

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

2015 年半年度报告

2015 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：二〇一五年八月二十八日

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 2015 年 8 月 25 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 2015 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	7
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	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说 明	16
5.3	托管人对本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	16
6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	20
7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47

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	47
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	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
9	开放式基金份额变动	51
10	大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	52
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	55
11	备查文件目录	58
11.1	备查文件目录	58
11.2	存放地点	58
11.3	查阅方式	58

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	28,180,138.31份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳		
上市日期	2012年7月23日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深300指数分级 A	华安沪深300指数分级 B	华安沪深300指数分级
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	11998208.00	11998208.00	4183722.31

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		朱学华	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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	31,897,888.00
本期利润	22,420,338.98
加权平均基金份额本期利润	0.4000
本期加权平均净值利润率	27.11%
本期基金份额净值增长率	24.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,872,444.42
期末可供分配基金份额利润	0.7052
期末基金资产净值	45,978,250.68
期末基金份额净值	1.632
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	76.08%

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	-7.59%	3.32%	-7.22%	3.32%	-0.37%	0.00%
过去三个	10.05%	2.45%	9.90%	2.48%	0.15%	-0.03%

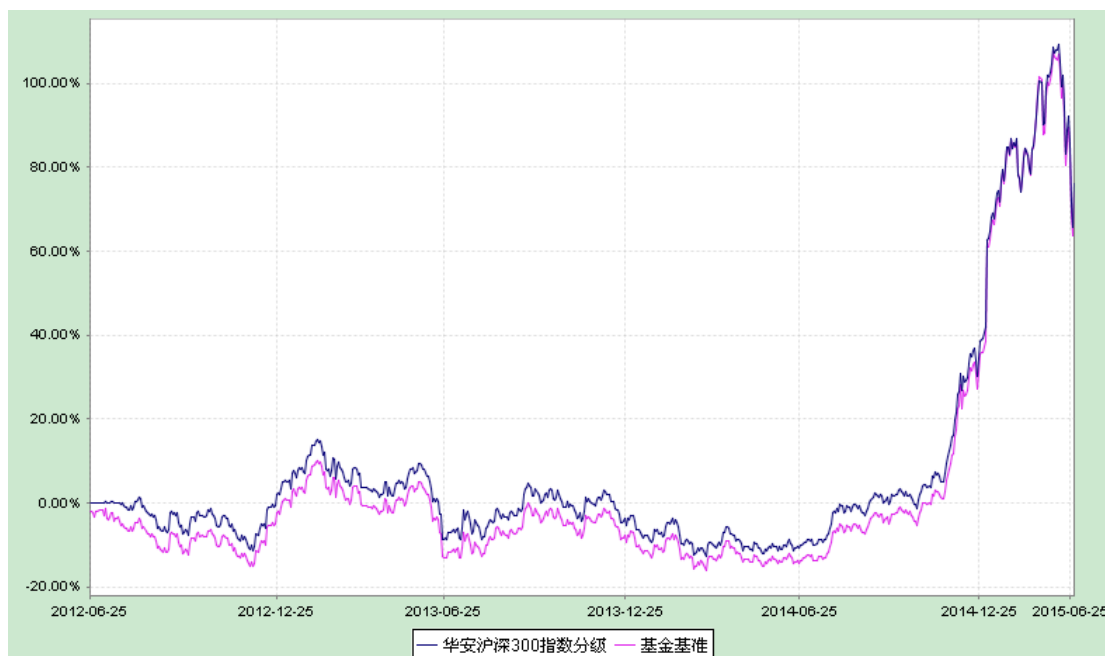
月						
过去六个月	24.16%	2.13%	25.26%	2.15%	-1.10%	-0.02%
过去一年	94.78%	1.71%	101.28%	1.75%	-6.50%	-0.04%
过去三年	76.08%	1.40%	77.68%	1.42%	-1.60%	-0.02%
自基金成立起至今	76.08%	1.39%	74.20%	1.42%	1.88%	-0.03%

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 2015 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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、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、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等 67 只开放式基金。管理资产规模达到 1214.76 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	2015-05-28	10 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），10 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 月至 2015 年 5 月同时担任本基金的基金经理。2014 年 12 月起担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。
钱晶	本基金的基金经理	2015-05-28	-	3 年	硕士, 3 年证券、基金行业从业经验, 曾任国信证券分析师。2014 年 12 月加入华安基金, 任指数投资部量化分析师。2015 年 5 月起担任本基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、邮件发送、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，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易

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, 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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合, 在不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析, 未发现违反公平交易原则的异常情况。

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年以来, 我国经济基本面稳重趋缓, 实体经济存在一定的压力。上半年, 央行多次降息降准, 货币层面宽松, 简政放权, 鼓励创新创业等政策为经济带来新的动力。居民财富结构逐步向权益类市场倾斜, 股票和基金开户数创历史新高, 总体资产配置趋势对股票市

场有利。A 股国际化方面获得新的进展，以沪港通为代表，国际上新的资金不断涌入 A 股股市，首先利好以沪深 300 为代表的一线蓝筹股。

上半年，沪深 300 指数上涨 27.47%。一、二月在获利回吐的压力下有所回调，在新增资金的推动下，沪深 300 指数在三、四月增长迅猛，连续突破 4000，5000 点大关。进入六月，沪深 300 指数和全市场一起，经历了快速的回调。其背后原因一方面是前期过快增长有回调的压力，另一方面也是资本市场上快速去杠杆的效应。

总体来看，沪深 300 指数今年表现在全球范围内还是相当不错的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.632 元，本报告期份额净值增长率为 24.16%，同期业绩比较基准增长率为 25.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了全面且充分的调整后，市场的资金结构更健康，投资价值得到突显，夯实了行情向上的基础，总体上我们认为沪深 300 指数下半年的投资机遇大过风险。

首先，市场将保持宽裕的流动性。在宏观经济增速下台阶的大背景下，货币政策已步入降息周期，外汇收入放缓使被动投放的货币减少，要保持 M2 合理适当增长，就有注入较多流动性对冲的必要，预计下半年还会有两次降准及降息空间，这将为股市提供充裕的流动性支持。其次，改革+转型+升级+宽松宏观经济政策有力地支撑了对经济稳健增长的信心，有利股市。第三，国企改革预期持续发力。下半年随着国企改革进程的加快推进，有望为股市提供新一轮的上涨动力，这个主题投资导向具有长期性，几乎可肯定会贯穿本轮牛市始末。

作为沪深 300 指数分级基金的管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，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：基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，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，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历，15 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，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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、华安现金富利货币、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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。

公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接基金、华安中证高分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理，指数投资部高级总监。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等信息的真实、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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,862,233.95	8,031,159.50
结算备付金		59,381.33	275,066.76
存出保证金		46,840.10	9,869.70
交易性金融资产	6.4.7.2	43,388,835.47	92,781,422.97
其中: 股票投资		43,377,210.67	92,754,074.66
基金投资		-	-
债券投资		11,624.80	27,348.31
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		1,639,485.43	1,357,117.28
应收利息	6.4.7.5	526.87	2,304.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	49,524.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		46,997,303.15	102,506,465.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		-	-
应付赎回款		647,450.76	3,604,166.82
应付管理人报酬		45,398.39	96,383.85
应付托管费		9,987.65	21,204.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	87,240.82	122,261.41
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	228,974.85	439,391.20
负债合计		1,019,052.47	4,283,407.72
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	26,105,806.26	69,232,941.57
未分配利润	6.4.7.10	19,872,444.42	28,990,116.17
所有者权益合计		45,978,250.68	98,223,057.74

负债和所有者权益总计		46,997,303.15	102,506,465.46
------------	--	---------------	----------------

注：报告截止日 2015 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 1.632 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额参考净值 1.031 元，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额参考净值 2.233 元；基金份额总额 28,180,138.31 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 4,183,722.31 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额 11,998,208.00 份，华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额 11,998,208.00 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		23,398,045.89	-2,612,521.77
1.利息收入		20,825.43	9,185.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,785.52	9,180.96
债券利息收入		39.91	4.21
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）		32,730,081.78	-226,212.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,348,898.85	-682,570.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,569.72	-
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	359,613.21	456,357.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-9,477,549.02	-2,401,338.09
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	124,687.70	5,844.02
减：二、费用		977,706.91	548,623.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	412,679.56	202,725.87

2. 托管费	6.4.10.2.2	90,789.50	44,599.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	182,426.17	15,313.76
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	291,811.68	285,984.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,420,338.98	-3,161,145.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,420,338.98	-3,161,145.69

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	69,232,941.57	28,990,116.17	98,223,057.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,420,338.98	22,420,338.98
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）	-43,127,135.31	-31,538,010.73	-74,665,146.04
其中：1.基金申购款	14,719,879.31	11,978,951.75	26,698,831.06
2.基金赎回款	-57,847,014.62	-43,516,962.48	-101,363,977.10
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）	26,105,806.26	19,872,444.42	45,978,250.68
项目	上年度可比期间 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

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：朱学华，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： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2015 年 8 月 27 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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

除下述会计估计变更的说明以外，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

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,862,233.95
定期存款	-

其他存款	-
合计	1,862,233.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		31,528,964.20	43,377,210.67	11,848,246.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	11,624.80	3,624.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,000.00	11,624.80	3,624.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		31,536,964.20	43,388,835.47	11,851,871.27

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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	480.21
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	24.03
应收债券利息	0.67
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.97
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.99
合计	526.87

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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	87,240.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	87,240.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,440.12
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	176,534.73
银行手续费	-
指数使用费	50,000.00
合计	228,974.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,969,683.20	69,232,941.57
本期申购	147,088.26	139,547.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,454,529.51	-1,379,961.38
基金拆分/份额折算前	71,662,241.95	67,992,527.80
基金拆分/份额折算调整	1,721,040.76	-
本期申购	15,737,752.50	14,580,331.70
本期赎回（以“-”号填列）	-60,940,896.90	-56,467,053.24
本期末	28,180,138.31	26,105,806.26

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	3,715,663.53	25,274,452.64	28,990,116.17
本期利润	31,897,888.00	-9,477,549.02	22,420,338.98
本期基金份额交易产生的变动数	-11,687,221.11	-19,850,789.62	-31,538,010.73

其中：基金申购款	6,406,595.48	5,572,356.27	11,978,951.75
基金赎回款	-18,093,816.59	-25,423,145.89	-43,516,962.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,926,330.42	-4,053,886.00	19,872,444.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,655.30
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	772.96
其他	357.26
合计	20,785.52

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	85,702,760.48
减：卖出股票成本总额	53,353,861.63
买卖股票差价收入	32,348,898.85

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,713.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,100.00
减：应收利息总额	44.08
债券投资收益	21,569.72

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	359,613.21
基金投资产生的股利收益	-
合计	359,613.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-9,477,549.02
——股票投资	-9,475,925.51
——债券投资	-1,623.51
——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	-9,477,549.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	124,687.70
合计	124,687.70

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	182,426.17
银行间市场交易费用	-
合计	182,426.17

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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	1,776.95
上市年费	29,752.78
帐户维护费	13,500.00
指数使用费	100,000.00
合计	291,811.68

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、注册登记机构、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 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2015年1月1日至2015年6月 30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	412,679.56	202,725.87
其中：支付销售机构的客户维护费	9,687.25	9,154.56

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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	90,789.50	44,599.69

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。

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,862,233.95	19,655.30	2,878,571.88	9,087.77

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（2015 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
000024	招商地产	2015-04-03	重大资产重组	36.43	-	-	10,047	166,066.11	366,012.21	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	筹划非公开发行股票	8.44	-	-	15,062	107,199.84	127,123.28	-
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项停牌	7.00	2015-08-24	6.30	16,872	54,452.86	118,104.00	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	筹划非公开发行股票	12.96	-	-	9,005	48,222.32	116,704.80	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项停牌	20.75	-	-	4,632	57,386.95	96,114.00	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项停牌	23.57	-	-	4,096	45,395.06	96,542.72	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项停牌	24.50	-	-	3,624	53,389.51	88,788.00	-
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项停牌	42.89	-	-	3,167	54,515.60	135,832.63	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项停牌	71.48	2015-08-05	69.20	986	52,588.19	70,479.28	-
002001	新 和 成	2015-06-30	筹划员工持股计划	17.09	2015-07-13	18.49	2,898	43,576.69	49,526.82	-
002069	獐 子 岛	2015-06-01	重大事项停牌	19.76	-	-	1,484	27,012.99	29,323.84	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	筹划非公开发行股票	37.85	-	-	2,834	47,251.64	107,266.90	-
002310	东方园林	2015-05-27	重大事项停牌	38.30	-	-	2,131	39,175.90	81,617.30	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项停牌	44.35	-	-	2,142	68,244.57	94,997.70	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大事项停牌	29.21	2015-07-20	26.29	1,966	29,491.89	57,426.86	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项停牌	20.67	2015-07-29	18.60	2,821	39,626.52	58,310.07	-
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项停牌	17.51	-	-	6,121	59,367.36	107,178.71	-
600277	亿利能源	2015-06-01	重大事项停牌	14.62	-	-	2,387	20,343.01	34,897.94	-
600395	盘江股份	2015-06-09	筹划非公开发	15.71	2015-0	14.00	2,765	32,585.10	43,438.15	-

			行股票		8-19					
600886	国投电力	2015-06-24	重大事项停牌	14.87	-	-	14,146	106,698.60	210,351.02	-
600900	长江电力	2015-06-15	重大事项停牌	14.35	-	-	20,746	192,544.47	297,705.10	-
601021	春秋航空	2015-06-26	筹划非公开发 行股票	126.09	2015-0 7-21	113.48	600	80,560.60	75,654.00	-
601111	中国国航	2015-06-30	筹划非公开发 行股票	15.36	2015-0 7-29	13.78	7,014	45,657.01	107,735.04	-
601216	内蒙君正	2015-06-29	重大事项停牌	24.07	2015-0 7-02	24.20	2,978	28,375.48	71,680.46	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项停牌	42.76	2015-0 7-13	38.50	2,487	84,980.41	106,344.12	-

注：本基金截至 2015 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 2015 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 2015 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 2015 年 6 月 30 日,本基金持有信用类债券占基金净值比例微小(2014 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 2015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	1,862,233.95	-	-	-	1,862,233.95
结算备付金	59,381.33	-	-	-	59,381.33
存出保证金	46,840.10	-	-	-	46,840.10
交易性金融 资产	-	-	11,624.80	43,377,210.67	43,388,835.47
应收证券清 算款	-	-	-	1,639,485.43	1,639,485.43
应收利息	-	-	-	526.87	526.87
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,968,455.38	-	11,624.80	45,017,222.97	46,997,303.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	647,450.76	647,450.76
应付管理人 报酬	-	-	-	45,398.39	45,398.39
应付托管费	-	-	-	9,987.65	9,987.65
应付交易费 用	-	-	-	87,240.82	87,240.82
其他负债	-	-	-	228,974.85	228,974.85
负债总计	-	-	-	1,019,052.47	1,019,052.47
利率敏感度 缺口	1,968,455.38	-	11,624.80	43,998,170.50	45,978,250.68
上年度末 2014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	8,031,159.50	-	-	-	8,031,159.50
结算备付金	275,066.76	-	-	-	275,066.76
存出保证金	9,869.70	-	-	-	9,869.70
交易性金融资产	-	27,348.31	-	92,754,074.66	92,781,422.97
应收证券清算款	-	-	-	1,357,117.28	1,357,117.28
应收利息	-	-	-	2,304.69	2,304.69
应收申购款	49,524.56	-	-	-	49,524.56
资产总计	8,365,620.52	27,348.31	-	94,113,496.63	102,506,465.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,604,166.82	3,604,166.82
应付管理人报酬	-	-	-	96,383.85	96,383.85
应付托管费	-	-	-	21,204.44	21,204.44
应付交易费用	-	-	-	122,261.41	122,261.41
其他负债	-	-	-	439,391.20	439,391.20
负债总计	-	-	-	4,283,407.72	4,283,407.72
利率敏感度缺口	8,365,620.52	27,348.31	-	89,830,088.91	98,223,057.74

注：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 2015 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 0.03%(2014 年 12 月 31 日：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	43,377,210.67	94.34	92,754,074.66	94.43
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	43,377,210.67	94.34	92,754,074.66	94.43

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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加约227.66万元	增加约474.00万元
	业绩比较基准下降5%	减少约227.66万元	减少约474.00万元

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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	43,377,210.67	92.30
	其中：股票	43,377,210.67	92.30
2	固定收益投资	11,624.80	0.02
	其中：债券	11,624.80	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	1,921,615.28	4.09
7	其他各项资产	1,686,852.40	3.59
8	合计	46,997,303.15	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

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	116,284.16	0.25
B	采矿业	1,845,826.78	4.01
C	制造业	15,177,685.33	33.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,700,898.23	3.70

E	建筑业	1,892,692.96	4.12
F	批发和零售业	1,065,379.85	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,893,194.23	4.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,477,421.93	5.39
J	金融业	13,453,418.18	29.26
K	房地产业	1,861,489.83	4.05
L	租赁和商务服务业	394,313.12	0.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	441,747.05	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	88,102.06	0.19
R	文化、体育和娱乐业	625,137.60	1.36
S	综合	176,737.22	0.38
	合计	43,210,328.53	93.98

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	29,323.84	0.06
B	采矿业	43,438.15	0.09
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	94,120.15	0.20
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	166,882.14	0.36

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	18,672	1,529,983.68	3.33
2	600036	招商银行	66,313	1,241,379.36	2.70
3	600030	中信证券	30,171	811,901.61	1.77
4	600837	海通证券	33,113	721,863.40	1.57
5	601166	兴业银行	41,673	718,859.25	1.56
6	600000	浦发银行	40,296	683,420.16	1.49
7	000651	格力电器	10,229	653,633.10	1.42
8	601328	交通银行	69,534	572,960.16	1.25
9	601766	中国南车	30,585	561,540.60	1.22
10	601668	中国建筑	62,034	515,502.54	1.12
11	000002	万 科 A	30,084	436,819.68	0.95
12	601989	中国重工	29,403	435,164.40	0.95
13	601288	农业银行	116,594	432,563.74	0.94
14	600519	贵州茅台	1,665	428,987.25	0.93
15	600016	民生银行	42,879	426,217.26	0.93
16	601601	中国太保	13,533	408,425.94	0.89
17	601398	工商银行	76,467	403,745.76	0.88
18	600887	伊利股份	21,270	402,003.00	0.87
19	601818	光大银行	74,831	401,094.16	0.87
20	601169	北京银行	27,777	369,989.64	0.80
21	000024	招商地产	10,047	366,012.21	0.80
22	601006	大秦铁路	24,673	346,408.92	0.75
23	300059	东方财富	5,400	340,686.00	0.74
24	601390	中国中铁	24,055	329,312.95	0.72
25	600104	上汽集团	14,067	317,914.20	0.69
26	600048	保利地产	27,100	309,482.00	0.67
27	600900	长江电力	20,746	297,705.10	0.65
28	601988	中国银行	59,910	292,959.90	0.64
29	002024	苏宁云商	18,701	286,125.30	0.62
30	000776	广发证券	12,495	283,011.75	0.62
31	600015	华夏银行	18,542	282,023.82	0.61

32	601688	华泰证券	12,079	279,387.27	0.61
33	600795	国电电力	37,132	258,810.04	0.56
34	600050	中国联通	34,641	253,918.53	0.55
35	601336	新华保险	4,135	252,483.10	0.55
36	000858	五 粮 液	7,921	251,095.70	0.55
37	600999	招商证券	9,187	243,088.02	0.53
38	600011	华能国际	17,155	240,684.65	0.52
39	000768	中航飞机	5,490	239,254.20	0.52
40	000333	美的集团	6,302	234,938.56	0.51
41	600518	康美药业	12,698	225,135.54	0.49
42	601628	中国人寿	7,030	220,179.60	0.48
43	600276	恒瑞医药	4,930	219,582.20	0.48
44	300104	乐视网	4,200	217,392.00	0.47
45	000725	京东方 A	41,584	215,820.96	0.47
46	600029	南方航空	14,828	215,599.12	0.47
47	601009	南京银行	9,297	211,971.60	0.46
48	000166	申万宏源	13,037	211,851.25	0.46
49	000069	华侨城 A	16,209	210,392.82	0.46
50	600886	国投电力	14,146	210,351.02	0.46
51	000001	平安银行	14,251	207,209.54	0.45
52	600690	青岛海尔	6,811	206,577.63	0.45
53	000100	TCL 集团	36,402	205,671.30	0.45
54	002415	海康威视	4,588	205,542.40	0.45
55	000063	中兴通讯	8,474	201,765.94	0.44
56	601899	紫金矿业	38,211	195,640.32	0.43
57	601857	中国石油	16,914	191,635.62	0.42
58	601377	兴业证券	13,784	188,702.96	0.41
59	000625	长安汽车	8,883	187,875.45	0.41
60	600019	宝钢股份	20,673	180,682.02	0.39
61	600570	恒生电子	1,567	175,582.35	0.38
62	600028	中国石化	24,441	172,553.46	0.38
63	601919	中国远洋	13,800	172,224.00	0.37
64	601186	中国铁建	10,897	170,320.11	0.37
65	600118	中国卫星	2,964	168,829.44	0.37
66	601788	光大证券	6,200	167,090.00	0.36
67	600111	北方稀土	9,209	167,051.26	0.36
68	600010	包钢股份	31,836	165,228.84	0.36
69	600739	辽宁成大	6,753	165,110.85	0.36
70	000728	国元证券	4,280	162,554.40	0.35
71	600588	用友网络	3,441	157,873.08	0.34
72	600221	海南航空	24,621	157,328.19	0.34

73	600839	四川长虹	15,852	155,983.68	0.34
74	000423	东阿阿胶	2,805	152,872.50	0.33
75	600340	华夏幸福	5,016	152,737.20	0.33
76	000783	长江证券	10,876	151,720.20	0.33
77	601618	中国中冶	20,971	151,620.33	0.33
78	300027	华谊兄弟	3,942	150,347.88	0.33
79	600535	天士力	2,995	149,031.20	0.32
80	600150	中国船舶	2,885	148,577.50	0.32
81	600893	中航动力	2,793	148,447.95	0.32
82	600109	国金证券	6,049	147,595.60	0.32
83	002202	金风科技	7,576	147,504.72	0.32
84	000338	潍柴动力	4,629	146,554.14	0.32
85	601669	中国电建	12,778	144,902.52	0.32
86	600804	鹏博士	4,843	144,611.98	0.31
87	000157	中联重科	17,829	144,593.19	0.31
88	600100	同方股份	6,808	142,899.92	0.31
89	601106	中国一重	11,800	142,898.00	0.31
90	601099	太平洋	11,000	142,120.00	0.31
91	600196	复星医药	4,859	140,619.46	0.31
92	002736	国信证券	5,600	140,504.00	0.31
93	600352	浙江龙盛	9,910	140,424.70	0.31
94	000402	金融街	9,933	140,353.29	0.31
95	600009	上海机场	4,366	138,402.20	0.30
96	601018	宁波港	15,622	138,098.48	0.30
97	002230	科大讯飞	3,941	137,698.54	0.30
98	600958	东方证券	4,800	137,376.00	0.30
99	600703	三安光电	4,384	137,219.20	0.30
100	000917	电广传媒	3,167	135,832.63	0.30
101	601998	中信银行	17,615	135,811.65	0.30
102	600637	东方明珠	3,220	135,497.60	0.29
103	002142	宁波银行	6,379	134,915.85	0.29
104	002241	歌尔声学	3,724	133,691.60	0.29
105	600585	海螺水泥	6,216	133,333.20	0.29
106	002450	康得新	4,326	132,375.60	0.29
107	600315	上海家化	3,034	131,675.60	0.29
108	600115	东方航空	10,586	130,419.52	0.28
109	600066	宇通客车	6,329	130,060.95	0.28
110	000630	铜陵有色	15,062	127,123.28	0.28
111	601600	中国铝业	13,577	126,673.41	0.28
112	000039	中集集团	3,891	125,679.30	0.27
113	002594	比亚迪	2,273	125,537.79	0.27

114	600031	三一重工	12,935	125,340.15	0.27
115	600005	武钢股份	17,800	125,134.00	0.27
116	300070	碧水源	2,561	124,951.19	0.27
117	000623	吉林敖东	3,678	123,580.80	0.27
118	000568	泸州老窖	3,765	122,776.65	0.27
119	601901	方正证券	10,311	122,597.79	0.27
120	600406	国电南瑞	5,903	122,133.07	0.27
121	002008	大族激光	4,228	121,428.16	0.26
122	601898	中煤能源	10,599	121,040.58	0.26
123	600583	海油工程	7,254	120,851.64	0.26
124	600177	雅戈尔	6,531	119,256.06	0.26
125	300124	汇川技术	2,481	119,088.00	0.26
126	600663	陆家嘴	2,388	118,779.12	0.26
127	000060	中金岭南	6,360	118,232.40	0.26
128	000709	河北钢铁	16,872	118,104.00	0.26
129	000778	新兴铸管	9,005	116,704.80	0.25
130	000009	中国宝安	7,118	116,094.58	0.25
131	600674	川投能源	9,256	115,792.56	0.25
132	600256	广汇能源	11,056	114,982.40	0.25
133	600068	葛洲坝	9,645	112,750.05	0.25
134	601333	广深铁路	13,705	112,655.10	0.25
135	600085	同仁堂	3,097	111,213.27	0.24
136	600309	万华化学	4,522	109,341.96	0.24
137	600415	小商品城	7,134	109,007.52	0.24
138	600600	青岛啤酒	2,322	108,181.98	0.24
139	601111	中国国航	7,014	107,735.04	0.23
140	002292	奥飞动漫	2,834	107,266.90	0.23
141	600153	建发股份	6,121	107,178.71	0.23
142	000826	桑德环境	2,736	106,403.04	0.23
143	601633	长城汽车	2,487	106,344.12	0.23
144	601866	中海集运	10,958	104,101.00	0.23
145	000895	双汇发展	4,869	103,855.77	0.23
146	000061	农产品	5,073	103,489.20	0.23
147	000559	万向钱潮	4,698	102,698.28	0.22
148	002673	西部证券	3,600	102,132.00	0.22
149	600332	白云山	2,879	99,210.34	0.22
150	600741	华域汽车	4,630	98,850.50	0.21
151	002146	荣盛发展	7,906	98,825.00	0.21
152	002422	科伦药业	2,452	98,178.08	0.21
153	000686	东北证券	5,042	98,167.74	0.21
154	600688	上海石化	9,075	97,374.75	0.21

155	600863	内蒙华电	11,867	97,072.06	0.21
156	000839	中信国安	4,096	96,542.72	0.21
157	600060	海信电器	3,916	96,294.44	0.21
158	000793	华闻传媒	4,632	96,114.00	0.21
159	002353	杰瑞股份	2,142	94,997.70	0.21
160	600252	中恒集团	4,128	94,944.00	0.21
161	600875	东方电气	4,600	94,162.00	0.20
162	002236	大华股份	2,939	93,812.88	0.20
163	601607	上海医药	4,185	93,199.95	0.20
164	601179	中国西电	9,079	93,059.75	0.20
165	000581	威孚高科	2,975	92,195.25	0.20
166	000538	云南白药	1,058	91,273.66	0.20
167	601933	永辉超市	7,806	90,471.54	0.20
168	600718	东软集团	4,152	90,222.96	0.20
169	300058	蓝色光标	5,661	89,500.41	0.19
170	002129	中环股份	4,509	89,233.11	0.19
171	000878	云南铜业	3,624	88,788.00	0.19
172	300015	爱尔眼科	2,731	88,102.06	0.19
173	600660	福耀玻璃	6,068	86,651.04	0.19
174	002465	海格通信	2,689	86,558.91	0.19
175	600018	上港集团	10,926	86,424.66	0.19
176	600157	永泰能源	12,532	86,220.16	0.19
177	600316	洪都航空	2,488	86,035.04	0.19
178	600362	江西铜业	3,988	85,781.88	0.19
179	601168	西部矿业	7,793	85,099.56	0.19
180	600642	申能股份	8,479	84,874.79	0.18
181	002500	山西证券	4,682	84,697.38	0.18
182	600867	通化东宝	3,842	84,255.06	0.18
183	002385	大北农	6,074	82,120.48	0.18
184	002456	欧菲光	2,431	82,021.94	0.18
185	601555	东吴证券	4,002	81,920.94	0.18
186	600827	百联股份	3,926	81,700.06	0.18
187	002310	东方园林	2,131	81,617.30	0.18
188	600372	中航电子	2,336	81,596.48	0.18
189	600489	中金黄金	6,330	81,467.10	0.18
190	600649	城投控股	8,690	81,251.50	0.18
191	601808	中海油服	2,908	81,249.52	0.18
192	601117	中国化学	8,232	80,508.96	0.18
193	601929	吉视传媒	5,222	78,956.64	0.17
194	000629	攀钢钒钛	14,657	78,561.52	0.17
195	002252	上海莱士	1,200	78,528.00	0.17

196	002153	石基信息	600	77,994.00	0.17
197	601992	金隅股份	6,479	77,424.05	0.17
198	600089	特变电工	5,222	77,337.82	0.17
199	000970	中科三环	3,700	76,257.00	0.17
200	002065	东华软件	2,644	76,015.00	0.17
201	601021	春秋航空	600	75,654.00	0.16
202	300146	汤臣倍健	1,903	74,749.84	0.16
203	300133	华策影视	2,742	74,034.00	0.16
204	600271	航天信息	1,143	73,963.53	0.16
205	002410	广联达	3,151	73,733.40	0.16
206	000400	许继电气	2,915	73,341.40	0.16
207	600398	海澜之家	4,037	73,190.81	0.16
208	300002	神州泰岳	4,800	73,152.00	0.16
209	601216	内蒙君正	2,978	71,680.46	0.16
210	000598	兴蓉环境	7,485	71,631.45	0.16
211	000792	盐湖股份	2,504	71,063.52	0.15
212	600648	外高桥	2,023	70,966.84	0.15
213	002399	海普瑞	2,081	70,733.19	0.15
214	002470	金正大	3,254	70,644.34	0.15
215	000963	华东医药	986	70,479.28	0.15
216	600705	中航资本	3,037	70,306.55	0.15
217	002570	贝因美	3,617	70,205.97	0.15
218	000712	锦龙股份	2,000	70,200.00	0.15
219	002294	信立泰	2,449	70,041.40	0.15
220	000999	华润三九	2,281	69,319.59	0.15
221	300251	光线传媒	2,779	69,197.10	0.15
222	000425	徐工机械	5,149	68,327.23	0.15
223	600108	亚盛集团	6,593	68,303.48	0.15
224	603288	海天味业	2,125	67,872.50	0.15
225	000831	五矿稀土	2,648	67,735.84	0.15
226	600008	首创股份	4,657	66,827.95	0.15
227	600547	山东黄金	2,705	66,813.50	0.15
228	000876	新希望	3,430	66,576.30	0.14
229	601098	中南传媒	2,848	65,247.68	0.14
230	000825	太钢不锈	9,058	64,402.38	0.14
231	601958	金钼股份	5,443	64,118.54	0.14
232	600208	新湖中宝	8,304	64,106.88	0.14
233	600170	上海建工	6,826	64,027.88	0.14
234	000729	燕京啤酒	6,113	63,575.20	0.14
235	002081	金螳螂	2,226	62,750.94	0.14
236	000983	西山煤电	6,616	62,719.68	0.14

237	600166	福田汽车	7,005	61,854.15	0.13
238	002051	中工国际	2,072	61,704.16	0.13
239	600369	西南证券	3,127	61,445.55	0.13
240	600809	山西汾酒	2,169	61,252.56	0.13
241	600549	厦门钨业	2,422	61,179.72	0.13
242	600783	鲁信创投	1,618	60,642.64	0.13
243	601800	中国交建	3,431	60,248.36	0.13
244	603000	人民网	1,151	60,001.63	0.13
245	600373	中文传媒	2,463	59,013.48	0.13
246	300024	机器人	762	58,872.12	0.13
247	600485	信威集团	1,318	57,847.02	0.13
248	000960	锡业股份	2,860	57,629.00	0.13
249	002375	亚厦股份	1,966	57,426.86	0.12
250	600578	京能电力	6,138	54,812.34	0.12
251	600317	营口港	8,600	54,180.00	0.12
252	600717	天津港	3,600	53,964.00	0.12
253	601699	潞安环能	5,547	53,639.49	0.12
254	601991	大唐发电	6,700	53,466.00	0.12
255	000898	鞍钢股份	7,199	52,552.70	0.11
256	600348	阳泉煤业	5,038	51,639.50	0.11
257	600998	九州通	2,268	50,712.48	0.11
258	600383	金地集团	4,003	50,637.95	0.11
259	002001	新 和 成	2,898	49,526.82	0.11
260	601258	庞大集团	9,054	49,434.84	0.11
261	600497	驰宏锌锗	3,330	48,584.70	0.11
262	601118	海南橡胶	4,906	47,980.68	0.10
263	002344	海宁皮城	2,423	47,563.49	0.10
264	002653	海思科	1,761	47,547.00	0.10
265	000413	东旭光电	4,846	47,393.88	0.10
266	000750	国海证券	2,797	46,989.60	0.10
267	000027	深圳能源	3,699	45,682.65	0.10
268	601928	凤凰传媒	2,629	44,955.90	0.10
269	601888	中国国旅	675	44,752.50	0.10
270	600633	浙报传媒	2,280	44,688.00	0.10
271	600873	梅花生物	4,228	44,140.32	0.10
272	002038	双鹭药业	773	43,790.45	0.10
273	000046	泛海控股	2,900	42,485.00	0.09
274	600188	兖州煤业	2,940	40,425.00	0.09
275	600023	浙能电力	4,017	39,848.64	0.09
276	601158	重庆水务	3,669	39,405.06	0.09
277	002475	立讯精密	1,149	38,847.69	0.08

278	000937	冀中能源	4,766	38,223.32	0.08
279	600277	亿利能源	2,387	34,897.94	0.08
280	601088	中国神华	1,353	28,210.05	0.06
281	603993	洛阳钼业	2,186	27,018.96	0.06
282	000503	海虹控股	471	23,079.00	0.05
283	002007	华兰生物	507	22,455.03	0.05
284	000156	华数传媒	602	21,539.56	0.05
285	600027	华电国际	1,921	21,361.52	0.05
286	601225	陕西煤业	2,512	20,548.16	0.04
287	600516	方大炭素	1,499	17,853.09	0.04
288	600038	中直股份	242	14,991.90	0.03
289	601969	海南矿业	800	14,584.00	0.03
290	300017	网宿科技	140	6,498.80	0.01
291	600597	光明乳业	233	5,359.00	0.01
292	601231	环旭电子	262	4,456.62	0.01
293	000800	一汽轿车	171	4,254.48	0.01
294	000883	湖北能源	295	2,572.40	0.01

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	002416	爱施德	2,821	58,310.07	0.13
2	600395	盘江股份	2,765	43,438.15	0.09
3	600546	山煤国际	4,208	35,810.08	0.08
4	002069	獐子岛	1,484	29,323.84	0.06

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	000166	申万宏源	596,420.16	0.61
2	601318	中国平安	480,758.00	0.49
3	601766	中国中车	457,282.75	0.47
4	300059	东方财富	442,800.00	0.45
5	600637	东方明珠	307,298.88	0.31
6	600036	招商银行	285,183.00	0.29
7	300104	乐视网	276,990.00	0.28

8	600030	中信证券	243,045.00	0.25
9	600016	民生银行	241,474.00	0.25
10	601788	光大证券	220,956.00	0.22
11	601106	中国一重	218,241.00	0.22
12	600837	海通证券	206,442.00	0.21
13	601919	中国远洋	190,535.00	0.19
14	600958	东方证券	188,664.00	0.19
15	002736	国信证券	179,172.00	0.18
16	601099	太平洋	177,760.00	0.18
17	601166	兴业银行	174,250.00	0.18
18	600000	浦发银行	162,859.00	0.17
19	600875	东方电气	133,262.00	0.14
20	601988	中国银行	132,088.00	0.13

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	600016	民生银行	3,274,207.86	3.33
2	601318	中国平安	2,731,177.36	2.78
3	600036	招商银行	2,089,885.18	2.13
4	601166	兴业银行	2,021,693.97	2.06
5	600030	中信证券	1,856,100.60	1.89
6	600000	浦发银行	1,805,011.51	1.84
7	600837	海通证券	1,707,629.66	1.74
8	000002	万科 A	1,379,781.65	1.40
9	000001	平安银行	1,332,262.24	1.36
10	601668	中国建筑	1,168,038.90	1.19
11	600519	贵州茅台	1,004,404.31	1.02
12	000651	格力电器	973,108.15	0.99
13	601328	交通银行	961,924.80	0.98
14	601601	中国太保	896,404.48	0.91
15	601288	农业银行	884,167.53	0.90
16	601088	中国神华	880,650.54	0.90
17	601398	工商银行	757,534.69	0.77
18	601989	中国重工	751,154.91	0.76
19	601390	中国中铁	744,416.40	0.76
20	601901	方正证券	734,247.27	0.75

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	13,452,923.15
卖出股票的收入（成交）总额	85,702,760.48

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	11,624.80	0.03
8	其他	-	-
9	合计	11,624.80	0.03

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	110031	航信转债	80	11,624.80	0.03

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 本基金投资的中信证券（600030）和海通证券（600837）因存在违规为到期融资融券合约展期问题，2015 年 1 月 16 日受到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。报告期内，基金投资的前十名其他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	46,840.10
2	应收证券清算款	1,639,485.43
3	应收股利	-

4	应收利息	526.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,686,852.40

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

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	002069	獐子岛	29,323.84	0.06	重大事项停牌
2	002416	爱施德	58,310.07	0.13	重大事项停牌
3	600395	盘江股份	43,438.15	0.09	筹划非公开发行股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

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	132	90,895.52	9,004,898.00	75.05%	2,993,310.00	24.95%
华安沪深	274	43,789.08	1,098,800.00	9.16%	10,899,408.00	90.84%

300 指数 分级 B						
华安 沪深 300 指数 分级	170	24,610.13	498,723.00	11.92%	3,684,999.31	88.08%
合计	576	48,923.85	10,602,421.00	37.62%	17,577,717.31	62.38%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华安沪深300指数分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华汇人寿保险股份有限公司一分红险	8,507,215.00	70.90%
2	解咏梅	754,646.00	6.29%
3	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）—鼎锋另类策略 2 期证	483,583.00	4.03%
4	童卫	250,061.00	2.08%
5	彭刚	159,100.00	1.33%
6	李志平	120,100.00	1.00%
7	蔡捷	102,682.00	0.86%
8	谷世红	100,300.00	0.84%
9	马其星	81,452.00	0.68%
10	陈浩	81,100.00	0.68%

华安沪深300指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	周文龙	1,099,100.00	9.16%
2	中信证券股份有限公司	1,066,601.00	8.89%
3	谈颂	585,327.00	4.88%
4	刘倩	242,100.00	2.02%
5	宋沫伶	191,834.00	1.60%
6	赵秀	189,100.00	1.58%
7	张毅	181,000.00	1.51%

8	舒元	174,963.00	1.46%
9	王晓宇	150,000.00	1.25%
10	乔志成	139,500.00	1.16%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
	华安沪深 300 指数 分级 A	754,646.00	6.29%
	华安沪深 300 指数 分级 B	-	-
	华安沪深 300 指数 分级	-	-
	合计	754,646.00	2.68%

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	华安沪深 300 指数分 级 B	华安沪深 300 指数分 级
基金合同生效日(2012 年 6 月 25 日)基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	17,729,171.00	17,729,171.00	37,511,341.20
本报告期基金总申购份额	-	-	15,884,840.76
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	62,395,426.41
本报告期基金拆分变动份额	-5,730,963.00	-5,730,963.00	13,182,966.76
本报告期期末基金份额总额	11,998,208.00	11,998,208.00	4,183,722.31

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。

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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2015 年 5 月 28 日，基金管理人发布了华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理变更公告，牛勇先生不再担任本基金的基金经理，同时新增钱晶先生为本基金的基金经理。

(3) 2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(4) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

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如下：

无。

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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	54,211,503.38	56.13%	49,354.97	56.57%	-
国泰君安	1	20,365,156.79	21.09%	18,021.42	20.66%	-
中信证券	1	9,700,263.03	10.04%	8,831.02	10.12%	-
申银万国	1	6,772,194.07	7.01%	5,992.76	6.87%	-
广发证券	1	3,629,967.52	3.76%	3,304.73	3.79%	-
中信建投	1	1,906,745.26	1.97%	1,735.92	1.99%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	1	-	-	-	-	-
西南证券	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：本期新增上海证券深圳交易单元一个。

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

中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	43,713.80	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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份额停复牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司	2015-01-06

		网站	
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2015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	2015-01-06
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	2015-01-07
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	2015-01-07
5	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-07
6	关于基金电子交易平台延长工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	2015-03-12
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-31
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-04
9	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-08
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华域汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-14
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“湖北能源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-16
12	华安基金关于华安沪深300指数分级证券投资基金变更场内简称的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司	2015-04-24

		网站	
13	关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为销售机构并参加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	2015-05-22
14	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	2015-05-28
15	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、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	2015-06-02
16	关于旗下部分基金在官方京东店开展认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	2015-06-10
17	关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-10
18	关于基金电子交易平台延长工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	2015-06-12
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-12
20	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-29
21	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-30

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
二〇一五年八月二十八日