

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
2016 年半年度报告
2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误! 未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误! 未定义书签。
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误! 未定义书签。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误! 未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误! 未定义书签。
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
6 半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1 资产负债表	错误! 未定义书签。
6.2 利润表	错误! 未定义书签。
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	错误! 未定义书签。
6.4 报表附注	错误! 未定义书签。
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	错误! 未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
7.4 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	错误! 未定义书签。
7.5 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	错误! 未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动	错误! 未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误! 未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误! 未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误! 未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误! 未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误! 未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误! 未定义书签。
7.13 投资组合报告附注	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误！未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误！未定义书签。
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误！未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误！未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误！未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误！未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	53
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	错误！未定义书签。
12.2 存放地点	错误！未定义书签。
12.3 查阅方式	错误！未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	华安深证 300 指数（LOF）
场内简称	华安 S300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,100,873.81 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huanan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京西城区复兴门内大街1号

邮政编码	200120	100818
法定代表人	朱学华	田国立

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、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-162,735.79
本期利润	-6,042,851.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2485
本期加权平均净值利润率	-21.01%
本期基金份额净值增长率	-16.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,326,522.93
期末可供分配基金份额利润	0.2210
期末基金资产净值	29,427,396.74
期末基金份额净值	1.221
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	22.10%

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	3.12%	1.39%	2.29%	1.32%	0.83%	0.07%
过去三个月	-0.65%	1.49%	-0.40%	1.37%	-0.25%	0.12%
过去六个月	-16.94%	2.38%	-16.56%	2.20%	-0.38%	0.18%

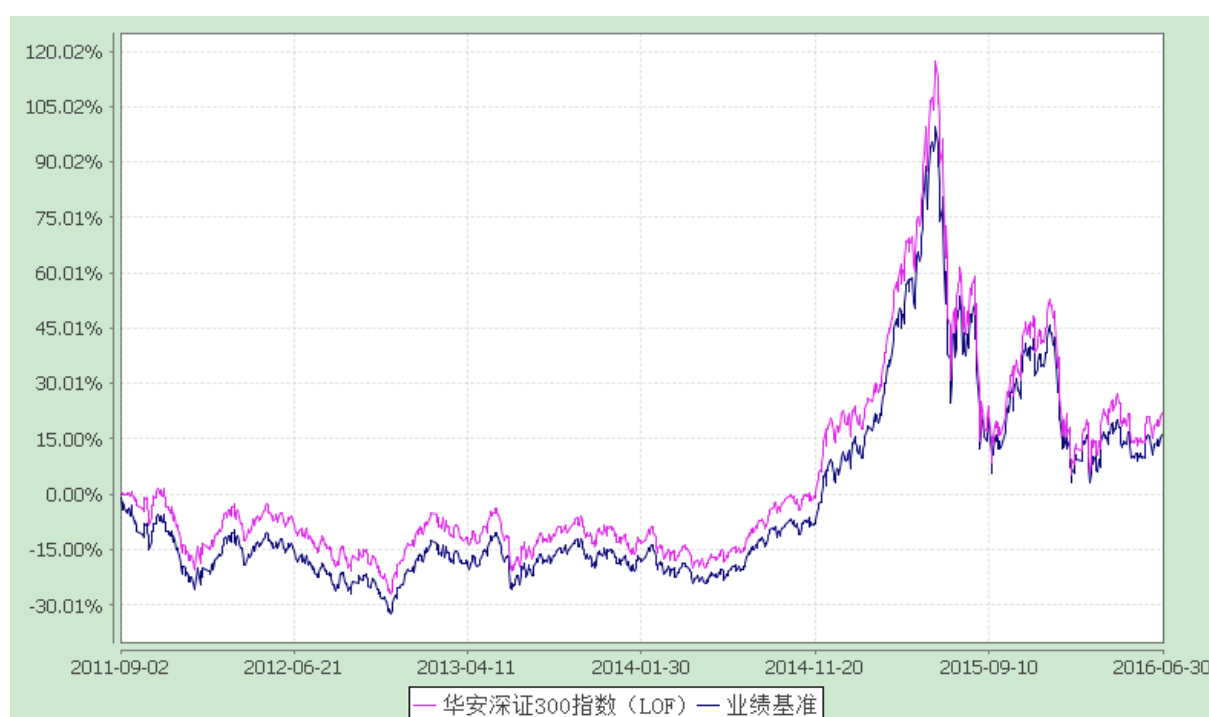
过去一年	-29.34%	2.68%	-26.71%	2.53%	-2.63%	0.15%
过去三年	51.30%	1.96%	55.32%	1.88%	-4.02%	0.08%
自基金合同生效起至今	22.10%	1.76%	16.55%	1.72%	5.55%	0.04%

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

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011 年 9 月 2 日至 2016 年 6 月 30 日）



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 2016 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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、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、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 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		
孙晨进	基金经理	2015-03-20	-	6 年	硕士研究生，6 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月起担任本基金及华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。
许之彦	基金经理，指数与量化投资事业总部高级总监	2011-09-02	-	13 年	理学博士，13 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金

					融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 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，2009 年 9 月起同时担任上证 180 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。2010 年 11 月至 2012 年 12 月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。2011 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月起担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。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。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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。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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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，出现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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，虽然经济增长还面临较大压力，但整体比较平稳。从一季度开始，政府工作报告提出了经济增速区间目标，稳增长和保持适度的经济增长速度仍然是政策的核心关注点之一。这表明在持续推进供给侧结构性改革的同时也需要适度扩大总需求。二季度以来，经济增速预计会与一季度持平。同时，由于内需不足、外需疲软等原因，年初以来政府稳增长、调结构的双重目标也得以延续，经济也逐渐出现了一些企稳的迹象，如 PMI 首次回到 50 以上。

纵观上半年，权益类资产一季度弱势下跌，二季度偏弱震荡，但结构性分化明显。在全球风险偏好下降的背景下，具有避险属性的黄金等大宗商品价格表现稳定。债券市场受到信用债违约事件频发的影响，信用利差扩大，信用债与利率债出现分化。

深证 300 指数上半年随市场下跌后企稳窄幅震荡。基金管理人对于基金管理采取审慎的原则，在保证流动性的前提下，力争基金单位净值复制深证 300 指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.221 元，本报告期份额净值增长率为 -16.94%，同期业绩比较基准增长率为 -16.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们判断宏观调控政策的摇摆性、徘徊性仍会不时发生，这会导致市场预期混乱、风险偏好时起时落。其次，尽管近期通胀预期有所减弱，货币政策宽松的大周期已经过去，未来货币政策进一步宽松的空间有限。但供给侧结构性改革，以及稳增长的需要，货币政策边际紧缩的可能性也很小。我们认为下半年大盘指数处于震荡的概率较大。

作为深证 300 指数基金的管理人，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：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、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，台湾保德信投信任基金经理。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、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，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高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、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、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，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，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（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板

50 指数分级、华安创业板 50ETF 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

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人;基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,673,772.97	2,327,304.14
结算备付金		517.10	-
存出保证金		1,590.57	5,360.12
交易性金融资产	6.4.7.2	27,934,896.45	33,465,374.11
其中：股票投资		27,931,696.45	33,455,274.11
基金投资		-	-
债券投资		3,200.00	10,100.00
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		58,633.42	-
应收利息	6.4.7.5	348.64	480.99
应收股利		-	-
应收申购款		452.41	20,021.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,670,211.56	35,818,540.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		28,118.94	53,783.65
应付管理人报酬		11,796.12	14,984.72
应付托管费		2,359.23	2,996.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,246.65	7,469.07
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	197,293.88	346,202.67
负债合计		242,814.82	425,437.05
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	24,100,873.81	24,080,120.41
未分配利润	6.4.7.10	5,326,522.93	11,312,983.08
所有者权益合计		29,427,396.74	35,393,103.49
负债和所有者权益总计		29,670,211.56	35,818,540.54

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.221 元，基金份额总额 24,100,873.81 份。

6.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-5,682,046.14	20,683,500.57
1.利息收入		6,861.55	13,131.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,851.00	13,122.07
债券利息收入		10.55	9.43
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）		187,848.02	20,467,819.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,106.54	20,280,664.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,332.01	9,136.56
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	175,409.47	178,018.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,880,115.74	182,300.13
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	3,360.03	20,249.17
减：二、费用		360,805.39	688,900.22
1. 管理人报酬		71,519.73	129,238.05
2. 托管费		14,303.95	25,847.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	17,636.03	245,565.68
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	257,345.68	288,248.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,042,851.53	19,994,600.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,042,851.53	19,994,600.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-6,042,851.53	-6,042,851.53
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)	20,753.40	56,391.38	77,144.78
其中: 1.基金申购款	3,308,945.63	682,298.11	3,991,243.74
2.基金赎回款	-3,288,192.23	-625,906.73	-3,914,098.96
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)	24,100,873.81	5,326,522.93	29,427,396.74
项目	上年度可比期间 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)	50,426,725.29	9,445,813.95	59,872,539.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	19,994,600.35	19,994,600.35
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)	-25,207,810.97	-11,084,563.73	-36,292,374.70
其中: 1.基金申购款	8,409,698.33	5,470,754.28	13,880,452.61
2.基金赎回款	-33,617,509.30	-16,555,318.01	-50,172,827.31
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)	25,218,914.32	18,355,850.57	43,574,764.89

报表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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简

称“中国证监会”)证监许可[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,830,415.01 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额,其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意,本基金 146,584,08.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,在封闭期满可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 8 月 23 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》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 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的说明

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

本会计期间不存在会计估计变更。

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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,673,772.97
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,673,772.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		29,097,234.28	27,931,696.45	-1,165,537.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,200.00	3,200.00	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,200.00	3,200.00	0.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计	29,100,434.28	27,934,896.45	-1,165,537.83
----	---------------	---------------	---------------

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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	336.21
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	0.18
应收债券利息	0.81
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	10.81
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.63
合计	348.64

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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,246.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,246.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	103.20
预提账户维护费	-
预提审计费	27,847.82
预提信息披露费	89,507.60
预提上市年费	29,835.26
应付指数使用费	50,000.00
合计	197,293.88

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,080,120.41	24,080,120.41
本期申购	3,308,945.63	3,308,945.63
本期赎回（以“-”号填列）	-3,288,192.23	-3,288,192.23
本期末	24,100,873.81	24,100,873.81

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	14,203,061.89	-2,890,078.81	11,312,983.08
本期利润	-162,735.79	-5,880,115.74	-6,042,851.53
本期基金份额交易产生的变动数	25,386.51	31,004.87	56,391.38
其中：基金申购款	1,905,897.55	-1,223,599.44	682,298.11
基金赎回款	-1,880,511.04	1,254,604.31	-625,906.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,065,712.61	-8,739,189.68	5,326,522.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,702.10

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	111.06
其他	37.84
合计	6,851.00

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,771,231.77
减：卖出股票成本总额	5,760,125.23
买卖股票差价收入	11,106.54

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,443.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,100.00
减：应收利息总额	11.29
买卖债券差价收入	1,332.01

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	175,409.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	175,409.47

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
------	----------------------------

1.交易性金融资产	-5,880,115.74
——股票投资	-5,880,115.74
——债券投资	-
——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	-5,880,115.74

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	3,360.03
合计	3,360.03

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 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	17,636.03
银行间市场交易费用	-
合计	17,636.03

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	27,847.82
信息披露费	89,507.60
银行汇划费用	1,155.00
上市年费	29,835.26
帐户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	257,345.68

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

本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

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

无。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	71,519.73	129,238.05
其中：支付销售机构的客户维护费	26,436.57	48,452.69

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,303.95	25,847.63

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国银行股份有限公司	1,673,772.97	6,702.10	3,938,816.60	11,857.91

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行保管，按银行同业利率计息。

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。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015-12-18	重大事项停牌	18.20	2016-07-04	21.99	57,388.00	745,586.00	1,044,461.60	-
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大资产重组	10.90	2016-07-14	10.60	3,758.00	35,992.51	40,962.20	-
000415	渤海金控	2016-02-01	重大资产重组	6.82	2016-08-11	7.50	10,800.00	54,157.05	73,656.00	-
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	重大事项停牌	8.92	-	-	7,542.00	40,979.67	67,274.64	-
000547	航天发展	2016-04-19	重大资产重组	15.36	-	-	4,700.00	91,729.00	72,192.00	-
000629	*ST 钒钛	2016-05-26	重大事项停牌	2.39	-	-	25,029.00	116,334.41	59,819.31	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大资产重组	22.04	-	-	30,924.00	514,599.49	681,564.96	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大资产重组	12.50	-	-	1,360.00	29,419.08	17,000.00	-
000718	苏宁环球	2016-01-04	重大资产重组	9.91	2016-07-18	11.78	5,799.00	40,964.25	57,468.09	-

000728	国元证券	2016-06-08	股价异常波动	16.72	2016-07-08	17.35	8,024.00	220,256.52	134,161.28	-
000975	银泰资源	2016-04-19	重大资产重组	14.39	-	-	2,800.00	43,628.85	40,292.00	-
002052	同洲电子	2016-01-12	股价异常波动	10.03	-	-	3,888.00	39,097.02	38,996.64	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大资产重组	25.10	2016-07-04	22.59	4,748.00	144,482.56	119,174.80	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大资产重组	8.29	-	-	9,237.00	162,065.38	76,574.73	-
002190	成飞集成	2016-04-21	重大事项停牌	35.44	2016-07-12	38.98	1,178.00	48,834.66	41,748.32	-
002266	浙富控股	2016-05-25	重大资产重组	5.35	-	-	9,738.00	67,898.43	52,098.30	-
002280	联络互动	2016-04-25	重大资产重组	19.71	-	-	3,750.00	93,465.00	73,912.50	-
002465	海格通信	2016-06-11	重大事项停牌	12.44	-	-	10,338.00	89,537.30	128,604.72	-
002555	三七互娱	2016-06-07	重大资产重组	18.10	2016-08-16	19.91	2,200.00	39,825.00	39,820.00	-
300032	金龙机电	2016-06-28	重大事项停牌	20.10	2016-07-07	19.14	2,000.00	37,748.00	40,200.00	-
300052	中青宝	2016-06-08	重大资产重组	22.03	-	-	1,100.00	42,457.83	24,233.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组	27.47	-	-	2,100.00	49,665.00	57,687.00	-

注：本基金截至 2016 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 2016 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 2016 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

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪深证 300 指数，属于较高风险、较高预期收益

的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

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

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

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银行，因而与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 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2015 年 12 月 31 日：0.03%)。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金所承担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。

本基金持有及承担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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2016 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	1,673,772.97	-	-	-	1,673,772.97
结算备付金	517.10	-	-	-	517.10
存出保证金	1,590.57	-	-	-	1,590.57
交易性金融资产	-	-	3,200.00	27,931,696.45	27,934,896.45
应收利息	-	-	-	348.64	348.64
应收申购款	-	-	-	452.41	452.41
应收证券清算款	-	-	-	58,633.42	58,633.42
资产总计	1,675,880.64	-	3,200.00	27,991,130.92	29,670,211.56
负债					

应付赎回款	-	-	-	28,118.94	28,118.94
应付管理人报酬	-	-	-	11,796.12	11,796.12
应付托管费	-	-	-	2,359.23	2,359.23
应付交易费用	-	-	-	3,246.65	3,246.65
其他负债	-	-	-	197,293.88	197,293.88
负债总计	-	-	-	242,814.82	242,814.82
利率敏感度缺口	1,675,880.64	-	3,200.00	27,748,316.10	29,427,396.74
上年度末 2015 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	2,327,304.14	-	10,100.00	-	2,337,404.14
存出保证金	5,360.12	-	-	-	5,360.12
交易性金融资产	-	-	-	33,455,274.11	33,455,274.11
应收利息	-	-	-	480.99	480.99
应收申购款	-	-	-	20,021.18	20,021.18
资产总计	2,332,664.26	-	10,100.00	33,475,776.28	35,818,540.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	53,783.65	53,783.65
应付管理人报酬	-	-	-	14,984.72	14,984.72
应付托管费	-	-	-	2,996.94	2,996.94
应付交易费用	-	-	-	7,469.07	7,469.07
其他负债	-	-	-	346,202.67	346,202.67
负债总计	-	-	-	425,437.05	425,437.05
利率敏感度缺口	2,332,664.26	-	10,100.00	33,050,339.23	35,393,103.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 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 0.01% (2015 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(2015 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的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	27,931,696.45	94.92	33,455,274.11	94.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	27,931,696.45	94.92	33,455,274.11	94.52

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：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	2. 业绩比较基准上升 5%	增加约 159	增加约 182
	1. 业绩比较基准下降 5%	减少约 159	减少约 182

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	27,931,696.45	94.14
	其中：股票	27,931,696.45	94.14
2	固定收益投资	3,200.00	0.01
	其中：债券	3,200.00	0.01
	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	1,674,290.07	5.64
7	其他各项资产	61,025.04	0.21

8	合计	29,670,211.56	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 报告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	340,039.46	1.16
B	采矿业	477,006.70	1.62
C	制造业	15,403,994.99	52.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	441,727.93	1.50
E	建筑业	437,925.61	1.49
F	批发和零售业	762,752.95	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	30,641.52	0.10
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,411,316.08	11.59
J	金融业	2,406,384.56	8.18
K	房地产业	2,212,417.15	7.52
L	租赁和商务服务业	570,408.76	1.94
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	481,495.33	1.64
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	144,497.44	0.49
R	文化、体育和娱乐业	685,883.67	2.33
S	综合	125,204.30	0.43
	合计	27,931,696.45	94.92

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

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	000002	万 科 A	57,388	1,044,461.60	3.55
2	000651	格力电器	30,924	681,564.96	2.32
3	000333	美的集团	21,391	507,394.52	1.72
4	000001	平安银行	54,350	472,845.00	1.61
5	000858	五 粮 液	12,269	399,110.57	1.36
6	000725	京东方 A	160,973	371,847.63	1.26
7	300104	乐视网	6,745	356,877.95	1.21
8	000776	广发证券	20,143	337,596.68	1.15
9	002024	苏宁云商	29,095	315,971.70	1.07
10	300059	东方财富	14,229	315,883.80	1.07
11	002450	康得新	18,312	313,135.20	1.06
12	002415	海康威视	13,294	285,289.24	0.97
13	000783	长江证券	23,307	270,361.20	0.92
14	002304	洋河股份	3,674	264,234.08	0.90
15	000625	长安汽车	16,037	219,225.79	0.74
16	002594	比亚迪	3,585	218,720.85	0.74
17	000063	中兴通讯	15,212	218,140.08	0.74
18	000100	TCL 集团	65,128	214,271.12	0.73
19	300017	网宿科技	3,178	213,561.60	0.73
20	002736	国信证券	12,100	208,725.00	0.71
21	001979	招商蛇口	13,800	196,650.00	0.67
22	300024	机器人	7,736	196,417.04	0.67
23	000423	东阿阿胶	3,709	195,946.47	0.67
24	000166	申万宏源	23,061	193,943.01	0.66
25	002230	科大讯飞	5,794	190,332.90	0.65
26	000503	海虹控股	4,733	190,313.93	0.65
27	000538	云南白药	2,914	187,370.20	0.64
28	002673	西部证券	7,031	181,821.66	0.62
29	002466	天齐锂业	4,206	179,554.14	0.61
30	002142	宁波银行	11,630	171,891.40	0.58
31	002241	歌尔声学	5,769	165,454.92	0.56
32	002202	金风科技	10,822	163,736.86	0.56
33	000568	泸州老窖	5,466	162,340.20	0.55
34	000768	中航飞机	8,001	157,539.69	0.54
35	000839	中信国安	7,217	153,794.27	0.52

36	002456	欧菲光	4,991	147,234.50	0.50
37	300070	碧水源	9,872	146,895.36	0.50
38	000402	金融街	15,074	146,519.28	0.50
39	000069	华侨城 A	22,785	145,824.00	0.50
40	300027	华谊兄弟	10,578	143,226.12	0.49
41	002252	上海莱士	3,772	142,128.96	0.48
42	000895	双汇发展	6,475	135,198.00	0.46
43	000728	国元证券	8,024	134,161.28	0.46
44	002405	四维图新	5,424	133,430.40	0.45
45	002340	格林美	15,018	131,707.86	0.45
46	002500	山西证券	7,904	130,890.24	0.44
47	000157	中联重科	31,568	130,375.84	0.44
48	002008	大族激光	5,658	129,228.72	0.44
49	002183	怡亚通	8,984	128,650.88	0.44
50	002465	海格通信	10,338	128,604.72	0.44
51	300124	汇川技术	6,585	127,749.00	0.43
52	000917	电广传媒	7,631	126,140.43	0.43
53	000686	东北证券	9,743	125,782.13	0.43
54	000009	中国宝安	9,139	125,204.30	0.43
55	002236	大华股份	9,512	124,607.20	0.42
56	000559	万向钱潮	7,946	123,957.60	0.42
57	000413	东旭光电	14,351	123,275.09	0.42
58	300003	乐普医疗	6,740	122,937.60	0.42
59	000623	吉林敖东	4,847	120,932.65	0.41
60	002065	东华软件	4,748	119,174.80	0.40
61	300168	万达信息	4,543	118,072.57	0.40
62	000338	潍柴动力	14,972	116,931.32	0.40
63	000661	长春高新	1,085	115,747.80	0.39
64	000876	新希望	13,844	115,182.08	0.39
65	000793	华闻传媒	11,359	112,226.92	0.38
66	002007	华兰生物	3,560	111,784.00	0.38
67	002475	立讯精密	5,655	111,120.75	0.38
68	002385	大北农	13,710	110,502.60	0.38
69	000750	国海证券	14,776	109,194.64	0.37
70	300033	同花顺	1,300	105,885.00	0.36
71	000826	启迪桑德	3,451	105,428.05	0.36
72	000630	铜陵有色	41,280	104,851.20	0.36
73	300072	三聚环保	3,732	103,152.48	0.35
74	000540	中天城投	16,241	101,181.43	0.34
75	000061	农产品	8,314	101,098.24	0.34
76	000963	华东医药	1,490	100,426.00	0.34
77	300315	掌趣科技	9,492	99,571.08	0.34
78	000012	南玻 A	8,636	98,968.56	0.34
79	002030	达安基因	3,383	94,047.40	0.32

80	000060	中金岭南	9,012	93,995.16	0.32
81	002049	紫光国芯	2,136	93,877.20	0.32
82	000977	浪潮信息	4,000	93,800.00	0.32
83	000425	徐工机械	30,202	92,418.12	0.31
84	000748	长城信息	4,709	92,390.58	0.31
85	000887	中鼎股份	4,175	92,309.25	0.31
86	300253	卫宁健康	3,703	91,464.10	0.31
87	300055	万邦达	5,000	91,050.00	0.31
88	000988	华工科技	4,517	90,565.85	0.31
89	000997	新大陆	4,455	89,278.20	0.30
90	002292	奥飞娱乐	2,966	88,831.70	0.30
91	000792	盐湖股份	4,201	88,641.10	0.30
92	002081	金螳螂	8,805	88,226.10	0.30
93	002439	启明星辰	3,400	87,822.00	0.30
94	300058	蓝色光标	9,004	87,428.84	0.30
95	002074	国轩高科	2,200	86,834.00	0.30
96	002400	省广股份	6,110	86,334.30	0.29
97	000983	西山煤电	10,592	86,324.80	0.29
98	000998	隆平高科	4,501	85,428.98	0.29
99	000709	河钢股份	30,486	84,446.22	0.29
100	000970	中科三环	5,782	83,896.82	0.29
101	300144	宋城演艺	3,358	83,647.78	0.28
102	002573	清新环境	4,926	83,347.92	0.28
103	002179	中航光电	1,900	82,308.00	0.28
104	000050	深天马 A	3,924	81,893.88	0.28
105	002038	双鹭药业	2,703	81,576.54	0.28
106	002219	恒康医疗	7,307	80,742.35	0.27
107	002273	水晶光电	2,868	80,275.32	0.27
108	000656	金科股份	20,800	79,456.00	0.27
109	300015	爱尔眼科	2,168	79,197.04	0.27
110	002701	奥瑞金	8,921	78,772.43	0.27
111	300088	长信科技	5,282	78,543.34	0.27
112	000028	国药一致	1,196	77,859.60	0.26
113	000738	中航动控	2,948	77,827.20	0.26
114	300498	温氏股份	2,143	77,619.46	0.26
115	000046	泛海控股	7,575	76,583.25	0.26
116	002129	中环股份	9,237	76,574.73	0.26
117	002152	广电运通	4,650	76,446.00	0.26
118	300077	国民技术	3,800	75,240.00	0.26
119	000039	中集集团	5,302	75,129.34	0.26
120	000078	海王生物	10,105	75,080.15	0.26
121	000581	威孚高科	3,714	74,874.24	0.25
122	002280	联络互动	3,750	73,912.50	0.25
123	000415	渤海金控	10,800	73,656.00	0.25

124	002491	通鼎互联	4,300	73,358.00	0.25
125	002310	东方园林	3,049	72,932.08	0.25
126	300079	数码视讯	8,466	72,553.62	0.25
127	300133	华策影视	4,646	72,338.22	0.25
128	000547	航天发展	4,700	72,192.00	0.25
129	002739	万达院线	900	71,910.00	0.24
130	300251	光线传媒	6,178	71,417.68	0.24
131	002299	圣农发展	2,753	71,302.70	0.24
132	300002	神州泰岳	6,691	71,192.24	0.24
133	002001	新 和 成	3,348	70,743.24	0.24
134	002168	深圳惠程	4,967	69,935.36	0.24
135	000712	锦龙股份	3,332	69,172.32	0.24
136	000697	炼石有色	3,000	68,550.00	0.23
137	002004	华邦健康	7,500	68,475.00	0.23
138	300043	互动娱乐	4,800	68,016.00	0.23
139	002470	金正大	8,412	67,716.60	0.23
140	000758	中色股份	8,702	67,440.50	0.23
141	002276	万马股份	3,400	67,354.00	0.23
142	000511	*ST 烯碳	7,542	67,274.64	0.23
143	000598	兴蓉环境	12,667	66,881.76	0.23
144	002422	科伦药业	4,338	66,848.58	0.23
145	002311	海大集团	4,233	66,754.41	0.23
146	000031	中粮地产	7,030	66,292.90	0.23
147	002191	劲嘉股份	5,714	66,225.26	0.23
148	000410	沈阳机床	3,900	65,442.00	0.22
149	300244	迪安诊断	1,980	65,300.40	0.22
150	000778	新兴铸管	14,062	65,247.68	0.22
151	000400	许继电气	4,220	65,156.80	0.22
152	002353	杰瑞股份	3,379	65,147.12	0.22
153	000671	阳 光 城	10,950	65,043.00	0.22
154	000930	中粮生化	5,900	64,782.00	0.22
155	000829	天音控股	4,811	64,226.85	0.22
156	300170	汉得信息	4,200	63,756.00	0.22
157	002018	华信国际	6,700	63,650.00	0.22
158	002312	三泰控股	3,340	63,293.00	0.22
159	002138	顺络电子	3,468	62,874.84	0.21
160	000999	华润三九	2,591	62,754.02	0.21
161	000566	海南海药	5,694	62,121.54	0.21
162	000729	燕京啤酒	8,156	61,904.04	0.21
163	300433	蓝思科技	2,200	61,864.00	0.21
164	002092	中泰化学	7,276	61,554.96	0.21
165	300273	和佳股份	3,210	61,471.50	0.21
166	000979	中弘股份	22,410	61,403.40	0.21
167	000800	一汽轿车	5,600	60,928.00	0.21

168	000938	紫光股份	1,000	60,880.00	0.21
169	300274	阳光电源	2,485	60,634.00	0.21
170	000878	云南铜业	5,927	60,336.86	0.21
171	000901	航天科技	1,499	60,184.85	0.20
172	300267	尔康制药	4,200	60,144.00	0.20
173	002410	广联达	4,202	60,088.60	0.20
174	002104	恒宝股份	3,655	60,088.20	0.20
175	000629	*ST 钒钛	25,029	59,819.31	0.20
176	002155	湖南黄金	4,542	59,818.14	0.20
177	002261	拓维信息	4,300	59,469.00	0.20
178	002294	信立泰	2,185	59,432.00	0.20
179	300001	特锐德	2,700	58,563.00	0.20
180	300115	长盈精密	2,810	57,886.00	0.20
181	300166	东方国信	2,100	57,687.00	0.20
182	000718	苏宁环球	5,799	57,468.09	0.20
183	000883	湖北能源	12,410	57,458.30	0.20
184	002022	科华生物	2,690	57,323.90	0.19
185	000690	宝新能源	8,398	56,938.44	0.19
186	002185	华天科技	4,451	56,661.23	0.19
187	002467	二六三	3,656	56,338.96	0.19
188	000831	*ST 五稀	4,272	56,304.96	0.19
189	000960	锡业股份	4,863	56,216.28	0.19
190	002250	联化科技	3,924	56,191.68	0.19
191	002146	荣盛发展	8,361	56,185.92	0.19
192	002161	远望谷	3,769	56,120.41	0.19
193	000627	天茂集团	7,200	55,656.00	0.19
194	002153	石基信息	2,103	55,477.14	0.19
195	002223	鱼跃医疗	1,748	55,446.56	0.19
196	300199	翰宇药业	2,700	54,945.00	0.19
197	002657	中科金财	1,000	54,940.00	0.19
198	000066	长城电脑	4,300	54,825.00	0.19
199	001696	宗申动力	5,011	54,720.12	0.19
200	000021	深科技	4,942	54,411.42	0.18
201	002501	利源精制	5,000	54,000.00	0.18
202	002368	太极股份	1,517	53,899.01	0.18
203	300216	千山药机	1,700	53,771.00	0.18
204	002051	中工国际	2,718	53,463.06	0.18
205	300146	汤臣倍健	3,938	53,320.52	0.18
206	002477	雏鹰农牧	8,904	53,156.88	0.18
207	002489	浙江永强	6,700	53,064.00	0.18
208	000516	国际医学	9,065	53,030.25	0.18
209	002474	榕基软件	2,799	52,901.10	0.18
210	002428	云南锗业	3,072	52,776.96	0.18
211	000543	皖能电力	7,360	52,550.40	0.18

212	000592	平潭发展	7,748	52,531.44	0.18
213	000786	北新建材	5,774	52,427.92	0.18
214	002266	浙富控股	9,738	52,098.30	0.18
215	002055	得润电子	1,700	52,054.00	0.18
216	300291	华录百纳	2,200	51,766.00	0.18
217	002642	荣之联	1,950	51,304.50	0.17
218	000027	深圳能源	8,000	51,040.00	0.17
219	002375	亚厦股份	4,505	50,906.50	0.17
220	000667	美好集团	14,200	50,694.00	0.17
221	300085	银之杰	1,690	50,531.00	0.17
222	002073	软控股份	4,177	50,332.85	0.17
223	002424	贵州百灵	2,915	50,138.00	0.17
224	300134	大富科技	1,671	50,063.16	0.17
225	000825	太钢不锈	15,712	49,649.92	0.17
226	002050	三花股份	5,106	49,272.90	0.17
227	002665	首航节能	6,210	48,996.90	0.17
228	300026	红日药业	2,725	47,387.75	0.16
229	000777	中核科技	1,955	46,059.80	0.16
230	002013	中航机电	3,412	45,993.76	0.16
231	002570	贝因美	3,584	45,839.36	0.16
232	002285	世联行	5,880	45,805.20	0.16
233	000156	华数传媒	2,466	45,744.30	0.16
234	000006	深振业 A	6,190	45,620.30	0.16
235	002522	浙江众成	2,400	45,000.00	0.15
236	000616	海航投资	8,417	44,946.78	0.15
237	002063	远光软件	2,882	44,526.90	0.15
238	000939	凯迪生态	4,967	44,454.65	0.15
239	002390	信邦制药	4,800	44,352.00	0.15
240	000751	锌业股份	8,000	44,240.00	0.15
241	000816	智慧农业	7,425	43,881.75	0.15
242	002431	棕榈股份	3,797	43,665.50	0.15
243	300147	香雪制药	2,962	43,630.26	0.15
244	002130	沃尔核材	2,700	43,416.00	0.15
245	002440	闰土股份	2,921	43,376.85	0.15
246	000875	吉电股份	7,700	43,197.00	0.15
247	002318	久立特材	3,700	42,809.00	0.15
248	000851	高鸿股份	3,300	42,537.00	0.14
249	002437	誉衡药业	4,800	41,760.00	0.14
250	002190	成飞集成	1,178	41,748.32	0.14
251	002106	莱宝高科	3,492	41,484.96	0.14
252	000541	佛山照明	4,009	41,252.61	0.14
253	000401	冀东水泥	3,758	40,962.20	0.14
254	000732	泰禾集团	2,100	40,824.00	0.14
255	000572	海马汽车	7,863	40,808.97	0.14

256	000937	冀中能源	7,646	40,676.72	0.14
257	002005	德豪润达	6,835	40,394.85	0.14
258	000685	中山公用	3,888	40,357.44	0.14
259	000975	银泰资源	2,800	40,292.00	0.14
260	300032	金龙机电	2,000	40,200.00	0.14
261	002603	以岭药业	2,524	40,156.84	0.14
262	002396	星网锐捷	2,029	39,971.30	0.14
263	300202	聚龙股份	1,649	39,922.29	0.14
264	002555	三七互娱	2,200	39,820.00	0.14
265	002095	生意宝	700	39,193.00	0.13
266	300212	易华录	1,310	38,998.70	0.13
267	002052	同洲电子	3,888	38,996.64	0.13
268	300257	开山股份	2,344	38,722.88	0.13
269	002563	森马服饰	3,500	37,905.00	0.13
270	002151	北斗星通	1,125	37,867.50	0.13
271	000961	中南建设	6,717	37,682.37	0.13
272	002681	奋达科技	2,230	37,642.40	0.13
273	000158	常山股份	2,700	37,503.00	0.13
274	002011	盾安环境	3,319	37,438.32	0.13
275	300157	恒泰艾普	3,437	37,085.23	0.13
276	000898	鞍钢股份	9,630	36,882.90	0.13
277	002195	二三四五	3,000	36,870.00	0.13
278	300005	探路者	2,090	35,634.50	0.12
279	000528	柳工	5,443	35,270.64	0.12
280	300039	上海凯宝	3,462	35,208.54	0.12
281	002625	龙生股份	800	35,184.00	0.12
282	002429	兆驰股份	4,148	34,760.24	0.12
283	300226	上海钢联	686	34,574.40	0.12
284	002399	海普瑞	1,977	34,518.42	0.12
285	000652	泰达股份	7,309	33,621.40	0.11
286	000681	视觉中国	1,421	33,606.65	0.11
287	000897	津滨发展	8,600	33,282.00	0.11
288	002029	七匹狼	3,249	32,977.35	0.11
289	002269	美邦服饰	7,465	32,846.00	0.11
290	000062	深圳华强	1,207	32,589.00	0.11
291	002498	汉缆股份	7,500	32,550.00	0.11
292	000861	海印股份	6,400	31,616.00	0.11
293	000088	盐田港	4,758	30,641.52	0.10
294	002344	海宁皮城	2,978	29,035.50	0.10
295	000539	粤电力 A	5,747	28,849.94	0.10
296	300052	中青宝	1,100	24,233.00	0.08
297	002203	海亮股份	2,788	21,662.76	0.07
298	002568	百润股份	900	19,800.00	0.07
299	002653	海思科	1,103	17,670.06	0.06

300	000693	ST 华泽	1,360	17,000.00	0.06
-----	--------	-------	-------	-----------	------

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

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	000001	平安银行	157,186.00	0.44
2	000100	TCL 集团	134,440.00	0.38
3	300072	三聚环保	124,557.00	0.35
4	002049	紫光国芯	116,558.00	0.33
5	000725	京东方 A	114,817.00	0.32
6	300017	网宿科技	103,863.00	0.29
7	002304	洋河股份	103,609.00	0.29
8	002673	西部证券	97,320.00	0.27
9	002450	康得新	93,895.00	0.27
10	300059	东方财富	93,050.00	0.26
11	002594	比亚迪	89,415.00	0.25
12	000333	美的集团	88,010.00	0.25
13	002219	恒康医疗	85,381.00	0.24
14	002018	华信国际	84,641.00	0.24
15	300498	温氏股份	81,751.00	0.23
16	000625	长安汽车	80,908.00	0.23
17	000671	阳光城	80,740.00	0.23
18	000651	格力电器	78,936.00	0.22
19	000776	广发证券	78,930.00	0.22
20	002736	国信证券	76,962.00	0.22

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	000982	中银绒业	1,333,313.20	3.77
2	000876	新希望	231,147.44	0.65

3	000748	长城信息	165,679.86	0.47
4	000725	京东方 A	137,771.92	0.39
5	300072	三聚环保	113,162.58	0.32
6	300024	机器人	96,288.32	0.27
7	002673	西部证券	91,120.01	0.26
8	300059	东方财富	90,435.03	0.26
9	300104	乐视网	88,257.84	0.25
10	002236	大华股份	85,905.00	0.24
11	002024	苏宁云商	84,021.95	0.24
12	000001	平安银行	81,381.54	0.23
13	000333	美的集团	80,842.03	0.23
14	002292	奥飞娱乐	75,175.00	0.21
15	000503	海虹控股	70,919.00	0.20
16	000338	潍柴动力	70,160.00	0.20
17	000100	TCL 集团	70,131.00	0.20
18	002001	新 和 成	69,002.00	0.19
19	000938	紫光股份	62,338.00	0.18
20	002191	劲嘉股份	61,888.00	0.17

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	6,116,663.31
卖出股票的收入（成交）总额	5,771,231.77

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（可交换债）	3,200.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,200.00	0.01

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	127003	海印转债	32	3,200.00	0.01

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投资。

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

无。

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 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的广发证券（000776）于 2015 年 9 月 12 日公告：1、2015 年 8 月 24 日，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，被中国证监会立案调查；2、2015 年 9 月 10 日，因未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项等规定对客户的信息进行审查和了解，被中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款的处罚。

除此之外，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，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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,590.57
2	应收证券清算款	58,633.42
3	应收股利	-
4	应收利息	348.64
5	应收申购款	452.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,025.04

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	000002	万 科 A	1,044,461.60	3.55	重大事项停 牌
2	000651	格力电器	681,564.96	2.32	重大资产重 组

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中不存在流通受限情况。

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

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
502	48,009.71	0.00	0.00%	24,100,873.81	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘素清	200,700.00	0.83%
2	张凌	183,619.00	0.76%
3	金思宇	150,018.00	0.62%
4	曹伟	110,009.00	0.46%
5	杨晓云	78,809.00	0.33%
6	李萍	75,000.00	0.31%
7	曹洁	60,002.00	0.25%

8	李淑芹	50,300.00	0.21%
9	蔡俏冰	50,009.00	0.21%
10	黄耀芳	50,001.00	0.21%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	273.79	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

基金合同生效日（2011 年 9 月 2 日）基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	24,080,120.41
本报告期基金总申购份额	3,308,945.63
减：本报告期基金总赎回份额	3,288,192.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,100,873.81

10 重大事件揭示

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

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

本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

本报告期内无管理人、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	
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	11,523,530.26	97.13%	10,501.62	97.13%	-
国泰君安	1	340,300.18	2.87%	310.12	2.87%	-

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
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	11,443.30	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06

3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万科 A”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	2016-01-09
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新希望”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	2016-01-12
6	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乐融多源为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-13
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网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	2016-01-14
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新海宜”、“蓝色光标”、“宁波港”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	2016-01-16
9	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝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	2016-01-19
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“互动娱乐”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	2016-01-26
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长信科技”、“慧球科技”、“升华拜克”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	2016-01-29
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“苏宁环球”、“和晶科技”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	2016-01-30
13	华安基金管理有限公司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	2016-02-03
14	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“康得新”、“江西铜业”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	2016-02-25
16	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南方汇通”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	2016-03-03
17	华安基金管理有限公司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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2016-03-28

	告	司网站	
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中银绒业”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	2016-03-23
19	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	2016-03-25
20	华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“四维图新”、“国瓷材料”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	2016-04-05
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”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	2016-04-09
23	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赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
24	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得金融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	2016-04-13
25	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富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	2016-04-19
26	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中经北证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	2016-04-29
27	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
28	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
29	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金观诚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	2016-05-10
31	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米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	2016-05-10
32	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平	《上海证券报》、《证券时	2016-05-10

	台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
33	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“银泰资源”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	2016-05-12
34	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-13
35	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“光线传媒”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	2016-05-18
36	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商行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	2016-06-02
37	华安基金管理有限公司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	2016-06-08
38	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融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	2016-06-14
39	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“广电运通”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	2016-06-16
40	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万达信息”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	2016-06-17
41	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“格力电器”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	2016-06-22
42	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2016-06-28

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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日