.基金赎回款	-63,358,417.20	-4,611,183.06	-67,969,600.26
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）	65,074,762.35	-4,662,212.27	60,412,550.08

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李勃，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 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%×沪深 300 指数收益率+5%×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 2014 年 8 月 28 日批准报

出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》及其他相关税务法规和实务操作,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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(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派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，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，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	2,878,571.88
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,878,571.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		39,815,082.27	37,337,355.73	-2,477,726.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	9,184.00	1,184.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,000.00	9,184.00	1,184.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,823,082.27	37,346,539.73	-2,476,542.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	509.68
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	-
应收债券利息	4.21
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.99
合计	514.88

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,686.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,686.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	32.02
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	256,534.73
银行手续费	-
应付指数使用费	50,000.00
合计	306,566.75

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,080,360.32	48,225,111.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-881.00	-865.33
基金拆分/份额折算前	49,079,479.32	48,224,246.30
基金拆分/份额折算调整	1,736,377.77	-
本期申购	727,589.42	690,627.03
本期赎回（以“-”号填列）	-5,547,252.53	-5,263,429.70
本期末	45,996,193.98	43,651,443.63

6.4.7.10 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	-2,387,566.29	1,002,352.25	-1,385,214.04
本期利润	-759,807.60	-2,401,338.09	-3,161,145.69
本期基金份额交易产生的变动数	245,964.88	129,181.80	375,146.68
其中：基金申购款	-36,365.75	-10,559.40	-46,925.15
基金赎回款	282,330.63	139,741.20	422,071.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,901,409.01	-1,269,804.04	-4,171,213.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,087.77
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	54.12
其他	39.07
合计	9,180.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,342,557.05
减：卖出股票成本总额	7,025,127.19
买卖股票差价收入	-682,570.14

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	456,357.27
基金投资产生的股利收益	-
合计	456,357.27

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	-2,401,338.09
——股票投资	-2,402,522.09
——债券投资	1,184.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,401,338.09

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	5,844.02
合计	5,844.02

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。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	15,313.76
银行间市场交易费用	-
合计	15,313.76

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	27,769.02
信息披露费	119,012.93
银行汇划费用	449.87
上市年费	29,752.78
帐户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	285,984.60

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：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	202,725.87	422,028.92
其中：支付销售机构的客户 维护费	9,154.56	15,229.86

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	44,599.69	92,846.36

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。

单位：人民币元

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,878,571.88	9,087.77	5,720,542.86	19,444.41

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

在存续期内，本基金(包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额)不进行收益分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600498	烽火通信	2014-06-30	重大事项停牌	11.91	2014-07-07	12.10	3,772	53,899.36	44,924.52	-
600516	方大炭素	2014-06-30	重大事项停牌	9.59	2014-07-02	9.05	6,550	50,401.26	62,814.50	-
600637	百视通	2014-05-29	重大事项停牌	32.03	-	-	5,220	124,725.26	167,196.60	-
600832	东方明珠	2014-05-29	重大事项停牌	10.98	-	-	12,167	66,150.38	133,593.66	-
601669	中国电建	2014-05-13	重大事项停牌	2.79	-	-	29,328	106,690.50	81,825.12	-
000009	中国宝安	2014-05-28	重大事项停牌	10.21	2014-08-15	9.33	9,670	80,958.49	98,730.70	-
000536	华映科技	2014-05-23	重大事项停牌	23.10	2014-08-20	25.41	1,177	30,196.20	27,188.70	-

000562	宏源 证券	2013-1 0-31	重大事 项停牌	8.22	2014-07-28	8.93	10,901	99,711.21	89,606.22	-
000878	云南 铜业	2014-0 4-17	重大事 项停牌	7.61	2014-07-17	7.50	5,532	80,212.08	42,098.52	-
000960	锡业 股份	2014-0 5-06	重大事 项停牌	12.44	2014-08-05	13.68	3,597	49,740.33	44,746.68	-
002570	贝因 美	2014-0 6-19	重大事 项停牌	14.36	-	-	4,675	55,662.74	67,133.00	-

注：本基金截至 2014 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2014 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2014 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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控制委员会，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；根据公司章程，在管理层层面设立合规与风险控制委员会，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。风险管理部向督察长和总裁汇报工作。

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。

6.4.13.2 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 2014 年 6 月 30 日,本基金未持有信用类债券(2013 年 12 月 31 日:同)。因此信用风险的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.3 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 6.4.12 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约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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,878,571.88	-	-	-	2,878,571.88
存出保证金	2,372.73	-	-	-	2,372.73
交易性金融资产	9,184.00	-	-	37,337,355.73	37,346,539.73
应收利息	-	-	-	514.88	514.88
资产总计	2,890,128.61	0.00	0.00	37,337,870.61	40,227,999.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	388,889.87	388,889.87
应付赎回款	-	-	-	9,381.51	9,381.51
应付管理人报酬	-	-	-	32,166.99	32,166.99
应付托管费	-	-	-	7,076.73	7,076.73
应付交易费用	-	-	-	3,686.79	3,686.79
其他负债	-	-	-	306,566.75	306,566.75
负债总计	0.00	0.00	0.00	747,768.64	747,768.64
利率敏感度缺口	2,890,128.61	0.00	0.00	36,590,101.97	39,480,230.58
上年度末 2013 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	2,889,812.18	-	-	-	2,889,812.18
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	10,112.67	-	-	-	10,112.67
交易性金融资产	-	-	-	44,346,086.61	44,346,086.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	639.15	639.15
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	2,899,924.85	-	-	44,346,725.76	47,246,650.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	41,100.06	41,100.06
应付托管费	-	-	-	9,041.99	9,041.99
应付交易费用	-	-	-	10,610.97	10,610.97
其他负债	-	-	-	346,000.00	346,000.00
负债总计	-	-	-	406,753.02	406,753.02
利率敏感度缺口	2,899,924.85	-	-	43,939,972.74	46,839,897.59

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 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%(2013 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(2013 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	37,337,355.73	94.57	44,346,086.61	94.68
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,337,355.73	94.57	44,346,086.61	94.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以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）	
		本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加约198.00万元	增加约236.00万元
	业绩比较基准下降5%	减少约198.00万元	减少约236.00万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 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	37,337,355.73	92.81
	其中：股票	37,337,355.73	92.81
2	固定收益投资	9,184.00	0.02
	其中：债券	9,184.00	0.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,878,571.88	7.16
7	其他各项资产	2,887.61	0.01
8	合计	40,227,999.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	119,190.45	0.30
B	采矿业	2,091,437.65	5.30
C	制造业	13,609,877.86	34.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,317,136.54	3.34
E	建筑业	1,167,995.51	2.96
F	批发和零售业	1,011,238.62	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	922,333.58	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,468,197.06	3.72
J	金融业	12,515,380.08	31.70
K	房地产业	1,750,543.82	4.43

L	租赁和商务服务业	330,392.84	0.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	352,490.99	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	318,917.53	0.81
S	综合	331,159.64	0.84
	合计	37,306,292.17	94.49

7.2.2 积极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	31,063.56	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,063.56	0.08

7.3 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

7.3.1 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	601318	中国平安	36,158	1,422,455.72	3.60
2	600036	招商银行	129,963	1,330,821.12	3.37
3	600016	民生银行	213,508	1,325,884.68	3.36
4	601166	兴业银行	89,960	902,298.80	2.29
5	600000	浦发银行	88,116	797,449.80	2.02
6	000002	万 科 A	73,318	606,339.86	1.54
7	600030	中信证券	52,105	597,123.30	1.51
8	600837	海通证券	62,286	569,916.90	1.44
9	000651	格力电器	18,228	536,814.60	1.36
10	601288	农业银行	204,493	515,322.36	1.31
11	600519	贵州茅台	3,534	501,757.32	1.27
12	601328	交通银行	123,640	479,723.20	1.22
13	000001	平安银行	44,959	445,543.69	1.13
14	601398	工商银行	128,428	435,370.92	1.10
15	601601	中国太保	23,718	421,943.22	1.07
16	600104	上汽集团	25,042	383,142.60	0.97
17	601088	中国神华	24,972	363,092.88	0.92
18	600887	伊利股份	10,754	356,172.48	0.90
19	601169	北京银行	41,512	334,586.72	0.85
20	601818	光大银行	127,397	323,588.38	0.82
21	601668	中国建筑	113,546	320,199.72	0.81
22	600383	金地集团	33,815	300,615.35	0.76
23	600015	华夏银行	34,994	286,950.80	0.73
24	601006	大秦铁路	45,004	283,975.24	0.72
25	000858	五 粮 液	14,342	257,152.06	0.65
26	000333	美的集团	13,050	252,126.00	0.64
27	600048	保利地产	49,153	243,798.88	0.62
28	600585	海螺水泥	15,098	237,340.56	0.60
29	600900	长江电力	37,476	233,100.72	0.59
30	002024	苏宁云商	34,101	223,702.56	0.57
31	600028	中国石化	41,687	219,690.49	0.56
32	000776	广发证券	22,351	219,039.80	0.55
33	000538	云南白药	4,066	212,245.20	0.54
34	600111	包钢稀土	10,768	211,591.20	0.54
35	600050	中国联通	64,162	207,243.26	0.52
36	600089	特变电工	24,359	206,807.91	0.52
37	601857	中国石油	26,390	198,980.60	0.50
38	000063	中兴通讯	14,844	194,753.28	0.49
39	601989	中国重工	39,686	191,286.52	0.48

40	600276	恒瑞医药	5,701	189,045.16	0.48
41	600535	天士力	4,841	187,685.57	0.48
42	600690	青岛海尔	12,362	182,463.12	0.46
43	000895	双汇发展	5,031	180,059.49	0.46
44	600011	华能国际	31,790	179,931.40	0.46
45	600999	招商证券	17,563	177,561.93	0.45
46	000625	长安汽车	14,212	174,949.72	0.44
47	002594	比亚迪	3,658	173,718.42	0.44
48	600196	复星医药	8,594	173,512.86	0.44
49	600518	康美药业	11,568	172,941.60	0.44
50	600637	百视通	5,220	167,196.60	0.42
51	600256	广汇能源	23,639	165,945.78	0.42
52	000725	京东方 A	74,730	162,164.10	0.41
53	601766	中国南车	35,597	160,186.50	0.41
54	601688	华泰证券	21,161	159,130.72	0.40
55	600739	辽宁成大	10,267	156,366.41	0.40
56	002241	歌尔声学	5,817	155,081.22	0.39
57	002415	海康威视	9,066	153,578.04	0.39
58	601628	中国人寿	11,275	153,452.75	0.39
59	600019	宝钢股份	37,412	153,389.20	0.39
60	600018	上港集团	34,405	153,102.25	0.39
61	601901	方正证券	27,666	150,226.38	0.38
62	600352	浙江龙盛	9,120	147,288.00	0.37
63	000157	中联重科	33,229	147,204.47	0.37
64	000100	TCL 集团	64,149	146,259.72	0.37
65	600406	国电南瑞	10,958	146,070.14	0.37
66	601299	中国北车	31,249	141,870.46	0.36
67	000338	潍柴动力	7,968	141,750.72	0.36
68	600795	国电电力	65,177	141,434.09	0.36
69	000423	东阿阿胶	4,087	136,178.84	0.34
70	600703	三安光电	5,758	134,909.94	0.34
71	600315	上海家化	3,677	134,762.05	0.34
72	601336	新华保险	6,356	134,302.28	0.34
73	600832	东方明珠	12,167	133,593.66	0.34
74	600886	国投电力	25,679	130,962.90	0.33
75	601009	南京银行	16,303	130,424.00	0.33
76	601899	紫金矿业	59,769	130,296.42	0.33
77	002450	康得新	5,702	129,720.50	0.33
78	000069	华侨城 A	27,487	128,914.03	0.33
79	002304	洋河股份	2,531	128,448.25	0.33
80	601988	中国银行	49,974	127,433.70	0.32

81	600309	万华化学	8,131	123,265.96	0.31
82	002353	杰瑞股份	3,060	123,165.00	0.31
83	000581	威孚高科	4,523	121,985.31	0.31
84	000783	长江证券	12,567	120,643.20	0.31
85	002236	大华股份	4,476	120,628.20	0.31
86	600804	鹏博士	8,239	118,971.16	0.30
87	600031	三一重工	22,998	115,909.92	0.29
88	002230	科大讯飞	4,355	115,843.00	0.29
89	002008	大族激光	6,600	114,444.00	0.29
90	000503	海虹控股	5,700	111,150.00	0.28
91	600066	宇通客车	6,794	109,655.16	0.28
92	600893	航空动力	4,255	109,651.35	0.28
93	002202	金风科技	11,546	109,571.54	0.28
94	600600	青岛啤酒	2,718	108,883.08	0.28
95	601186	中国铁建	23,234	107,108.74	0.27
96	002065	东华软件	5,291	106,454.92	0.27
97	000768	中航飞机	10,080	106,142.40	0.27
98	600332	白云山	4,185	104,164.65	0.26
99	600340	华夏幸福	4,133	104,027.61	0.26
100	002142	宁波银行	11,273	103,711.60	0.26
101	600100	同方股份	11,569	103,079.79	0.26
102	000793	华闻传媒	8,693	102,142.75	0.26
103	601377	兴业证券	11,722	101,043.64	0.26
104	601390	中国中铁	38,804	100,114.32	0.25
105	000402	金 融 街	18,342	99,963.90	0.25
106	601998	中信银行	23,282	99,414.14	0.25
107	000009	中国宝安	9,670	98,730.70	0.25
108	600079	人福医药	3,304	98,624.40	0.25
109	600583	海油工程	13,376	98,581.12	0.25
110	002038	双鹭药业	2,141	95,424.37	0.24
111	002081	金 螳 螂	6,709	94,999.44	0.24
112	600009	上海机场	7,246	93,473.40	0.24
113	000400	许继电气	4,609	92,410.45	0.23
114	000963	华东医药	1,695	91,530.00	0.23
115	600150	中国船舶	4,306	90,684.36	0.23
116	600705	中航投资	5,636	90,570.52	0.23
117	600271	航天信息	4,328	90,325.36	0.23
118	000826	桑德环境	3,938	89,983.30	0.23
119	601607	上海医药	7,231	89,881.33	0.23
120	000562	宏源证券	10,901	89,606.22	0.23
121	600660	福耀玻璃	10,546	88,586.40	0.22

122	002400	省广股份	3,600	88,488.00	0.22
123	000039	中集集团	6,572	88,459.12	0.22
124	600718	东软集团	6,549	88,346.01	0.22
125	600010	包钢股份	24,246	87,770.52	0.22
126	002465	海格通信	5,500	87,615.00	0.22
127	600674	川投能源	7,453	87,498.22	0.22
128	000568	泸州老窖	5,328	87,272.64	0.22
129	600085	同仁堂	4,994	87,045.42	0.22
130	600839	四川长虹	27,917	85,984.36	0.22
131	600118	中国卫星	4,618	85,340.64	0.22
132	000917	电广传媒	5,600	85,288.00	0.22
133	000623	吉林敖东	5,453	84,630.56	0.21
134	600489	中金黄金	11,065	84,094.00	0.21
135	600547	山东黄金	5,422	83,932.56	0.21
136	600177	雅戈尔	11,712	82,335.36	0.21
137	000024	招商地产	7,876	82,067.92	0.21
138	601669	中国电建	29,328	81,825.12	0.21
139	601808	中海油服	4,625	81,353.75	0.21
140	601991	大唐发电	22,637	80,587.72	0.20
141	000831	五矿稀土	3,831	80,374.38	0.20
142	600109	国金证券	4,043	80,334.41	0.20
143	601633	长城汽车	3,139	79,416.70	0.20
144	601929	吉视传媒	6,900	78,936.00	0.20
145	601168	西部矿业	14,404	78,789.88	0.20
146	002475	立讯精密	2,400	78,672.00	0.20
147	600252	中恒集团	6,655	78,063.15	0.20
148	002410	广联达	2,939	77,707.16	0.20
149	601117	中国化学	14,900	77,629.00	0.20
150	600362	江西铜业	6,326	77,620.02	0.20
151	000970	中科三环	6,493	77,136.84	0.20
152	600741	华域汽车	7,771	76,000.38	0.19
153	601888	中国国旅	2,288	75,595.52	0.19
154	600597	光明乳业	4,665	74,826.60	0.19
155	002422	科伦药业	1,875	74,718.75	0.19
156	600221	海南航空	44,701	74,650.67	0.19
157	600642	申能股份	17,157	74,118.24	0.19
158	000060	中金岭南	10,859	73,841.20	0.19
159	000792	盐湖股份	4,848	73,059.36	0.19
160	600867	通化东宝	5,600	72,968.00	0.18
161	600369	西南证券	8,491	72,598.05	0.18
162	600153	建发股份	13,094	71,362.30	0.18

163	600649	城投控股	11,230	70,749.00	0.18
164	000061	农产品	7,660	70,701.80	0.18
165	000728	国元证券	7,386	69,723.84	0.18
166	002385	大北农	6,112	69,432.32	0.18
167	000729	燕京啤酒	10,558	68,627.00	0.17
168	000012	南玻A	9,974	68,122.42	0.17
169	000629	攀钢钒钛	32,497	67,593.76	0.17
170	002570	贝因美	4,675	67,133.00	0.17
171	601800	中国交建	17,704	66,567.04	0.17
172	601600	中国铝业	21,714	66,010.56	0.17
173	601018	宁波港	29,007	65,845.89	0.17
174	002456	欧菲光	3,072	65,832.96	0.17
175	601333	广深铁路	25,664	65,186.56	0.17
176	600166	福田汽车	12,759	65,070.90	0.16
177	600108	亚盛集团	11,705	64,728.65	0.16
178	000598	兴蓉投资	13,549	64,628.73	0.16
179	600827	友谊股份	5,877	64,529.46	0.16
180	600068	葛洲坝	17,380	64,479.80	0.16
181	601555	东吴证券	9,024	64,250.88	0.16
182	000425	徐工机械	9,308	63,759.80	0.16
183	600372	中航电子	2,800	63,476.00	0.16
184	600588	用友软件	4,495	63,244.65	0.16
185	601618	中国中冶	36,894	63,088.74	0.16
186	600516	方大炭素	6,550	62,814.50	0.16
187	601933	永辉超市	9,889	62,498.48	0.16
188	000983	西山煤电	11,840	62,396.80	0.16
189	600880	博瑞传播	5,200	61,568.00	0.16
190	600029	南方航空	26,560	61,353.60	0.16
191	000778	新兴铸管	16,487	61,166.77	0.15
192	601098	中南传媒	4,209	60,777.96	0.15
193	600875	东方电气	5,072	60,204.64	0.15
194	000709	河北钢铁	32,148	59,795.28	0.15
195	000876	新希望	5,296	59,791.84	0.15
196	000800	一汽轿车	6,200	59,520.00	0.15
197	002007	华兰生物	2,269	59,220.90	0.15
198	600497	驰宏锌锗	6,354	58,520.34	0.15
199	600267	海正药业	3,935	58,356.05	0.15
200	601179	中国西电	16,300	58,191.00	0.15
201	600060	海信电器	5,982	57,726.30	0.15
202	600316	洪都航空	3,361	57,439.49	0.15
203	000999	华润三九	3,059	56,255.01	0.14

204	002375	亚厦股份	2,482	55,993.92	0.14
205	601898	中煤能源	13,838	55,767.14	0.14
206	600655	豫园商城	7,567	55,693.12	0.14
207	600208	新湖中宝	18,952	55,339.84	0.14
208	600863	内蒙华电	14,623	55,128.71	0.14
209	002292	奥飞动漫	1,500	55,050.00	0.14
210	600027	华电国际	17,903	54,962.21	0.14
211	601118	海南橡胶	8,870	54,461.80	0.14
212	600688	上海石化	16,525	54,367.25	0.14
213	002146	荣盛发展	5,705	54,026.35	0.14
214	601928	凤凰传媒	5,818	53,991.04	0.14
215	000839	中信国安	7,076	53,777.60	0.14
216	002310	东方园林	3,253	53,707.03	0.14
217	600549	厦门钨业	2,111	53,619.40	0.14
218	000686	东北证券	7,457	53,466.69	0.14
219	601699	潞安环能	7,015	53,243.85	0.13
220	600436	片仔癀	686	53,185.58	0.13
221	002001	新 和 成	4,252	52,682.28	0.13
222	600143	金发科技	11,877	52,377.57	0.13
223	002129	中环股份	2,746	52,366.22	0.13
224	600415	小商品城	10,333	51,974.99	0.13
225	601958	金钼股份	7,280	51,396.80	0.13
226	600008	首创股份	8,273	51,127.14	0.13
227	600348	阳泉煤业	9,043	51,002.52	0.13
228	600663	陆家嘴	3,182	50,402.88	0.13
229	600648	外高桥	1,881	50,109.84	0.13
230	000750	国海证券	5,282	49,914.90	0.13
231	002500	山西证券	7,578	49,181.22	0.12
232	601231	环旭电子	1,581	48,758.04	0.12
233	000630	铜陵有色	5,416	48,527.36	0.12
234	601238	广汽集团	6,434	48,448.02	0.12
235	603000	人民网	1,224	47,968.56	0.12
236	600062	华润双鹤	2,679	46,052.01	0.12
237	002294	信立泰	1,532	45,990.64	0.12
238	000758	中色股份	4,615	45,873.10	0.12
239	600216	浙江医药	4,993	45,685.95	0.12
240	601992	金隅股份	8,081	45,415.22	0.12
241	600498	烽火通信	3,772	44,924.52	0.11
242	600664	哈药股份	7,211	44,852.42	0.11
243	000960	锡业股份	3,597	44,746.68	0.11
244	600115	东方航空	19,256	44,481.36	0.11

245	000883	湖北能源	8,400	44,268.00	0.11
246	600219	南山铝业	8,729	43,819.58	0.11
247	002344	海宁皮城	3,499	43,632.53	0.11
248	000413	东旭光电	5,700	42,750.00	0.11
249	601111	中国国航	12,898	42,434.42	0.11
250	000878	云南铜业	5,532	42,098.52	0.11
251	600123	兰花科创	5,223	39,276.96	0.10
252	600157	永泰能源	16,361	38,775.57	0.10
253	002429	兆驰股份	5,000	38,700.00	0.10
254	600895	张江高科	5,901	38,474.52	0.10
255	601866	中海集运	17,929	37,830.19	0.10
256	002106	莱宝高科	3,308	37,380.40	0.09
257	600259	广晟有色	965	36,891.95	0.09
258	600873	梅花生物	7,107	36,458.91	0.09
259	600376	首开股份	8,430	36,417.60	0.09
260	002399	海普瑞	1,947	36,369.96	0.09
261	601666	平煤股份	8,879	35,871.16	0.09
262	601158	重庆水务	7,221	35,671.74	0.09
263	600170	上海建工	8,247	35,379.63	0.09
264	600058	五矿发展	3,349	35,331.95	0.09
265	000027	深圳能源	6,200	34,844.00	0.09
266	000401	冀东水泥	4,210	34,227.30	0.09
267	600998	九州通	2,500	33,475.00	0.08
268	002470	金正大	1,700	32,623.00	0.08
269	002653	海思科	1,688	32,409.60	0.08
270	600188	兖州煤业	4,624	31,998.08	0.08
271	601216	内蒙君正	3,000	31,590.00	0.08
272	000937	冀中能源	5,288	30,829.04	0.08
273	002673	西部证券	2,812	30,369.60	0.08
274	002051	中工国际	1,792	29,030.40	0.07
275	600023	浙能电力	6,240	28,204.80	0.07
276	000718	苏宁环球	6,228	28,088.28	0.07
277	600783	鲁信创投	1,744	28,008.64	0.07
278	000536	华映科技	1,177	27,188.70	0.07
279	600809	山西汾酒	2,029	26,945.12	0.07
280	600546	山煤国际	7,455	26,688.90	0.07
281	601258	庞大集团	5,993	26,309.27	0.07
282	002603	以岭药业	881	25,919.02	0.07
283	000869	张裕 A	1,063	25,628.93	0.06
284	600633	浙报传媒	1,900	25,213.00	0.06
285	600096	云天化	3,528	24,801.84	0.06

286	600395	盘江股份	3,878	24,702.86	0.06
287	002416	爱施德	1,600	23,760.00	0.06
288	603699	纽威股份	1,200	23,364.00	0.06
289	601918	国投新集	7,793	21,742.47	0.06
290	600277	亿利能源	3,300	21,450.00	0.05
291	601139	深圳燃气	3,094	20,667.92	0.05
292	600403	大有能源	3,735	19,758.15	0.05
293	000656	金科股份	2,715	18,706.35	0.05
294	000961	中南建设	2,737	17,872.61	0.05
295	601225	陕西煤业	4,000	16,520.00	0.04
296	000156	华数传媒	542	15,224.78	0.04
297	002269	美邦服饰	1,570	13,046.70	0.03
298	603993	洛阳钼业	1,562	10,465.40	0.03

7.3.2 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

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	002069	獐子岛	2,222	31,063.56	0.08

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000503	海虹控股	113,772.00	0.24
2	002008	大族激光	112,444.00	0.24
3	002465	海格通信	85,189.00	0.18
4	002400	省广股份	84,933.00	0.18
5	000917	电广传媒	83,216.00	0.18
6	601929	吉视传媒	81,884.00	0.17
7	000001	平安银行	81,333.00	0.17
8	002410	广联达	76,481.00	0.16
9	002475	立讯精密	74,184.00	0.16
10	600867	通化东宝	70,728.00	0.15
11	600880	博瑞传播	64,220.00	0.14
12	601179	中国西电	59,634.00	0.13
13	600372	中航电子	54,982.02	0.12
14	002292	奥飞动漫	50,994.00	0.11

15	601318	中国平安	47,593.00	0.10
16	000413	东旭光电	46,683.00	0.10
17	600036	招商银行	44,980.00	0.10
18	000883	湖北能源	43,773.00	0.09
19	600016	民生银行	43,097.00	0.09
20	002429	兆驰股份	38,500.00	0.08

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。

7.4.2 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	601318	中国平安	232,785.94	0.50
2	600016	民生银行	216,455.88	0.46
3	600036	招商银行	215,939.05	0.46
4	601166	兴业银行	139,906.19	0.30
5	600000	浦发银行	133,280.61	0.28
6	600837	海通证券	99,242.92	0.21
7	600030	中信证券	97,945.23	0.21
8	000002	万科 A	91,932.57	0.20
9	000651	格力电器	86,436.39	0.18
10	601288	农业银行	79,976.50	0.17
11	601328	交通银行	75,752.59	0.16
12	601989	中国重工	72,928.95	0.16
13	601398	工商银行	72,238.97	0.15
14	000001	平安银行	67,231.30	0.14
15	600694	大商股份	65,306.95	0.14
16	600887	伊利股份	65,219.65	0.14
17	601601	中国太保	64,122.13	0.14
18	601099	太平洋	62,976.69	0.13
19	600811	东方集团	61,653.33	0.13
20	600372	中航电子	60,635.40	0.13

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。

7.4.3 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	2,418,918.40
卖出股票的收入（成交）总额	6,342,557.05

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。

7.5 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	9,184.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	9,184.00	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110025	国金转债	80	9,184.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

无

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,372.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	514.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,887.61

7.12.4 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。

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 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不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
华安沪深 300 指 数分级 A (场内简 称: 华安 300A)	205	78,792.66	12,954,926.00	80.20%	3,197,570.00	19.80%
华安沪深 300 指 数分级 B (场内简 称: 华安 300B)	395	40,892.39	3,951,901.00	24.47%	12,200,595.00	75.53%
华安沪深 300 指 数分级 (场内简 称: 华安 300)	258	53,066.67	7,341,581.25	53.62%	6,349,620.73	46.38%
合计	858	53,608.62	24,248,408.25	52.72%	21,747,785.73	47.28%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华安沪深300指数分级A (场内简称: 华安300A)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	华汇人寿保险股份 有限公司一分红险	10,398,118.00	64.37%
2	山西潞安矿业 (集 团) 有限责任公司 企业年金计划—中 国工商银行	2,508,011.00	15.53%
3	解玲	345,100.00	2.14%
4	童卫	250,061.00	1.55%
5	谷世红	201,541.00	1.25%
6	蔡捷	151,582.00	0.94%
7	张庆云	138,895.00	0.86%
8	刘岚	122,114.00	0.76%
9	路晓茵	100,751.00	0.62%

10	贾楠	100,007.00	0.62%
----	----	------------	-------

华安沪深300指数分级B（场内简称：华安300B）

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	2,314,200.00	14.33%
2	中信证券股份有限公司	1,637,701.00	10.14%
3	周文辉	1,472,000.00	9.11%
4	张有树	538,109.00	3.33%
5	陈月甜	525,064.00	3.25%
6	谢丽娟	500,500.00	3.10%
7	杨珊珊	500,000.00	3.10%
8	吴为军	450,400.00	2.79%
9	赵行伦	368,700.00	2.28%
10	解玲	355,000.00	2.20%

8.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	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	-	-
	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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 指数分级 A（场内简称：华安 300A）	华安沪深 300 指数分级 B（场内简称：华安 300B）	华安沪深 300 指数分级（场内简称：华安 300）
基金合同生效日(2012 年 6 月 25 日)基金份额总额	197,289,916	197,289,916	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	16,119,778	16,119,778	16,840,804.32
本报告期基金总申购份额	-	-	727,589.42
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	5,548,133.53
本报告期基金拆分变动份额	32,718	32,718	1,670,941.77
本报告期期末基金份额总额	16,152,496	16,152,496	13,691,201.98

10 大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			的比例			
财达证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有 限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

申银万国证券股份有限公司	1	2,728,019.97	31.31%	2,413.99	30.70%	-
天风证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	5,985,444.83	68.69%	5,449.17	69.30%	-
中银国际证券有限责任公司	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和合规性进行阐述。

(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) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

10.7.2 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
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
广州证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 有限负责公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-

中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

10.8 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期间华安300A份额停牌 的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中 国证券报》和公司 网站	2014-01-03
2	关于华安沪深300指数分级证券投资基金之 华安沪深300A份额2014年度约定年基准收益 率的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中 国证券报》和公司 网站	2014-01-03
3	关于华安沪深300A份额定期份额折算后次日 前收盘价调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中 国证券报》和公司 网站	2014-01-06
4	关于华安沪深300指数分级证券投资基金定 期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中 国证券报》和公司 网站	2014-01-06
5	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	2014-03-13
6	华安沪深300指数分级证券投资基金基金经 理变更公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中 国证券报》和公司 网站	2014-04-23
7	关于电子直销平台“微钱宝”账户转换交易 费率优惠的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、《中	2014-06-10

		国证券报》和公司网站	
8	关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-12
9	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	2014-06-13

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。

11 备查文件目录

11.1 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；

11.2 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>。

11.3 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
二〇一四年八月二十九日