

**华安沪深 300 指数分级证券投资基金**  
**2016 年年度报告**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	16
6.1 管理层对财务报表的责任 .....	17
6.2 注册会计师的责任 .....	17
6.3 审计意见 .....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	18
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况 .....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	错误! 未定义书签。
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	华安沪深 300 指数分级		
场内简称	华安 300		
基金主代码	160417		
交易代码	160417		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 25 日		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	25,418,112.64 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 7 月 23 日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指 数分级 B	华安沪深 300 指 数分级
下属分级基金的场内简称	HS300A	HS300B	华安 300
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	10,948,246.00 份	10,948,246.00 份	3,521,620.64 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其

			风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
--	--	--	------------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		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 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-1,567,958.40	34,643,488.43	8,466,803.81
本期利润	-3,392,865.31	14,816,532.71	29,871,428.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1595	0.3730	0.5919
本期加权平均净值利润率	-13.94%	25.93%	61.66%
本期基金份额净值增长率	-12.42%	3.85%	46.08%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	6,667,549.37	8,016,017.88	3,715,663.53
期末可供分配基金份额利润	0.2623	0.4386	0.0509
期末基金资产净值	29,639,202.08	24,948,415.91	98,223,057.74
期末基金份额净值	1.166	1.365	1.346
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	28.98%	47.27%	41.82%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

		②		准差④		
过去三个月	1.04%	0.66%	1.66%	0.67%	-0.62%	-0.01%
过去六个月	4.95%	0.71%	4.71%	0.72%	0.24%	-0.01%
过去一年	-12.42%	1.40%	-10.70%	1.33%	-1.72%	0.07%
过去三年	32.86%	1.72%	40.01%	1.70%	-7.15%	0.02%
自基金合同生效起至今	28.98%	1.57%	30.25%	1.57%	-1.27%	0.00%

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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2012 年 6 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日)



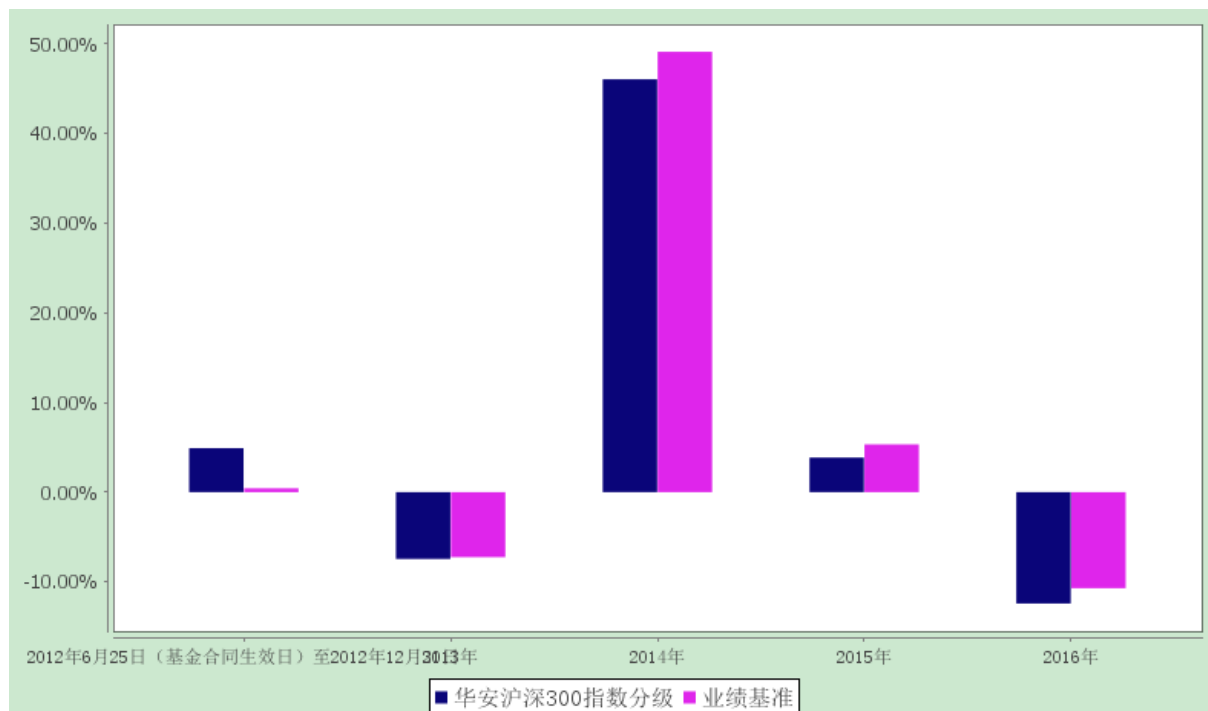
注：本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





注：本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 25 日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同，本基金不进行收益分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安信

用四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略混合、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安汇财通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱晶	本基金的基金经理	2015-05-28	-	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 月起担任本基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。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。2016 年 8 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意

向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 9 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，经济增长仍处于底部位置，全年 GDP 增速 6.7%，较 15 年下降 0.2%。在上半年，楼市狂欢之后，房地产政策收紧，房地产销售增速下降，预计将对经济产生一定负面影响。货币政策从“稳健略偏宽松”到“稳健中性”，长久期国债在 11、12 月份大幅调整，市场利率中枢抬升。股票市场分化严重，低估值蓝筹显著跑赢高估值小股票。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.166 元, 本报告期份额净值增长率为-12.42%, 同期业绩比较基准增长率为-10.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年, 沪深 300 指数下跌 11.28%, 中证 500 指数下跌 17.78%, 中证 1000 下跌 20.01%, 沪深 300 指数表现最佳。对于沪深 300 指数, 我们认为当前其主要吸引力在于估值较低。沪深 300 当前平均估值 13 倍左右, 估值层面具有较高的安全边际。因此, 我们认为沪深 300 指数可以作为投资者的中长期资产配置标的。

作为基金管理人, 我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则, 降低跟踪偏离和跟踪误差, 勤勉尽责, 为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

监察稽核工作重点集中于以下几个方面:

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

稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

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

###### (1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳

定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

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

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

## (2) 托管银行

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

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

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

### §6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20232 号

华安沪深 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：

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



## 6.1 管理层对财务报表的责任

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

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

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

## 6.2 注册会计师的责任

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

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

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

单峰 张振波

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 24 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	1,899,886.86	1,594,860.94
结算备付金		-	-
存出保证金		2,829.20	10,814.00
交易性金融资产	7.4.7.2	28,104,407.08	23,724,801.74
其中：股票投资		28,104,407.08	23,710,614.54
基金投资		-	-
债券投资		-	14,187.20
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	440.75	367.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	8,258.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>30,007,563.89</b>	<b>25,339,103.34</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		48,593.90	9,897.99
应付管理人报酬		25,311.09	22,193.63
应付托管费		5,568.43	4,882.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,705.25	7,675.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	286,183.14	346,037.30
<b>负债合计</b>		<b>368,361.81</b>	<b>390,687.43</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	22,971,652.71	16,932,398.03
未分配利润	7.4.7.10	6,667,549.37	8,016,017.88
<b>所有者权益合计</b>		<b>29,639,202.08</b>	<b>24,948,415.91</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>30,007,563.89</b>	<b>25,339,103.34</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金份额总额 25,418,112.64 份，其中华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额 3,521,620.64 份，基金份额净值 1.166 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 10,948,246.00 份，基金份额参考净值 1.050 元；华安沪深 300 指数分级证券投资基金之积极收益类份额 10,948,246.00 份，基金份额参考净值 1.282 元。

## 7.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-2,544,945.40</b>	<b>16,340,435.49</b>
1.利息收入		13,060.53	33,585.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,033.91	33,538.86
债券利息收入		26.62	46.94
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）		-745,557.81	35,940,849.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,215,183.64	35,283,919.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,512.91	21,569.72
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	467,112.92	635,360.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,824,906.91	-19,826,955.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	12,458.79	192,955.96
<b>减：二、费用</b>		<b>847,919.91</b>	<b>1,523,902.78</b>
1. 管理人报酬		243,441.70	577,639.96
2. 托管费		53,557.08	127,080.77
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	47,659.82	237,832.14
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	503,261.31	581,349.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,392,865.31</b>	<b>14,816,532.71</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,392,865.31</b>	<b>14,816,532.71</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,932,398.03	8,016,017.88	24,948,415.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,392,865.31	-3,392,865.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,039,254.68	2,044,396.80	8,083,651.48
其中：1.基金申购款	14,033,494.62	4,076,196.60	18,109,691.22
2.基金赎回款	-7,994,239.94	-2,031,799.80	-10,026,039.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	22,971,652.71	6,667,549.37	29,639,202.08

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,232,941.57	28,990,116.17	98,223,057.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,816,532.71	14,816,532.71
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）	-52,300,543.54	-35,790,631.00	-88,091,174.54
其中：1.基金申购款	44,131,592.32	25,316,914.68	69,448,507.00
2.基金赎回款	-96,432,135.86	-61,107,545.68	-157,539,681.54
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）	16,932,398.03	8,016,017.88	24,948,415.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具, 包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、



债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,899,886.86	1,594,860.94
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	1,899,886.86	1,594,860.94

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	28,426,849.42	28,104,407.08	-322,442.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		28,426,849.42	28,104,407.08	-322,442.34
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		22,210,537.17	23,710,614.54	1,500,077.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	11,800.00	14,187.20	2,387.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,800.00	14,187.20	2,387.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		22,222,337.17	23,724,801.74	1,502,464.57

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	438.72	355.06
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	-	7.70
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.73	0.20
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.30	4.90
合计	440.75	367.86

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,705.25	7,675.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,705.25	7,675.90

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	183.14	37.30
预提费用	236,000.00	296,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	286,183.14	346,037.30

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元



项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	18,274,717.17	16,932,398.03
本期申购	7,391.34	6,847.48
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
-基金拆分/份额折算前	18,282,108.51	16,939,245.51
基金拆分/份额折算调整	462,278.23	—
本期申购	15,520,625.12	14,026,647.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-8,846,899.22	-7,994,239.94
本期末	25,418,112.64	22,971,652.71

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

2. 根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定以及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定和《关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人以 2016 年 1 月 4 日为基金份额折算基准日，对在该日登记在册的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额办理定期份额折算业务。折算前沪深 300A 份额份额为 7,779,177.00 份，新增份额折算比例为 0.050571736，折算后沪深 300A 份额为 7,779,177.00 份，折算后沪深 300A 份额净值 1.001 元；折算前华安沪深 300 场外份额为 1,863,619.51 份，新增份额折算比例为 0.025285868，折算后华安沪深 300 场外份额为 1,910,742.74 份，折算后华安沪深 300 场外份额净值 1.236 元；折算前华安沪深 300 场内份额为 860,135.00 份，新增份额折算比例为 0.025285868，折算后华安沪深 300 场内份额为 1,275,290.00 份，折算后华安沪深 300 场内份额净值 1.236 元。

3. 截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的华安沪深 300A 份额为 10,948,246.00 份 (2015 年 12 月 31 日：7,779,177.00 份)，华安沪深 300B 份额为 10,948,246.00 份 (2015 年 12 月 31 日：7,779,177.00 份)，托管在场内未上市的华安沪深 300 份额为 819,937.00 份 (2015 年 12 月 31 日：860,135.00 份)，托管在场外未上市的华安沪深 300 份额为 2,701,683.64 份 (2015 年 12 月 31 日：1,856,228.17 份)。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，其中上市的基金份额可选择按市价流通，未上市的基金份额可按基金份额净值申购赎回；场外未上市的基金份额登记在注册登记系统，

按基金份额净值申购或赎回，通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,577,789.88	-9,561,772.00	8,016,017.88
本期利润	-1,567,958.40	-1,824,906.91	-3,392,865.31
本期基金份额交易产生的变动数	5,894,513.06	-3,850,116.26	2,044,396.80
其中：基金申购款	13,682,720.29	-9,606,523.69	4,076,196.60
基金赎回款	-7,788,207.23	5,756,407.43	-2,031,799.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,904,344.54	-15,236,795.17	6,667,549.37

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,666.29	31,959.29
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	263.81	1,003.53
其他	103.81	576.04
合计	13,033.91	33,538.86

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	13,263,482.64	108,278,382.02
减：卖出股票成本总额	14,478,666.28	72,994,462.86
买卖股票差价收入	-1,215,183.64	35,283,919.16

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,512.91	21,569.72
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,512.91	21,569.72

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,331.23	43,713.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,800.00	22,100.00
减：应收利息总额	18.32	44.08
买卖债券差价收入	2,512.91	21,569.72

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

股票投资产生的股利收益	467,112.92	635,360.57
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	467,112.92	635,360.57

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-1,824,906.91	-19,826,955.72
——股票投资	-1,822,519.71	-19,824,094.61
——债券投资	-2,387.20	-2,861.11
——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	-1,824,906.91	-19,826,955.72

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	12,458.79	192,955.96
其他	-	-
合计	12,458.79	192,955.96

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

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	47,659.82	237,832.14
银行间市场交易费用	-	-
合计	47,659.82	237,832.14

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	180,000.00	240,000.00
银行汇划费用	1,261.31	2,849.91
上市年费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
账户维护费	6,000.00	22,500.00
合计	503,261.31	581,349.91

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

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定以及《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金以 2017 年 1 月 3 日为份额折算基准日，对在该日

登记在册的华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额办理定期份额折算业务，并于 2017 年 1 月 4 日进行了变更登记。

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

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金 2016 年度的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	243,441.70	577,639.96
其中：支付销售机构的客户维护费	6,641.12	13,599.70

注：支付基金管理人 华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	53,557.08	127,080.77

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,899,886.86	12,666.29	1,594,860.94	31,959.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项停牌	6.25	2017-01-26	6.29	18,160.00	166,811.68	113,500.00	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项停牌	6.93	2017-01-03	7.00	8,300.00	58,215.70	57,519.00	-
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项停牌	6.97	2017-01-20	6.27	8,795.00	72,639.03	61,301.15	-
002122	中环股	2016-04	重大事	8.27	-	-	3,209.00	43,040.55	26,538.43	-



9	份	-25	项停牌							
300104	乐视网	2016-12-07	重大事项停牌	32.96	2017-01-16	36.88	2,900.00	172,084.12	95,584.00	
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项停牌	16.63	-	-	4,403.00	69,864.55	73,221.89	
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60	-	-	4,418.00	96,443.60	64,502.80	
600649	城投控股	2016-12-06	重大事项停牌	20.34	-	-	4,390.00	37,514.23	89,292.60	
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项停牌	10.79	-	-	3,600.00	70,786.56	38,844.00	
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项停牌	8.42	-	-	9,000.00	81,149.91	75,780.00	

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

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合

作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理

的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资及存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,899,886.86	-	-	-	1,899,886.86
存出保证金	2,829.20	-	-	-	2,829.20
交易性金融资产	-	-	-	28,104,407.08	28,104,407.08
应收利息	-	-	-	440.75	440.75
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,902,716.06	-	-	28,104,847.83	30,007,563.89
负债					

应付赎回款	-	-	-	48,593.90	48,593.90
应付管理费	-	-	-	25,311.09	25,311.09
应付托管费	-	-	-	5,568.43	5,568.43
应付交易费用	-	-	-	2,705.25	2,705.25
其他负债	-	-	-	286,183.14	286,183.14
负债总计	-	-	-	368,361.81	368,361.81
利率敏感度缺口	1,902,716.06	-	-	27,736,486.02	29,639,202.08
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,594,860.94	-	-	-	1,594,860.94
存出保证金	10,814.00	-	-	-	10,814.00
交易性金融资产	-	-	14,187.20	23,710,614.54	23,724,801.74
应收利息	-	-	-	367.86	367.86
应收申购款	-	-	-	8,258.80	8,258.80
资产总计	1,605,674.94	-	14,187.20	23,719,241.20	25,339,103.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,897.99	9,897.99
应付管理费	-	-	-	22,193.63	22,193.63
应付托管费	-	-	-	4,882.61	4,882.61
应付交易费用	-	-	-	7,675.90	7,675.90
其他负债	-	-	-	346,037.30	346,037.30
负债总计	-	-	-	390,687.43	390,687.43
利率敏感度缺口	1,605,674.94	-	14,187.20	23,328,553.77	24,948,415.91

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2016 年 12 月 31 日未持有债券资产(2015 年 12 月 31 日：0.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	28,104,407.08	94.82	23,710,614.54	95.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	28,104,407.08	94.82	23,710,614.54	95.04

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,560,000.00	增加约 1,250,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,560,000.00	减少约 1,250,000.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 27,408,323.21 元，属于第二层次的余额为 696,083.87 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 22,175,644.07 元，第二层次 1,549,157.67 元，无第三层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	28,104,407.08	93.66
	其中:股票	28,104,407.08	93.66
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	1,899,886.86	6.33
7	其他各项资产	3,269.95	0.01
8	合计	30,007,563.89	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	25,097.76	0.08
B	采矿业	981,418.82	3.31
C	制造业	8,656,189.99	29.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	768,495.02	2.59
E	建筑业	1,253,559.00	4.23
F	批发和零售业	569,059.78	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	812,637.43	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,623,091.66	5.48
J	金融业	9,937,916.41	33.53
K	房地产业	1,381,475.90	4.66
L	租赁和商务服务业	321,819.48	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	220,083.83	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,806.90	0.12
R	文化、体育和娱乐业	379,151.96	1.28
S	综合	131,503.40	0.44
	合计	27,098,307.34	91.43

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元



代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	80,138.06	0.27
C	制造业	442,769.99	1.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	306,254.49	1.03
E	建筑业	40,159.64	0.14
F	批发和零售业	37,202.88	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	20,126.00	0.07
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	-	-
K	房地产业	43,663.00	0.15
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	35,785.68	0.12
S	综合	-	-
	合计	1,006,099.74	3.39

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	601318	中国平安	33,231	1,177,374.33	3.97
2	601166	兴业银行	40,924	660,513.36	2.23
3	600016	民生银行	72,506	658,354.48	2.22
4	600036	招商银行	31,603	556,212.80	1.88
5	600519	贵州茅台	1,533	512,251.95	1.73
6	601328	交通银行	84,248	486,110.96	1.64
7	600000	浦发银行	26,538	430,180.98	1.45
8	000002	万科A	20,895	429,392.25	1.45
9	601668	中国建筑	45,971	407,303.06	1.37
10	600837	海通证券	24,756	389,907.00	1.32
11	600030	中信证券	24,131	387,543.86	1.31
12	000333	美的集团	13,753	387,422.01	1.31
13	601169	北京银行	37,335	364,389.60	1.23
14	601288	农业银行	117,209	363,347.90	1.23
15	000651	格力电器	14,752	363,194.24	1.23
16	600887	伊利股份	18,621	327,729.60	1.11
17	601398	工商银行	66,145	291,699.45	0.98
18	601766	中国中车	28,129	274,820.33	0.93
19	601601	中国太保	9,663	268,341.51	0.91
20	601211	国泰君安	14,000	260,260.00	0.88
21	600900	长江电力	20,235	256,175.10	0.86
22	000001	平安银行	26,321	239,521.10	0.81
23	600104	上汽集团	10,193	239,025.85	0.81
24	601988	中国银行	64,610	222,258.40	0.75
25	000725	京东方A	72,884	208,448.24	0.70
26	601390	中国中铁	22,885	202,761.10	0.68
27	000858	五粮液	5,821	200,708.08	0.68
28	601989	中国重工	28,103	199,250.27	0.67
29	600048	保利地产	21,800	199,034.00	0.67
30	600276	恒瑞医药	4,296	195,468.00	0.66
31	601818	光大银行	48,828	190,917.48	0.64
32	600050	中国联通	26,041	190,359.71	0.64
33	601688	华泰证券	9,979	178,224.94	0.60
34	600015	华夏银行	16,350	177,397.50	0.60
35	600028	中国石化	32,241	174,423.81	0.59
36	601186	中国铁建	14,097	168,600.12	0.57
37	600518	康美药业	9,098	162,399.30	0.55
38	000776	广发证券	9,095	153,341.70	0.52
39	600958	东方证券	9,500	147,535.00	0.50
40	002450	康得新	7,547	144,223.17	0.49
41	002415	海康威视	5,632	134,097.92	0.45
42	002024	苏宁云商	11,426	130,827.70	0.44
43	601006	大秦铁路	18,273	129,372.84	0.44
44	002304	洋河股份	1,800	127,080.00	0.43

45	601628	中国人寿	5,130	123,581.70	0.42
46	601009	南京银行	11,114	120,475.76	0.41
47	001979	招商蛇口	7,299	119,630.61	0.40
48	601857	中国石油	14,914	118,566.30	0.40
49	002736	国信证券	7,500	116,625.00	0.39
50	000063	中兴通讯	7,269	115,940.55	0.39
51	600795	国电电力	36,132	114,538.44	0.39
52	600999	招商证券	6,987	114,097.71	0.38
53	000166	申万宏源	18,160	113,500.00	0.38
54	601899	紫金矿业	33,911	113,262.74	0.38
55	601939	建设银行	20,600	112,064.00	0.38
56	601336	新华保险	2,535	110,982.30	0.37
57	300059	东方财富	6,522	110,417.46	0.37
58	601377	兴业证券	14,389	110,075.85	0.37
59	601099	太平洋	20,915	107,712.25	0.36
60	000783	长江证券	10,176	104,100.48	0.35
61	600585	海螺水泥	6,116	103,727.36	0.35
62	601985	中国核电	14,300	100,958.00	0.34
63	300070	碧水源	5,700	99,864.00	0.34
64	002142	宁波银行	5,955	99,091.20	0.33
65	601088	中国神华	6,053	97,937.54	0.33
66	601788	光大证券	6,000	95,940.00	0.32
67	601901	方正证券	12,617	95,889.20	0.32
68	600019	宝钢股份	15,073	95,713.55	0.32
69	300104	乐视网	2,900	95,584.00	0.32
70	600637	东方明珠	4,020	93,666.00	0.32
71	000538	云南白药	1,229	93,588.35	0.32
72	600690	青岛海尔	9,322	92,101.36	0.31
73	601669	中国电建	12,678	92,042.28	0.31
74	000503	海虹控股	2,171	91,290.55	0.31
75	000768	中航飞机	4,290	91,205.40	0.31
76	600089	特变电工	9,922	90,587.86	0.31
77	002673	西部证券	4,308	89,477.16	0.30
78	600383	金地集团	6,903	89,462.88	0.30
79	000625	长安汽车	5,983	89,386.02	0.30
80	600649	城投控股	4,390	89,292.60	0.30
81	000423	东阿阿胶	1,605	86,461.35	0.29
82	601600	中国铝业	20,177	85,146.94	0.29
83	601555	东吴证券	6,402	84,954.54	0.29
84	600705	中航资本	13,774	84,296.88	0.28
85	600547	山东黄金	2,305	84,155.55	0.28
86	600109	国金证券	6,449	84,030.47	0.28
87	600010	包钢股份	29,936	83,521.44	0.28
88	600703	三安光电	6,214	83,205.46	0.28

89	002594	比亚迪	1,673	83,114.64	0.28
90	600886	国投电力	12,446	83,014.82	0.28
91	600535	天士力	1,995	82,772.55	0.28
92	600111	北方稀土	6,709	82,319.43	0.28
93	002202	金风科技	4,776	81,717.36	0.28
94	600660	福耀玻璃	4,309	80,276.67	0.27
95	002456	欧菲光	2,331	79,906.68	0.27
96	600066	宇通客车	4,029	78,928.11	0.27
97	600009	上海机场	2,966	78,658.32	0.27
98	600893	中航动力	2,393	78,346.82	0.26
99	600068	葛洲坝	8,445	77,609.55	0.26
100	000839	中信国安	8,450	77,571.00	0.26
101	300017	网宿科技	1,440	77,198.40	0.26
102	002230	科大讯飞	2,841	76,962.69	0.26
103	600100	同方股份	5,508	76,285.80	0.26
104	600029	南方航空	10,828	76,012.56	0.26
105	601727	上海电气	9,000	75,780.00	0.26
106	002739	万达院线	1,400	75,698.00	0.26
107	600804	鹏博士	3,443	75,504.99	0.25
108	002241	歌尔股份	2,830	75,051.60	0.25
109	000338	潍柴动力	7,458	74,281.68	0.25
110	000100	TCL 集团	22,502	74,256.60	0.25
111	600406	国电南瑞	4,403	73,221.89	0.25
112	600415	小商品城	8,334	72,089.10	0.24
113	601800	中国交建	4,731	71,863.89	0.24
114	300024	机器人	3,356	71,751.28	0.24
115	000568	泸州老窖	2,169	71,577.00	0.24
116	600309	万华化学	3,322	71,522.66	0.24
117	000728	国元证券	3,580	71,242.00	0.24
118	600031	三一重工	11,635	70,973.50	0.24
119	600196	复星医药	3,059	70,785.26	0.24
120	002252	上海莱士	3,060	70,655.40	0.24
121	601618	中国中冶	14,971	69,764.86	0.24
122	000069	华侨城 A	10,009	69,562.55	0.23
123	000793	华闻传媒	6,132	69,230.28	0.23
124	600570	恒生电子	1,467	69,154.38	0.23
125	002065	东华软件	2,934	68,362.20	0.23
126	000009	中国宝安	6,584	68,210.24	0.23
127	601198	东兴证券	3,400	68,204.00	0.23
128	601607	上海医药	3,485	68,166.60	0.23
129	600023	浙能电力	12,517	67,967.31	0.23
130	000623	吉林敖东	2,185	67,713.15	0.23
131	600271	航天信息	3,386	67,550.70	0.23
132	600739	辽宁成大	3,753	67,403.88	0.23

133	600867	通化东宝	3,031	66,469.83	0.22
134	600177	雅戈尔	4,731	66,139.38	0.22
135	600221	海南航空	20,121	65,594.46	0.22
136	600606	绿地控股	7,500	65,325.00	0.22
137	600340	华夏幸福	2,716	64,912.40	0.22
138	000413	东旭光电	5,746	64,699.96	0.22
139	600352	浙江龙盛	7,010	64,562.10	0.22
140	600485	信威集团	4,418	64,502.80	0.22
141	600115	东方航空	9,086	64,238.02	0.22
142	000895	双汇发展	3,069	64,234.17	0.22
143	601888	中国国旅	1,475	64,015.00	0.22
144	600820	隧道股份	5,800	63,858.00	0.22
145	600816	安信信托	2,700	63,774.00	0.22
146	600489	中金黄金	5,265	63,653.85	0.21
147	000630	铜陵有色	20,455	63,001.40	0.21
148	002007	华兰生物	1,731	61,883.25	0.21
149	600369	西南证券	8,654	61,703.02	0.21
150	002465	海格通信	5,278	61,488.70	0.21
151	601018	宁波港	12,122	61,337.32	0.21
152	601919	中远海控	11,700	61,308.00	0.21
153	000750	国海证券	8,795	61,301.15	0.21
154	600741	华域汽车	3,830	61,088.50	0.21
155	600157	永泰能源	15,232	61,080.32	0.21
156	000157	中联重科	13,429	60,967.66	0.21
157	601998	中信银行	9,415	60,350.15	0.20
158	300124	汇川技术	2,962	60,217.46	0.20
159	002236	大华股份	4,397	60,150.96	0.20
160	600718	东软集团	3,052	60,002.32	0.20
161	002008	大族激光	2,628	59,392.80	0.20
162	600674	川投能源	6,756	58,777.20	0.20
163	600150	中国船舶	2,085	57,566.85	0.19
164	000540	中天城投	8,300	57,519.00	0.19
165	601933	永辉超市	11,712	57,505.92	0.19
166	000963	华东医药	786	56,647.02	0.19
167	601111	中国国航	7,814	56,260.80	0.19
168	300027	华谊兄弟	5,082	55,902.00	0.19
169	600153	建发股份	5,221	55,864.70	0.19
170	600118	中国卫星	1,764	55,107.36	0.19
171	300315	掌趣科技	5,900	54,516.00	0.18
172	600959	江苏有线	4,820	54,466.00	0.18
173	002475	立讯精密	2,573	53,389.75	0.18
174	000686	东北证券	4,310	53,271.60	0.18
175	600085	同仁堂	1,697	53,251.86	0.18
176	000060	中金岭南	4,760	53,074.00	0.18

177	600061	国投安信	3,400	53,074.00	0.18
178	600005	武钢股份	15,500	52,855.00	0.18
179	601333	广深铁路	10,405	52,753.35	0.18
180	600170	上海建工	10,971	51,892.83	0.18
181	000876	新希望	6,360	51,198.00	0.17
182	600018	上港集团	9,926	50,821.12	0.17
183	000826	启迪桑德	1,536	50,657.28	0.17
184	600663	陆家嘴	2,278	50,412.14	0.17
185	000917	电广传媒	3,467	49,890.13	0.17
186	600583	海油工程	6,754	49,844.52	0.17
187	002183	怡亚通	4,500	48,870.00	0.16
188	002081	金螳螂	4,889	47,863.31	0.16
189	600839	四川长虹	11,352	47,451.36	0.16
190	600588	用友网络	2,241	46,657.62	0.16
191	000559	万向钱潮	3,498	46,383.48	0.16
192	600256	广汇能源	9,656	45,093.52	0.15
193	300168	万达信息	2,200	44,484.00	0.15
194	603993	洛阳钼业	11,958	44,483.76	0.15
195	002385	大北农	6,261	44,453.10	0.15
196	000792	盐湖股份	2,304	43,937.28	0.15
197	000425	徐工机械	12,947	43,760.86	0.15
198	600208	新潮中宝	10,504	43,696.64	0.15
199	000709	河钢股份	13,072	43,660.48	0.15
200	600688	上海石化	6,775	43,631.00	0.15
201	300058	蓝色光标	4,261	43,334.37	0.15
202	601718	际华集团	4,700	43,287.00	0.15
203	600895	张江高科	2,400	42,528.00	0.14
204	002500	山西证券	3,482	41,853.64	0.14
205	600362	江西铜业	2,488	41,624.24	0.14
206	600060	海信电器	2,417	41,379.04	0.14
207	000415	渤海金控	5,700	40,755.00	0.14
208	000983	西山煤电	4,816	40,743.36	0.14
209	601633	长城汽车	3,667	40,557.02	0.14
210	600332	白云山	1,679	40,262.42	0.14
211	601866	中远海发	9,758	39,812.64	0.13
212	600074	保千里	3,000	39,720.00	0.13
213	601258	庞大集团	14,254	39,483.58	0.13
214	600252	中恒集团	8,484	38,856.72	0.13
215	600875	东方电气	3,600	38,844.00	0.13
216	300002	神州泰岳	4,200	38,808.00	0.13
217	600737	中粮屯河	3,100	38,626.00	0.13
218	000977	浪潮信息	1,800	38,160.00	0.13
219	002470	金正大	4,808	37,983.20	0.13
220	600376	首开股份	3,200	37,792.00	0.13

221	600666	奥瑞德	1,400	37,730.00	0.13
222	600446	金证股份	1,500	37,695.00	0.13
223	300144	宋城演艺	1,800	37,692.00	0.13
224	000402	金融街	3,633	37,419.90	0.13
225	600873	梅花生物	5,728	37,346.56	0.13
226	002292	奥飞娱乐	1,634	37,091.80	0.13
227	300015	爱尔眼科	1,231	36,806.90	0.12
228	601216	君正集团	7,820	36,363.00	0.12
229	600704	物产中大	3,500	36,155.00	0.12
230	600038	中直股份	742	35,927.64	0.12
231	600827	百联股份	2,426	34,837.36	0.12
232	000778	新兴铸管	6,705	34,664.85	0.12
233	000738	中航动控	1,400	34,636.00	0.12
234	002195	二三四五	3,000	33,960.00	0.11
235	600373	中文传媒	1,663	33,592.60	0.11
236	000039	中集集团	2,292	33,509.04	0.11
237	002152	广电运通	2,500	33,200.00	0.11
238	000712	锦龙股份	1,400	32,816.00	0.11
239	000156	华数传媒	1,802	32,273.82	0.11
240	600037	歌华有线	2,100	32,172.00	0.11
241	601872	招商轮船	6,500	32,110.00	0.11
242	600021	上海电力	2,600	31,564.00	0.11
243	002146	荣盛发展	4,006	31,447.10	0.11
244	600372	中航电子	1,636	30,364.16	0.10
245	600008	首创股份	7,314	30,060.54	0.10
246	603000	人民网	1,702	30,057.32	0.10
247	600685	中船防务	1,000	29,700.00	0.10
248	601225	陕西煤业	6,112	29,643.20	0.10
249	002027	分众传媒	1,900	27,113.00	0.09
250	000800	一汽轿车	2,471	26,859.77	0.09
251	002129	中环股份	3,209	26,538.43	0.09
252	300146	汤臣倍健	2,206	26,339.64	0.09
253	300251	光线传媒	2,658	25,942.08	0.09
254	601021	春秋航空	700	25,718.00	0.09
255	000061	农产品	2,073	25,643.01	0.09
256	000027	深圳能源	3,703	25,439.61	0.09
257	600582	天地科技	5,100	25,347.00	0.09
258	601118	海南橡胶	3,606	25,097.76	0.08
259	002424	贵州百灵	1,300	24,622.00	0.08
260	300133	华策影视	2,153	24,436.55	0.08
261	601928	凤凰传媒	2,329	24,384.63	0.08
262	002153	石基信息	1,000	24,370.00	0.08
263	600871	石化油服	5,500	22,550.00	0.08
264	601958	金钼股份	2,943	22,513.95	0.08

265	600648	外高桥	1,123	22,168.02	0.07
266	601608	中信重工	3,900	21,879.00	0.07
267	600783	鲁信创投	918	20,765.16	0.07
268	603885	吉祥航空	800	18,640.00	0.06
269	300085	银之杰	800	16,720.00	0.06
270	600188	兖州煤业	1,240	13,466.40	0.05
271	002568	百润股份	500	10,120.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600011	华能国际	12,655	89,217.75	0.30
2	300003	乐普医疗	2,600	46,618.00	0.16
3	000046	泛海控股	4,700	43,663.00	0.15
4	600398	海澜之家	4,037	43,559.23	0.15
5	601106	中国一重	7,900	42,739.00	0.14
6	002422	科伦药业	2,604	41,976.48	0.14
7	600642	申能股份	6,879	40,379.73	0.14
8	601117	中国化学	5,932	40,159.64	0.14
9	600027	华电国际	7,421	36,733.95	0.12
10	601098	中南传媒	2,148	35,785.68	0.12
11	601991	大唐发电	9,100	34,762.00	0.12
12	601179	中国西电	6,179	34,478.82	0.12
13	601992	金隅股份	7,558	33,708.68	0.11
14	601898	中煤能源	5,499	31,949.19	0.11
15	000729	燕京啤酒	4,313	29,975.35	0.10
16	000999	华润三九	1,181	29,206.13	0.10
17	000898	鞍钢股份	5,599	28,218.96	0.10
18	600098	广州发展	2,500	28,050.00	0.09
19	002294	信立泰	949	27,748.76	0.09
20	000825	太钢不锈	6,858	27,020.52	0.09
21	600863	内蒙华电	8,767	27,002.36	0.09
22	000883	湖北能源	5,895	26,999.10	0.09
23	000629	*ST 钒钛	10,457	24,992.23	0.08
24	600600	青岛啤酒	822	24,199.68	0.08
25	601808	中海油服	1,808	23,196.64	0.08
26	002399	海普瑞	1,129	20,570.38	0.07
27	600317	营口港	5,800	20,126.00	0.07
28	600998	九州通	968	20,076.32	0.07
29	600578	京能电力	4,238	17,799.60	0.06
30	600546	*ST 山煤	4,208	17,126.56	0.06
31	600022	山东钢铁	5,100	12,750.00	0.04



32	601016	节能风电	600	5,310.00	0.02
----	--------	------	-----	----------	------

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,400,966.39	5.62
2	600016	民生银行	875,569.00	3.51
3	601166	兴业银行	722,280.00	2.90
4	600036	招商银行	576,962.00	2.31
5	600000	浦发银行	509,055.00	2.04
6	600519	贵州茅台	498,077.00	2.00
7	601328	交通银行	480,146.00	1.92
8	600030	中信证券	385,052.00	1.54
9	000002	万科 A	384,920.00	1.54
10	601288	农业银行	339,889.00	1.36
11	600837	海通证券	321,487.00	1.29
12	601169	北京银行	290,068.00	1.16
13	601211	国泰君安	286,410.00	1.15
14	601398	工商银行	274,311.00	1.10
15	000333	美的集团	261,947.00	1.05
16	601766	中国中车	260,163.00	1.04
17	600887	伊利股份	252,340.13	1.01
18	601668	中国建筑	233,444.00	0.94
19	601601	中国太保	206,798.00	0.83
20	600900	长江电力	202,334.50	0.81

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	473,285.00	1.90
2	600016	民生银行	391,206.00	1.57
3	600519	贵州茅台	327,333.88	1.31

4	601166	兴业银行	215,351.00	0.86
5	600000	浦发银行	199,829.00	0.80
6	600036	招商银行	176,337.90	0.71
7	000002	万科A	116,587.00	0.47
8	600030	中信证券	114,370.00	0.46
9	601328	交通银行	112,604.00	0.45
10	600837	海通证券	110,684.00	0.44
11	601398	工商银行	105,425.00	0.42
12	601169	北京银行	101,429.00	0.41
13	601377	兴业证券	99,736.00	0.40
14	601288	农业银行	94,970.00	0.38
15	600887	伊利股份	93,823.00	0.38
16	002415	海康威视	88,363.00	0.35
17	601668	中国建筑	87,522.00	0.35
18	600999	招商证券	87,014.00	0.35
19	601336	新华保险	86,848.00	0.35
20	000630	铜陵有色	84,645.00	0.34

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	20,694,978.53
卖出股票的收入（成交）总额	13,263,482.64

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2015 年 11 月 26 日，海通证券股份有限公司因在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》收到中国证券监督管理委员会调查通知书；2016 年 11 月 28 日，海通证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]127 号），原因为未按规定审查、了解客户真实身份，被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。报告期内，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额

1	存出保证金	2,829.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	440.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,269.95

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安沪深 300 指数分级 A	157	69,734.05	9,740,749.00	88.97%	1,207,497.00	11.03%
华安沪深 300 指	415	26,381.32	3,321,305.00	30.34%	7,626,941.00	69.66%

数分级 B						
华安沪深 300 指数分级	374	9,416.10	511,332.00	14.52%	3,010,288.64	85.48%
合计	946	26,869.04	13,573,386.00	53.40%	11,844,726.64	46.60%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 华安沪深 300 指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司—金得量化套利集合资金信托计划	6,487,014.00	59.25%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募）	3,140,207.00	28.68%
3	谢孟春	229,689.00	2.10%
4	蔡捷	102,682.00	0.94%
5	李元	97,706.00	0.89%
6	中信证券股份有限公司	82,250.00	0.75%
7	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 6 号私募证券投资基金	63,278.00	0.58%
8	周敬	50,003.00	0.46%
9	解咏梅	50,000.00	0.46%
10	罗广斌	42,139.00	0.38%

### 华安沪深300指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	利得资本管理有限公司—利得资本—利得盈 1 号资产管理计划	2,281,630.00	20.84%
2	中信证券股份有限公司	838,901.00	7.66%
3	梁万宜	751,000.00	6.86%
4	区艳芬	656,712.00	6.00%
5	黎富兴	548,400.00	5.01%
6	唐素正	250,000.00	2.28%
7	郭磊	222,300.00	2.03%
8	洪耀林	220,000.00	2.01%
9	吴为军	210,300.00	1.92%
10	邓琦	182,400.00	1.67%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指数 分级 B	华安沪深 300 指数 分级
基金合同生效日（2012 年 6 月 25 日）基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	7,779,177.00	7,779,177.00	2,716,363.17
本报告期基金总申购份额	-	-	15,990,294.69
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	8,846,899.22
本报告期基金拆分变动份额	3,169,069.00	3,169,069.00	-6,338,138.00
本报告期期末基金份额总额	10,948,246.00	10,948,246.00	3,521,620.64

拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 56,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元 数量	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	
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	13,204,931.53	38.94%	12,296.41	39.18%	-
招商证券股份有限公司	3	9,592,970.27	28.29%	8,933.43	28.47%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	9,109,198.88	26.87%	8,301.85	26.45%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,387,225.00	4.09%	1,292.07	4.12%	-
西南证券股份有限公司	1	425,374.00	1.25%	387.66	1.24%	-
方正证券股份有限公司	1	187,425.00	0.55%	170.81	0.54%	-

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，最大限度地调调整体资源，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：

2016年2月完成退租托管在建设银行的德邦证券上海33187交易单元

2016年3月完成退租托管在建设银行的长城证券上海27450交易单元

2016年5月完成租用托管在建设银行的申万宏源证券深圳000793交易单元

2016年9月完成租用托管在建设银行的的天风证券深圳001624交易单元

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申银万国证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

招商证券股份 有限公司	20,185.80	82.96%	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	4,145.43	17.04%	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间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	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 HS300A 份额停复牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-05
3	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金之华安沪深 300A 份额 2016 年度约定年基准收益率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-05
4	关于华安沪深 300A 份额定期份额折算后次日日前收盘价调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
5	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
6	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
7	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
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万科 A”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-09
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新希望”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-12
10	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

11	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
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“京能电力”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-14
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新海宜”、“蓝色光标”、“宁波港”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-16
14	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
15	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
16	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
17	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
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“康得新”、“江西铜业”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南方汇通”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-03
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-25
21	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	2016-03-28
22	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
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-09
24	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
25	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》	2016-04-13

		和公司网站	
26	关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-04-19
27	关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-04-29
28	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
29	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
30	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
31	关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-05-10
32	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
33	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
34	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-05-13
35	关于华安旗下部分基金参加民生银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-05-14
36	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“光线传媒”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-05-18
37	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
38	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
39	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
40	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的	《上海证券报》、《证券	2016-06-22

	“格力电器”股票估值调整的公告	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
41	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
42	关于旗下部分基金增加常熟农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-07-20
43	华安基金新增蛋卷基金代销并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-07-22
44	华安基金关于旗下部分基金增加大智慧为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-08-06
45	关于旗下部分基金增加华金证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-08-12
46	关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-08-13
47	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-08-15
48	关于旗下部分基金增加同花顺为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-09-20
49	关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-09-21
50	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-09-23
51	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-10-13
52	关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-11-10
53	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-11-10
54	关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2016-11-16

55	华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-16
56	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-29
57	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万家文化”、“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-15
58	关于旗下部分基金增加东海期货为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-20
59	华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28

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

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日