

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§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 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	错误! 未定义书签。
1.1 重要提示	错误! 未定义书签。
§2 基金简介	错误! 未定义书签。
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、基金净值表现及利润分配情况	错误! 未定义书签。
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。
3.3 过去三年基金的利润分配情况	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	错误! 未定义书签。
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合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	错误! 未定义书签。
4.7 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。
4.8 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。
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误! 未定义书签。
§5 托管人报告	错误! 未定义书签。
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	错误! 未定义书签。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	错误! 未定义书签。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	错误! 未定义书签。
§6 审计报告	错误! 未定义书签。
§7 年度财务报表	错误! 未定义书签。
7.1 资产负债表	错误! 未定义书签。
7.2 利润表	错误! 未定义书签。
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	错误! 未定义书签。
7.4 报表附注	错误! 未定义书签。
§8 投资组合报告	错误! 未定义书签。
8.1 期末基金资产组合情况	错误! 未定义书签。
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误! 未定义书签。
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误! 未定义书签。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	错误! 未定义书签。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误! 未定义书签。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误! 未定义书签。
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误! 未定义书签。
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误! 未定义书签。
8.9 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。

8.10	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。
8.11	投资组合报告附注	错误! 未定义书签。
§9	基金份额持有人信息	错误! 未定义书签。
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误! 未定义书签。
9.2	期末上市基金前十名持有人	错误! 未定义书签。
9.3	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。
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§10	开放式基金份额变动	错误! 未定义书签。
§11	重大事件揭示	错误! 未定义书签。
11.1	基金份额持有人大会决议	错误! 未定义书签。
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	错误! 未定义书签。
11.3	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。
11.4	基金投资策略的改变	错误! 未定义书签。
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	错误! 未定义书签。
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	错误! 未定义书签。
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误! 未定义书签。
11.8	其他重大事件	错误! 未定义书签。
§12	发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§13	影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§14	备查文件目录	错误! 未定义书签。
14.1	备查文件目录	错误! 未定义书签。
14.2	存放地点	错误! 未定义书签。
14.3	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	22,240,279.75 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@huaan.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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-533,420.57	18,885,296.39	11,365,989.42

本期利润	-6,560,827.81	13,332,422.91	24,222,300.34
加权平均基金份额本期利润	-0.2765	0.4498	0.1588
本期加权平均净值利润率	-22.68%	31.10%	17.95%
本期基金份额净值增长率	-18.71%	23.84%	33.67%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	4,343,958.19	11,312,983.08	2,643,162.38
期末可供分配基金份额利润	0.1953	0.4698	0.0524
期末基金资产净值	26,584,237.94	35,393,103.49	59,872,539.24
期末基金份额净值	1.195	1.470	1.187
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	19.50%	47.00%	18.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

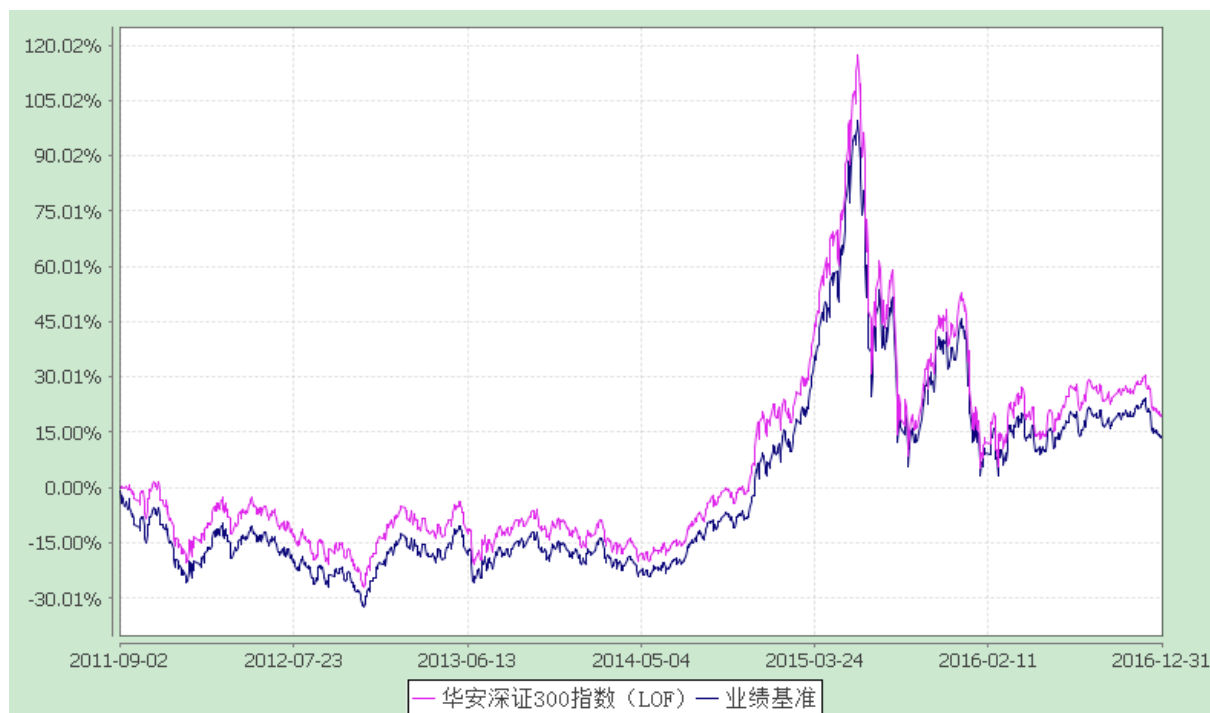
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.86%	0.79%	-3.30%	0.80%	-0.56%	-0.01%
过去六个月	-2.13%	0.89%	-2.23%	0.88%	0.10%	0.01%
过去一年	-18.71%	1.78%	-18.40%	1.66%	-0.31%	0.12%
过去三年	34.57%	1.93%	37.76%	1.85%	-3.19%	0.08%
过去五年	43.11%	1.72%	47.29%	1.67%	-4.18%	0.05%
自基金合同生效起至今	19.50%	1.70%	13.92%	1.66%	5.58%	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）

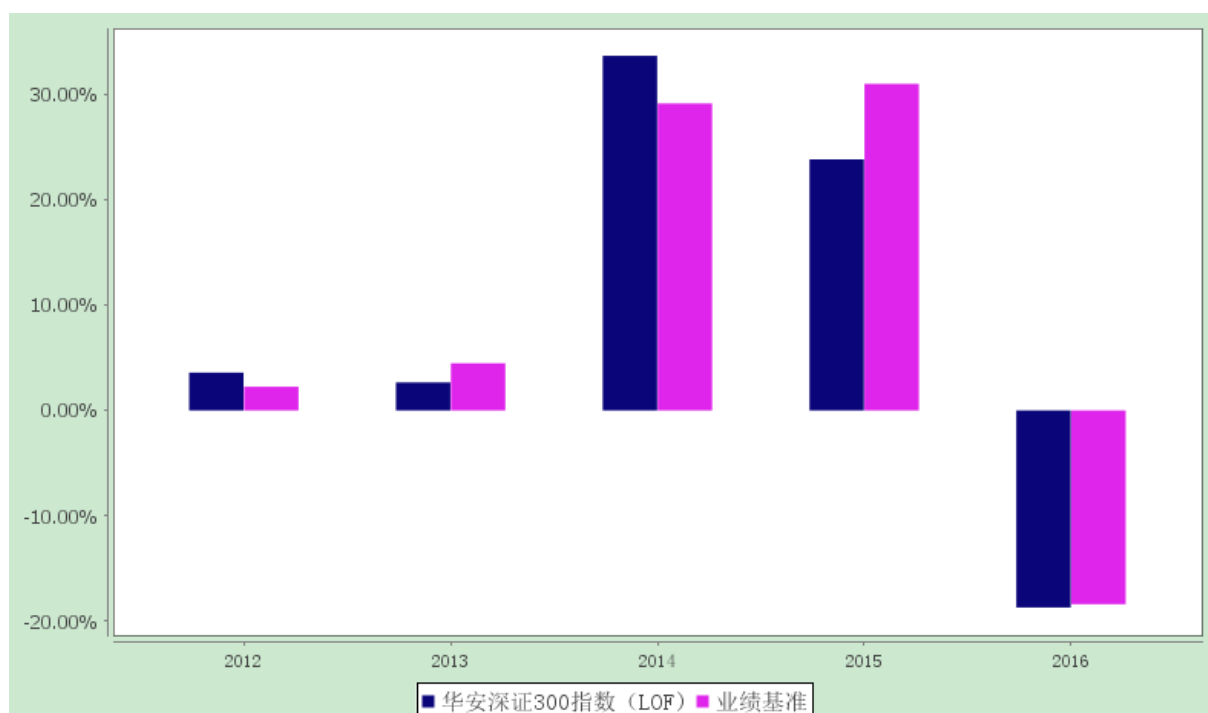
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011 年 9 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2011 年 9 月 2 日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 12 月 31 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 ETF、华安上证龙头 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、华安信用四季红债券、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、华安逆向策略混合、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、华安汇财通货币、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、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数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 6 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。
孙晨进	本基金的基金经理	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 月起担任华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时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。2016 年 12 月起，同时担任华安事件驱动量化策略混合型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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、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市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，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% 的次数为 9 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，A 股市场以窄幅震荡为主，价值成长风格切换较为频繁，市场情绪整体比较谨慎。深证 300 指数全年下跌 19.39%，与之对比，上证综合指数下跌 12.91%，中证 500 下跌 17.78%，中小板指数下跌 22.89%，创业板指数下跌 27.71%；从成交额来看，A 股市场交易活跃度较 2015 年有所降低：万德全 A 全年成交金额 126.51 万亿，较 2015 年下降 50.08%。整体来看，在经历了 2015 年的大幅波动后，2016 年 A 股市场呈缩量调整态势，资金面以存量博弈为主。深证 300 指数，作为成分股风格、行业配比都较为均衡的指数，在主流指数中表现较好。管理人利用复制指数的方法管理基金，基金净值走势与指数走势相近。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.195 元，本报告期份额净值增长率为-18.71%，同期业绩比较基准增长率为-18.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，尽管资本市场仍面临国内外经济、政治环境等很多不确定性，但我们仍看好权益资产的整体表现：一方面，从影响估值最核心的企业盈利来看，经济转型期中，供给侧改革、产业结构升级、一带一路等政策和主题带动企业盈利预期数据整体向好。若预期逐步兑现，则有望持续提高整个市场的估值水平。另一方面，从利率角度，在目前的低利率环境下，我们认为货币政策继续紧

缩的可能性不大，低利率环境将提升权益市场吸引力；另外从市场情绪角度，经济企稳有助于提高投资者风险偏好，从大类资产配置的角度，吸引资金流向权益市场。

深证 300 指数整体市盈率 27.82 倍，2017 年预测市盈率 2.22 倍，在主流指数中具有一定优势，我们认为在 2017 年，该指数大概率将有较好的表现。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- （1）积极配合监管部门新法规的实施，不断完善公司的内部控制制度和业务操作流程；
- （2）继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。
- （3）完善公司内控建设，强化基金的公平交易和异常交易的检查与监控，防范内幕交易与操纵市场行为的出现，同时进行投资管理人员合规培训、及定期进行基金经理的合规谈话，建立健全坚守“三条底线”的长效机制；
- （4）做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。
- （5）推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。
- （6）按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。
- （7）有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：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、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，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、华安汇财通货币、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、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20220 号

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“华安深证 300 指数基金”)的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

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

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映;

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

6.2 注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述华安深证 300 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安深证 300 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

单峰 张振波

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	1,768,143.34	2,327,304.14
结算备付金		-	-
存出保证金		1,544.74	5,360.12
交易性金融资产	7.4.7.2	25,170,108.71	33,465,374.11
其中: 股票投资		25,166,477.99	33,455,274.11
基金投资		-	-
债券投资		3,630.72	10,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	359.73	480.99
应收股利		-	-
应收申购款		1,628.39	20,021.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,941,784.91	35,818,540.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		51,954.27	-

应付赎回款		2.49	53,783.65
应付管理人报酬		11,621.05	14,984.72
应付托管费		2,324.22	2,996.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,644.92	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	7.4.7.8	286,000.02	346,202.67
负债合计		357,546.97	425,437.05
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	22,240,279.75	24,080,120.41
未分配利润	7.4.7.10	4,343,958.19	11,312,983.08
所有者权益合计		26,584,237.94	35,393,103.49
负债和所有者权益总计		26,941,784.91	35,818,540.54

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.195 元，基金份额总额 22,240,279.75 份。

7.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-5,829,503.42	14,462,921.96
1.利息收入		13,336.37	22,655.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,319.37	22,644.66
债券利息收入		17.00	10.98
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		174,610.66	19,965,980.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-167,573.60	19,660,642.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,332.01	9,136.56
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	340,852.25	296,201.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,027,407.24	-5,552,873.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,956.79	27,158.98
减：二、费用		731,324.39	1,130,499.05
1. 管理人报酬		144,685.22	214,244.97
2. 托管费		28,937.00	42,849.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	41,509.68	295,305.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	516,192.49	578,099.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,560,827.81	13,332,422.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,560,827.81	13,332,422.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,560,827.81	-6,560,827.81
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）	-1,839,840.66	-408,197.08	-2,248,037.74
其中：1.基金申购款	6,414,007.89	1,544,828.17	7,958,836.06
2.基金赎回款	-8,253,848.55	-1,953,025.25	-10,206,873.80
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）	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	13,332,422.91	13,332,422.91
三、本期基金份额交易	-26,346,604.88	-11,465,253.78	-37,811,858.66

产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	13,135,856.11	7,437,774.86	20,573,630.97
2.基金赎回款	-39,482,460.99	-18,903,028.64	-58,385,489.63
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）	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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 607,830,415.01 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 146,584,084.00 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，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%。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{深证 300 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于 2016 年度出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分布信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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、资产支持证券和私募债券除外)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,768,143.34	2,327,304.14
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,768,143.34	2,327,304.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		26,479,738.04	25,166,477.99	-1,313,260.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,200.00	3,630.72	430.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,200.00	3,630.72	430.72
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		26,482,938.04	25,170,108.71	-1,312,829.33
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		28,740,696.20	33,455,274.11	4,714,577.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	10,100.00	10,100.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,100.00	10,100.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		28,750,796.20	33,465,374.11	4,714,577.91

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	351.50	476.91
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	-	0.02
应收债券利息	7.26	1.55
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.27	0.11
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.70	2.40
合计	359.73	480.99

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,644.92	7,469.07
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,644.92	7,469.07

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.02	202.67
预提账户维护费	-	-
预提费用	236,000.00	296,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	286,000.02	346,202.67

7.4.7.9 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 12 月 31 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	6,414,007.89	6,414,007.89
本期赎回（以“-”号填列）	-8,253,848.55	-8,253,848.55
本期末	22,240,279.75	22,240,279.75

注：截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,339,947.00 份(2015 年 12 月 31 日：1,709,607.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 20,900,332.75 份(2015 年 12 月 31 日：22,370,513.41 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,203,061.89	-2,890,078.81	11,312,983.08
本期利润	-533,420.57	-6,027,407.24	-6,560,827.81
本期基金份额交易产生的变动数	-1,065,471.63	657,274.55	-408,197.08
其中：基金申购款	3,731,321.67	-2,186,493.50	1,544,828.17

基金赎回款	-4,796,793.30	2,843,768.05	-1,953,025.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,604,169.69	-8,260,211.50	4,343,958.19

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	13,091.20	21,088.04
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	172.59	1,183.84
其他	55.58	372.78
合计	13,319.37	22,644.66

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	14,541,903.27	111,693,583.69
减：卖出股票成本总额	14,709,476.87	92,032,941.12
买卖股票差价收入	-167,573.60	19,660,642.57

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,332.01	9,136.56
债券投资收益——赎回差价收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,332.01	9,136.56

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,443.30	27,450.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,100.00	18,300.00
减：应收利息总额	11.29	13.44
买卖债券差价收入	1,332.01	9,136.56

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	340,852.25	296,201.69
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	340,852.25	296,201.69

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-6,027,407.24	-5,552,873.48
——股票投资	-6,027,837.96	-5,548,527.60
——债券投资	430.72	-4,345.88
——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	-6,027,407.24	-5,552,873.48

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	9,956.79	27,158.98
其他收入_其他	-	-
合计	9,956.79	27,158.98

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	41,509.68	295,305.27
银行间市场交易费用	-	-

合计	41,509.68	295,305.27
----	-----------	------------

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	180,000.00	240,000.00
银行汇划费用	2,192.49	4,099.79
上市年费	60,000.00	60,000.00
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	516,192.49	578,099.79

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运

营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止, 上述税收政策对本基金 2016 年度的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	144,685.22	214,244.97

其中：支付销售机构的客户维护费	54,162.12	79,531.91
-----------------	-----------	-----------

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,937.00	42,849.02

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,768,143.34	13,091.20	2,327,304.14	21,088.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

基金作为个人投资者参与网上认购获配的新债，从新债获配日至新债上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000050	深天马 A	2016-09-12	重大事项停牌	18.82	-	-	4,024.00	66,278.88	75,731.68	-
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项停牌	6.25	2017-01-26	6.29	36,482.00	324,897.19	228,012.50	-
000516	国际医学	2016-12-05	重大事项停牌	7.90	-	-	9,365.00	44,138.12	73,983.50	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项停牌	6.93	2017-01-03	7.00	16,341.00	130,054.15	113,243.13	-
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	2017-01-03	16.90	4,700.00	91,729.00	72,192.00	-
000558	莱茵体育	2016-10-17	重大事项停牌	13.91	-	-	2,800.00	44,772.00	38,948.00	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	1,360.00	29,419.08	17,000.00	-
000697	炼石有色	2016-11-17	重大事项停牌	23.51	-	-	2,500.00	61,900.21	58,775.00	-
000748	长城信息	2016-11-01	重大事项停牌	20.31	-	-	4,209.00	92,793.80	85,484.79	2017 年 1 月

										18 日 起终 止上 市并 已摘 牌
000750	国海证 券	2016-12-15	重大事 项停牌	6.97	2017-01-20	6.27	12,676.00	116,345.73	88,351.72	-
000829	天音控 股	2016-09-29	重大事 项停牌	11.28	-	-	4,111.00	54,280.54	46,372.08	-
000887	中鼎股 份	2016-11-18	重大事 项停牌	25.94	2017-02-15	23.99	3,575.00	51,013.02	92,735.50	-
002075	沙钢股 份	2016-09-19	重大事 项停牌	16.12	-	-	4,700.00	70,137.00	75,764.00	-
002129	中环股 份	2016-04-25	重大事 项停牌	8.27	-	-	9,237.00	162,065.38	76,389.99	-
002396	星网锐 捷	2016-09-12	重大事 项停牌	19.70	2017-02-21	18.35	2,029.00	35,591.56	39,971.30	-
002400	省广股 份	2016-11-28	重大事 项停牌	13.79	-	-	5,710.00	108,304.26	78,740.90	-
002440	闰土股 份	2016-10-21	重大事 项停牌	16.34	2017-01-12	15.22	2,921.00	62,180.06	47,729.14	-
002491	通鼎互 联	2016-12-22	重大事 项停牌	15.54	2017-01-03	15.89	2,052.00	37,001.82	31,888.08	-
002681	奋达科 技	2016-12-19	重大事 项停牌	12.93	-	-	2,230.00	45,106.51	28,833.90	-
300088	长信科 技	2016-09-12	重大事 项停牌	15.80	-	-	6,082.00	61,697.39	96,095.60	-
300104	乐视网	2016-12-07	重大事 项停牌	32.96	2017-01-16	36.88	6,245.00	334,685.60	205,835.20	-
300212	易华录	2016-11-30	重大事 项停牌	34.00	-	-	1,310.00	46,703.58	44,540.00	-
300367	东方网 力	2016-12-15	重大事 项停牌	20.04	-	-	2,600.00	64,768.00	52,104.00	-
300496	中科创 达	2016-10-11	重大事 项停牌	52.28	2017-01-06	47.49	600.00	39,870.00	31,368.00	-

注：1. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1:0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。

换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通, 当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

2. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该类股票将在所公布事项的重大影响消除后, 经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责, 并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能

以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	1,768,143.34	-	-	-	1,768,143.34
存出保证金	1,544.74	-	-	-	1,544.74
交易性金融资产	-	-	3,630.72	25,166,477.99	25,170,108.71
应收利息	-	-	-	359.73	359.73
应收申购款	-	-	-	1,628.39	1,628.39
资产总计	1,769,688.08	-	3,630.72	25,168,466.11	26,941,784.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2.49	2.49
应付管理人报酬	-	-	-	11,621.05	11,621.05

应付托管费	-	-	-	2,324.22	2,324.22
应付交易费用	-	-	-	5,644.92	5,644.92
应付证券清算款	-	-	-	51,954.27	51,954.27
其他负债	-	-	-	286,000.02	286,000.02
负债总计	-	-	-	357,546.97	357,546.97
利率敏感度缺口	1,769,688.08	-	3,630.72	24,810,919.14	26,584,237.94
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01% (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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	25,166,477.99	94.67	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	-	-	-	-
合计	25,166,477.99	94.67	33,455,274.11	94.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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：人民币元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,420,000.00	增加约 1,820,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,420,000.00	减少约 1,820,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 23,370,018.70 元，属于第二层次的余额为 1,800,090.01 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 28,569,211.51 元，第二层次 4,896,162.60 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,166,477.99	93.41
	其中：股票	25,166,477.99	93.41
2	固定收益投资	3,630.72	0.01
	其中：债券	3,630.72	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	1,768,143.34	6.56
7	其他各项资产	3,532.86	0.01
8	合计	26,941,784.91	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	695,973.11	2.62
B	采矿业	232,295.34	0.87
C	制造业	13,202,940.39	49.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	341,674.26	1.29
E	建筑业	409,165.88	1.54
F	批发和零售业	608,424.65	2.29
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	2,778,086.32	10.45
J	金融业	2,157,194.08	8.11
K	房地产业	1,476,694.38	5.55
L	租赁和商务服务业	467,547.64	1.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	438,381.99	1.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,803.20	0.44
R	文化、体育和娱乐业	690,318.07	2.60
S	综合	111,245.68	0.42
	合计	23,725,744.99	89.25

8.2.2 积极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	-	-

B	采矿业	52,763.00	0.20
C	制造业	1,092,356.00	4.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,820.00	0.64
J	金融业	41,760.00	0.16
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	83,034.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,440,733.00	5.42

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	24,366	686,390.22	2.58
2	000651	格力电器	26,524	653,020.88	2.46
3	000002	万科A	22,906	470,718.30	1.77
4	000001	平安银行	46,823	426,089.30	1.60
5	300498	温氏股份	11,743	413,588.46	1.56

6	000725	京东方 A	140,828	402,768.08	1.52
7	000858	五 粮 液	10,238	353,006.24	1.33
8	000776	广发证券	16,994	286,518.84	1.08
9	002415	海康威视	11,000	261,910.00	0.99
10	002450	康得新	13,544	258,825.84	0.97
11	002024	苏宁云商	21,325	244,171.25	0.92
12	000166	申万宏源	36,482	228,012.50	0.86
13	002304	洋河股份	3,064	216,318.40	0.81
14	000063	中兴通讯	13,012	207,541.40	0.78
15	300104	乐视网	6,245	205,835.20	0.77
16	300059	东方财富	11,979	202,804.47	0.76
17	000783	长江证券	19,607	200,579.61	0.75
18	000538	云南白药	2,514	191,441.10	0.72
19	001979	招商蛇口	11,100	181,929.00	0.68
20	002673	西部证券	8,631	179,265.87	0.67
21	000625	长安汽车	11,937	178,338.78	0.67
22	000413	东旭光电	15,292	172,187.92	0.65
23	000503	海虹控股	4,033	169,587.65	0.64
24	002142	宁波银行	9,565	159,161.60	0.60
25	000423	东阿阿胶	2,933	158,000.71	0.59
26	002202	金风科技	9,222	157,788.42	0.59
27	002736	国信证券	10,016	155,748.80	0.59
28	000768	中航飞机	7,279	154,751.54	0.58
29	300070	碧水源	8,677	152,021.04	0.57
30	002594	比亚迪	3,036	150,828.48	0.57
31	000100	TCL 集团	45,428	149,912.40	0.56
32	002456	欧菲光	4,291	147,095.48	0.55
33	300017	网宿科技	2,720	145,819.20	0.55
34	300072	三聚环保	3,134	145,072.86	0.55
35	002230	科大讯飞	5,294	143,414.46	0.54
36	300024	机器人	6,636	141,877.68	0.53
37	000568	泸州老窖	4,207	138,831.00	0.52
38	000839	中信国安	15,055	138,204.90	0.52
39	000728	国元证券	6,898	137,270.20	0.52
40	002739	万达院线	2,482	134,201.74	0.50
41	000338	潍柴动力	13,372	133,185.12	0.50
42	002241	歌尔股份	4,787	126,951.24	0.48
43	000069	华侨城 A	18,085	125,690.75	0.47
44	000623	吉林敖东	4,047	125,416.53	0.47
45	002466	天齐锂业	3,806	123,504.70	0.46
46	002065	东华软件	5,248	122,278.40	0.46
47	000157	中联重科	26,468	120,164.72	0.45
48	300124	汇川技术	5,860	119,133.80	0.45
49	000793	华闻传媒	10,459	118,082.11	0.44

50	002252	上海莱士	5,110	117,989.90	0.44
51	000895	双汇发展	5,575	116,684.75	0.44
52	000540	中天城投	16,341	113,243.13	0.43
53	002007	华兰生物	3,160	112,970.00	0.42
54	002236	大华股份	8,148	111,464.64	0.42
55	000009	中国宝安	10,738	111,245.68	0.42
56	002008	大族激光	4,858	109,790.80	0.41
57	000630	铜陵有色	35,480	109,278.40	0.41
58	300315	掌趣科技	11,592	107,110.08	0.40
59	002475	立讯精密	5,055	104,891.25	0.39
60	002465	海格通信	8,938	104,127.70	0.39
61	000686	东北证券	8,252	101,994.72	0.38
62	300027	华谊兄弟	8,978	98,758.00	0.37
63	000060	中金岭南	8,812	98,253.80	0.37
64	000826	启迪桑德	2,951	97,323.98	0.37
65	300088	长信科技	6,082	96,095.60	0.36
66	300408	三环集团	6,000	95,280.00	0.36
67	000917	电广传媒	6,531	93,981.09	0.35
68	000876	新 希 望	11,544	92,929.20	0.35
69	000887	中鼎股份	3,575	92,735.50	0.35
70	002405	四维图新	4,724	91,409.40	0.34
71	000559	万向钱潮	6,846	90,777.96	0.34
72	000656	金科股份	16,967	88,907.08	0.33
73	002183	怡 亚 通	8,184	88,878.24	0.33
74	300003	乐普医疗	4,940	88,574.20	0.33
75	002310	东方园林	6,249	88,423.35	0.33
76	000750	国海证券	12,676	88,351.72	0.33
77	002085	万丰奥威	4,383	86,608.08	0.33
78	000748	长城信息	4,209	85,484.79	0.32
79	002500	山西证券	7,104	85,390.08	0.32
80	002385	大北农	12,010	85,271.00	0.32
81	000425	徐工机械	24,602	83,154.76	0.31
82	002426	胜利精密	10,000	82,700.00	0.31
83	000709	河钢股份	24,686	82,451.24	0.31
84	300168	万达信息	4,043	81,749.46	0.31
85	000998	隆平高科	3,801	81,455.43	0.31
86	002340	格林美	12,318	80,682.90	0.30
87	002074	国轩高科	2,600	80,574.00	0.30
88	002400	省广股份	5,710	78,740.90	0.30
89	300058	蓝色光标	7,604	77,332.68	0.29
90	002460	赣锋锂业	2,900	76,879.00	0.29
91	000997	新 大 陆	3,955	76,845.65	0.29
92	002129	中环股份	9,237	76,389.99	0.29
93	000963	华东医药	1,056	76,105.92	0.29

94	000402	金 融 街	7,374	75,952.20	0.29
95	002075	沙钢股份	4,700	75,764.00	0.28
96	000050	深天马 A	4,024	75,731.68	0.28
97	000983	西山煤电	8,892	75,226.32	0.28
98	300115	长盈精密	2,867	74,714.02	0.28
99	300144	宋城演艺	3,558	74,504.52	0.28
100	002081	金 螳 螂	7,605	74,452.95	0.28
101	000661	长春高新	663	74,156.55	0.28
102	000516	国际医学	9,365	73,983.50	0.28
103	000547	航天发展	4,700	72,192.00	0.27
104	000581	威孚高科	3,214	72,122.16	0.27
105	000977	浪潮信息	3,400	72,080.00	0.27
106	002092	中泰化学	5,931	71,765.10	0.27
107	000415	渤海金控	10,000	71,500.00	0.27
108	002168	深圳惠程	4,501	71,385.86	0.27
109	002049	紫光国芯	2,136	70,359.84	0.26
110	000400	许继电气	3,820	69,333.00	0.26
111	000690	宝新能源	7,398	68,579.46	0.26
112	000930	中粮生化	5,100	68,544.00	0.26
113	002027	分众传媒	4,800	68,496.00	0.26
114	002176	江特电机	5,700	68,001.00	0.26
115	000970	中科三环	5,082	67,844.70	0.26
116	000039	中集集团	4,602	67,281.24	0.25
117	002030	达安基因	2,883	66,885.60	0.25
118	000792	盐湖股份	3,501	66,764.07	0.25
119	002470	金正大	8,412	66,454.80	0.25
120	000738	中航动控	2,648	65,511.52	0.25
121	002292	奥飞娱乐	2,866	65,058.20	0.24
122	002038	双鹭药业	2,403	64,184.13	0.24
123	002701	奥瑞金	7,421	64,117.44	0.24
124	000778	新兴铸管	12,362	63,911.54	0.24
125	002004	华邦健康	7,000	63,490.00	0.24
126	002422	科伦药业	3,938	63,480.56	0.24
127	002573	清新环境	3,626	63,346.22	0.24
128	000046	泛海控股	6,775	62,939.75	0.24
129	300253	卫宁健康	3,203	62,746.77	0.24
130	000598	兴蓉环境	10,867	62,593.92	0.24
131	002439	启明星辰	3,000	62,370.00	0.23
132	002179	中航光电	1,700	61,693.00	0.23
133	000566	海南海药	4,794	60,931.74	0.23
134	000712	锦龙股份	2,586	60,615.84	0.23
135	000960	锡业股份	4,563	59,866.56	0.23
136	300015	爱尔眼科	1,968	58,843.20	0.22
137	000697	炼石有色	2,500	58,775.00	0.22

138	002013	中航机电	3,212	58,747.48	0.22
139	002250	联化科技	3,624	58,636.32	0.22
140	002353	杰瑞股份	2,879	58,443.70	0.22
141	000961	中南建设	5,617	58,416.80	0.22
142	000988	华工科技	3,717	58,171.05	0.22
143	300033	同花顺	844	58,050.32	0.22
144	002195	二三四五	5,100	57,732.00	0.22
145	002311	海大集团	3,833	57,686.65	0.22
146	000758	中色股份	7,202	57,543.98	0.22
147	002223	鱼跃医疗	1,848	57,324.96	0.22
148	002273	水晶光电	2,868	57,073.20	0.21
149	300244	迪安诊断	1,780	56,960.00	0.21
150	000592	平潭发展	8,348	56,432.48	0.21
151	300418	昆仑万维	2,600	56,160.00	0.21
152	002665	首航节能	6,410	56,151.60	0.21
153	002018	华信国际	5,500	55,935.00	0.21
154	002001	新 和 成	2,848	55,820.80	0.21
155	300055	万邦达	3,400	55,692.00	0.21
156	300431	暴风集团	1,200	55,200.00	0.21
157	002185	华天科技	4,569	55,193.52	0.21
158	002294	信立泰	1,885	55,117.40	0.21
159	300134	大富科技	2,171	55,056.56	0.21
160	300383	光环新网	2,200	54,912.00	0.21
161	000031	中粮地产	6,130	54,679.60	0.21
162	000012	南 玻 A	4,805	54,488.70	0.20
163	300002	神州泰岳	5,891	54,432.84	0.20
164	000078	海王生物	8,605	54,211.50	0.20
165	000999	华润三九	2,191	54,183.43	0.20
166	000878	云南铜业	4,581	54,101.61	0.20
167	002146	荣盛发展	6,861	53,858.85	0.20
168	002152	广电运通	4,050	53,784.00	0.20
169	000671	阳 光 城	9,650	53,750.50	0.20
170	000718	苏宁环球	6,199	53,497.37	0.20
171	300077	国民技术	3,287	53,413.75	0.20
172	000028	国药一致	796	53,252.40	0.20
173	002051	中工国际	2,318	53,128.56	0.20
174	002138	顺络电子	3,068	53,107.08	0.20
175	002410	广联达	3,602	52,589.20	0.20
176	300251	光线传媒	5,378	52,489.28	0.20
177	000883	湖北能源	11,410	52,257.80	0.20
178	300367	东方网力	2,600	52,104.00	0.20
179	002299	圣农发展	2,453	52,052.66	0.20
180	000006	深振业 A	5,490	51,880.50	0.20
181	002191	劲嘉股份	4,973	51,768.93	0.19

182	000938	紫光股份	900	51,651.00	0.19
183	300079	数码视讯	7,166	51,308.56	0.19
184	000061	农产品	4,135	51,149.95	0.19
185	000729	燕京啤酒	7,356	51,124.20	0.19
186	002276	万马股份	3,400	51,102.00	0.19
187	000800	一汽轿车	4,700	51,089.00	0.19
188	300146	汤臣倍健	4,238	50,601.72	0.19
189	000825	太钢不锈	12,812	50,479.28	0.19
190	002501	利源精制	4,100	50,307.00	0.19
191	002343	慈文传媒	1,100	49,687.00	0.19
192	300273	和佳股份	2,910	49,644.60	0.19
193	300267	尔康制药	3,800	49,590.00	0.19
194	000786	北新建材	4,774	49,124.46	0.18
195	000979	中弘股份	18,510	48,866.40	0.18
196	002266	浙富控股	8,438	48,602.88	0.18
197	002477	雏鹰农牧	9,604	48,212.08	0.18
198	000627	天茂集团	6,300	48,195.00	0.18
199	300026	红日药业	8,875	48,191.25	0.18
200	002019	亿帆医药	3,134	47,918.86	0.18
201	002104	恒宝股份	4,055	47,808.45	0.18
202	002022	科华生物	2,390	47,800.00	0.18
203	000156	华数传媒	2,666	47,748.06	0.18
204	002440	闰土股份	2,921	47,729.14	0.18
205	002424	贵州百灵	2,515	47,634.10	0.18
206	300182	捷成股份	4,599	47,415.69	0.18
207	002280	联络互动	3,350	46,799.50	0.18
208	300291	华录百纳	2,100	46,788.00	0.18
209	300199	翰宇药业	2,600	46,748.00	0.18
210	000732	泰禾集团	2,630	46,524.70	0.18
211	002153	石基信息	1,903	46,376.11	0.17
212	000829	天音控股	4,111	46,372.08	0.17
213	000543	皖能电力	6,060	46,116.60	0.17
214	000066	长城电脑	3,700	46,028.00	0.17
215	000027	深圳能源	6,600	45,342.00	0.17
216	300133	华策影视	3,946	44,787.10	0.17
217	300212	易华录	1,310	44,540.00	0.17
218	002390	信邦制药	4,500	44,505.00	0.17
219	002714	牧原股份	1,900	44,232.00	0.17
220	002268	卫士通	1,400	43,988.00	0.17
221	000667	美好置业	11,900	43,911.00	0.17
222	300170	汉得信息	3,700	43,697.00	0.16
223	300166	东方国信	2,100	43,659.00	0.16
224	002368	太极股份	1,417	43,374.37	0.16
225	300001	特锐德	2,500	43,350.00	0.16

226	002489	浙江永强	5,716	43,270.12	0.16
227	002522	浙江众成	2,400	43,176.00	0.16
228	002657	中科金财	1,000	43,160.00	0.16
229	300274	阳光电源	4,073	42,929.42	0.16
230	000901	航天科技	1,299	42,685.14	0.16
231	000021	深科技	4,442	41,888.06	0.16
232	300010	立思辰	2,500	41,550.00	0.16
233	300216	千山药机	1,210	41,055.30	0.15
234	300014	亿纬锂能	1,400	40,880.00	0.15
235	000937	冀中能源	6,046	40,750.04	0.15
236	002431	棕榈股份	4,397	40,276.52	0.15
237	002396	星网锐捷	2,029	39,971.30	0.15
238	000898	鞍钢股份	7,930	39,967.20	0.15
239	000685	中山公用	3,588	39,934.44	0.15
240	002002	鸿达兴业	5,420	39,782.80	0.15
241	001696	宗申动力	4,211	39,583.40	0.15
242	002224	三力士	2,600	39,104.00	0.15
243	000558	莱茵体育	2,800	38,948.00	0.15
244	002375	亚厦股份	3,665	38,775.70	0.15
245	000687	华讯方舟	2,500	38,400.00	0.14
246	002308	威创股份	2,600	38,324.00	0.14
247	002261	拓维信息	3,200	38,144.00	0.14
248	002437	誉衡药业	4,500	37,215.00	0.14
249	002285	世联行	4,880	37,088.00	0.14
250	002399	海普瑞	1,977	36,020.94	0.14
251	300433	蓝思科技	1,300	35,893.00	0.14
252	002055	得润电子	1,500	35,565.00	0.13
253	300085	银之杰	1,690	35,321.00	0.13
254	002474	榕基软件	2,599	35,242.44	0.13
255	002190	成飞集成	1,078	34,474.44	0.13
256	002467	二六三	3,256	34,253.12	0.13
257	000851	高鸿股份	2,900	33,814.00	0.13
258	002284	亚太股份	2,382	33,514.74	0.13
259	002642	荣之联	1,650	33,165.00	0.12
260	000973	佛塑科技	4,400	33,000.00	0.12
261	002555	三七互娱	2,000	32,800.00	0.12
262	000158	常山股份	2,600	32,500.00	0.12
263	002010	传化智联	1,700	31,960.00	0.12
264	002491	通鼎互联	2,052	31,888.08	0.12
265	000062	深圳华强	1,107	31,449.87	0.12
266	300043	星辉娱乐	3,100	31,434.00	0.12
267	300496	中科创达	600	31,368.00	0.12
268	002563	森马服饰	3,000	30,810.00	0.12
269	002681	奋达科技	2,230	28,833.90	0.11

270	000539	粤电力 A	5,047	26,850.04	0.10
271	002416	爱施德	1,800	26,514.00	0.10
272	000681	视觉中国	1,221	23,272.26	0.09
273	002568	百润股份	1,000	20,240.00	0.08

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300136	信维通信	3,900	111,150.00	0.42
2	002044	美年健康	6,300	83,034.00	0.31
3	002407	多氟多	3,000	81,870.00	0.31
4	300156	神雾环保	3,000	75,030.00	0.28
5	300296	利亚德	2,100	70,812.00	0.27
6	002131	利欧股份	4,200	66,990.00	0.25
7	002508	老板电器	1,800	66,240.00	0.25
8	002572	索菲亚	1,200	64,992.00	0.24
9	000008	神州高铁	6,400	59,648.00	0.22
10	000806	银河生物	3,300	52,272.00	0.20
11	300068	南都电源	2,400	46,248.00	0.17
12	300207	欣旺达	3,300	45,870.00	0.17
13	002108	沧州明珠	2,100	42,777.00	0.16
14	300020	银江股份	2,700	42,606.00	0.16
15	002444	巨星科技	2,700	42,120.00	0.16
16	002797	第一创业	1,200	41,760.00	0.16
17	002326	永太科技	2,400	39,144.00	0.15
18	002329	皇氏集团	2,700	38,124.00	0.14
19	000762	西藏矿业	2,100	35,763.00	0.13
20	002624	完美世界	1,200	35,748.00	0.13
21	002716	金贵银业	1,500	34,710.00	0.13
22	002610	爱康科技	10,500	34,335.00	0.13
23	000957	中通客车	2,100	33,327.00	0.13
24	002643	万润股份	900	32,670.00	0.12
25	300292	吴通控股	3,600	31,428.00	0.12
26	300073	当升科技	600	25,842.00	0.10
27	000555	神州信息	1,200	25,476.00	0.10
28	002709	天赐材料	600	25,302.00	0.10
29	002631	德尔未来	1,200	22,284.00	0.08
30	000693	ST 华泽	1,360	17,000.00	0.06
31	300474	景嘉微	300	16,161.00	0.06

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	413,277.00	1.17
2	000333	美的集团	319,274.00	0.90
3	000001	平安银行	203,584.00	0.58
4	002673	西部证券	190,793.00	0.54
5	000413	东旭光电	178,939.00	0.51
6	002739	万达院线	160,599.00	0.45
7	000725	京东方 A	154,341.00	0.44
8	002304	洋河股份	139,435.00	0.39
9	000100	TCL 集团	134,440.00	0.38
10	000776	广发证券	128,869.00	0.36
11	000166	申万宏源	128,828.00	0.36
12	300408	三环集团	125,891.00	0.36
13	300072	三聚环保	124,557.00	0.35
14	002450	康得新	121,958.00	0.34
15	300059	东方财富	120,071.00	0.34
16	300017	网宿科技	118,121.00	0.33
17	002049	紫光国芯	116,558.00	0.33
18	300124	汇川技术	110,141.00	0.31
19	300136	信维通信	108,640.00	0.31
20	002460	赣锋锂业	108,040.00	0.31

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000982	中银绒业	1,333,313.20	3.77
2	000002	万 科 A	756,036.72	2.14
3	000876	新 希 望	252,392.44	0.71
4	000333	美的集团	235,712.68	0.67
5	000725	京东方 A	228,722.92	0.65

6	002024	苏宁云商	196,169.95	0.55
7	000001	平安银行	194,968.48	0.55
8	000748	长城信息	176,180.86	0.50
9	300059	东方财富	162,360.53	0.46
10	000839	中信国安	147,919.85	0.42
11	002450	康得新	144,517.26	0.41
12	300072	三聚环保	144,246.62	0.41
13	000776	广发证券	141,201.58	0.40
14	002673	西部证券	139,279.01	0.39
15	300024	机器人	136,019.32	0.38
16	000100	TCL 集团	135,584.00	0.38
17	300104	乐视网	133,205.84	0.38
18	000413	东旭光电	123,678.07	0.35
19	002415	海康威视	121,791.74	0.34
20	002236	大华股份	119,253.64	0.34

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,448,518.71
卖出股票的收入（成交）总额	14,541,903.27

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,630.72	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,630.72	0.01

8.6 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	3,630.72	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 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持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2016 年 11 月 26 日, 广发证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]128 号), 被中国证监会处以券责令改正, 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, 原因为公司存在未能按规定审查、了解客户身份等违法违规行为。本报告期内, 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。

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

8.12.3 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	1,544.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	359.73
5	应收申购款	1,628.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,532.86

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	3,630.72	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
580	38,345.31	0.00	0.00%	22,240,279.75	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘素清	200,700.00	0.91%
2	张凌	183,619.00	0.83%
3	金思宇	150,018.00	0.68%
4	曹伟	110,009.00	0.50%
5	杨晓云	78,809.00	0.36%
6	李萍	75,000.00	0.34%
7	曹洁	60,002.00	0.27%
8	蔡俏冰	50,009.00	0.23%
9	黄耀芳	50,001.00	0.23%
10	曾亭曦	44,861.00	0.21%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	295.37	0.00%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 9 月 2 日)基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	24,080,120.41
本报告期基金总申购份额	6,414,007.89
减：本报告期基金总赎回份额	8,253,848.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,240,279.75

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 56,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
西南证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	1	16,483,483.63	61.13%	15,021.71	61.13%	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	10,482,873.71	38.87%	9,553.17	38.87%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	11,443.30	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间	《上海证券报》、《证券	2016-01-04

	调整旗下基金相关业务办理时间的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
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公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
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

	公告	和公司网站	
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	2016-05-10
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
43	关于旗下部分基金增加常熟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	2016-07-20
44	华安基金新增蛋卷基金代销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	2016-07-22
45	华安基金关于旗下部分基金增加大智慧为销	《上海证券报》、《证券	2016-08-06

	售机构并参加费率优惠活动的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
46	关于旗下部分基金增加华金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	2016-08-12
47	关于旗下部分基金增加创金启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	2016-08-13
48	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	2016-08-15
49	关于旗下部分基金增加同花顺为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-20
50	关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-21
51	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公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-23
52	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-13
53	关于旗下部分基金增加云湾投资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	2016-11-10
54	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	2016-11-10
55	关于旗下部分基金增加乾道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	2016-11-16
56	华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-16
57	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公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-29
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“莱茵体育”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	2016-11-30
59	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万家文化”、“乐视网”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	2016-12-15

60	关于旗下部分基金增加东海期货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	2016-12-20
61	关于旗下部分基金参加邮储银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28

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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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；

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日