

**华安纳斯达克 100 指数证券投资基金**  
**2015 年半年度报告**  
**2015 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                         | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                 | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                            | 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 .....                          | 5  |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....                       | 6  |
| 2.5 信息披露方式 .....                               | 6  |
| 2.6 其他相关资料 .....                               | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                   | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                          | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                               | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                           | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                         | 8  |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 .....              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....               | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                  | 10 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....              | 11 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....              | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                 | 12 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                  | 14 |
| 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 .....        | 14 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                           | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                   | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....  | 14 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 15 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....                 | 15 |
| 6.1 资产负债表 .....                                | 15 |
| 6.2 利润表 .....                                  | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                       | 17 |
| 6.4 报表附注 .....                                 | 18 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                          | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                           | 33 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....               | 34 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....                       | 34 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....        | 35 |
| 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....      | 35 |
| 7.4.2 积极投资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益投资明细 ..... | 42 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                      | 42 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                   | 43 |
| 7.7 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 .....       | 43 |
| 7.8 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 .....    | 44 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....    | 44 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....      | 44 |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.11 投资组合报告附注 .....                    | 44        |
| <b>8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....            | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....         | 45        |
| <b>9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>45</b> |
| <b>10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 45        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                   | 46        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....              | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....    | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                      | 47        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>50</b> |
| <b>12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                      | 50        |
| 12.2 存放地点 .....                        | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                        | 50        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金 |
| 基金简称       | 华安纳斯达克 100 指数       |
| 基金主代码      | 040046              |
| 交易代码       | 040046              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2013 年 8 月 2 日      |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 17,879,118.95 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金为股票指数基金，通过严格的指数化投资策略与风险控制，紧密跟踪标的指数，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略   | 本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。<br>本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 4%（以美元计价计算）。 |
| 业绩比较基准 | 纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。   |
| 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               | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                       | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-38969999             | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn     | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099               | 010-67595096         |
| 传真          |      | 021-68863414             | 010-66275853         |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区金融大街25号        |
| 办公地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼    |
| 邮政编码        |      | 200120                   | 100033               |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 朱学华 | 王洪章 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人   |
|------|----|---|
| 名称   | 英文 | State Street Bank and Trust Company                                       |
|      | 中文 | 美国道富银行  |
| 注册地址 |    | One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America |
| 办公地址 |    | One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America |
| 邮政编码 |    | 02111   |

## 2.5 信息披露方式

|                      |                               |
|----------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》        |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn              |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层 |

## 2.6 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                     |
|--------|--------------------|--------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司     | 北京市西城区太平桥大街 17 号         |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,072,502.90                         |
| 本期利润          | 1,371,722.90                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0529                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.09%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.78%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 5,234,808.31                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2928                               |
| 期末基金资产净值      | 23,113,927.26                        |
| 期末基金份额净值      | 1.293                                |

|                     |                              |
|---------------------|------------------------------|
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2015 年 6 月 30 日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | 29.30%                       |

注：1.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（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -2.85%   | 0.83%       | -2.57%     | 0.81%         | -0.28% | 0.02%  |
| 过去三个月 | 0.70%    | 0.81%       | 0.98%      | 0.82%         | -0.28% | -0.01% |
| 过去六个月 | 2.78%    | 0.85%       | 3.70%      | 0.92%         | -0.92% | -0.07% |
| 过去一年  | 10.42%   | 0.80%       | 13.49%     | 0.88%         | -3.07% | -0.08% |
| 成立起至今 | 29.30%   | 0.72%       | 39.18%     | 0.84%         | -9.88% | -0.12% |

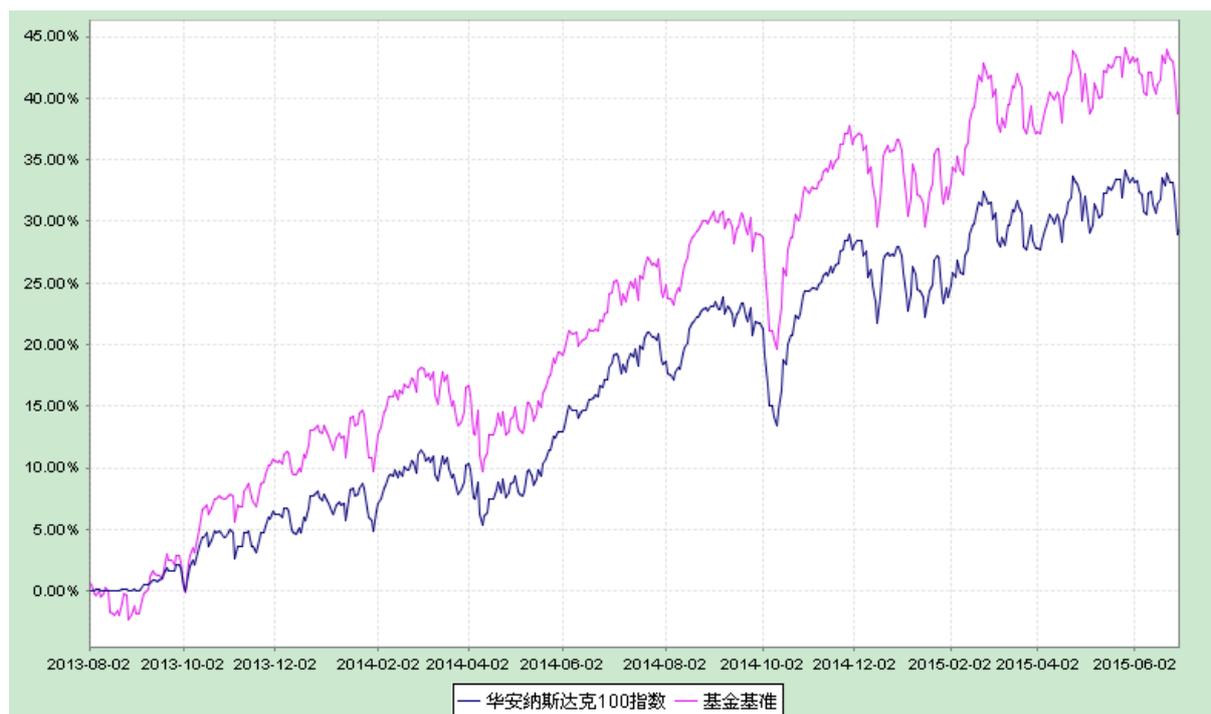
注：本基金业绩比较基准：纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。

根据本基金合同的有关规定：本基金主要投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股，与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金的投资比例限制：为投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的 10%；投资于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%。

#### 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

华安纳斯达克 100 指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2013 年 8 月 2 日至 2015 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华

安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等 67 只开放式基金。管理资产规模达到 1214.76 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务           | 任本基金的基金经理<br>（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------|---------------------|------|--------|---|
|     |              | 任职日期                | 离任日期 |        |   |
| 徐宜宜 | 本基金的<br>基金经理 | 2013-08-02          | -    | 9 年    | 管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM（金融风险管理师），9 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011 年 1 月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011 年 5 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职务。2012 年 3 月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。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及本基金的基金经理。2013 年 12 月起同时担任华安中证细分地产交易型开放 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 式指数证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月起同时担任华安国际龙头 (DAX) 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：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法

合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。

(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、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。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。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 1 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内 1 季度，纳斯达克 100 指数上涨 4.1%，指数成分股表现活跃。特别是互联网和生物医药行业，均创出过去十年新高。单季度，苹果股票上涨 9.99%，英特尔上涨 4.85%，而谷歌搜索引擎份额有所下降，单季股价下跌 8.83%。

进入 2015 年 2 季度，纳斯达克 100 指数继续稳中有升，上涨 1.74%，指数成分股表现活跃。特别是互联网和生物医药行业，均创出过去十年新高。单季度，苹果股票上涨 1.2%，英特尔下跌 2.73%。

总体来看，纳斯达克 100 指数延续了过去三年以来的趋势，继续大幅跑赢周期股，小盘股，说明美国经济已经进入科技创新带动的新阶段。从美国宏观数据来看，2015 年一季度实际 GDP 增速减速，但就业数据向好，房屋新开工面积均高于预期。我们认为，美国经济新一轮经济增长仍然是科技创新驱动型。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.293 元，本报告期份额净值增长率为 2.78%，同期业绩比较基准增长率为 3.70%，基金偏离度为 -0.92%，年化跟踪误差 0.15%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计纳斯达克指数基金在 2015 年将继续保持良好的投资收益。美国经济进一步走强的信号将持续显现，并进一步体现在企业盈利中。从基本面来看，美国科技股估值仍然合理，创新能力和成长性依旧具有全球优势。

作为纳斯达克 100 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。

#### 4.7 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、估值政策重大对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价

值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

翁启森, 基金投资部兼全球投资部高级总监, 总经理助理, 工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理, 台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理, 台湾中信证券投资总监助理, 台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司, 现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理, 华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明, 投资研究部高级总监, 研究生学历, 15 年金融、证券、基金从业经验, 曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司, 担任研究发展部宏观研究员, 现任华安优选的基金经理, 投资研究部高级总监。

贺涛, 金融学硕士, 固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员, 华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安现金富利货币、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置的基金经理, 固定收益部总监。

许之彦, 指数投资部高级总监, 理学博士, CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作, 2005 年加入华安基金管理有限公司, 曾任研究发展部数量策略分析师, 现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接基金、华安中证高分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理, 指数投资部高级总监。

陈林, 基金运营部总经理, 工商管理硕士, 高级会计师, CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作, 2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司, 曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理, 现任基金运营部总经理。

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任, 并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

**4.8 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**

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本报告期内本基金自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日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，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。

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,730,591.70                   | 4,495,546.43                     |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 23,074,110.04                  | 31,783,596.81                    |
| 其中：股票投资         |            | 23,074,110.04                  | 31,783,596.81                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 2,252,035.41                   | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 161.96                         | 272.44                           |
| 应收股利            |            | 10,357.84                      | 12,185.99                        |
| 应收申购款           |            | 33,063.78                      | 358,719.13                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>27,100,320.73</b>           | <b>36,650,320.80</b>             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 3,764,787.40                   | 481,189.35                       |
| 应付管理人报酬         | 6.4.10.2   | 18,129.57                      | 24,001.43                        |

|                   |          |                      |                      |
|-------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 应付托管费             | 6.4.10.2 | 5,665.46             | 7,500.45             |
| 应付销售服务费           |          | -                    | -                    |
| 应付交易费用            | 6.4.7.7  | -                    | -                    |
| 应交税费              |          | -                    | -                    |
| 应付利息              |          | -                    | -                    |
| 应付利润              |          | -                    | -                    |
| 递延所得税负债           |          | -                    | -                    |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 197,811.04           | 291,664.98           |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>3,986,393.47</b>  | <b>804,356.21</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                    | -                    |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 17,879,118.95        | 28,489,839.28        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 5,234,808.31         | 7,356,125.31         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>23,113,927.26</b> | <b>35,845,964.59</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>27,100,320.73</b> | <b>36,650,320.80</b> |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.293 元，基金份额总额 17,879,118.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>1,664,766.68</b>                      | <b>5,751,280.70</b>                           |
| 1.利息收入                | 6.4.7.11 | 6,530.62                                 | 31,470.61                                     |
| 其中：存款利息收入             |          | 6,530.62                                 | 31,470.61                                     |
| 债券利息收入                |          | -  | -   |
| 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）      |          | 2,172,076.86                             | 5,940,520.70                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 1,979,947.99                             | 5,442,081.74                                  |
| 基金投资收益                |          | -  | 24,657.54                                     |
| 债券投资收益                |          | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益            |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                |          | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.13 | 192,128.87                               | 473,781.42                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | -700,780.00                              | -686,106.93                                   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | 160,106.76                               | 351,401.73                                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.15 | 26,832.44                                | 113,994.59                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>293,043.78</b>                        | <b>503,721.45</b>                             |

|                            |          |                     |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2 | 134,044.13          | 272,327.54          |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2 | 41,888.71           | 85,102.39           |
| 3. 销售服务费                   |          | -                   | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.16 | 2,857.34            | 11,648.19           |
| 5. 利息支出                    |          | -                   | -                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                   | -                   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.17 | 114,253.60          | 134,643.33          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>1,371,722.90</b> | <b>5,247,559.25</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>1,371,722.90</b> | <b>5,247,559.25</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日      |               |                |
|--|--|---------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 28,489,839.28                              | 7,356,125.31  | 35,845,964.59  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 1,371,722.90  | 1,371,722.90   |
| 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）      | -10,610,720.33                             | -3,493,039.90 | -14,103,760.23 |
| 其中：1.基金申购款                             | 8,290,597.45                               | 2,268,765.46  | 10,559,362.91  |
| 2.基金赎回款                                | -18,901,317.78                             | -5,761,805.36 | -24,663,123.14 |
| 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（基金净值）                        | 17,879,118.95                              | 5,234,808.31  | 23,113,927.26  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |               |                |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 54,845,388.57                              | 4,304,718.63  | 59,150,107.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 5,247,559.25  | 5,247,559.25   |
| 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）      | -19,150,848.55                             | -3,460,393.33 | -22,611,241.88 |

|  |                |               |                |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 少以“-”号填列)                              |                |               |                |
| 其中：1.基金申购款                             | 63,059,541.27  | 5,525,264.25  | 68,584,805.52  |
| 2.基金赎回款                                | -82,210,389.82 | -8,985,657.58 | -91,196,047.40 |
| 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）                        | 35,694,540.02  | 6,091,884.55  | 41,786,424.57  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安纳斯达克 100 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2013]10 号文《关于核准华安纳斯达克 100 指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2013 年 6 月 13 日到 2013 年 7 月 31 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第 60971571\_B08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 8 月 2 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)折合人民币 272,883,718.70 元，在募集期间产生的活期存款利息折合人民币 155,700.83 元，以上实收基金(本息)合计共折合人民币 273,039,419.53 元，折合 273,039,419.53 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构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，境外资产托管人为美国道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

本基金主要投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股，与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股以及与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不低于基金资产的 85%，其中投资于与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的 10%；投资于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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为：纳斯达克 100 价格指数（Nasdaq 100 Price Index）收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税；

(2)基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税；

(3)基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 1,730,591.70           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 1,730,591.70           |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |               |              |
|--------|------------------------|---------------|--------------|
|        | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票     | 18,186,666.69          | 23,074,110.04 | 4,887,443.35 |
| 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     | 18,186,666.69          | 23,074,110.04 | 4,887,443.35 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 161.96                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | -                      |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 161.96                 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 13,720.28              |
| 预提费用        | 184,090.76             |
| 合计          | 197,811.04             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                |
|----------------|---------------------------------------|----------------|
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额           |
| 上年度末           | 28,489,839.28                         | 28,489,839.28  |
| 本期申购           | 8,290,597.45                          | 8,290,597.45   |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -18,901,317.78                        | -18,901,317.78 |
| 本期末            | 17,879,118.95                         | 17,879,118.95  |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 7,416,867.78  | -60,742.47    | 7,356,125.31  |
| 本期利润           | 2,072,502.90  | -700,780.00   | 1,371,722.90  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,089,725.23 | -403,314.67   | -3,493,039.90 |
| 其中：基金申购款       | 2,199,912.17  | 68,853.29     | 2,268,765.46  |
| 基金赎回款          | -5,289,637.40 | -472,167.96   | -5,761,805.36 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 6,399,645.45  | -1,164,837.14 | 5,234,808.31  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 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 | -                                     |
| 其他        | 91.22                                 |
| 合计        | 6,530.62                              |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
|            | 卖出股票成交总额                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 8,008,706.77                          |
| 买卖股票差价收入   | 1,979,947.99                          |

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 192,128.87                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 192,128.87                 |

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -700,780.00                |
| ——股票投资     | -700,780.00                |
| ——债券投资     | -                          |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | -                          |
| ——其他       | -                          |
| 2.衍生工具     | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3.其他       | -                          |
| 合计         | -700,780.00                |

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 26,832.44                  |
| 合计      | 26,832.44                  |

#### 6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,857.34                   |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 2,857.34                   |

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 24,795.19                  |
| 信息披露费 | 79,260.15                  |

|        |            |
|--------|------------|
| 银行汇划费用 | 145.00     |
| 指数使用费  | 10,053.26  |
| 合计     | 114,253.60 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)   | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构        |
| 美国道富银行                 | 基金境外托管行             |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 134,044.13                     | 272,327.54                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 49,495.66                      | 180,335.91                          |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 41,888.71                      | 85,102.39                           |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                              |          | 上年度可比期间                         |           |
|-------|---------------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|       | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |          | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |           |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 建设银行  | 1,112,909.63                    | 6,420.61 | 4,706,178.45                    | 31,254.33 |
| 道富银行  | 617,682.07                      | 18.79    | 75,406.56                       | 106.49    |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型指数基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括纳斯达克 100 指数成分股、备选成分股以及与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等、固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行以及其委托的境外托管行，并通过对交易对手的管理进行筛选，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，因此违约风险不重大。

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。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，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。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015 年 6 月 30 日      | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|-----------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                          |              |       |       |               |               |
| 银行存款                        | 1,730,591.70 | -     | -     | -             | 1,730,591.70  |
| 交易性金融资产                     | -            | -     | -     | 23,074,110.04 | 23,074,110.04 |
| 应收证券清算款                     | -            | -     | -     | 2,252,035.41  | 2,252,035.41  |
| 应收利息                        | -            | -     | -     | 161.96        | 161.96        |
| 应收股利                        | -            | -     | -     | 10,357.84     | 10,357.84     |
| 应收申购款                       | 14,035.58    | -     | -     | 19,028.20     | 33,063.78     |
| 资产总计                        | 1,744,627.28 | -     | -     | 25,355,693.45 | 27,100,320.73 |
| 负债                          |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                       | -            | -     | -     | 3,764,787.40  | 3,764,787.40  |
| 应付管理人报酬                     | -            | -     | -     | 18,129.57     | 18,129.57     |
| 应付托管费                       | -            | -     | -     | 5,665.46      | 5,665.46      |
| 其他负债                        | -            | -     | -     | 197,811.04    | 197,811.04    |
| 负债总计                        | -            | -     | -     | 3,986,393.47  | 3,986,393.47  |
| 利率敏感度缺口                     | 1,744,627.28 | -     | -     | 21,369,299.98 | 23,113,927.26 |
| 上年度末<br>2014 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |              |       |       |               |               |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 银行存款    | 4,495,546.43 | - | - | -             | 4,495,546.43  |
| 交易性金融资产 | -            | - | - | 31,783,596.81 | 31,783,596.81 |
| 应收证券清算款 | -            | - | - | -             | -             |
| 应收利息    | -            | - | - | 272.44        | 272.44        |
| 应收股利    | -            | - | - | 12,185.99     | 12,185.99     |
| 应收申购款   | 147,077.53   | - | - | 211,641.60    | 358,719.13    |
| 资产总计    | 4,642,623.96 | - | - | 32,007,696.84 | 36,650,320.80 |
| 负债      |              |   |   |               |               |
| 应付赎回款   | -            | - | - | 481,189.35    | 481,189.35    |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 24,001.43     | 24,001.43     |
| 应付托管费   | -            | - | - | 7,500.45      | 7,500.45      |
| 其他负债    | -            | - | - | 291,664.98    | 291,664.98    |
| 负债总计    | -            | - | - | 804,356.21    | 804,356.21    |
| 利率敏感度缺口 | 4,642,623.96 | - | - | 31,203,340.63 | 35,845,964.59 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2015 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款(2014 年 12 月 31 日同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2015年6月30日 |    |
|----------|-------------------|----|
|          | 美元<br>折合人民币       | 合计 |
| 以外币计价的资产 |                   |    |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 银行存款          | 714,416.46    | 714,416.46    |
| 交易性金融资产       | 23,074,110.04 | 23,074,110.04 |
| 应收申购款         | 0.37          | 0.37          |
| 应收利息          | 3.73          | 3.73          |
| 应收股利          | 10,357.84     | 10,357.84     |
| 应收证券清算款       | 2,252,035.41  | 2,252,035.41  |
| 资产合计          | 26,050,923.85 | 26,050,923.85 |
| 以外币计价的负债      |               |               |
| 应付美元赎回款       | 2,338,357.91  | 2,338,357.91  |
| 应付美元赎回费       | 8,812.94      | 8,812.94      |
| 负债合计          | 2,347,170.85  | 2,347,170.85  |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 23,703,753.00 | 23,703,753.00 |
| 项目            | 上年度末          |               |
|               | 2014年12月31日   |               |
|               | 美元<br>折合人民币   | 合计            |
| 以外币计价的资产      |               |               |
| 银行存款          | 3,382,710.53  | 3,382,710.53  |
| 交易性金融资产       | 31,783,596.81 | 31,783,596.81 |
| 应收申购款         | 125,546.03    | 125,546.03    |
| 应收利息          | 40.14         | 40.14         |
| 应收股利          | 12,185.99     | 12,185.99     |
| 应收证券清算款       | -             | -             |
| 资产合计          | 35,304,079.50 | 35,304,079.50 |
| 以外币计价的负债      |               |               |
| 应付美元赎回款       | 125,607.89    | 125,607.89    |
| 应付美元赎回费       | 473.43        | 473.43        |
| 负债合计          | 126,081.32    | 126,081.32    |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 35,177,998.18 | 35,177,998.18 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率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<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|--|--------------|------------------------|--------------------------|
|  | 美元相对人民币贬值 5% | 减少约 119 万元             | 减少约 176 万元               |
|  | 美元相对人民币升值 5% | 增加约 119 万元             | 增加约 176 万元               |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成分股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如成分股流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，如采用优化方法计算最优化投资组合的个股权重比例，对投资组合管理进行适当变通和调整，以此构建本基金实际的投资组合，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。本基金投资组合中纳斯达克 100 指数成分股、备选成分股，与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的投资比例不低于基金资产的 85%，其中投资于与纳斯达克 100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |                      |
|----|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|    | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|    |                        |                      |                          |                      |

|              |               |       |               |       |
|--------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 23,074,110.04 | 99.83 | 31,783,596.81 | 88.67 |
| 交易性金融资产—基金投资 | -             | -     | -             | -     |
| 交易性金融资产—债券投资 | -             | -     | -             | -     |
| 衍生金融资产—权证投资  | -             | -     | -             | -     |
| 其他           | -             | -     | -             | -     |
| 合计           | 23,074,110.04 | 99.83 | 31,783,596.81 | 88.67 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                          |
|----|----------------------|-----------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加约 104 万元                  | 增加约 147 万元               |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少约 104 万元                  | 减少约 147 万元               |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目      | 金额            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资    | 23,074,110.04 | 85.14        |
|    | 其中：普通股  | 23,074,110.04 | 85.14        |
|    | 存托凭证    | -             | -            |
|    | 优先股     | -             | -            |
|    | 房地产信托凭证 | -             | -            |
| 2  | 基金投资    | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资  | -             | -            |
|    | 其中：债券   | -             | -            |
|    | 资产支持证券  | -             | -            |
| 4  | 金融衍生品投资 | -             | -            |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 其中：远期             | -             | -      |
|   | 期货                | -             | -      |
|   | 期权                | -             | -      |
|   | 权证                | -             | -      |
| 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 | 货币市场工具            | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 1,730,591.70  | 6.39   |
| 8 | 其他各项资产            | 2,295,618.99  | 8.47   |
| 9 | 合计                | 27,100,320.73 | 100.00 |

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 美国     | 23,074,110.04 | 99.83        |
| 合计     | 23,074,110.04 | 99.83        |

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

#### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 金融     | -             | -            |
| 工业     | 498,753.61    | 2.16         |
| 信息技术   | 12,750,900.14 | 55.17        |
| 非必需消费品 | 4,328,576.56  | 18.73        |
| 能源     | -             | -            |
| 保健     | 3,962,514.57  | 17.14        |
| 公用事业   | -             | -            |
| 必需消费品  | 1,226,418.72  | 5.31         |
| 电信服务   | 217,094.86    | 0.94         |
| 材料     | 85,193.02     | 0.37         |
| 合计     | 23,069,451.48 | 99.81        |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

#### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值     | 占基金资产净值比例（%） |
|------|----------|--------------|
| 信息技术 | 4,658.56 | 0.02         |

|    |  |          |      |
|----|--|----------|------|
| 合计 |  | 4,658.56 | 0.02 |
|----|--|----------|------|

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

##### 7.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)                    | 公司名称<br>(中文)   | 证券代码     | 所在证<br>券市场 | 所属国家<br>(地区) | 数量 (股) | 公允价值         | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
|----|---------------------------------|----------------|----------|------------|--------------|--------|--------------|-----------------------|
| 1  | APPLE<br>INC                    | 苹果公司           | AAPL US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 3,400  | 2,607,114.15 | 11.28                 |
| 2  | MICROS<br>OFT<br>CORP           | 微软             | MSFT US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 5,100  | 1,376,568.74 | 5.96                  |
| 3  | AMAZO<br>N.COM<br>INC           | 亚马逊公<br>司      | AMZN US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 400    | 1,061,541.05 | 4.59                  |
| 4  | FACEBO<br>OK INC                | Facebook<br>公司 | FB US    | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 1,900  | 996,232.52   | 4.31                  |
| 5  | GOOGLE<br>INC-CL C              | 谷歌公司           | GOOG US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 300    | 954,656.98   | 4.13                  |
| 6  | GILEAD<br>SCIENCE<br>S INC      | Gilead 科<br>学  | GILD US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 1,000  | 715,780.29   | 3.1                   |
| 7  | CISCO<br>SYSTEM<br>S INC        | 思科             | CSCO US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 4,000  | 671,517.82   | 2.91                  |
| 8  | COMCAS<br>T<br>CORP-CL<br>ASS A | 康卡斯特           | CMCSA US | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 1,800  | 661,809.43   | 2.86                  |
| 9  | GOOGLE<br>INC-CLA               | 谷歌公司           | GOOGL US | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 200    | 660,317.71   | 2.86                  |
| 10 | INTEL<br>CORP                   | 英特尔公<br>司      | INTC US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 3,300  | 613,618.98   | 2.65                  |
| 11 | AMGEN<br>INC                    | 安进             | AMGN US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 600    | 563,135.92   | 2.44                  |
| 12 | CELGEN<br>E CORP                | Celgene 公<br>司 | CELG US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 700    | 495,290.25   | 2.14                  |
| 13 | BIOGEN<br>IDEC<br>INC           | 生物基因           | BIIB US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 200    | 493,905.52   | 2.14                  |
| 14 | QUALCO                          | 高通公司           | QCOM US  | 纳斯达        | 美国           | 1,000  | 382,894.77   | 1.66                  |

|    |   |                             |         |             |    |       |            |      |
|----|---|-----------------------------|---------|-------------|----|-------|------------|------|
|    | MM INC                                      |                             |         | 克市场         |    |       |            |      |
| 15 | EXPRES<br>S<br>SCRIPTS<br>HOLDIN<br>G CO    | 快捷药方                        | ESRX US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 700   | 380,620.51 | 1.65 |
| 16 | EBAY<br>INC                                 | 电子湾                         | EBAY US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 1,000 | 368,283.26 | 1.59 |
| 17 | BAIDU<br>INC -<br>SPON<br>ADR               | 百度                          | BIDU US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 300   | 365,128.65 | 1.58 |
| 18 | COSTCO<br>WHOLESA<br>LE<br>CORP             | 好市多批<br>发                   | COST US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 400   | 330,281.13 | 1.43 |
| 19 | KRAFT<br>FOODS<br>GROUP<br>INC              | Kraft<br>Foods<br>Group Inc | KRFT US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 600   | 312,307.14 | 1.35 |
| 20 | REGENE<br>RON<br>PHARM<br>ACEUTI<br>CALS    | 再生元制<br>药股份有<br>限公司         | REGN US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 100   | 311,873.08 | 1.35 |
| 21 | STARBU<br>CKS<br>CORP                       | 星巴克                         | SBUX US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 900   | 295,002.60 | 1.28 |
| 22 | DIRECT<br>V                                 | DIRECTV<br>公司               | DTV US  | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 500   | 283,640.47 | 1.23 |
| 23 | MONDE<br>LEZ<br>INTERN<br>ATIONA<br>L INC-A | Mondelez<br>国际公司            | MDLZ US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 1,100 | 276,664.85 | 1.2  |
| 24 | TEXAS<br>INSTRU<br>MENTS<br>INC             | 德州仪器                        | TXN US  | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 800   | 251,929.23 | 1.09 |
| 25 | ADOBE<br>SYSTEM<br>S INC                    | 奥多比                         | ADBE US | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 500   | 247,631.37 | 1.07 |
| 26 | AUTOMA<br>TIC<br>DATA                       | ADP 公司                      | ADP US  | 纳斯达克<br>克市场 | 美国 | 500   | 245,247.06 | 1.06 |

|    |   |                  |         |            |    |     |            |      |
|----|---|------------------|---------|------------|----|-----|------------|------|
|    | PROCES<br>SING                                    |                  |         |            |    |     |            |      |
| 27 | COGNIZ<br>ANT<br>TECH<br>SOLUTI<br>ONS-A          | 高知特科<br>技公司      | CTSH US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 600 | 224,087.89 | 0.97 |
| 28 | ALEXIO<br>N<br>PHARM<br>ACEUTI<br>CAL<br>S<br>INC | Alexion 制<br>药公司 | ALXN US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200 | 221,031.09 | 0.96 |
| 29 | YAHOO!<br>INC                                     | 雅虎               | YHOO US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 900 | 216,183.01 | 0.94 |
| 30 | BROADC<br>OM<br>CORP-CL<br>A                      | Broadcom<br>公司   | BRCM US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 600 | 188,873.56 | 0.82 |
| 31 | INTUIT<br>INC                                     | Intuit 公司        | INTU US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 300 | 184,820.24 | 0.8  |
| 32 | TWENTY<br>-FIRST<br>CENTUR<br>Y FOX<br>INC        | 新闻集团             | FOXA US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 900 | 179,070.40 | 0.77 |
| 33 | CERNER<br>CORP                                    | 塞纳公司             | CERN US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400 | 168,882.09 | 0.73 |
| 34 | MYLAN<br>INC                                      | 迈兰实验<br>室        | MYL US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400 | 165,947.56 | 0.72 |
| 35 | TESLA<br>MOTORS<br>INC                            | 特斯拉汽<br>车公司      | TSLA US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100 | 164,003.43 | 0.71 |
| 36 | MONSTE<br>R<br>BEVERA<br>GE CORP                  | 怪兽饮料<br>公司       | MNST US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200 | 163,868.93 | 0.71 |
| 37 | AVAGO<br>TECHNO<br>LOGIES<br>LTD                  | 安华高科<br>技有限公司    | AVGO US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200 | 162,536.17 | 0.7  |
| 38 | VIACOM<br>INC-CLA<br>SS B                         | 维亚康姆<br>公司       | VIAB US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400 | 158,073.24 | 0.68 |
| 39 | PACCAR  | 帕卡               | PCAR US | 纳斯达        | 美国 | 400 | 156,043.53 | 0.68 |

|    |  |                          |         |            |    |       |            |      |
|----|--|--------------------------|---------|------------|----|-------|------------|------|
|    | INC  |                          |         | 克市场        |    |       |            |      |
| 40 | VERTEX<br>PHARM<br>ACEUTI<br>CAL<br>S<br>INC | 维特制药<br>股份有<br>限公<br>司   | VRTX US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 150,981.47 | 0.65 |
| 41 | APPLIED<br>MATERI<br>ALS<br>INC              | 应用材料                     | AMAT US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 1,200 | 141,004.07 | 0.61 |
| 42 | O'REILL<br>Y<br>AUTOM<br>OTIVE<br>INC        | O'Reilly<br>汽车股份<br>有限公司 | ORLY US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 138,155.13 | 0.6  |
| 43 | MARRIO<br>TT<br>INTERN<br>ATIONA<br>L-CLA    | 万豪国际                     | MAR US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 300   | 136,437.21 | 0.59 |
| 44 | ILLUMIN<br>A<br>INC                          | Illumina 公<br>司          | ILMN US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 133,496.57 | 0.58 |
| 45 | NXP<br>SEMICO<br>DUCTO<br>RS<br>NV           | NXP 半导<br>体公司            | NXPI US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 120,071.10 | 0.52 |
| 46 | ROSS<br>STORES<br>INC                        | Ross 商店<br>有限公司          | ROST US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400   | 118,872.84 | 0.51 |
| 47 | ANALOG<br>DEVICES<br>INC                     | 模拟器件                     | ADI US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 300   | 117,720.42 | 0.51 |
| 48 | SEAGAT<br>E<br>TECHNO<br>LOGY                | 希捷科技<br>公司               | STX US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400   | 116,158.40 | 0.5  |
| 49 | PAYCHE<br>X<br>INC                           | Paychex<br>公司            | PAYX US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400   | 114,642.23 | 0.5  |
| 50 | CHARTE<br>R<br>COMMU<br>NICATIO<br>N-A       | Charter 通<br>信公司         | CHTR US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 104,695.40 | 0.45 |
| 51 | MICRON<br>TECHNO<br>LOGY                     | 美光技术                     | MU US   | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 900   | 103,662.20 | 0.45 |

|    |                                       |                                       |         |            |    |       |            |      |
|----|---------------------------------------|---------------------------------------|---------|------------|----|-------|------------|------|
|    | INC                                   |                                       |         |            |    |       |            |      |
| 52 | ACTIVISION<br>BLIZZARD<br>INC         | 动视暴雪<br>股份有限<br>公司                    | ATVI US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 700   | 103,607.18 | 0.45 |
| 53 | FISERV<br>INC                         | Fiserv 公司                             | FISV US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 101,277.90 | 0.44 |
| 54 | SIRIUS<br>XM<br>HOLDIN<br>GS I        | Sirius XM<br>公司                       | SIRI US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 4,400 | 100,336.40 | 0.43 |
| 55 | SYMANTEC<br>CORP                      | 赛门铁克                                  | SYMC US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 700   | 99,498.84  | 0.43 |
| 56 | CHECK<br>POINT<br>SOFTWARE<br>TECH    | Check<br>Point<br>Software<br>Technol | CHKP US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 97,267.38  | 0.42 |
| 57 | DOLLAR<br>TREE<br>INC                 | Dollar Tree<br>公司                     | DLTR US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 96,582.65  | 0.42 |
| 58 | WHOLE<br>FOODS<br>MARKET<br>INC       | 全食超市                                  | WFM US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400   | 96,448.15  | 0.42 |
| 59 | WESTERN<br>DIGITAL<br>CORP            | 西部数据<br>公司                            | WDC US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 95,885.70  | 0.41 |
| 60 | VODAFONE<br>GROUP<br>PLC-SP<br>ADR    | 沃达丰                                   | VOD US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 427   | 95,152.99  | 0.41 |
| 61 | ALTERA<br>CORP                        | Altera 公司                             | ALTR US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 300   | 93,904.90  | 0.41 |
| 62 | CA INC                                | 冠群国际                                  | CA US   | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 500   | 89,533.67  | 0.39 |
| 63 | VERISK<br>ANALYTICS<br>INC-CLASS<br>A | Verisk 分析<br>公司                       | VRSK US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 88,965.11  | 0.38 |
| 64 | HENRY<br>SCHEIN<br>INC                | 亨利香恩<br>公司                            | HSIC US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 86,886.48  | 0.38 |

|    |                                 |                 |         |        |    |     |           |      |
|----|---------------------------------|-----------------|---------|--------|----|-----|-----------|------|
| 65 | CITRIX SYSTEMS INC              | 思杰系统            | CTXS US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 85,786.04 | 0.37 |
| 66 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC         | 阿卡迈技术公司         | AKAM US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 85,370.31 | 0.37 |
| 67 | SIGMA-ALDRICH                   | 西格玛-奥德里奇        | SIAL US | 纳斯达克市场 | 美国 | 100 | 85,193.02 | 0.37 |
| 68 | LIBERTY INTERACTIVE             | 自由媒体公司-互动       | QVCA US | 纳斯达克市场 | 美国 | 500 | 84,826.20 | 0.37 |
| 69 | BED BATH & BEYOND INC           | Bed Bath&Beyond | BBBY US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 84,343.23 | 0.36 |
| 70 | DISH NETWORK CORP-A             | DISH 网络公司       | DISH US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 82,790.37 | 0.36 |
| 71 | STERICYCLE INC                  | Stericycle 公司   | SRCL US | 纳斯达克市场 | 美国 | 100 | 81,867.22 | 0.35 |
| 72 | XILINX INC                      | 赛灵思             | XLNX US | 纳斯达克市场 | 美国 | 300 | 80,992.97 | 0.35 |
| 73 | FASTENAL CO                     | 快扣公司            | FAST US | 纳斯达克市场 | 美国 | 300 | 77,361.49 | 0.33 |
| 74 | CATAMARAN CORP                  | SXC 健康解决方案公司    | CTRX US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 74,683.74 | 0.32 |
| 75 | NVIDIA CORP                     | NVIDIA 公司       | NVDA US | 纳斯达克市场 | 美国 | 600 | 73,766.70 | 0.32 |
| 76 | SANDISK CORP                    | SanDisk Corp    | SNDK US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 71,186.76 | 0.31 |
| 77 | SBA COMMUNICATIONS CORP-CLASS A | SBA 通信公司        | SBAC US | 纳斯达克市场 | 美国 | 100 | 70,288.06 | 0.3  |
| 78 | KLA-TEKCORPORATION              | Kla-Tencor 公司   | KLAC US | 纳斯达克市场 | 美国 | 200 | 68,729.09 | 0.3  |

|    |                                       |                                     |          |            |    |       |           |      |
|----|---------------------------------------|-------------------------------------|----------|------------|----|-------|-----------|------|
| 79 | LIBERTY<br>GLOBAL<br>PLC-A            | 自由国际<br>传媒公司                        | LBTYA US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 66,112.47 | 0.29 |
| 80 | STAPLES<br>INC                        | 史泰博公<br>司                           | SPLS US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 700   | 65,519.45 | 0.28 |
| 81 | MATTEL<br>INC                         | 美泰                                  | MAT US   | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 400   | 62,823.35 | 0.27 |
| 82 | AUTODE<br>SK INC                      | 欧特克                                 | ADSK US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 61,227.70 | 0.26 |
| 83 | WYNN<br>RESORT<br>S LTD               | 永利度假<br>村有限公<br>司                   | WYNN US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 60,322.89 | 0.26 |
| 84 | NETAPP<br>INC                         | 网域存储<br>技术                          | NTAP US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 300   | 57,883.56 | 0.25 |
| 85 | EXPEDIT<br>ORS<br>INTL<br>WASH<br>INC | 华盛顿康<br>捷国际物<br>流公司                 | EXPD US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 56,373.51 | 0.24 |
| 86 | TRACTO<br>R<br>SUPPLY<br>COMPAN<br>Y  | 拖拉机供<br>应公司                         | TSCO US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 54,985.72 | 0.24 |
| 87 | LINEAR<br>TECHNO<br>LOGY<br>CORP      | 凌特                                  | LLTC US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 54,080.91 | 0.23 |
| 88 | GARMIN<br>LTD                         | 佳明有限<br>公司                          | GRMN US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 53,714.09 | 0.23 |
| 89 | TRIPADV<br>ISOR INC                   | Tripadvisor<br>公司                   | TRIP US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 53,273.91 | 0.23 |
| 90 | VIMPEL<br>COM<br>LTD-SPO<br>N ADR     | VimpelCo<br>m 有限公<br>司              | VIP US   | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 1,700 | 51,653.81 | 0.22 |
| 91 | KEURIG<br>GREEN<br>MOUNT<br>AIN INC   | KEURIG<br>GREEN<br>MOUNTAI<br>N INC | GMCR US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100   | 46,848.52 | 0.2  |
| 92 | LIBERTY<br>MEDIA<br>CORP - C          | Liberty 传<br>媒集团                    | LMCA US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200   | 43,895.65 | 0.19 |
| 93 | DISCOV                                | 探索传播                                | DISCA US | 纳斯达        | 美国 | 200   | 40,667.67 | 0.18 |

|    |  |                          |          |            |    |     |           |      |
|----|--|--------------------------|----------|------------|----|-----|-----------|------|
|    | ERY<br>COMMUNICATIO<br>NS-A                  | 公司                       |          | 克市场        |    |     |           |      |
| 94 | C.H.<br>ROBINS<br>ON<br>WORLD<br>WIDE<br>INC | 罗宾逊全<br>球物流有<br>限公司      | CHRW US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100 | 38,142.75 | 0.17 |
| 95 | DISCOV<br>ERY<br>COMMUNICATIO<br>NS-C        | 探索传播<br>公司               | DISCK US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 200 | 38,002.14 | 0.16 |
| 96 | LIBERTY<br>MEDIA<br>CORP - A                 | Liberty<br>Media<br>Corp | LMCA US  | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 100 | 22,033.41 | 0.1  |
| 97 | LIBERTY<br>VENTUR<br>ES - S                  | Liberty<br>Ventures      | LVNTA US | 纳斯达<br>克市场 | 美国 | 71  | 17,045.76 | 0.07 |

注：所用证券代码采用彭博代码。

#### 7.4.2 积极投资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益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)   | 公司名称<br>(中文) | 证券代码    | 所在证<br>券市场 | 所属国家<br>(地区) | 数量 (股) | 公允价值     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
|----|----------------|--------------|---------|------------|--------------|--------|----------|-----------------------|
| 1  | EQUINIX<br>INC | 易昆尼克<br>斯公司  | EQIX US | 纳斯达<br>克市场 | 美国           | 3      | 4,658.56 | 0.02                  |

注：所用证券代码采用彭博代码。

#### 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

无。

##### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 证券代码 | 本期累计卖出金<br>额 | 占期初基金<br>资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|------|--------------|------------------------|
|----|-----------|------|--------------|------------------------|

|    |                              |          |              |      |
|----|------------------------------|----------|--------------|------|
| 1  | APPLE INC                    | AAPL US  | 2,602,122.19 | 7.26 |
| 2  | MICROSOFT CORP               | MSFT US  | 1,149,902.82 | 3.21 |
| 3  | GOOGLE INC-CL A              | GOOGL US | 678,452.61   | 1.89 |
| 4  | GILEAD SCIENCES INC          | GILD US  | 551,579.35   | 1.54 |
| 5  | INTEL CORP                   | INTC US  | 504,919.88   | 1.41 |
| 6  | CISCO SYSTEMS INC            | CSCO US  | 367,179.68   | 1.02 |
| 7  | AMGEN INC                    | AMGN US  | 291,884.16   | 0.81 |
| 8  | QUALCOMM INC                 | QCOM US  | 278,963.74   | 0.78 |
| 9  | AMAZON.COM INC               | AMZN US  | 268,486.43   | 0.75 |
| 10 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | MDLZ US  | 236,032.95   | 0.66 |
| 11 | STARBUCKS CORP               | SBUX US  | 225,544.84   | 0.63 |
| 12 | FACEBOOK INC                 | FB US    | 200,794.63   | 0.56 |
| 13 | TEXAS INSTRUMENTS INC        | TXN US   | 170,264.73   | 0.47 |
| 14 | EQUINIX INC                  | EQIX US  | 147,945.95   | 0.41 |
| 15 | COMCAST CORP-CLASS A         | CMCSA US | 146,136.00   | 0.41 |
| 16 | EBAY INC                     | EBAY US  | 145,684.31   | 0.41 |
| 17 | CELGENE CORP                 | CELG US  | 141,117.10   | 0.39 |
| 18 | TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | FOXA US  | 121,399.59   | 0.34 |
| 19 | KRAFT FOODS GROUP INC        | KRFT US  | 106,559.85   | 0.3  |
| 20 | EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | ESRX US  | 103,981.45   | 0.29 |

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |              |
|------------|--------------|
| 买入成本（成交）总额 | -            |
| 卖出收入（成交）总额 | 9,988,654.76 |

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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

**7.11.3 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   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,252,035.41 |
| 3  | 应收股利    | 10,357.84    |
| 4  | 应收利息    | 161.96       |
| 5  | 应收申购款   | 33,063.78    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,295,618.99 |

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**7.11.5.1 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。

**7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 974      | 18,356.38     | 0.00  | 0.00%      | 17,879,118.95 | 100.00%    |

### 8.2 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 | 6,119.34  | 0.03%    |

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013 年 8 月 2 日）基金份额总额 | 273,039,419.53 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 28,489,839.28  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 8,290,597.45   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 18,901,317.78  |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 17,879,118.95  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

(2) 2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(3) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易         |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--|--------|--------------|--------------|-----------|------------|----|
|  |        | 成交金额         | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| Morgan Stanley & Co. International PLC           | -      | 188,424.24   | 1.89%        | 30.57     | 1.14%      | -  |
| Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated | -      | 1,183,523.41 | 11.85%       | 55.10     | 2.06%      | -  |
| Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company   | -      | -            | -            | -         | -          | -  |
| Barclays   | -      | 8,616,707.11 | 86.26%       | 2,585.20  | 96.79%     | -  |

|                             |   |   |   |   |   |  |
|-----------------------------|---|---|---|---|---|--|
| Capital Asia Limited.       |   |   |   |   |   |  |
| UBS Securities Asia Limited | - | - | - | - | - |  |

注：1.券商专用交易单元选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

(1) 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；

(2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(4) 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；

(5) 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。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日 |
|----|------|--------|-------|
|----|------|--------|-------|

|    |   |                             | 期          |
|----|---|-----------------------------|------------|
| 1  | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-01-14 |
| 2  | 关于旗下部分基金增加上海长量基金为代销机构的公告                            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-01-23 |
| 3  | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-02-11 |
| 4  | 关于华安旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告                 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-02-11 |
| 5  | 关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停美元现钞、美元现汇份额申购的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-02-17 |
| 6  | 关于旗下部分基金增加北京增财基金销售为代销机构并参加费率优惠活动的公告                 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-06 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-07 |
| 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 | 2015-03-12 |
| 9  | 关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-13 |
| 10 | 关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告               | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-17 |
| 11 | 关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告                             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-18 |
| 12 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-31 |
| 13 | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-03-31 |
| 14 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-04-08 |
| 15 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金暂停大                              | 《上海证券报》、《证券时                | 2015-04-14 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 额申购及定期定额投资的公告  | 报》、《中国证券报》和公司网站             |            |
| 16 | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回及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 | 2015-05-20 |
| 17 | 华安纳斯达克 100 指数证券投资基金恢复大额申购及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 | 2015-05-22 |
| 18 | 关于华安旗下部分基金增加天天基金为销售机构的公告                                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-28 |
| 19 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-05-29 |
| 20 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业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》和公司网站 | 2015-05-29 |
| 21 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、申购费率优惠活动的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-02 |
| 22 | 关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构的公告                                     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-02 |
| 23 | 关于旗下部分基金在官方京东店开展认购费率优惠活动的公告                                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-10 |
| 24 | 关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告                            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-10 |
| 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 | 2015-06-12 |
| 26 | 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 | 2015-06-29 |
| 27 | 华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-30 |
| 28 | 华安基金管理有限公司关于华安纳斯达克 100 指数证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2015-06-30 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安纳斯达克 100 指数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；

### 12.2 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>。

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十八日