

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
2017 年年度报告
2017 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 22 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	错误！未定义书签。
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	67
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67

8.10 告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.11 投资组合报告附注	67
§9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末上市基金前十名持有人	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
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	74
§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	79
14.1 备查文件目录	79
14.2 存放地点	79
14.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	华安沪深 300 指数分级		
场内简称	华安 300		
基金主代码	160417		
交易代码	160417		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 25 日		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	197,406,661.17 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	2012 年 7 月 23 日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指 数分级 B	华安沪深 300 指 数分级
下属分级基金的场内简称	HS300A	HS300B	华安 300
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	2,451,049.00 份	2,451,049.00 份	192,504,563.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差,追求尽可能贴近标的指数的表现。		
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征;华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	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 层、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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层
--------	------------	-------------------------------

§3 主要财务指标、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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	13,755,844.84	-1,567,958.40	34,643,488.43
本期利润	51,001,626.03	-3,392,865.31	14,816,532.71
加权平均基金份额本期利润	0.2970	-0.1595	0.3730
本期加权平均净值利润率	22.84%	-13.94%	25.93%
本期基金份额净值增长率	24.60%	-12.42%	3.85%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	106,043,090.05	6,667,549.37	8,016,017.88
期末可供分配基金份额利润	0.5372	0.2623	0.4386
期末基金资产净值	280,712,691.33	29,639,202.08	24,948,415.91
期末基金份额净值	1.4220	1.1660	1.3650
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	60.72%	28.98%	47.27%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.06%	0.76%	4.82%	0.76%	0.24%	0.00%
过去六个月	11.79%	0.66%	9.44%	0.66%	2.35%	0.00%
过去一年	24.60%	0.60%	20.70%	0.60%	3.90%	0.00%
过去三年	13.33%	1.62%	13.42%	1.60%	-0.09%	0.02%
过去五年	53.21%	1.48%	56.87%	1.47%	-3.66%	0.01%
自基金合同生效起至今	60.72%	1.45%	57.53%	1.44%	3.19%	0.01%

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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

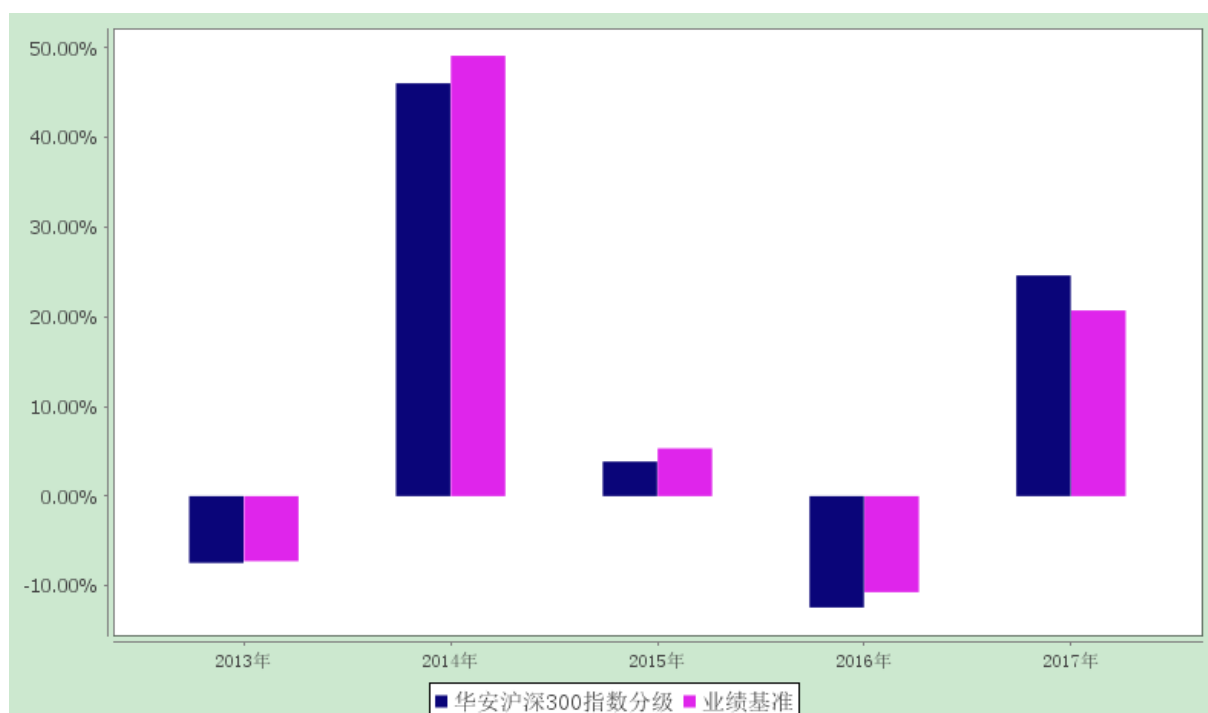
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 6 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)



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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

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 2012 年 6 月 25 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

根据基金合同，本基金不进行收益分配。

§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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 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		
钱晶	本基金的基金经理	2015-05-28	2017-10-27	6 年	硕士，6 年证券、基金行业从业经验，曾任国信证券分析师。2014 年 12 月加入华安基金，任指数投资部量化分析师。2015 年 5 月至 2017 年 10 月，担任本基金的基金经理。2015 年 6 月至 2017 年 10 月，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 月至 2017 年 10 月，担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月至 2017 年 10 月，担任华安中证细分医药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。2016 年 8 月至 2017 年 10 月，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
苏卿云	本基金的基金经理	2017-10-11	-	10 年	硕士研究生，10 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资事业总部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月起，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任本基金、华安中证细分医药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。2017 年 12 月起，同时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

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 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

2017 年，随着供给侧结构性改革的进一步推进以及全球经济的全面持续复苏，国内经济总体呈现平稳态势，全年 GDP 增速 6.9%，工业企业，特别是周期性行业盈利逐步改善，PPI 持续恢复性上涨。国内央行保持稳健中性的货币政策基调，利率中枢自 2017 年下半年起呈逐步上行趋势。以资管新规为代表的金融监管法规密集出台，以进一步规范资管行业，防范金融风险。

受经济基本面、产业逻辑以及投资者结构和资金偏好的共同影响，2017 年全年 A 股市场风格出现极端分化，价值股重估，龙头股崛起，代表大盘蓝筹的上证 180 指数和沪深 300 指数全年分别上涨 19.69% 和 21.78%，而中小市值股票则持续下跌。同时，A 股指数的波动率出现显著下降。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而控制每日跟踪误差以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.4220 元，本报告期份额净值增长率为 24.60%，

同期业绩比较基准增长率为 20.70%。

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 2018 年，我们认为全球经济仍将总体保持向好，虽然也会面临一定不确定性。国内经济受实体经济去杠杆的负面影响，下行仍然压力较大。同时，我们预计，2018 年仍将延续 2017 年的金融严监管态势。

鉴于经济基本面和金融严监管环境，我们预计，2018 年市场仍将偏好那些盈利增长确定、估值较为合理的公司，但可能风格分化不会那么极端，部分有业绩、“真成长”的公司也将受到市场关注。另外，A 股市场的投资者结构将进一步机构化，以险资、社保资金为代表的绝对收益导向型的长线资金入市比重的提升以及受 2018 年 A 股即将纳入全球 MSCI 体系的影响，借道沪港通、深港通的海外配置资金仍将持续进入 A 股市场，这些增量资金无疑也都更偏好质地优良的蓝筹股。

我们认为，2018 年优质蓝筹股将延续强势。尽管前期涨幅较大，但当前优质蓝筹股盈利和估值的匹配性依旧非常高。作为沪深两市优质蓝筹的代表性指数，沪深 300 指数目前 14 倍左右的市盈率，仍可以作为投资者的中长期资产配置标的。

作为基金管理人，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）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。

（2）强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

（3）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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会, 负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时, 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; 同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成, 具有多年的证券、基金从业经验, 熟悉相关法律法规, 具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内, 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议, 由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

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；基金资产净值有连续超过 20 个工作日低于 5000 万元的情形，但截至 2017 年 12 月 31 日，基金资产净值已经超过 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 20816 号

华安沪深 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“华安沪深 300 分级基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 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 审计意见

我们认为，后附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,公允反映了华安沪深 300 分级基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安沪深 300 分级基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

华安沪深 300 分级基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安沪深 300 分级基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安沪深 300 分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安沪深 300 分级基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安沪深 300 分级基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安沪深 300 分级基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

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 魏 佳 亮

中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	17,007,575.00	1,899,886.86
结算备付金		16,687.24	-
存出保证金		15,241.29	2,829.20
交易性金融资产	7.4.7.2	264,154,308.56	28,104,407.08
其中：股票投资		263,953,408.56	28,104,407.08
基金投资		-	-
债券投资		200,900.00	-
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		73,891.83	-
应收利息	7.4.7.5	3,292.20	440.75
应收股利		-	-
应收申购款		167,632.04	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		281,438,628.16	30,007,563.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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		81,159.82	-
应付赎回款		76,179.30	48,593.90
应付管理人报酬		236,055.53	25,311.09
应付托管费		51,932.22	5,568.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	55,322.85	2,705.25
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	225,287.11	286,183.14
负债合计		725,936.83	368,361.81
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	174,669,601.28	22,971,652.71
未分配利润	7.4.7.10	106,043,090.05	6,667,549.37
所有者权益合计		280,712,691.33	29,639,202.08
负债和所有者权益总计		281,438,628.16	30,007,563.89

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额总额 197,406,661.17 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 192,504,563.17 份，基金份额净值 1.4220 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 2,451,049.00 份，基金份额参考净值 1.0500 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额 2,451,049.00 份，基金份额参考净值 1.7940 元。

7.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		54,584,558.84	-2,544,945.40
1.利息收入		117,339.64	13,060.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	117,253.50	13,033.91
债券利息收入		86.14	26.62
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）		17,152,504.90	-745,557.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,283,669.09	-1,215,183.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	19,109.97	2,512.91
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,849,725.84	467,112.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	37,245,781.19	-1,824,906.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	68,933.11	12,458.79
减：二、费用		3,582,932.81	847,919.91
1. 管理人报酬		2,206,408.00	243,441.70
2. 托管费		485,409.74	53,557.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	453,161.43	47,659.82
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	437,953.64	503,261.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,001,626.03	-3,392,865.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,001,626.03	-3,392,865.31

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	22,971,652.71	6,667,549.37	29,639,202.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,001,626.03	51,001,626.03
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）	151,697,948.57	48,373,914.65	200,071,863.22
其中：1.基金申购款	187,840,069.27	67,574,743.09	255,414,812.36
2.基金赎回款	-36,142,120.70	-19,200,828.44	-55,342,949.14
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	174,669,601.28	106,043,090.05	280,712,691.33

金净值)			
项目	上年度可比期间		
	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)	16,932,398.03	8,016,017.88	24,948,415.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,392,865.31	-3,392,865.31
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)	6,039,254.68	2,044,396.80	8,083,651.48
其中：1.基金申购款	14,033,494.62	4,076,196.60	18,109,691.22
2.基金赎回款	-7,994,239.94	-2,031,799.80	-10,026,039.74
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)	22,971,652.71	6,667,549.37	29,639,202.08

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 278 号《关于核准华安沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》

核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,221,793.60 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 201 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 607,313,857.99 份，其中认购资金利息折合 92,064.39 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华安沪深 300 份额”)、华安沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“华安沪深 300A 份额”)及长华安沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“华安沪深 300B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售华安沪深 300 份额。投资人场外认购所得的华安沪深 300 份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的华安沪深 300 份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额。华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后，华安沪深 300 份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内华安沪深 300 份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份华安沪深 300A 份额与 1 份华安沪深 300B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华安沪深 300A 份额与 1 份华安沪深 300B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内华安沪深 300 份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：华安沪深 300 份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额数量的总和。本基金每 1 份华安沪深 300A 份额与每 1 份华安沪深 300B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份华安沪深 300 份额的基金份额净值之和。华安沪深 300A 份额的约定收益率为同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3.5%，华安沪深 300A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出华安沪深 300A 份额的基金份额参考

净值后, 根据华安沪深 300 份额的基金份额净值与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间的基金份额参考净值关系, 可以计算出华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。于本基金存续期内每年第一个工作日(除基金合同生效日所在会计年度外), 本基金将进行基金的定期份额折算: 定期份额折算后华安沪深 300A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元, 基金份额折算基准日折算前华安沪深 300A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内华安沪深 300 份额分配给华安沪深 300A 份额持有人。华安沪深 300 份额持有人持有的每 2 份华安沪深 300 份额将按 1 份华安沪深 300A 份额获得新增华安沪深 300 份额的分配。持有场外华安沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华安沪深 300 份额的分配; 持有场内华安沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华安沪深 300 份额的分配。经过上述份额折算后, 华安沪深 300A 份额的参考净值和华安沪深 300 份额的净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后, 华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。华安沪深 300B 份额不参与定期份额折算, 每次定期份额折算不改变华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外, 当华安沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时, 或当华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.300 元时, 本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日, 进行不定期份额折算: 份额折算后本基金将确保华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的比例为 1:1, 份额折算后华安沪深 300A 份额的基金份额参考净值、华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值和华安沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当华安沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时, 基金份额折算基准日折算前华安沪深 300 份额的基金份额净值及华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为华安沪深 300 份额分别分配给华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的持有人。当华安沪深 300B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.300 元时, 华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 235 号文核准, 本基金华安沪深 300A 份额 197,289,916.00 份基金份额和华安沪深 300B 份额 197,289,916.00 份基金份额于 2012 年 7 月 23 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的华安沪深 300 份额, 基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下, 将其分拆为华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额即可上市流通; 对于托管在场外的华

安沪深 300 份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2018 年 3 月 22 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》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

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

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，不需要披露分部信息。

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[2017]13 号《中国证监会关于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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的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	上年度末
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	17,007,575.00	1,899,886.86
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	17,007,575.00	1,899,886.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		227,030,069.71	263,953,408.56	36,923,338.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	200,900.00	200,900.00	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	200,900.00	200,900.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		227,230,969.71	264,154,308.56	36,923,338.85
项目		上年度末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		28,426,849.42	28,104,407.08	-322,442.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计	28,426,849.42	28,104,407.08	-322,442.34	

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,258.65	438.72
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	7.50	-
应收债券利息	18.31	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.94	0.73
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6.80	1.30
合计	3,292.20	440.75

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	55,322.85	2,705.25
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	55,322.85	2,705.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	287.11	183.14
预提账户维护费	-	-
预提审计费	55,000.00	-
预提信息披露费	120,000.00	-
预提费用	-	236,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	225,287.11	286,183.14

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,418,112.64	22,971,652.71
本期申购	1,873.14	1,692.79
本期赎回（以“-”号填列）	-52.00	-47.00
-基金拆分/份额折算前	25,419,933.78	22,973,298.50
基金拆分/份额折算调整	551,672.73	—
本期申购	212,282,373.45	187,838,376.48
本期赎回（以“-”号填列）	-40,847,318.79	-36,142,073.70
本期末	197,406,661.17	174,669,601.28

注：1. 本基金的基金份额包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额。本期申购含申购的华安沪深 300 份额和配对转入的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额，本期赎回含赎回的华安沪深 300 份额和配对转出的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额。

2. 根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定以及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定和《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人以 2017 年 1 月 3 日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额办理定期份额折算业务。折算前沪深 300A 份额份额为 10,948,246.00 份，新增份额折算比例为 0.043404848，折算后沪深 300A 份额为 10,948,246.00 份，折算后沪深 300A 份额净值 1.000 元；折算前华安沪深 300 场外份额为 2,703,556.78 份，新增份额折算比例为 0.021702424，折算后华安沪深 300 场外份额为 2,762,230.51 份，折算后华安沪深 300 场外份额净值 1.152 元；折算前华安沪深 300 场内份额为 819,885.00 份，新增份额折算比例为 0.021702424，折算后华安沪深 300 场内份额为 1,312,884.00 份，折算后华安沪深 300 场内份额净值 1.152 元。

3. 截至 2017 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的华安沪深 300A 份额为 2,451,049.00 份(2016 年 12 月 31 日：10,948,246.00 份)，华安沪深 300B 份额为 2,451,049.00 份(2016 年 12 月 31 日：10,948,246.00 份)，托管在场内未上市的华安沪深 300 份额为 699,508.00 份(2016 年 12 月 31 日：819,937.00 份)，托管在场外未上市的华安沪深 300 份额为 191,805,055.17 份(2016 年 12 月 31 日：2,701,683.64 份)。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外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。华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

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	21,904,344.54	-15,236,795.17	6,667,549.37
本期利润	13,755,844.84	37,245,781.19	51,001,626.03

本期基金份额交易产生的变动数	143,351,492.74	-94,977,578.09	48,373,914.65
其中：基金申购款	178,922,700.02	-111,347,956.93	67,574,743.09
基金赎回款	-35,571,207.28	16,370,378.84	-19,200,828.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	179,011,682.12	-72,968,592.07	106,043,090.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	108,983.14	12,666.29
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	2,880.04	263.81
其他	5,390.32	103.81
合计	117,253.50	13,033.91

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	88,969,706.83	13,263,482.64
减：卖出股票成本总额	76,686,037.74	14,478,666.28
买卖股票差价收入	12,283,669.09	-1,215,183.64

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
----	--	---

	月31日	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	19,109.97	2,512.91
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	19,109.97	2,512.91

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 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	166,177.80	24,331.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	147,000.00	21,800.00
减：应收利息总额	67.83	18.32
买卖债券差价收入	19,109.97	2,512.91

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,849,725.84	467,112.92
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,849,725.84	467,112.92

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	37,245,781.19	-1,824,906.91

——股票投资	37,245,781.19	-1,822,519.71
——债券投资	-	-2,387.20
——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	37,245,781.19	-1,824,906.91

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	68,933.11	12,458.79
其他	-	-
合计	68,933.11	12,458.79

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，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	453,161.43	47,659.82
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	453,161.43	47,659.82

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	55,000.00	56,000.00
信息披露费	120,000.00	180,000.00
银行汇划费用	2,953.64	1,261.31
上市年费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
账户维护费	-	6,000.00
合计	437,953.64	503,261.31

注：根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

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

根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定以及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金以 2018 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对在该日登记在册的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额办理定期份额折算业务，并于 2018 年 1 月 3 日进行了变更登记。

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东

国泰君安创新投资有限公司	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
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809 号文核准，华安基金管理有限公司的原股东上海电气（集团）总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于 2017 年 10 月 17 日就上述股东变更事项进行公告。

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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,206,408.00	243,441.70
其中：支付销售机构的客户维护费	8,721.97	6,641.12

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 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	485,409.74	53,557.08

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指数分 级 B	华安沪深 300 指数分 级	合计
华安基金管理有限公司	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华安沪深300指数 分级A	华安沪深300指数分 级B	华安沪深300指数分 级	合计
合计	-	-	-	-

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国建设银行	17,007,575.00	108,983.14	1,899,886.86	12,666.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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

7.4.10.7.1 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（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股中签	11.06	53.21	2,010.00	22,230.60	106,952.10	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	网下中签	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123006	东财转债	2017-12-20	2018-01-29	配债中签	100.00	100.00	729.00	72,900.00	72,900.00	-
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	配债中签	100.00	100.00	1,135.00	113,500.00	113,500.00	-
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	配债中签	100.00	100.00	145.00	14,500.00	14,500.00	-

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	72,100.00	501,970.59	529,935.00	-
000629	*ST 钒钛	2017-04-20	重大事项停牌	3.07	-	-	10,457.00	35,767.66	32,102.99	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项停牌	9.15	2018-02-09	8.24	38,408.00	291,566.13	351,433.20	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	11,500.00	683,614.24	598,460.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大事项停牌	3.91	2018-01-24	13.80	60,800.00	1,070,013.00	237,728.00	-
600151	中国船舶	2017-09-11	重大事项停牌	24.67	2018-01-24	22.20	16,885.00	474,816.38	416,552.95	-

0	船	-27	项停牌		3-21					
600157	永泰能源	2017-11-21	重大事项停牌	3.36	-	-	113,732.00	455,655.46	382,139.52	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	31,026.00	712,076.08	1,177,126.44	-
600332	白云山	2017-10-31	重大事项停牌	32.14	2018-01-08	30.15	13,779.00	384,297.28	442,857.06	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.59	-	-	4,418.00	96,443.60	64,458.62	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	18,880.00	335,739.75	328,512.00	-
600685	中船防务	2017-09-27	重大事项停牌	26.66	2018-03-21	24.05	8,000.00	259,326.39	213,280.00	-
601216	君正集团	2017-12-15	重大事项停牌	4.71	-	-	75,620.00	392,877.61	356,170.20	-
601600	中国铝业	2017-11-14	重大事项停牌	6.67	2018-02-26	7.28	167,977.00	857,153.71	1,120,406.59	-

注：本基金截至 2017 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

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

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

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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、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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

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、债券投资及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	17,007,575.00	-	-	-	17,007,575.00
结算备付金	16,687.24	-	-	-	16,687.24
存出保证金	15,241.29	-	-	-	15,241.29
交易性金融资产	-	-	200,900.00	263,953,408.56	264,154,308.56
应收证券清算款	-	-	-	73,891.83	73,891.83
应收利息	-	-	-	3,292.20	3,292.20
应收申购款	-	-	-	167,632.04	167,632.04
资产总计	17,039,503.53	-	200,900.00	264,198,224.63	281,438,628.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	81,159.82	81,159.82
应付赎回款	-	-	-	76,179.30	76,179.30
应付管理人报酬	-	-	-	236,055.53	236,055.53
应付托管费	-	-	-	51,932.22	51,932.22
应付交易费用	-	-	-	55,322.85	55,322.85
其他负债	-	-	-	225,287.11	225,287.11
负债总计	-	-	-	725,936.83	725,936.83
利率敏感度缺口	17,039,503.53	-	200,900.00	263,472,287.80	280,712,691.33
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,899,886.86	-	-	-	1,899,886.86
存出保证金	2,829.20	-	-	-	2,829.20
交易性金融资产	-	-	-	28,104,407.08	28,104,407.08
应收利息	-	-	-	440.75	440.75
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,902,716.06	-	-	28,104,847.83	30,007,563.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,593.90	48,593.90
应付管理费	-	-	-	25,311.09	25,311.09
应付托管费	-	-	-	5,568.43	5,568.43
应付交易费用	-	-	-	2,705.25	2,705.25
其他负债	-	-	-	286,183.14	286,183.14
负债总计	-	-	-	368,361.81	368,361.81
利率敏感度缺口	1,902,716.06	-	-	27,736,486.02	29,639,202.08

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

本基金 2017 年 12 月 31 日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 0.07%(2016 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 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。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	263,953,408.56	94.03	28,104,407.08	94.82
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	263,953,408.56	94.03	28,104,407.08	94.82

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	上年度末
		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 13,920,000.00	增加约 1,560,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 13,920,000.00	减少约 1,560,000.00

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 2017 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 257,616,798.80 元，属于第二层次的余额为 6,299,781.76 元，属于第三层次的余额为 237,728.00 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 27,408,323.21 元，第二层次 696,083.87 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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具的余额为 237,728.00 元(2016 年 12 月 31 日：无)。本基金本期净转入/(转出)第三层次的金额为 611,952.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为-374,224.00 元，涉及乐视网(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间：净转入第三层次零元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动零元)。

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

权益工具投资

2017 年 1 月 1 日 -

购买 -

出售 -

转入第三层次 611,952.00

转出第三层次 -

当期利得或损失总额 -374,224.00

计入损益的利得或损失 -374,224.00

2017 年 12 月 31 日 237,728.00

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2017 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益 -755,784.88

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

2017 年 12 月 31 日公允价值 估值技术 不可观察输入值

名称 范围/加权平均值 与公允价值之间的关系

交易性金融资产—

乐视网 237,728.00

可比公司法 市销率 1.90 正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定,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。

§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	263,953,408.56	93.79
	其中:股票	263,953,408.56	93.79
2	固定收益投资	200,900.00	0.07
	其中:债券	200,900.00	0.07
	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	17,024,262.24	6.05
7	其他各项资产	260,057.36	0.09
8	合计	281,438,628.16	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	607,701.30	0.22
B	采矿业	8,422,068.35	3.00
C	制造业	103,255,414.75	36.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,041,788.78	2.51
E	建筑业	10,119,887.47	3.61
F	批发和零售业	5,311,493.31	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	8,430,190.41	3.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,164,879.91	3.62
J	金融业	88,752,762.69	31.62
K	房地产业	12,671,818.61	4.51
L	租赁和商务服务业	3,083,898.82	1.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,732,985.13	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	928,451.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	1,901,046.55	0.68
S	综合	247,390.00	0.09
	合计	262,671,777.08	93.57

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	32,102.99	0.01
C	制造业	866,651.15	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	316,453.00	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	1,281,631.48	0.46

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	601318	中国平安	242,731	16,986,315.38	6.05
2	600519	贵州茅台	11,233	7,834,905.17	2.79
3	600036	招商银行	231,103	6,706,609.06	2.39
4	000333	美的集团	101,753	5,640,168.79	2.01
5	601166	兴业银行	279,224	4,744,015.76	1.69
6	000651	格力电器	107,852	4,713,132.40	1.68
7	600016	民生银行	529,706	4,444,233.34	1.58
8	600887	伊利股份	136,221	4,384,953.99	1.56
9	601328	交通银行	615,548	3,822,553.08	1.36
10	000858	五粮液	42,521	3,396,577.48	1.21
11	000002	万科A	108,895	3,382,278.70	1.20
12	600000	浦发银行	263,039	3,311,661.01	1.18
13	601288	农业银行	856,509	3,280,429.47	1.17
14	002415	海康威视	82,698	3,225,222.00	1.15
15	600030	中信证券	176,331	3,191,591.10	1.14
16	000725	京东方A	531,084	3,074,976.36	1.10
17	601668	中国建筑	336,071	3,031,360.42	1.08
18	601398	工商银行	483,245	2,996,119.00	1.07
19	601601	中国太保	70,463	2,918,577.46	1.04
20	600276	恒瑞医药	37,869	2,612,203.62	0.93
21	000001	平安银行	192,321	2,557,869.30	0.91
22	600104	上汽集团	78,493	2,514,915.72	0.90
23	601169	北京银行	327,122	2,338,922.30	0.83
24	600837	海通证券	181,356	2,334,051.72	0.83
25	600900	长江电力	147,835	2,304,747.65	0.82
26	600048	保利地产	159,400	2,255,510.00	0.80
27	601766	中国中车	163,529	1,980,336.19	0.71
28	000063	中兴通讯	53,269	1,936,860.84	0.69

29	601988	中国银行	472,210	1,874,673.70	0.67
30	600019	宝钢股份	198,117	1,711,730.88	0.61
31	601211	国泰君安	84,200	1,559,384.00	0.56
32	002304	洋河股份	13,500	1,552,500.00	0.55
33	002027	分众传媒	109,660	1,544,012.80	0.55
34	600518	康美药业	66,498	1,486,895.28	0.53
35	601818	光大银行	356,828	1,445,153.40	0.51
36	600028	中国石化	235,541	1,443,866.33	0.51
37	600703	三安光电	54,814	1,391,727.46	0.50
38	002594	比亚迪	20,273	1,318,758.65	0.47
39	601336	新华保险	18,735	1,315,197.00	0.47
40	600585	海螺水泥	44,816	1,314,453.28	0.47
41	600015	华夏银行	143,680	1,293,120.00	0.46
42	601989	中国重工	213,703	1,288,629.09	0.46
43	600690	青岛海尔	68,322	1,287,186.48	0.46
44	600050	中国联通	203,241	1,286,515.53	0.46
45	002230	科大讯飞	21,741	1,285,762.74	0.46
46	601688	华泰证券	73,179	1,263,069.54	0.45
47	601006	大秦铁路	133,273	1,208,786.11	0.43
48	000538	云南白药	11,629	1,183,715.91	0.42
49	600309	万华化学	31,026	1,177,126.44	0.42
50	601857	中国石油	145,114	1,173,972.26	0.42
51	601939	建设银行	150,500	1,155,840.00	0.41
52	601186	中国铁建	103,097	1,148,500.58	0.41
53	600919	江苏银行	155,200	1,140,720.00	0.41
54	601012	隆基股份	31,300	1,140,572.00	0.41
55	601628	中国人寿	37,330	1,136,698.50	0.40
56	601600	中国铝业	167,977	1,120,406.59	0.40
57	000776	广发证券	66,295	1,105,800.60	0.39
58	000568	泸州老窖	16,369	1,080,354.00	0.38
59	601899	紫金矿业	232,511	1,067,225.49	0.38
60	002450	康得新	47,447	1,053,323.40	0.38
61	601390	中国中铁	125,285	1,051,141.15	0.37
62	600741	华域汽车	35,330	1,048,947.70	0.37
63	001979	招商蛇口	53,099	1,038,616.44	0.37
64	601088	中国神华	44,353	1,027,659.01	0.37
65	002024	苏宁云商	83,426	1,025,305.54	0.37
66	002142	宁波银行	56,752	1,010,753.12	0.36
67	600196	复星医药	22,559	1,003,875.50	0.36
68	600009	上海机场	21,566	970,685.66	0.35
69	600958	东方证券	69,700	966,042.00	0.34
70	601888	中国国旅	21,850	948,071.50	0.34
71	002008	大族激光	19,128	944,923.20	0.34
72	600029	南方航空	78,628	937,245.76	0.33

73	002466	天齐锂业	17,610	937,028.10	0.33
74	600031	三一重工	102,935	933,620.45	0.33
75	600660	福耀玻璃	31,409	910,861.00	0.32
76	000338	潍柴动力	108,516	905,023.44	0.32
77	002236	大华股份	38,997	900,440.73	0.32
78	300136	信维通信	17,600	892,320.00	0.32
79	601009	南京银行	114,000	882,360.00	0.31
80	600999	招商证券	51,287	880,084.92	0.31
81	002456	欧菲科技	42,577	876,660.43	0.31
82	300059	东方财富	67,246	870,835.70	0.31
83	601933	永辉超市	85,912	867,711.20	0.31
84	002202	金风科技	45,569	858,975.65	0.31
85	000413	东旭光电	90,946	853,073.48	0.30
86	002475	立讯精密	35,559	833,502.96	0.30
87	600340	华夏幸福	26,516	832,337.24	0.30
88	600089	特变电工	83,318	825,681.38	0.29
89	600795	国电电力	264,132	824,091.84	0.29
90	600221	海航控股	257,821	822,448.99	0.29
91	002460	赣锋锂业	11,400	817,950.00	0.29
92	601985	中国核电	104,600	768,810.00	0.27
93	002241	歌尔股份	43,660	757,501.00	0.27
94	601377	兴业证券	103,989	757,039.92	0.27
95	600010	宝钢股份	306,370	753,670.20	0.27
96	000100	TCL 集团	191,602	747,247.80	0.27
97	601669	中国电建	102,878	742,779.16	0.26
98	300070	碧水源	42,100	731,277.00	0.26
99	601225	陕西煤业	89,612	731,233.92	0.26
100	000166	申万宏源	134,860	724,198.20	0.26
101	600115	东方航空	87,886	721,544.06	0.26
102	600066	宇通客车	29,729	715,577.03	0.25
103	300072	三聚环保	20,300	713,139.00	0.25
104	600111	北方稀土	48,809	712,123.31	0.25
105	000423	东阿阿胶	11,705	705,460.35	0.25
106	600406	国电南瑞	38,203	698,350.84	0.25
107	000503	海虹控股	16,071	693,624.36	0.25
108	000783	长江证券	86,676	682,140.12	0.24
109	600522	中天科技	48,100	670,514.00	0.24
110	600886	国投电力	91,246	669,745.64	0.24
111	002252	上海莱士	33,360	662,196.00	0.24
112	300124	汇川技术	22,362	648,945.24	0.23
113	600383	金地集团	50,603	639,115.89	0.23
114	601901	方正证券	92,227	635,444.03	0.23
115	601607	上海医药	25,885	626,158.15	0.22
116	000069	华侨城 A	73,509	624,091.41	0.22

117	002310	东方园林	30,000	605,100.00	0.22
118	002739	万达电影	11,500	598,460.00	0.21
119	002736	国信证券	55,100	597,835.00	0.21
120	600352	浙江龙盛	51,010	597,327.10	0.21
121	600606	绿地控股	81,800	597,140.00	0.21
122	601155	新城控股	20,200	591,860.00	0.21
123	000839	中信国安	61,450	589,305.50	0.21
124	601788	光大证券	43,800	588,234.00	0.21
125	000895	双汇发展	22,169	587,478.50	0.21
126	000963	华东医药	10,872	585,783.36	0.21
127	601618	中国中冶	119,971	580,659.64	0.21
128	600011	华能国际	94,100	580,597.00	0.21
129	300003	乐普医疗	24,000	579,840.00	0.21
130	601919	中远海控	85,500	578,835.00	0.21
131	600705	中航资本	100,574	555,168.48	0.20
132	601099	太平洋	152,715	552,828.30	0.20
133	000625	长安汽车	43,683	550,405.80	0.20
134	601111	中国国航	44,614	549,644.48	0.20
135	600804	鹏博士	32,143	547,395.29	0.20
136	002081	金螳螂	35,489	543,691.48	0.19
137	600893	航发动力	20,193	543,393.63	0.19
138	600271	航天信息	25,086	540,352.44	0.19
139	600816	安信信托	40,800	533,664.00	0.19
140	000540	中天金融	72,100	529,935.00	0.19
141	603799	华友钴业	6,600	529,518.00	0.19
142	601727	上海电气	79,000	528,510.00	0.19
143	000768	中航飞机	30,990	523,421.10	0.19
144	601555	东吴证券	53,802	522,955.44	0.19
145	600547	山东黄金	16,605	517,743.90	0.18
146	600535	天士力	14,495	515,732.10	0.18
147	600177	雅戈尔	56,203	515,381.51	0.18
148	600570	恒生电子	11,067	513,508.80	0.18
149	002508	老板电器	10,600	509,860.00	0.18
150	002044	美年健康	23,300	509,571.00	0.18
151	600068	葛洲坝	61,945	507,949.00	0.18
152	600208	新湖中宝	96,304	502,706.88	0.18
153	600674	川投能源	49,356	502,444.08	0.18
154	002558	巨人网络	13,600	500,480.00	0.18
155	000728	国元证券	45,270	497,970.00	0.18
156	600637	东方明珠	29,620	493,469.20	0.18
157	600023	浙能电力	91,417	487,252.61	0.17
158	600739	辽宁成大	27,453	483,172.80	0.17
159	002673	西部证券	39,196	482,894.72	0.17
160	600482	中国动力	19,400	481,314.00	0.17

161	601018	宁波港	88,522	470,051.82	0.17
162	600362	江西铜业	23,288	469,718.96	0.17
163	000623	吉林敖东	20,830	468,675.00	0.17
164	002797	第一创业	47,100	461,580.00	0.16
165	300024	机器人	24,456	460,261.92	0.16
166	600219	南山铝业	124,400	457,792.00	0.16
167	002572	索菲亚	12,400	456,320.00	0.16
168	600109	国金证券	47,449	452,663.46	0.16
169	600018	上港集团	67,526	449,047.90	0.16
170	600332	白云山	13,779	442,857.06	0.16
171	600297	广汇汽车	55,150	442,303.00	0.16
172	601800	中国交建	34,231	438,156.80	0.16
173	000157	中联重科	97,829	437,295.63	0.16
174	000425	徐工机械	94,247	436,363.61	0.16
175	000792	盐湖股份	31,206	434,075.46	0.15
176	600436	片仔癀	6,800	429,760.00	0.15
177	601998	中信银行	68,715	426,033.00	0.15
178	002294	信立泰	9,400	424,786.00	0.15
179	601333	广深铁路	76,005	423,347.85	0.15
180	600682	南京新百	11,200	423,248.00	0.15
181	300015	爱尔眼科	13,600	418,880.00	0.15
182	000060	中金岭南	37,360	417,311.20	0.15
183	000630	铜陵有色	141,555	413,340.60	0.15
184	601997	贵阳银行	30,900	412,824.00	0.15
185	002714	牧原股份	7,800	412,308.00	0.15
186	603993	洛阳钼业	59,358	408,383.04	0.15
187	601992	金隅股份	74,758	405,935.94	0.14
188	600085	同仁堂	12,297	396,455.28	0.14
189	600100	同方股份	39,808	390,118.40	0.14
190	600489	中金黄金	38,665	382,396.85	0.14
191	600157	永泰能源	113,732	382,139.52	0.14
192	000826	启迪桑德	11,436	377,616.72	0.13
193	002146	荣盛发展	39,006	371,727.18	0.13
194	000709	河钢股份	95,172	371,170.80	0.13
195	600170	上海建工	99,717	370,947.24	0.13
196	600498	烽火通信	12,500	360,375.00	0.13
197	000983	西山煤电	35,316	358,104.24	0.13
198	601216	君正集团	75,620	356,170.20	0.13
199	601198	东兴证券	24,700	355,680.00	0.13
200	600820	隧道股份	42,300	353,628.00	0.13
201	600153	建发股份	31,721	352,737.52	0.13
202	600415	小商品城	60,934	352,198.52	0.13
203	000876	新 希 望	47,260	352,087.00	0.13
204	002470	金正大	38,408	351,433.20	0.13

205	002500	山西证券	37,982	350,194.04	0.12
206	600588	用友网络	16,441	347,727.15	0.12
207	002465	海格通信	36,178	346,947.02	0.12
208	002065	东华软件	42,168	345,777.60	0.12
209	300017	网宿科技	32,365	344,363.60	0.12
210	002074	国轩高科	15,260	339,687.60	0.12
211	002007	华兰生物	12,531	336,833.28	0.12
212	600118	中国卫星	13,264	334,916.00	0.12
213	000008	神州高铁	37,900	331,625.00	0.12
214	300027	华谊兄弟	37,282	325,471.86	0.12
215	000750	国海证券	66,095	323,865.50	0.12
216	600663	陆家嘴	16,478	313,576.34	0.11
217	000559	万向钱潮	30,838	313,005.70	0.11
218	601633	长城汽车	26,967	309,850.83	0.11
219	600583	海油工程	49,554	304,757.10	0.11
220	300144	宋城演艺	16,300	304,158.00	0.11
221	300122	智飞生物	10,800	303,156.00	0.11
222	601117	中国化学	44,232	298,566.00	0.11
223	000402	金 融 街	26,833	298,114.63	0.11
224	002624	完美世界	8,800	294,448.00	0.10
225	600369	西南证券	63,254	292,866.02	0.10
226	000671	阳 光 城	36,300	285,681.00	0.10
227	600959	江苏有线	34,820	284,827.60	0.10
228	601991	大唐发电	67,200	278,880.00	0.10
229	002385	大北农	45,961	278,523.66	0.10
230	600008	首创股份	54,014	277,631.96	0.10
231	000686	东北证券	31,510	276,342.70	0.10
232	300315	掌趣科技	49,400	274,664.00	0.10
233	601229	上海银行	19,200	272,256.00	0.10
234	600376	首开股份	28,900	268,481.00	0.10
235	002426	胜利精密	46,000	268,180.00	0.10
236	000961	中南建设	41,600	266,656.00	0.09
237	000627	天茂集团	33,200	265,600.00	0.09
238	600704	物产中大	38,600	263,252.00	0.09
239	000898	鞍钢股份	41,300	262,255.00	0.09
240	600977	中国电影	16,700	257,180.00	0.09
241	601877	正泰电器	9,600	251,040.00	0.09
242	600549	厦门钨业	9,699	249,652.26	0.09
243	600649	城投控股	28,336	249,356.80	0.09
244	600061	国投资本	18,900	249,102.00	0.09
245	600895	张江高科	17,300	247,390.00	0.09
246	002352	顺丰控股	4,900	246,764.00	0.09
247	600038	中直股份	5,242	243,910.26	0.09
248	601866	中远海发	71,058	242,307.78	0.09

249	600827	百联股份	17,926	241,821.74	0.09
250	300033	同花顺	4,800	239,904.00	0.09
251	000415	渤海金控	41,600	239,616.00	0.09
252	000938	紫光股份	3,300	237,699.00	0.08
253	600074	保千里	23,800	234,906.00	0.08
254	601898	中煤能源	41,000	234,520.00	0.08
255	002602	世纪华通	6,900	234,462.00	0.08
256	002601	龙蟠佰利	13,700	219,474.00	0.08
257	002174	游族网络	9,600	214,080.00	0.08
258	600685	中船防务	8,000	213,280.00	0.08
259	000959	首钢股份	35,600	212,888.00	0.08
260	600373	中文传媒	12,363	209,305.59	0.07
261	601872	招商轮船	47,500	208,525.00	0.07
262	600688	上海石化	32,775	207,465.75	0.07
263	300251	光线传媒	19,758	206,471.10	0.07
264	601021	春秋航空	5,400	201,258.00	0.07
265	600021	上海电力	21,800	199,252.00	0.07
266	601718	际华集团	29,500	198,535.00	0.07
267	601118	海南橡胶	35,206	195,393.30	0.07
268	002153	石基信息	7,200	191,952.00	0.07
269	000723	美锦能源	27,600	190,164.00	0.07
270	601966	玲珑轮胎	10,800	188,568.00	0.07
271	002411	必康股份	6,851	182,716.17	0.07
272	601611	中国核建	17,600	180,752.00	0.06
273	600909	华安证券	24,300	176,661.00	0.06
274	002468	申通快递	6,900	170,361.00	0.06
275	002292	奥飞娱乐	11,734	167,678.86	0.06
276	600372	中航电子	11,836	162,034.84	0.06
277	601608	中信重工	38,900	160,268.00	0.06
278	000738	航发控制	10,300	157,487.00	0.06
279	601958	金钼股份	21,643	156,478.89	0.06
280	601881	中国银河	14,400	151,344.00	0.05
281	002608	江苏国信	14,600	148,336.00	0.05
282	002555	三七互娱	7,200	147,888.00	0.05
283	002424	贵州百灵	9,500	146,300.00	0.05
284	601878	浙商证券	8,200	136,284.00	0.05
285	600233	圆通速递	7,600	127,300.00	0.05
286	600188	兖州煤业	8,640	125,452.80	0.04
287	601212	白银有色	17,200	116,272.00	0.04
288	601375	中原证券	18,000	111,060.00	0.04
289	601163	三角轮胎	5,400	110,052.00	0.04
290	600871	石化油服	40,500	108,135.00	0.04
291	603833	欧派家居	900	106,245.00	0.04
292	600926	杭州银行	9,000	103,770.00	0.04

293	601228	广州港	16,700	102,037.00	0.04
294	603160	汇顶科技	1,000	96,940.00	0.03
295	600390	五矿资本	7,600	89,680.00	0.03
296	603858	步长制药	1,700	86,462.00	0.03
297	002841	视源股份	900	65,250.00	0.02
298	600485	信威集团	4,418	64,458.62	0.02
299	002831	裕同科技	1,000	55,880.00	0.02
300	002839	张家港行	4,500	52,740.00	0.02

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	600150	中国船舶	16,885	416,552.95	0.15
2	600666	奥瑞德	18,880	328,512.00	0.12
3	300104	乐视网	60,800	237,728.00	0.08
4	000555	神州信息	6,700	78,725.00	0.03
5	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
6	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
7	000629	攀钢钒钛	10,457	32,102.99	0.01
8	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
9	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
10	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
11	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
12	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
13	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	601318	中国平安	10,387,394.89	35.05
2	601166	兴业银行	5,577,177.00	18.82
3	600016	民生银行	5,291,697.00	17.85
4	600036	招商银行	5,163,392.62	17.42
5	600519	贵州茅台	4,946,530.26	16.69
6	601328	交通银行	4,338,910.00	14.64
7	000333	美的集团	3,934,978.00	13.28

8	000002	万 科 A	3,790,712.00	12.79
9	000651	格力电器	3,681,655.00	12.42
10	600000	浦发银行	3,658,110.01	12.34
11	601668	中国建筑	3,425,656.00	11.56
12	600030	中信证券	3,315,861.00	11.19
13	601288	农业银行	3,228,055.00	10.89
14	600837	海通证券	3,191,808.06	10.77
15	601169	北京银行	3,016,727.00	10.18
16	600887	伊利股份	2,904,956.60	9.80
17	601398	工商银行	2,647,653.00	8.93
18	601766	中国中车	2,544,645.11	8.59
19	601601	中国太保	2,271,087.00	7.66
20	600900	长江电力	2,258,974.00	7.62
21	600104	上汽集团	2,245,702.00	7.58
22	601211	国泰君安	2,229,679.32	7.52
23	002415	海康威视	2,109,244.50	7.12
24	000001	平安银行	2,074,499.00	7.00
25	000858	五 粮 液	2,061,712.00	6.96
26	000725	京东方 A	2,007,656.00	6.77
27	601988	中国银行	1,987,644.00	6.71
28	600276	恒瑞医药	1,921,985.25	6.48
29	600048	保利地产	1,786,567.00	6.03
30	601818	光大银行	1,660,926.00	5.60
31	601390	中国中铁	1,653,540.00	5.58
32	600050	中国联通	1,622,126.00	5.47
33	600019	宝钢股份	1,559,916.60	5.26
34	601989	中国重工	1,542,042.00	5.20
35	600015	华夏银行	1,528,209.00	5.16
36	601688	华泰证券	1,491,231.59	5.03
37	600028	中国石化	1,490,729.00	5.03
38	601186	中国铁建	1,471,869.00	4.97
39	600518	康美药业	1,339,455.16	4.52
40	002304	洋河股份	1,329,250.70	4.48
41	002027	分众传媒	1,319,755.00	4.45
42	600919	江苏银行	1,308,683.03	4.42
43	000776	广发证券	1,301,747.00	4.39
44	601857	中国石油	1,262,585.00	4.26
45	600958	东方证券	1,206,258.45	4.07
46	002594	比亚迪	1,147,020.00	3.87
47	002450	康得新	1,130,396.00	3.81
48	600585	海螺水泥	1,096,183.00	3.70
49	000063	中兴通讯	1,088,302.00	3.67
50	601628	中国人寿	1,082,917.00	3.65
51	601009	南京银行	1,080,595.00	3.65

52	001979	招商蛇口	1,079,867.00	3.64
53	601006	大秦铁路	1,065,754.00	3.60
54	000538	云南白药	1,064,880.00	3.59
55	002024	苏宁易购	1,050,507.00	3.54
56	601012	隆基股份	1,032,554.00	3.48
57	601939	建设银行	1,014,920.00	3.42
58	000413	东旭光电	1,006,241.00	3.39
59	300059	东方财富	998,318.00	3.37
60	600999	招商证券	978,095.00	3.30
61	601899	紫金矿业	972,373.00	3.28
62	600703	三安光电	969,346.00	3.27
63	600089	特变电工	967,275.80	3.26
64	000166	申万宏源	956,387.19	3.23
65	000783	长江证券	949,342.00	3.20
66	601336	新华保险	947,156.00	3.20
67	002736	国信证券	936,915.00	3.16
68	300136	信维通信	936,390.86	3.16
69	601377	兴业证券	933,309.07	3.15
70	600795	国电电力	916,557.00	3.09
71	300104	乐视网	912,008.00	3.08
72	600221	海航控股	908,532.00	3.07
73	002142	宁波银行	901,588.00	3.04
74	600690	青岛海尔	881,660.00	2.97
75	601901	方正证券	875,321.00	2.95
76	002230	科大讯飞	867,247.00	2.93
77	600031	三一重工	865,456.00	2.92
78	601985	中国核电	861,933.00	2.91
79	601099	太平洋	846,838.00	2.86
80	601600	中国铝业	841,423.00	2.84
81	002466	天齐锂业	841,248.60	2.84
82	601669	中国电建	838,181.00	2.83
83	600340	华夏幸福	818,457.00	2.76
84	600309	万华化学	818,409.00	2.76
85	000768	中航飞机	815,545.00	2.75
86	300072	三聚环保	812,020.00	2.74
87	000423	东阿阿胶	809,766.00	2.73
88	000839	中信国安	809,655.00	2.73
89	300070	碧水源	806,658.00	2.72
90	601088	中国神华	786,704.00	2.65
91	002460	赣锋锂业	785,318.00	2.65
92	600893	航发动力	783,393.40	2.64
93	600068	葛洲坝	779,625.00	2.63
94	600010	宝钢股份	778,785.00	2.63
95	601788	光大证券	778,762.98	2.63

96	002241	歌尔股份	774,261.00	2.61
97	600886	国投电力	774,214.00	2.61
98	002236	大华股份	770,643.00	2.60
99	000100	TCL 集团	764,582.00	2.58
100	600637	东方明珠	756,169.00	2.55
101	000625	长安汽车	756,010.00	2.55
102	000568	泸州老窖	754,275.00	2.54
103	002673	西部证券	751,266.20	2.53
104	600606	绿地控股	748,871.00	2.53
105	601555	东吴证券	745,561.06	2.52
106	600660	福耀玻璃	741,151.00	2.50
107	600111	北方稀土	739,349.00	2.49
108	600804	鹏博士	730,795.00	2.47
109	600705	中航资本	720,489.00	2.43
110	600109	国金证券	716,019.00	2.42
111	002456	欧菲科技	714,371.00	2.41
112	000338	潍柴动力	712,968.00	2.41
113	600009	上海机场	712,101.16	2.40
114	600029	南方航空	704,632.00	2.38
115	600115	东方航空	696,346.00	2.35
116	600066	宇通客车	694,408.00	2.34
117	600196	复星医药	689,535.38	2.33
118	000728	国元证券	688,953.00	2.32
119	601618	中国中冶	676,218.00	2.28
120	601800	中国交建	674,261.00	2.27
121	601225	陕西煤业	672,536.00	2.27
122	002252	上海莱士	672,246.00	2.27
123	002475	立讯精密	671,324.50	2.26
124	300015	爱尔眼科	670,102.00	2.26
125	000503	海虹控股	669,372.00	2.26
126	600547	山东黄金	669,364.00	2.26
127	600741	华域汽车	664,845.00	2.24
128	600383	金地集团	662,390.00	2.23
129	002202	金风科技	651,383.00	2.20
130	600406	国电南瑞	647,995.00	2.19
131	600535	天士力	647,120.00	2.18
132	601607	上海医药	641,616.00	2.16
133	000069	华侨城 A	634,498.00	2.14
134	300024	机器人	632,495.60	2.13
135	601888	中国国旅	622,920.00	2.10
136	600011	华能国际	618,702.00	2.09
137	600177	雅戈尔	614,647.00	2.07
138	600522	中天科技	613,129.00	2.07
139	002739	万达电影	606,568.00	2.05

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	601318	中国平安	3,824,182.00	12.90
2	000002	万 科 A	2,375,644.00	8.02
3	601166	兴业银行	1,679,468.00	5.67
4	600519	贵州茅台	1,647,111.00	5.56
5	600036	招商银行	1,624,166.00	5.48
6	601766	中国中车	1,257,948.00	4.24
7	600016	民生银行	1,233,285.00	4.16
8	000333	美的集团	1,188,274.00	4.01
9	000651	格力电器	1,174,955.00	3.96
10	601328	交通银行	1,068,034.00	3.60
11	600887	伊利股份	935,956.00	3.16
12	601211	国泰君安	933,713.00	3.15
13	601668	中国建筑	904,584.00	3.05
14	600030	中信证券	865,529.00	2.92
15	601288	农业银行	862,090.00	2.91
16	600000	浦发银行	818,439.00	2.76
17	601390	中国中铁	754,324.00	2.55
18	601398	工商银行	753,133.00	2.54
19	600837	海通证券	743,252.00	2.51
20	601601	中国太保	722,629.00	2.44
21	000725	京东方 A	720,496.00	2.43
22	000858	五 粮 液	704,109.93	2.38
23	601169	北京银行	679,694.00	2.29
24	600104	上汽集团	657,895.00	2.22
25	600900	长江电力	631,552.00	2.13
26	600276	恒瑞医药	612,146.00	2.07
27	000001	平安银行	600,796.70	2.03

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	275,213,114.47
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	88,969,706.83
---------------	---------------

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）	200,900.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,900.00	0.07

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	128024	宁行转债	1,135	113,500.00	0.04
2	123006	东财转债	729	72,900.00	0.03
3	128028	赣锋转债	145	14,500.00	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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					0.00

注：本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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	15,241.29
2	应收证券清算款	73,891.83
3	应收股利	-
4	应收利息	3,292.20
5	应收申购款	167,632.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	260,057.36

8.12.4 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。

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不存在流通受限的情况。

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

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	600150	中国船舶	416,552.95	0.15	重大事项停牌
2	600666	奥瑞德	328,512.00	0.12	重大事项停牌
3	300104	乐视网	237,728.00	0.08	重大事项停牌

§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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安沪深 300 指数分级 A	135	18,155.92	1,333,325.00	54.40%	1,117,724.00	45.60%
华安沪深 300 指数分级 B	263	9,319.58	26,099.00	1.06%	2,424,950.00	98.94%
华安沪深 300 指数分级	3,421	56,271.43	185,779,164.83	96.51%	6,725,398.34	3.49%
合计	3,819	51,690.67	187,138,588.83	94.80%	10,268,072.34	5.20%

9.2 期末上市基金前十名持有人

华安沪深 300 指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司—金得量化套利集合资金信托计划	1,312,825.00	53.56%
2	解咏梅	471,600.00	19.24%
3	蔡捷	102,682.00	4.19%
4	周敬	50,003.00	2.04%
5	黄晖	44,299.00	1.81%
6	罗广斌	42,139.00	1.72%
7	欧阳湘	41,500.00	1.69%
8	程竞姣	41,099.00	1.68%
9	张凤贤	38,093.00	1.55%
10	田琦妹	28,370.00	1.16%

华安沪深300指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	邓琦	182,400.00	7.44%
2	吴为军	156,200.00	6.37%
3	张晓晓	147,265.00	6.01%
4	洪耀林	100,000.00	4.08%
5	孙芹	100,000.00	4.08%
6	李德深	97,100.00	3.96%

7	陈志伟	93,539.00	3.82%
8	黄美菊	84,000.00	3.43%
9	胡伟	80,000.00	3.26%
10	马志海	78,442.00	3.20%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安沪深 300 指数分级 A	471,600.00	19.24%
	华安沪深 300 指数分级 B	0.00	0.00%
	华安沪深 300 指数分级	2,411.76	0.00%
	合计	474,011.76	0.24%

9.4 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安沪深 300 指数分级 A	-
	华安沪深 300 指数分级 B	-
	华安沪深 300 指数分级	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华安沪深 300 指数分级 A	-
	华安沪深 300 指数分级 B	-
	华安沪深 300 指数分级	0~10
	合计	0~10

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；

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 指数分级 A	华安沪深 300 指数分级 B	华安沪深 300 指数分级
基金合同生效日（2012 年 6 月 25 日）基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	10,948,246.00	10,948,246.00	3,521,620.64

本报告期基金总申购份额	-	-	212,835,919.32
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	40,847,370.79
本报告期基金拆分变动份额	-8,497,197.00	-8,497,197.00	16,994,394.00
本报告期期末基金份额总额	2,451,049.00	2,451,049.00	192,504,563.17

拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2017 年 8 月 9 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2018 年 2 月 13 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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

本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 55,000.00 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证券监管部门稽查或处罚等情况。

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	
新时代证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	146,080,332.94	40.63%	136,044.74	40.93%	-
东北证券	1	69,612,294.73	19.36%	64,829.69	19.51%	-
光大证券	1	62,324,934.28	17.34%	56,796.71	17.09%	-
国泰君安	1	51,159,994.36	14.23%	46,622.14	14.03%	-
华泰证券	1	15,404,873.55	4.29%	14,346.72	4.32%	-
招商证券	3	5,908,706.22	1.64%	5,502.69	1.66%	-
天风证券	2	4,625,125.11	1.29%	4,214.98	1.27%	-
申万宏源	2	1,509,234.83	0.42%	1,375.38	0.41%	-
中泰证券	1	912,044.68	0.25%	831.17	0.25%	-
方正证券	1	873,747.85	0.24%	796.25	0.24%	-
兴业证券	1	808,766.00	0.22%	753.36	0.23%	-
长江证券	2	145,656.16	0.04%	135.64	0.04%	-
华安证券	1	131,972.80	0.04%	122.90	0.04%	-

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领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《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：

2017年11月完成租用托管在建行的长江证券深圳000510交易单元

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
新时代证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	158,077.40	95.13%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,100.40	4.87%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 HS300A 份额停复牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-04
2	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金之华安沪深 300A 份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-04
3	关于华安沪深 300A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05

4	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05
5	关于旗下部分基金增加济安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	2017-01-11
6	关于旗下部分基金增加泰诚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	2017-01-18
7	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08
8	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	2017-02-13
9	华安基金管理有限公司关于华安华安双债添利债券型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“掌趣科技”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	2017-03-04
11	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-15
12	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
13	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	2017-03-28
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“山东黄金”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	2017-04-22
15	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
16	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
17	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“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》	2017-04-26

		和公司网站	
19	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-27
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-28
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-29
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-03
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-04
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-06
25	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	2017-05-10
26	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
27	关于旗下部分基金增加中民财富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	2017-06-07
28	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	2017-06-15
29	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	2017-06-27
30	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国神华”、“大富科技”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	2017-07-10
31	华安沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议(更新)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-10
32	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同（更新）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-10
33	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金调	《上海证券报》、《证券	2017-07-10

	整基金份额（参考）净值计算位数并修改基金合同、托管协议的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
34	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“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	2017-07-11
35	关于华安旗下部分基金增加新兰德为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-15
36	关于华安旗下部分基金增加平安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	2017-07-18
37	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-09
38	华安关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-17
39	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-18
40	华安关于旗下部分基金增加江南农商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	2017-08-19
41	华安基金关于参加江南银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-30
42	华安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	2017-09-13
43	华安关于旗下部分基金增加宜信普泽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	2017-09-15
44	华安基金关于参加长江证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-19
45	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国铝业”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	2017-09-20
46	关华安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	2017-09-27
47	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国重工”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	2017-09-30

48	关于华安旗下部分基金增加通华财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-30
49	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-11
50	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-17
51	关于华安旗下部分基金增加万得为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-20
52	关于华安旗下部分基金增加泛华普益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	2017-10-21
53	华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-28
54	关于华安旗下基金持有的“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	2017-10-31
55	关于华安基金电子直销平台开通协助投资者购买合作商户实物黄金业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-02
56	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-04
57	华安基金关于参加中信银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-08
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“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	2017-11-17
59	关于华安旗下部分基金增加民族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	2017-11-25
60	关于华安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	2017-12-19
61	华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-27
62	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2017-12-29

		和公司网站	
--	--	-------	--

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

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170930	185,340,353.83	0.00	0.00	185,340,353.83	93.89%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

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

13.2 存放地点

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

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

二〇一八年三月二十七日