

**华安中证银行指数分级证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <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 .....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6  |
| 2.5 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 10 |
| 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 .....             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 14 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                          | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                  | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 18 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 19 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                         | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                      | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....       | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 39 |
| 7.6 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 .....      | 39 |
| 7.7 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 .....   | 39 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....      | 40 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 40 |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                           | 40 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                      | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                   | 41 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                        | 42 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                | 43 |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....              | 错误！未定义书签。 |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....               | 43        |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                 | 44        |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                 | 44        |
| 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 ..... | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                   | 44        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....              | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 44        |
| 10.8 其他重大事件 .....                      | 46        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | 错误！未定义书签。 |
| <b>12 备查文件目录</b> .....                 | 48        |
| 12.1 备查文件目录 .....                      | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                        | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                        | 48        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |                 |
|-----------------|------------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 华安中证银行指数分级证券投资基金 |                  |                 |
| 基金简称            | 华安中证银行指数分级       |                  |                 |
| 场内简称            | 银行股基             |                  |                 |
| 基金主代码           | 160418           |                  |                 |
| 交易代码            | 160418           |                  |                 |
| 基金运作方式          | 上市契约型开放式         |                  |                 |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 月 9 日   |                  |                 |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司       |                  |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                  |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 728,186,922.66 份 |                  |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                  |                 |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深证               |                  |                 |
| 上市日期            | 2015 年 6 月 18 日  |                  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安中证银行指数分级 A     | 华安中证银行指数分级 B     | 华安中证银行指数分级      |
| 下属分级基金的场内简称     | 银行股 A            | 银行股 B            | 银行股基            |
| 下属分级基金的交易代码     | 150299           | 150300           | 160418          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 339,184,229.00 份 | 339,184,229.00 份 | 49,818,464.66 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 | <p>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（本基金的标的指数为中证全指银行指数），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，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的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%。</p> <p>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。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。  |
| 业绩比较基准 | 95%×中证银行指数收益率+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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。<br>从本基金所分离的两类基金份额来看，华安中证银行 A 份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；华安中证银行 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                    | 基金托管人                |
|-------------|------|--------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 华安基金管理有限公司               | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                       | 王永民                  |
|             | 联系电话 | 021-38969999             | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn     | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099               | 95566                |
| 传真          |      | 021-68863414             | 010-66594942         |
| 注册地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京西城区复兴门内大街1号        |
| 办公地址        |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京西城区复兴门内大街1号        |
| 邮政编码        |      | 200120                   | 100818               |
| 法定代表人       |      | 朱学华                      | 田国立                  |

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -20,521,299.91                       |
| 本期利润          | -51,908,053.11                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0673                              |
| 本期加权平均净值利润率   | -9.02%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -7.46%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | -160,494,297.16                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.2204                              |
| 期末基金资产净值      | 553,101,492.48                       |
| 期末基金份额净值      | 0.7596                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | -22.50%                              |

### 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      | -1.06%   | 0.52%       | -2.27%     | 0.58%         | 1.21%  | -0.06% |
| 过去三个月      | 1.09%    | 0.57%       | 0.17%      | 0.60%         | 0.92%  | -0.03% |
| 过去六个月      | -7.46%   | 1.19%       | -7.79%     | 1.16%         | 0.33%  | 0.03%  |
| 过去一年       | -17.90%  | 1.77%       | -15.02%    | 1.87%         | -2.88% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -22.50%  | 1.83%       | -23.46%    | 1.95%         | 0.96%  | -0.12% |

注：本基金的业绩比较基准为 95%×中证银行指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。

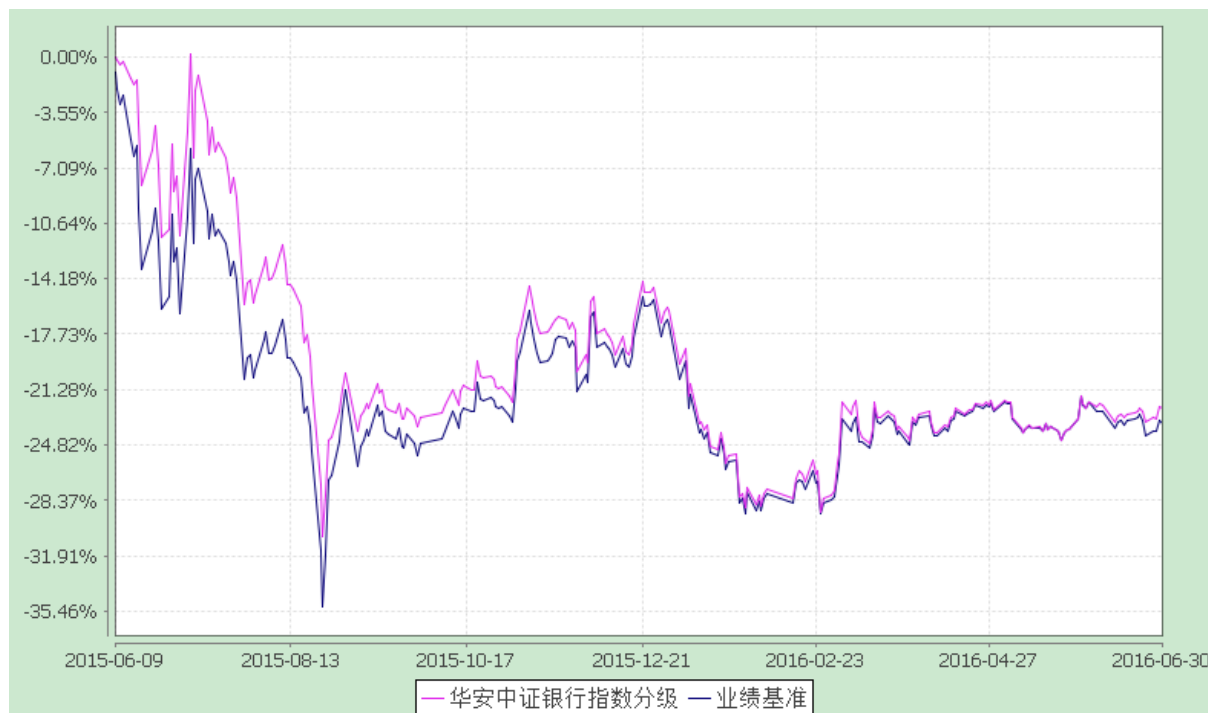
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证银行指数的成分股及其备选成分股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证银行指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 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

华安中证银行指数分级证券投资基金  
 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  
 (2015 年 6 月 9 日至 2016 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 6 月 30 日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数(LOF)、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、



华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头 (DAX) ETF、华安国际龙头 (DAX) ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                      | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 钱晶  | 基金经理                 | 2015-06-09      | -    | 5 年    | 硕士，5 年证券、基金行业从业经验，曾任国信证券分析师。2014 年 12 月加入华安基金，任指数投资部量化分析师。2015 年 5 月起担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、本基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月起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。 |
| 许之彦 | 基金经理，指数与量化投资事业总部高级总监 | 2015-06-09      | -    | 13 年   | 理学博士，13 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月起担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、本基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资

组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风控部门的监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、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；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年上半年，市场整体依旧延续了震荡向下的趋势。期间，各类重大事件的发生也一度对市场造成了比较大的波动，包括：1 月份的熔断，3 月份债券违约频发，5 月份权威人士讲话，6 月份英国脱欧。这些事件的发生也无疑加重了市场博弈的成分。

当然，即使除去这些事件性的因素，当前的基本面条件也难以支持市场走出趋势性的行情。从经济自身的条件来看，今年固定资产投资，尤其是民间固定资产投资下降显著。房地产销售增速 2 季度已经有所下滑，或带动房地产投资增速回调。这些因素使得经济下行压力加大，但在稳增长政策作用下，经济整体维持平稳。

此外，通胀和汇率压力有所缓和，货币政策维持稳健基调。在经济平稳和流动性边际变化不大的情况下，风险偏好的变化基本主导了 A 股的走势。

操作上，基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差、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 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7596 元，本报告期份额净值增长率为-7.46%，同期业绩比较基准增长率为-7.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，银行股被压制的的关键仍然在于投资者对银行资产质量的担忧，虽然监管层已经通过不良资产出表的方式进行了试点，但是改善程度仍要看具体情况而定。2016 年下半年银行的资产质量将进一步受到经济下行的压力，银行可能将加大损失准备金的计提来应对大量暴露的不良资产，这将影响银行的利润和 ROE。不过不良资产出表有助于银行释放风险，对估值有提升作用，目前银行股整体市净率为 0.85 倍，处于低位。因此我们预计，在盈利下滑和估值提升的共同作用下，2016 年下半年银行股价格小幅波动。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

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

###### (1) 公司方面

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

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华

安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数(LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理,指数投资部高级总监。

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

## (2) 托管银行

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

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

## 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安中证银行指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         | -                      | -                        |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 33,747,343.35          | 60,601,701.37            |
| 结算备付金      |         | -                      | 741,147.48               |
| 存出保证金      |         | 73,967.28              | 882,977.83               |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 520,230,412.56         | 609,964,067.20           |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 520,230,412.56            | 609,964,067.20              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资        |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 5,733.93                  | 10,021.05                   |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | 25,309,958.75               |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>554,057,457.12</b>     | <b>697,509,873.68</b>       |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015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          | 7.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | 19,992,326.44               |
| 应付赎回款           |            | 58,061.79                 | 499,117.44                  |
| 应付管理人报酬         | 7.4.10.2   | 455,391.54                | 517,307.43                  |
| 应付托管费           | 7.4.10.2   | 100,186.14                | 113,807.64                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 98,175.80                 | 317,281.98                  |
| 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    | 244,149.37                | 311,881.08                  |
| 负债合计            |            | 955,964.64                | 21,751,722.01               |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                         | -                           |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 713,595,789.64            | 806,792,984.07              |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -160,494,297.16           | -131,034,832.40             |
| 所有者权益合计         |            | 553,101,492.48            | 675,758,151.67              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 554,057,457.12            | 697,509,873.68              |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7596 元，基金份额总额 728,186,922.66 份，其中：华安中证银行份额净值 0.7596 元，份额总额 49,818,464.66 份；华安中证银行 A 份额参考净值 1.0298 元，份额总额 339,184,229.00 份；华安中证银行 B 份额参考净值 0.4894 元，份额总额 339,184,229.00 份。



## 6.2 利润表

会计主体：华安中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 9 日（基<br>金合同生效日）至 2015<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|--|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>-47,558,423.48</b>                    | <b>-8,093,458.15</b>                                       |
| 1.利息收入                     |          | 133,034.42                               | 48,921.02  |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11 | 133,034.42                               | 48,921.02  |
| 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）           |          | -16,530,767.00                           | 662,826.17   |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12 | -25,069,862.81                           | -  |
| 基金投资收益                     |          | -  | -  |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13 | -  | -  |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.14 | -  | -  |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.15 | -  | -  |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.16 | -  | -  |
| 股利收益                       | 7.4.7.17 | 8,539,095.81                             | 662,826.17   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.18 | -31,386,753.20                           | -8,827,852.47  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.19 | 226,062.30                               | 22,647.13  |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>4,349,629.63</b>                      | <b>859,661.68</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2 | 2,863,736.91                             | 184,765.34   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2 | 630,022.12                               | 40,648.38  |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -  |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.20 | 559,978.70                               | 587,362.29   |
| 5. 利息支出                    |          | -  | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -  | -  |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.21 | 295,891.90                               | 46,885.67  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-51,908,053.11</b>                    | <b>-8,953,119.83</b>                                       |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-51,908,053.11</b>                    | <b>-8,953,119.83</b>                                       |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日               |                 |                 |
|--|---|-----------------|-----------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 806,792,984.07                                      | -131,034,832.40 | 675,758,151.67  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -51,908,053.11  | -51,908,053.11  |
| 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）      | -93,197,194.43                                      | 22,448,588.35   | -70,748,606.08  |
| 其中：1.基金申购款                             | 144,192,885.40                                      | -34,041,100.52  | 110,151,784.88  |
| 2.基金赎回款                                | -237,390,079.83                                     | 56,489,688.87   | -180,900,390.96 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -               | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 713,595,789.64                                      | -160,494,297.16 | 553,101,492.48  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）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）                        | 254,178,858.26                                      | -               | 254,178,858.26  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -8,953,119.83   | -8,953,119.83   |
| 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）      | 391,396,056.71                                      | -27,264,122.72  | 364,131,933.99  |
| 其中：1.基金申购款                             | 406,356,733.14                                      | -28,485,524.35  | 377,871,208.79  |
| 2.基金赎回款                                | -14,960,676.43                                      | 1,221,401.63    | -13,739,274.80  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -               | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 645,574,914.97                                      | -36,217,242.55  | 609,357,672.42  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安中证银行指数分级证券投资基金(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[2015]913 号《关于准予华安中证银行指数分级证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自 2015 年 5 月 28 日至 2015 年 6 月 3 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(2015)验字第 60971571\_B21 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 2015 年 6 月 9 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)为人民币 254,156,933.22 元,在募集期间产生的存款利息为人民币 21,925.04 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 254,178,858.26 元,折合 254,178,858.26 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,基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括华安中证银行指数分级证券投资基金的基础份额(以下简称“华安中证银行份额”)、华安中证银行指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(以下简称“华安中证银行 A 份额”)和华安中证银行指数分级证券投资基金的积极收益类份额(以下简称“华安中证银行 B 份额”)。其中,华安中证银行 A 份额和华安中证银行 B 份额的基金份额配比始终保持 1 的比例不变。

在华安中证银行 A 份额和华安中证银行份额存续期内的每个会计年度的基金份额定期折算基准日(基金合同生效不足六个月的除外),本基金将进行基金的定期份额折算。定期份额折算的基准日为每个会计年度的 12 月 15 日(遇节假日顺延)。当华安中证银行份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时或当华安中证银行 B 份额的参考净值小于或等于 0.2500 元时,本基金将进行基金的不定期份额折算。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证银行指数的成分股及其备选成分股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、固定收益资产(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证银行指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为  $95\% \times \text{中证银行指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率}$ （税后）。

#### 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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

## 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>2016 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 33,747,343.35          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 33,747,343.35          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 562,737,176.05         | 520,230,412.56 | -42,506,763.49 |
| 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            | 562,737,176.05         | 520,230,412.56 | -42,506,763.49 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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>2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,703.48               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 0.15                   |
| 应收债券利息     | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | 0.33                   |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 29.97                  |
| 合计         | 5,733.93               |

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 98,175.80              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 98,175.80              |

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 215.63                 |
| 应付指数使用费     | 50,000.00              |
| 预提上市年费      | 29,835.26              |
| 预提审计费       | 34,809.32              |
| 预提信息披露费     | 129,289.16             |
| 合计          | 244,149.37             |

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                |
|------|---------------------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末 | 823,290,042.80                        | 806,792,984.07 |
| 本期申购 | 147,142,242.95                        | 144,192,885.40 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -242,245,363.09 | -237,390,079.83 |
| 本期末           | 728,186,922.66  | 713,595,789.64  |

(1) 本基金的基金份额包括华安中证银行份额、华安中证银行 A 份额和华安中证银行 B 份额。

(2) 申购含配对转换入份额，赎回含配对转换出份额。

(3) 本基金合同于 2015 年 6 月 9 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 254,156,933.22 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 21,925.04 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 254,178,858.26 元，折合 254,178,858.26 份基金份额。

(4) 根据《华安中证银行指数分级证券投资基金合同》规定，每年的基金份额定期折算基准日 12 月 15 日（遇节假日顺延）（基金合同生效不足六个月的除外），本基金将对华安中证银行 A 份额和华安中证银行份额进行定期份额折算。当华安中证银行份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时；当华安中证银行 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将分别对华安中证银行 A 份额、华安中证银行 B 份额和华安中证银行份额进行不定期份额折算。

#### 6.4.7.9 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           | -66,953,421.90 | -64,081,410.50 | -131,034,832.40 |
| 本期利润           | -20,521,299.91 | -31,386,753.20 | -51,908,053.11  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 9,547,717.64   | 12,900,870.71  | 22,448,588.35   |
| 其中：基金申购款       | -15,897,655.96 | -18,143,444.56 | -34,041,100.52  |
| 基金赎回款          | 25,445,373.60  | 31,044,315.27  | 56,489,688.87   |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -               |
| 本期末            | -77,927,004.17 | -82,567,292.99 | -160,494,297.16 |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 127,077.09                      |
| 定期存款利息收入  | -                               |
| 其他存款利息收入  | 2,929.09                        |
| 结算备付金利息收入 | 3,022.82                        |
| 其他        | 5.42                            |
| 合计        | 133,034.42                      |



### 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 195,471,225.32                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 220,541,088.13                  |
| 买卖股票差价收入   | -25,069,862.81                  |

### 6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                   |
|-------------|----------------------|
|             | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 8,539,095.81         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                    |
| 合计          | 8,539,095.81         |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称      | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 1.交易性金融资产 | -31,386,753.20       |
| ——股票投资    | -31,386,753.20       |

|            |                |
|------------|----------------|
| ——债券投资     | -              |
| ——资产支持证券投资 | -              |
| ——基金投资     | -              |
| ——贵金属投资    | -              |
| ——其他       | -              |
| 2.衍生工具     | -              |
| ——权证投资     | -              |
| 3.其他       | -              |
| 合计         | -31,386,753.20 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 226,062.30                 |
| 合计      | 226,062.30                 |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 559,978.70                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 559,978.70                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用   | 34,809.32                  |
| 信息披露费  | 129,289.16                 |
| 银行汇划费用 | 1,958.16                   |
| 上市年费   | 29,835.26                  |
| 指数使用费  | 100,000.00                 |
| 合计     | 295,891.90                 |

### 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，本基金无需要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、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)   | 基金托管人、基金代销机构 |

#### 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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未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

本基金本报告期未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>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2015年6月9日（基金合同<br>生效日）至2015年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,863,736.91                   | 184,765.34                                   |

|                 |           |          |
|-----------------|-----------|----------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 67,734.27 | 8,351.98 |
|-----------------|-----------|----------|

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2015年6月9日（基金合同<br>生效日）至2015年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 630,022.12                     | 40,648.38                                    |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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

华安中证银行指数分级 A

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<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2015年6月9日(基金合同生效日)<br>至2015年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|------------|--|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入     | 期末余额   | 当期利息收入    |
| 中国银行  | 33,747,343.35              | 127,077.09 | 44,414,576.84                                | 48,921.02 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

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 2016 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 2016 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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

### 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

### 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>2016年6月30日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|-------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                |               |      |      |                |                |
| 银行存款              | 33,747,343.35 | -    | -    | -              | 33,747,343.35  |
| 结算备付金             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 存出保证金             | 73,967.28     | -    | -    | -              | 73,967.28      |
| 交易性金融资产           | -             | -    | -    | 520,230,412.56 | 520,230,412.56 |
| 衍生金融资产            | -             | -    | -    | -              | -              |
| 买入返售金融资产          | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收证券清算款           | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收利息              | -             | -    | -    | 5,733.93       | 5,733.93       |
| 应收股利              | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应收申购款             | -             | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计              | 33,821,310.63 | -    | -    | 520,236,146.49 | 554,057,457.12 |
| 负债                |               |      |      |                |                |
| 短期借款              | -             | -    | -    | -              | -              |
| 交易性金融负债           | -             | -    | -    | -              | -              |
| 衍生金融负债            | -             | -    | -    | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款         | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付证券清算款           | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付赎回款             | -             | -    | -    | 58,061.79      | 58,061.79      |
| 应付管理人报酬           | -             | -    | -    | 455,391.54     | 455,391.54     |
| 应付托管费             | -             | -    | -    | 100,186.14     | 100,186.14     |
| 应付销售服务费           | -             | -    | -    | -              | -              |
| 应付交易费用            | -             | -    | -    | 98,175.80      | 98,175.80      |



|  |               |              |              |                |                |
|--|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 应付税费   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付利息   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付利润   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 其他负债   | -             | -            | -            | 244,149.37     | 244,149.37     |
| 负债总计   | -             | -            | -            | 955,964.64     | 955,964.64     |
| 利率敏感度缺口  | 33,821,310.63 | -            | -            | 519,280,181.85 | 553,101,492.48 |
| <b>上年度末</b><br><b>2015 年 12 月 31</b><br><b>日</b> | <b>1 年以内</b>  | <b>1-5 年</b> | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>      |
| 资产   |               |              |              |                |                |
| 银行存款   | 60,601,701.37 | -            | -            | -              | 60,601,701.37  |
| 结算备付金  | 741,147.48    | -            | -            | -              | 741,147.48     |
| 存出保证金  | 882,977.83    | -            | -            | -              | 882,977.83     |
| 交易性金融资产  | -             | -            | -            | 609,964,067.20 | 609,964,067.20 |
| 衍生金融资产   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 买入返售金融资产   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应收证券清算款  | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应收利息   | -             | -            | -            | 10,021.05      | 10,021.05      |
| 应收股利   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应收申购款  | 2,982.11      | -            | -            | 25,306,976.64  | 25,309,958.75  |
| 其他资产   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 资产总计   | 62,228,808.79 | -            | -            | 635,281,064.89 | 697,509,873.68 |
| 负债   |               |              |              |                |                |
| 短期借款   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 交易性金融负债  | -             | -            | -            | -              | -              |
| 衍生金融负债   | -             | -            | -            | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款  | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付证券清算款  | -             | -            | -            | 19,992,326.44  | 19,992,326.44  |
| 应付赎回款  | -             | -            | -            | 499,117.44     | 499,117.44     |
| 应付管理人报酬  | -             | -            | -            | 517,307.43     | 517,307.43     |
| 应付托管费  | -             | -            | -            | 113,807.64     | 113,807.64     |
| 应付销售服务费  | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付交易费用   | -             | -            | -            | 317,281.98     | 317,281.98     |
| 应付税费   | -             | -            | -            | -              | -              |

|         |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应付利息    | -             | - | - | -              | -              |
| 应付利润    | -             | - | - | -              | -              |
| 其他负债    | -             | - | - | 311,881.08     | 311,881.08     |
| 负债总计    | -             | - | - | 21,751,722.01  | 21,751,722.01  |
| 利率敏感度缺口 | 62,228,808.79 | - | - | 613,529,342.88 | 675,758,151.67 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 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(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于中证银行指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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>2016 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2015 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  | 520,230,412.<br>56     | 94.06                | 609,964,067.2<br>0       | 90.26                |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 其他            | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 合计            | 520,230,412.<br>56     | 94.06                | 609,964,067.2<br>0       | 90.26                |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |                          |
|----|-------------|------------------------------|--------------------------|
|    |             | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日       | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 2,820                    | 增加约 3,070                |
|    | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 2,820                    | 减少约 3,070                |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## 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              | 520,230,412.56 | 93.89         |
|    | 其中：股票             | 520,230,412.56 | 93.89         |
| 2  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 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      | 33,747,343.35  | 6.09          |
| 7  | 其他各项资产            | 79,701.21      | 0.01          |
| 8  | 合计                | 554,057,457.12 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别     | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -    | -             |
| B  | 采矿业      | -    | -             |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | -              | -     |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -     |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -     |
| J | 金融业              | 520,230,412.56 | 94.06 |
| K | 房地产业             | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 520,230,412.56 | 94.06 |

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 600016 | 民生银行 | 9,451,793  | 84,404,511.49 | 15.26        |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 4,273,445  | 65,127,301.80 | 11.77        |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 3,305,462  | 57,845,585.00 | 10.46        |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 3,463,505  | 53,926,772.85 | 9.75         |
| 5  | 601328 | 交通银行 | 7,544,494  | 42,475,501.22 | 7.68         |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 12,243,656 | 39,179,699.20 | 7.08         |
| 7  | 601169 | 北京银行 | 3,248,159  | 33,683,408.83 | 6.09         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 8  | 601398 | 工商银行 | 6,909,569 | 30,678,486.36 | 5.55 |
| 9  | 601988 | 中国银行 | 6,750,908 | 21,670,414.68 | 3.92 |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 5,100,558 | 19,178,098.08 | 3.47 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 2,201,300 | 19,151,310.00 | 3.46 |
| 12 | 600015 | 华夏银行 | 1,712,439 | 16,936,021.71 | 3.06 |
| 13 | 601009 | 南京银行 | 1,165,844 | 10,947,275.16 | 1.98 |
| 14 | 601939 | 建设银行 | 2,151,528 | 10,219,758.00 | 1.85 |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 625,099   | 9,238,963.22  | 1.67 |
| 16 | 601998 | 中信银行 | 981,888   | 5,567,304.96  | 1.01 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601169 | 北京银行 | 24,042,415.23 | 3.56            |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 22,161,703.15 | 3.28            |
| 3  | 601288 | 农业银行 | 19,508,826.78 | 2.89            |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 17,044,269.15 | 2.52            |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 16,781,403.16 | 2.48            |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 15,203,602.92 | 2.25            |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 11,801,489.77 | 1.75            |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 7,204,795.00  | 1.07            |
| 9  | 601988 | 中国银行 | 5,629,698.00  | 0.83            |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 4,773,236.82  | 0.71            |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 4,671,300.88  | 0.69            |
| 12 | 600015 | 华夏银行 | 4,214,530.38  | 0.62            |
| 13 | 601939 | 建设银行 | 2,711,082.11  | 0.40            |
| 14 | 601009 | 南京银行 | 2,459,406.00  | 0.36            |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 2,244,955.24  | 0.33            |
| 16 | 601998 | 中信银行 | 1,741,472.10  | 0.26            |

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资 |
|----|------|------|----------|--------|
|----|------|------|----------|--------|

|    |        |      |               | 产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 44,415,247.46 | 6.57         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 24,946,787.26 | 3.69         |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 17,752,486.58 | 2.63         |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 14,295,708.47 | 2.12         |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 13,781,735.61 | 2.04         |
| 6  | 601818 | 光大银行 | 11,559,429.55 | 1.71         |
| 7  | 601328 | 交通银行 | 10,958,972.56 | 1.62         |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 10,200,799.95 | 1.51         |
| 9  | 601988 | 中国银行 | 10,117,090.67 | 1.50         |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 8,875,146.89  | 1.31         |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 8,719,824.31  | 1.29         |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 6,266,093.97  | 0.93         |
| 13 | 600015 | 华夏银行 | 5,627,384.37  | 0.83         |
| 14 | 601009 | 南京银行 | 3,361,753.93  | 0.50         |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 2,607,602.82  | 0.39         |
| 16 | 601998 | 中信银行 | 1,985,160.92  | 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。

#### 7.4.3 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 | 162,194,186.69 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 195,471,225.32 |

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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的，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。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额        |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 73,967.28 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |



|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利  | -         |
| 4 | 应收利息  | 5,733.93  |
| 5 | 应收申购款 | -         |
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 待摊费用  | -         |
| 8 | 其他    | -         |
| 9 | 合计    | 79,701.21 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资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

| 份额级别             | 持有人户数<br>(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 |
| 华安中证银行<br>指数分级 A | 98           | 3,461,063.56  | 254,771,024.00 | 75.11%     | 84,413,205.00  | 24.89%     |
| 华安中证银行<br>指数分级 B | 100          | 3,391,842.29  | 49,553,093.00  | 14.61%     | 289,631,136.00 | 85.39%     |
| 华安中证银行<br>指数分级   | 731          | 68,151.11     | 3,469,715.00   | 6.96%      | 46,348,749.66  | 93.04%     |
| 合计               | 929          | 783,839.53    | 307,793,832.00 | 42.27%     | 420,393,090.66 | 57.73%     |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

## 华安中证银行指数分级 A

| 序号 | 持有人名称                            | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|----------------------------------|---------------|----------|
| 1  | 中国银河证券股份有限公司                     | 70,312,237.00 | 20.73%   |
| 2  | 广东君之健投资管理有限公司—君之健翱翔稳进证券投资基金      | 30,800,000.00 | 9.08%    |
| 3  | 中意人寿保险有限公司                       | 23,010,429.00 | 6.78%    |
| 4  | 北京快快网络技术有限公司                     | 11,904,609.00 | 3.51%    |
| 5  | 广东君之健投资管理有限公司—君之健翱翔价值证券投资基金      | 10,930,000.00 | 3.22%    |
| 6  | 中国人民财产保险股份有限公司—自有资金              | 9,000,000.00  | 2.65%    |
| 7  | 唐华胜                              | 7,669,738.00  | 2.26%    |
| 8  | 王磊                               | 6,324,681.00  | 1.86%    |
| 9  | 方正证券—招商银行—方正证券量化稳宝 CPPI1 号集合资产管理 | 6,009,854.00  | 1.77%    |
| 10 | 瑞泰人寿保险有限公司-万能                    | 5,608,835.00  | 1.65%    |

## 华安中证银行指数分级B

| 序号 | 持有人名称                          | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------------------|---------------|----------|
| 1  | 北京基典兴业科技发展有限公司                 | 30,022,900.00 | 8.85%    |
| 2  | 李秀霞                            | 8,011,212.00  | 2.36%    |
| 3  | 平安信托有限责任公司—金蕴 30 期（东方恒润）集合资金信托 | 7,052,195.00  | 2.08%    |
| 4  | 田宏伟                            | 5,782,534.00  | 1.70%    |
| 5  | 王雪君                            | 5,517,600.00  | 1.63%    |
| 6  | 王雪君                            | 5,113,300.00  | 1.51%    |
| 7  | 平安信托有限责任公司—投资精英之信璞             | 4,500,200.00  | 1.33%    |
| 8  | 王祖林                            | 4,386,014.00  | 1.29%    |

|    |                               |              |       |
|----|-------------------------------|--------------|-------|
| 9  | 周伟                            | 3,997,000.00 | 1.18% |
| 10 | 华润深国投信托有限公司-康成亨 1 期证券投资集合资金信托 | 3,960,000.00 | 1.17% |

华安中证银行指数分级

| 序号 | 持有人名称                          | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例 |
|----|--------------------------------|--------------|----------|
| 1  | 南京盛泉恒元投资有限公司—盛泉恒元多策略量化对冲 2 号基金 | 1,833,870.00 | 3.69%    |
| 2  | 中意人寿保险有限公司                     | 1,043,017.00 | 2.10%    |
| 3  | 沈艳                             | 500,000.00   | 1.01%    |
| 4  | 中国人民财产保险股份有限公司—自有资金            | 368,084.00   | 0.74%    |
| 5  | 林石头                            | 345,944.00   | 0.70%    |
| 6  | 姜双丽                            | 265,317.00   | 0.53%    |
| 7  | 李国晴                            | 204,098.00   | 0.41%    |
| 8  | 伍云芳                            | 204,098.00   | 0.41%    |
| 9  | 李怡名                            | 180,000.00   | 0.36%    |
| 10 | 赵艳                             | 121,433.00   | 0.24%    |

8.3 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 | 华安中证银行指数分级 A | -         | -        |
|                  | 华安中证银行指数分级 B | -         | -        |
|                  | 华安中证银行指数分级   | 5,557.01  | 0.01%    |
|                  | 合计           | -         | -        |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 华安中证银行指数分级 A  | 华安中证银行指数分级 B  | 华安中证银行指数分级    |
|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额 | 91,040,725.00 | 91,040,725.00 | 72,097,408.26 |

|               |                |                |                |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 369,338,073.00 | 369,338,073.00 | 84,613,896.80  |
| 本报告期基金总申购份额   | -              | -              | 147,142,242.95 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | -              | -              | 242,245,363.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -30,153,844.00 | -30,153,844.00 | 60,307,688.00  |
| 本报告期期末基金份额总额  | 339,184,229.00 | 339,184,229.00 | 49,818,464.66  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 西南证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | 249,733,876.44 | 69.82%       | 232,575.82 | 69.89%     | -  |
| 中泰证券 | 1      | 85,469,662.08  | 23.90%       | 79,598.27  | 23.92%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 14,871,495.23  | 4.16%        | 13,552.40  | 4.07%      | -  |
| 国信证券 | 1      | 6,671,920.58   | 1.87%        | 6,213.54   | 1.87%      | -  |
| 国泰君安 | 1      | 918,457.68     | 0.26%        | 836.95     | 0.25%      | -  |

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 西南证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 1  | 华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-04 |
| 2  | 华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-06 |
| 3  | 华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-07 |
| 4  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乐融多源为销售机构并参加费率优惠的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-13 |
| 5  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-14 |
| 6  | 华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-19 |
| 7  | 华安中证银行指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-27 |
| 8  | 华安中证银行指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-29 |
| 9  | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-03 |
| 10 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“卓翼科技”、“浦发银行”股票估值调整的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-19 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰为销售机构并参加费率优惠的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-23 |
| 12 | 华安中证银行指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-26 |
| 13 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延                          | 《上海证券报》、《证券时                | 2016-03-28 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告                        | 报》、《中国证券报》和公司网站             |            |
| 14 | 华安基金管理有限公司关于以自有资金购买基金所涉风险资产的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-30 |
| 15 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-12 |
| 16 | 关于旗下部分基金增加利得金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-13 |
| 17 | 华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-05 |
| 18 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-05 |
| 19 | 华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-06 |
| 20 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米为销售机构并参加费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 21 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 22 | 华安基金管理有限公司关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-13 |
| 23 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-02 |
| 24 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-08 |
| 25 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-14 |
| 26 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-28 |

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

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十六日