

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.11 投资组合报告附注	49
8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

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	204,229,719.43 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	7,763,146.00 份	7,763,146.00 份	188,703,427.43 份

2.2 基金产品说明

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

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	889,443.24
本期利润	18,743,879.12
加权平均基金份额本期利润	0.1382
本期加权平均净值利润率	11.55%
本期基金份额净值增长率	11.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)

期末可供分配利润	79,011,016.47
期末可供分配基金份额利润	0.3869
期末基金资产净值	259,717,219.66
期末基金份额净值	1.2720
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	43.76%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.47%	0.62%	4.73%	0.64%	0.74%	-0.02%
过去三个月	7.34%	0.58%	5.80%	0.59%	1.54%	-0.01%
过去六个月	11.46%	0.53%	10.25%	0.54%	1.21%	-0.01%
过去一年	16.98%	0.63%	15.47%	0.63%	1.51%	0.00%
过去三年	59.03%	1.68%	65.94%	1.66%	-6.91%	0.02%
自基金合同生效起至今	43.76%	1.50%	43.75%	1.50%	0.01%	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

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

（2012 年 6 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日）



注：根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十六部分“基金的投资”中投资范围、投资限制等有关约定。

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。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》, 将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括: 在研究环节, 研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中, 使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节, 公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略, 制定并严格执行交易决策规则, 以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制, 投资组合经理在授权范围内自主决策, 超过投资权限的操作需

要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。

（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，国内经济保持平稳。工业企业利润总额同比增速在一季度反弹至高点后，4 月份虽有所回落，但 5 月份的数据已经有小幅回升，经济表现出较强的韧性。从 PMI 数据来看，6 月制造业 PMI 为 51.7，较上月上升 0.5 个百分点，连续 11 个月保持在荣枯线之上；非制造业 PMI 商务活动指数为 54.9，维持高位。制造业和非制造业均维持较高的景气度，不排除下半年经济增长存在超预期的可能性。

在经济回暖的背景下，上半年 A 股市场整体略有上涨，上证综指涨幅 2.86%。同时，市场结构分化十分明显。代表蓝筹股的沪深 300 指数上半年上涨 10.78%，而代表新兴成长的创业板指同期下跌 7.34%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.272 元，本报告期份额净值增长率为 11.46%，同期业绩比较基准增长率为 10.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年 2 季度，沪深 300 指数上涨 6.10%，上证综指下跌 0.93%，沪深 300 指数跑赢上证综指。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确

定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值有连续超过 20 个工作日低于 5000 万元的情形，但截至 2017 年 6 月 30 日，基金资产净值已经超过 5000 万元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	17,438,810.54	1,899,886.86
结算备付金		64,341.95	-
存出保证金		48,219.06	2,829.20
交易性金融资产	6.4.7.2	242,716,671.02	28,104,407.08
其中：股票投资		242,716,671.02	28,104,407.08
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,220.58	440.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		260,271,263.15	30,007,563.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		100,522.59	48,593.90
应付管理人报酬	6.4.10.2	209,246.86	25,311.09
应付托管费	6.4.10.2	46,034.30	5,568.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,847.97	2,705.25
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	169,391.77	286,183.14
负债合计		554,043.49	368,361.81
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	180,706,203.19	22,971,652.71
未分配利润	6.4.7.10	79,011,016.47	6,667,549.37
所有者权益合计		259,717,219.66	29,639,202.08
负债和所有者权益总计		260,271,263.15	30,007,563.89

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.272 元，基金份额总额 204,229,719.43 份。其中 A 类基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 7,763,146.00 份；B 类基金份额净值 1.519 元，基金份额总额 7,763,146.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		20,197,120.27	-3,734,527.73
1.利息收入		55,624.68	5,765.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,611.27	5,739.28
债券利息收入		13.41	25.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,273,099.65	-831,978.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	251,796.83	-1,023,951.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	760.59	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,020,542.23	191,972.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,854,435.88	-2,914,384.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,960.06	6,070.66

减：二、费用		1,453,241.15	412,069.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	792,222.50	107,520.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	174,288.96	23,654.34
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	266,624.02	27,034.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	220,105.67	253,860.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,743,879.12	-4,146,596.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,743,879.12	-4,146,596.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	22,971,652.71	6,667,549.37	29,639,202.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,743,879.12	18,743,879.12
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）	157,734,550.48	53,599,587.98	211,334,138.46
其中：1. 基金申购款	165,892,022.59	56,641,083.18	222,533,105.77
2. 基金赎回款	-8,157,472.11	-3,041,495.20	-11,198,967.31
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）	180,706,203.19	79,011,016.47	259,717,219.66
项目	上年度可比期间 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）	16,932,398.03	8,016,017.88	24,948,415.91
二、本期经营活动产生的	-	-4,146,596.79	-4,146,596.79

基金净值变动数（本期利润）			
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）	231,806.59	76,416.81	308,223.40
其中：1.基金申购款	4,285,439.25	903,407.75	5,188,847.00
2.基金赎回款	-4,053,632.66	-826,990.94	-4,880,623.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	17,164,204.62	3,945,837.90	21,110,042.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，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，场外认购的全部份额确认为华安沪深 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”)212,734,025.99 份，场内认购部分按照基金合同约定的 1:1 比例份额确认为华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“华安沪深 300A 份额”)197,289,916.00 份和华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“华安沪深 300B 份额”)197,289,916.00 份。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》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约

定办理华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间的份额配对转换业务，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算并对折算后的华安沪深 300 份额的场内份额按照 1:1 的比例拆分为预期收益与风险不同的两个份额类别，即低风险且预期收益相对稳定的基金份额(即“华安沪深 300A 份额”)和高风险且预期收益相对较高的基金份额(即“华安沪深 300B 份额”)，两类基金份额的基金资产合并运作。本基金 1 份华安沪深 300A 份额与 1 份华安沪深 300B 份额构成一对份额组合，一对华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的份额组合的份额参考净值之和将等于 2 份华安沪深 300 份额的净值。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 300B 份额的份额参考净值根据华安沪深 300 份额的份额净值、华安沪深 300A 份额的份额参考净值以及华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额净值关系计算。每个会计年度的第一个工作日，在满足一定条件的情况下，本基金的基金管理人将根据基金合同约定，对华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算，华安沪深 300 份额持有人持有的每 2 份华安沪深 300 份额将获得按照 1 份华安沪深 300A 份额分配的新增华安沪深 300 份额；当华安 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元或华安 300B 份额的参考净值小于或等于 0.300 元，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额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、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。具体基金份额折算政策请参见本基金合同的相关章节。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 235 号文审核同意，本基金 394,579,832.00 份基金份额于 2012 年 7 月 23 日在深圳证券交易所挂牌交易(其中华安沪深 300A 份额为 197,289,916.00 份，华安沪深 300B 份额为 197,289,916.00 份)。华安沪深 300 份额开放场内和场外申购、赎回，上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，可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 300A 份额和华安沪深 300B 份额上市交易但不可单独申购、赎回。

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 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《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补充政策的通知》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。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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
活期存款	17,438,810.54
定期存款	-
其他存款	-
合计	17,438,810.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,184,677.48	242,716,671.02	17,531,993.54
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	225,184,677.48	242,716,671.02	17,531,993.54

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

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,174.56
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	26.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.39

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.53
合计	3,220.58

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	28,847.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,847.97

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	378.84
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提上市费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
合计	169,391.77

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,418,112.64	22,971,652.71
本期申购	1,873.14	1,692.79
本期赎回（以“-”号填列）	-52.00	-47.00
-基金拆分/份额折算前	25,419,933.78	22,973,298.50
基金拆分/份额折算调整	551,672.73	—
本期申购	187,477,981.14	165,890,329.80
本期赎回（以“-”号填列）	-9,219,868.22	-8,157,425.11

本期末	204,229,719.43	180,706,203.19
-----	----------------	----------------

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,904,344.54	-15,236,795.17	6,667,549.37
本期利润	889,443.24	17,854,435.88	18,743,879.12
本期基金份额交易产生的变动数	149,589,077.29	-95,989,489.31	53,599,587.98
其中：基金申购款	157,330,811.07	-100,689,727.89	56,641,083.18
基金赎回款	-7,741,733.78	4,700,238.58	-3,041,495.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	172,382,865.07	-93,371,848.60	79,011,016.47

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,677.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,335.49
其他	4,597.84
合计	55,611.27

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	22,838,185.69
减：卖出股票成本总额	22,586,388.86
买卖股票差价收入	251,796.83

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,774.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	36,000.00
减：应收利息总额	13.41
买卖债券差价收入	760.59

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,020,542.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,020,542.23

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	17,854,435.88
——股票投资	17,854,435.88
——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	17,854,435.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	13,960.06
合计	13,960.06

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	266,624.02
银行间市场交易费用	-
合计	266,624.02

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
银行汇划费用	1,092.74
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	220,105.67

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。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	792,222.50	107,520.01
其中：支付销售机构的客户维护费	3,430.99	2,834.18

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	174,288.96	23,654.34

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

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

无。

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

无。

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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国建设银行	17,438,810.54	48,677.94	1,197,633.32	5,542.12

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。

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-

注：无。

6.4.12.2 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
000100	TCL集团	2017-06-02	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	186,902.00	666,928.66	641,073.86	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组事项	24.93	-	-	18,171.00	744,709.77	453,003.03	-
000629	*ST 钒钛	2017-04-20	重大事项	3.07	-	-	10,457.00	35,767.66	32,102.99	-
002129	中环股份	2016-07-06	重大事项	8.27	-	-	3,209.00	43,040.55	26,538.43	-
002252	上海莱士	2017-06-21	重大事项	20.24	-	-	25,360.00	495,695.96	513,286.40	-
00239	海普瑞	2017-06	重大事	20.23	-	-	1,129.00	19,203.78	22,839.67	-

9		-29	项								
300104	乐视网	-	重大资产重组事项	28.61	-	-	30,400.00	1,070,013.00	869,744.00	-	
600050	中国联通	2017-04-03	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	219,441.00	1,659,613.43	1,639,224.27	-	
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组事项	14.12	-	-	45,408.00	643,245.49	641,160.96	-	
600485	信威集团	2017-06-27	重大资产重组事项	14.59	-	-	4,418.00	96,443.60	64,458.62	-	
600666	奥瑞德	2017-05-29	重大资产重组事项	17.40	-	-	18,880.00	335,739.75	328,512.00	-	
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组事项	3.60	-	-	288,132.00	945,105.10	1,037,275.20	-	
600959	江苏有线	2017-06-19	重大资产重组事项	10.57	-	-	37,920.00	414,696.28	400,814.40	-	
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	48,353.00	818,908.32	1,077,788.37	-	
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项	5.54	2017-07-26	5.26	33,100.00	187,337.97	183,374.00	-	
601727	上海电气	2017-06-22	资产重组事项	7.57	2017-07-03	7.54	76,900.00	543,986.91	582,133.00	-	
601872	招商轮船	2017-05-01	重大事项	5.16	-	-	53,700.00	280,647.37	277,092.00	-	
601919	中远海控	2017-05-17	资产重组事项	5.35	2017-07-26	5.89	96,800.00	597,877.09	517,880.00	-	
601989	中国重工	2017-05-29	资产重组事项	6.21	-	-	232,603.00	1,739,948.62	1,444,464.63	-	
603501	韦尔股份	2017-06-05	重大资产重组事项	20.15	-	-	1,657.00	11,632.14	33,388.55	-	

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

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

截至报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

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。

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。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。

于 2017 年 06 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2017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	17,438,810.54	-	-	-	17,438,810.54
结算备付金	64,341.95	-	-	-	64,341.95
存出保证金	48,219.06	-	-	-	48,219.06
交易性金融资产	-	-	-	242,716,671.02	242,716,671.02
应收利息	-	-	-	3,220.58	3,220.58
资产总计	17,551,371.55	-	-	242,719,891.60	260,271,263.15

负债					
应付赎回款	-	-	-	100,522.59	100,522.59
应付管理人报酬	-	-	-	209,246.86	209,246.86
应付托管费	-	-	-	46,034.30	46,034.30
应付交易费用	-	-	-	28,847.97	28,847.97
其他负债	-	-	-	169,391.77	169,391.77
负债总计	-	-	-	554,043.49	554,043.49
利率敏感度缺口	17,551,371.55	-	-	242,165,848.11	259,717,219.66
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	242,716,671.02	93.45	28,104,407.08	94.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	242,716,671.02	93.45	28,104,407.08	94.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,273	增加约 156
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,273	减少约 156

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增

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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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	242,716,671.02	93.26
	其中：股票	242,716,671.02	93.26
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	17,503,152.49	6.72
7	其他各项资产	51,439.64	0.02
8	合计	260,271,263.15	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	557,071.08	0.21
B	采矿业	8,071,572.08	3.11

C	制造业	84,452,482.38	32.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,912,031.76	2.66
E	建筑业	11,305,439.84	4.35
F	批发和零售业	5,187,177.78	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,023,405.99	2.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,608,618.71	4.47
J	金融业	85,529,355.87	32.93
K	房地产业	12,842,292.10	4.94
L	租赁和商务服务业	2,021,872.16	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,100,330.86	0.81
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	2,603,501.79	1.00
S	综合	742,818.56	0.29
	合计	240,957,970.96	92.78

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	32,102.99	0.01
C	制造业	1,147,562.85	0.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.01
F	批发和零售业	189,114.28	0.07
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	7,639.62	0.00
J	金融业	343,502.08	0.13

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	1,758,700.06	0.68

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	601318	中国平安	264,831	13,138,265.91	5.06
2	600036	招商银行	252,203	6,030,173.73	2.32
3	600519	贵州茅台	12,333	5,819,326.05	2.24
4	601166	兴业银行	304,724	5,137,646.64	1.98
5	000651	格力电器	117,652	4,843,732.84	1.87
6	600016	民生银行	578,106	4,752,031.32	1.83
7	000333	美的集团	109,953	4,732,377.12	1.82
8	000002	万科 A	166,395	4,154,883.15	1.60
9	601328	交通银行	671,748	4,137,967.68	1.59
10	601668	中国建筑	366,871	3,551,311.28	1.37
11	600000	浦发银行	274,839	3,476,713.35	1.34
12	601288	农业银行	934,609	3,289,823.68	1.27
13	600030	中信证券	192,531	3,276,877.62	1.26
14	600887	伊利股份	148,221	3,200,091.39	1.23
15	600837	海通证券	197,856	2,938,161.60	1.13
16	601398	工商银行	527,145	2,767,511.25	1.07
17	601169	北京银行	297,435	2,727,478.95	1.05

18	600104	上汽集团	85,693	2,660,767.65	1.02
19	601601	中国太保	76,863	2,603,349.81	1.00
20	000858	五粮液	46,421	2,583,792.86	0.99
21	600900	长江电力	161,335	2,481,332.30	0.96
22	000725	京东方 A	580,984	2,416,893.44	0.93
23	601766	中国中车	238,029	2,408,853.48	0.93
24	601211	国泰君安	111,900	2,295,069.00	0.88
25	002415	海康威视	67,148	2,168,880.40	0.84
26	600276	恒瑞医药	41,269	2,087,798.71	0.80
27	000001	平安银行	209,821	1,970,219.19	0.76
28	601988	中国银行	515,310	1,906,647.00	0.73
29	600048	保利地产	174,000	1,734,780.00	0.67
30	600050	中国联通	219,441	1,639,224.27	0.63
31	601390	中国中铁	182,185	1,579,543.95	0.61
32	601818	光大银行	389,628	1,577,993.40	0.61
33	600518	康美药业	72,498	1,576,106.52	0.61
34	600028	中国石化	256,941	1,523,660.13	0.59
35	600019	宝钢股份	216,017	1,449,474.07	0.56
36	600015	华夏银行	156,780	1,445,511.60	0.56
37	601989	中国重工	232,603	1,444,464.63	0.56
38	601688	华泰证券	79,779	1,428,044.10	0.55
39	000063	中兴通讯	58,169	1,380,932.06	0.53
40	002450	康得新	60,347	1,359,014.44	0.52
41	601186	中国铁建	112,597	1,354,541.91	0.52
42	002304	洋河股份	14,700	1,276,107.00	0.49
43	000776	广发证券	72,395	1,248,813.75	0.48
44	001979	招商蛇口	57,899	1,236,722.64	0.48
45	601006	大秦铁路	145,273	1,218,840.47	0.47
46	000538	云南白药	12,729	1,194,616.65	0.46
47	600690	青岛海尔	74,522	1,121,556.10	0.43
48	600585	海螺水泥	48,816	1,109,587.68	0.43
49	601628	中国人寿	40,730	1,098,895.40	0.42
50	601088	中国神华	48,353	1,077,788.37	0.41
51	600958	东方证券	76,200	1,059,942.00	0.41
52	601336	新华保险	20,335	1,045,219.00	0.40
53	600795	国电电力	288,132	1,037,275.20	0.40
54	002024	苏宁云商	91,026	1,024,042.50	0.39
55	601939	建设银行	164,300	1,010,445.00	0.39
56	601901	方正证券	100,617	999,126.81	0.38
57	601009	南京银行	89,014	997,846.94	0.38
58	600703	三安光电	49,814	981,335.80	0.38
59	600999	招商证券	55,987	964,096.14	0.37
60	600309	万华化学	33,426	957,320.64	0.37
61	600089	特变电工	91,718	947,446.94	0.36

62	002230	科大讯飞	23,741	947,265.90	0.36
63	601899	紫金矿业	270,811	928,881.73	0.36
64	000423	东阿阿胶	12,805	920,551.45	0.35
65	002142	宁波银行	47,655	919,741.50	0.35
66	601857	中国石油	118,714	912,910.66	0.35
67	601985	中国核电	114,200	891,902.00	0.34
68	600660	福耀玻璃	34,209	890,802.36	0.34
69	601669	中国电建	112,078	887,657.76	0.34
70	600009	上海机场	23,566	879,247.46	0.34
71	601377	兴业证券	117,489	872,943.27	0.34
72	300104	乐视网	30,400	869,744.00	0.33
73	000568	泸州老窖	17,169	868,408.02	0.33
74	002241	歌尔股份	44,760	862,972.80	0.33
75	300070	碧水源	45,800	854,170.00	0.33
76	002456	欧菲光	46,577	846,304.09	0.33
77	000166	申万宏源	147,260	824,656.00	0.32
78	601607	上海医药	28,185	813,982.80	0.31
79	300072	三聚环保	21,800	807,690.00	0.31
80	002236	大华股份	35,397	807,405.57	0.31
81	000069	华侨城 A	80,109	805,896.54	0.31
82	002736	国信证券	60,100	796,325.00	0.31
83	002466	天齐锂业	14,500	788,075.00	0.30
84	600886	国投电力	99,646	787,203.40	0.30
85	000338	潍柴动力	59,258	782,205.60	0.30
86	000783	长江证券	81,176	768,736.72	0.30
87	600196	复星医药	24,559	761,083.41	0.29
88	600068	葛洲坝	67,645	760,329.80	0.29
89	600031	三一重工	92,935	755,561.55	0.29
90	300059	东方财富	62,646	753,004.92	0.29
91	600741	华域汽车	30,830	747,319.20	0.29
92	600029	南方航空	85,828	746,703.60	0.29
93	600010	包钢股份	334,270	732,051.30	0.28
94	600340	华夏幸福	21,716	729,223.28	0.28
95	601600	中国铝业	160,677	726,260.04	0.28
96	002008	大族激光	20,928	724,945.92	0.28
97	601888	中国国旅	23,950	721,853.00	0.28
98	600066	宇通客车	32,529	714,662.13	0.28
99	601788	光大证券	47,800	713,654.00	0.27
100	600637	东方明珠	32,120	696,040.40	0.27
101	000625	长安汽车	47,583	686,146.86	0.26
102	000839	中信国安	67,150	670,828.50	0.26
103	601099	太平洋	166,415	668,988.30	0.26
104	002594	比亚迪	13,273	662,986.35	0.26
105	601933	永辉超市	93,612	662,772.96	0.26

106	600535	天士力	15,895	660,278.30	0.25
107	601618	中国中冶	130,971	656,164.71	0.25
108	600100	同方股份	45,408	641,160.96	0.25
109	000100	TCL 集团	186,902	641,073.86	0.25
110	600383	金地集团	55,003	630,884.41	0.24
111	000768	中航飞机	33,890	624,931.60	0.24
112	600705	中航资本	109,774	620,223.10	0.24
113	002673	西部证券	43,096	612,825.12	0.24
114	002475	立讯精密	20,773	607,402.52	0.23
115	600109	国金证券	51,749	606,498.28	0.23
116	600816	安信信托	44,600	606,114.00	0.23
117	600111	北方稀土	53,309	603,990.97	0.23
118	300124	汇川技术	23,462	599,219.48	0.23
119	601800	中国交建	37,331	593,189.59	0.23
120	002202	金风科技	38,276	592,129.72	0.23
121	000963	华东医药	11,872	590,038.40	0.23
122	002739	万达电影	11,500	586,155.00	0.23
123	601727	上海电气	76,900	582,133.00	0.22
124	601555	东吴证券	51,402	577,244.46	0.22
125	000895	双汇发展	24,269	576,388.75	0.22
126	600570	恒生电子	12,067	563,287.56	0.22
127	600271	航天信息	27,086	559,055.04	0.22
128	601018	宁波港	96,822	547,044.30	0.21
129	600023	浙能电力	99,617	543,908.82	0.21
130	600739	辽宁成大	29,853	538,249.59	0.21
131	600153	建发股份	41,621	538,159.53	0.21
132	600177	雅戈尔	52,403	530,318.36	0.20
133	600352	浙江龙盛	55,610	529,963.30	0.20
134	600674	川投能源	53,856	528,865.92	0.20
135	000728	国元证券	43,270	528,759.40	0.20
136	600547	山东黄金	18,105	523,777.65	0.20
137	300024	机器人	26,756	521,742.00	0.20
138	600893	航发动力	19,093	521,238.90	0.20
139	000623	吉林敖东	22,730	520,289.70	0.20
140	601919	中远海控	96,800	517,880.00	0.20
141	600221	海航控股	160,621	517,199.62	0.20
142	002252	上海莱士	25,360	513,286.40	0.20
143	000413	东旭光电	45,746	513,270.12	0.20
144	600018	上港集团	79,326	502,926.84	0.19
145	002065	东华软件	23,034	501,910.86	0.19
146	000793	华闻传媒	49,232	498,227.84	0.19
147	002007	华兰生物	13,631	497,531.50	0.19
148	600804	鹏博士	27,743	492,438.25	0.19
149	600115	东方航空	71,786	488,144.80	0.19

150	000157	中联重科	107,329	481,907.21	0.19
151	603993	洛阳钼业	95,158	481,499.48	0.19
152	600415	小商品城	66,434	480,982.16	0.19
153	000540	中天金融	68,800	478,160.00	0.18
154	601111	中国国航	48,614	473,986.50	0.18
155	601998	中信银行	75,115	472,473.35	0.18
156	600085	同仁堂	13,397	468,359.12	0.18
157	600820	隧道股份	46,100	465,610.00	0.18
158	600606	绿地控股	59,400	464,508.00	0.18
159	601198	东兴证券	26,900	463,756.00	0.18
160	000503	海虹控股	18,171	453,003.03	0.17
161	002465	海格通信	41,878	449,769.72	0.17
162	000826	启迪桑德	12,536	440,264.32	0.17
163	002310	东方园林	26,200	438,064.00	0.17
164	000630	铜陵有色	154,055	437,516.20	0.17
165	000709	河钢股份	104,072	436,061.68	0.17
166	600157	永泰能源	121,432	433,512.24	0.17
167	002081	金螳螂	38,889	427,001.22	0.16
168	000060	中金岭南	37,960	425,152.00	0.16
169	600663	陆家嘴	17,978	424,999.92	0.16
170	000009	中国宝安	52,384	423,786.56	0.16
171	600489	中金黄金	42,165	422,914.95	0.16
172	600061	国投安信	27,000	419,850.00	0.16
173	000876	新希望	50,960	418,891.20	0.16
174	300017	网宿科技	34,565	417,199.55	0.16
175	601155	新城控股	22,100	409,734.00	0.16
176	600118	中国卫星	14,464	402,677.76	0.16
177	600959	江苏有线	37,920	400,814.40	0.15
178	600332	白云山	13,779	400,142.16	0.15
179	600170	上海建工	104,017	397,344.94	0.15
180	000750	国海证券	72,195	397,072.50	0.15
181	600297	广汇汽车	52,650	396,454.50	0.15
182	601633	长城汽车	29,467	391,616.43	0.15
183	600008	首创股份	58,914	387,654.12	0.15
184	600369	西南证券	68,954	386,831.94	0.15
185	000425	徐工机械	102,647	384,926.25	0.15
186	600150	中国船舶	16,785	383,872.95	0.15
187	600208	新湖中宝	83,904	377,568.00	0.15
188	600718	东软集团	24,252	377,118.60	0.15
189	601333	广深铁路	83,105	375,634.60	0.14
190	000559	万向钱潮	33,738	358,297.56	0.14
191	600688	上海石化	53,475	353,469.75	0.14
192	000686	东北证券	34,310	344,815.50	0.13
193	601225	陕西煤业	48,712	344,393.84	0.13

194	000402	金融街	29,233	342,610.76	0.13
195	600362	江西铜业	20,188	340,369.68	0.13
196	000983	西山煤电	38,516	337,785.32	0.13
197	002074	国轩高科	10,700	337,585.00	0.13
198	600583	海油工程	53,954	336,672.96	0.13
199	300027	华谊兄弟	40,782	329,926.38	0.13
200	300033	同花顺	5,300	329,713.00	0.13
201	600498	烽火通信	12,800	324,480.00	0.12
202	600649	城投控股	30,836	324,086.36	0.12
203	600895	张江高科	18,900	319,032.00	0.12
204	600256	广汇能源	76,656	317,355.84	0.12
205	600827	百联股份	19,526	317,297.50	0.12
206	600373	中文传媒	13,463	316,515.13	0.12
207	002385	大北农	50,061	314,883.69	0.12
208	002146	荣盛发展	31,806	313,925.22	0.12
209	000917	电广传媒	27,767	313,767.10	0.12
210	002183	怡亚通	35,900	309,817.00	0.12
211	600704	物产中大	42,000	306,180.00	0.12
212	600588	用友网络	17,841	305,437.92	0.12
213	600074	保千里	23,800	304,878.00	0.12
214	000415	渤海金控	45,200	304,196.00	0.12
215	601216	君正集团	62,020	303,277.80	0.12
216	300144	宋城演艺	14,200	296,354.00	0.11
217	600060	海信电器	19,317	293,038.89	0.11
218	600376	首开股份	25,200	288,288.00	0.11
219	002470	金正大	38,208	287,706.24	0.11
220	002195	二三四五	40,090	286,643.50	0.11
221	000792	盐湖股份	27,306	285,347.70	0.11
222	601718	际华集团	32,200	283,038.00	0.11
223	601866	中远海发	77,858	280,288.80	0.11
224	601872	招商轮船	53,700	277,092.00	0.11
225	002174	游族网络	8,400	266,784.00	0.10
226	300168	万达信息	18,300	266,265.00	0.10
227	002500	山西证券	27,682	265,193.56	0.10
228	600038	中直股份	5,742	262,811.34	0.10
229	600021	上海电力	21,000	253,890.00	0.10
230	000977	浪潮信息	14,600	252,872.00	0.10
231	000627	天茂集团	31,100	251,288.00	0.10
232	600037	歌华有线	17,000	247,520.00	0.10
233	002152	广电运通	29,550	245,560.50	0.09
234	600737	中粮糖业	25,200	237,888.00	0.09
235	002714	牧原股份	8,500	231,370.00	0.09
236	000671	阳光城	39,200	228,144.00	0.09
237	600549	厦门钨业	10,499	225,623.51	0.09

238	600372	中航电子	12,936	224,698.32	0.09
239	000938	紫光股份	3,600	220,032.00	0.08
240	000738	航发控制	11,200	219,184.00	0.08
241	600685	中船防务	8,000	219,040.00	0.08
242	002292	奥飞娱乐	12,834	216,894.60	0.08
243	600482	中国动力	8,500	214,965.00	0.08
244	600446	金证股份	12,200	214,476.00	0.08
245	601877	正泰电器	10,400	208,936.00	0.08
246	000156	华数传媒	14,002	208,769.82	0.08
247	002027	分众传媒	14,900	205,024.00	0.08
248	601021	春秋航空	5,900	198,417.00	0.08
249	002424	贵州百灵	10,400	196,144.00	0.08
250	300133	华策影视	17,053	190,993.60	0.07
251	601608	中信重工	33,100	183,374.00	0.07
252	002131	利欧股份	54,600	179,634.00	0.07
253	002153	石基信息	7,900	179,567.00	0.07
254	300251	光线传媒	21,558	176,560.02	0.07
255	000718	苏宁环球	29,600	173,456.00	0.07
256	601958	金铂股份	23,543	168,803.31	0.06
257	601118	海南橡胶	28,806	163,618.08	0.06
258	002299	圣农发展	10,900	162,083.00	0.06
259	601611	中国核建	12,800	153,216.00	0.06
260	600871	石化油服	44,100	147,294.00	0.06
261	000008	神州高铁	20,200	147,056.00	0.06
262	600188	兖州煤业	9,340	114,321.60	0.04
263	000555	神州信息	6,700	111,890.00	0.04
264	002797	第一创业	9,500	87,495.00	0.03
265	601127	小康股份	4,300	85,785.00	0.03
266	600406	国电南瑞	4,403	77,712.95	0.03
267	600485	信威集团	4,418	64,458.62	0.02
268	601992	金隅股份	7,558	48,900.26	0.02
269	300315	掌趣科技	5,800	47,328.00	0.02
270	601117	中国化学	5,932	41,464.68	0.02

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

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	600546	山煤国际	4,208	20,156.32	0.01
2	600648	外高桥	9,123	168,957.96	0.07
3	600666	奥瑞德	18,880	328,512.00	0.13
4	601878	浙商证券	9,608	163,432.08	0.06

5	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
6	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.01
7	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
8	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
9	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.02
10	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
11	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
12	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
13	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.01
14	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
15	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.02
16	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
17	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.01
18	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
19	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.04
20	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
21	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
22	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
23	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
24	000629	*ST 钒钛	10,457	32,102.99	0.01
25	000712	锦龙股份	11,000	180,070.00	0.07
26	002129	中环股份	3,209	26,538.43	0.01
27	002399	海普瑞	1,129	22,839.67	0.01
28	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.03
29	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
30	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
31	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
32	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
33	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
34	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
35	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
36	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00

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	601318	中国平安	8,868,112.89	29.92
2	601166	兴业银行	5,009,236.00	16.90
3	600016	民生银行	4,776,174.00	16.11

4	600036	招商银行	4,470,857.62	15.08
5	600519	贵州茅台	4,344,347.26	14.66
6	601328	交通银行	3,880,858.00	13.09
7	000333	美的集团	3,447,914.00	11.63
8	000002	万 科 A	3,379,736.00	11.40
9	600000	浦发银行	3,210,333.84	10.83
10	000651	格力电器	3,187,674.00	10.75
11	601668	中国建筑	3,026,194.00	10.21
12	600030	中信证券	2,956,328.00	9.97
13	600837	海通证券	2,876,236.06	9.70
14	601288	农业银行	2,856,051.00	9.64
15	601169	北京银行	2,728,509.00	9.21
16	600887	伊利股份	2,523,967.60	8.52
17	601398	工商银行	2,323,297.00	7.84
18	601766	中国中车	2,283,128.11	7.70
19	601211	国泰君安	1,989,139.32	6.71
20	600900	长江电力	1,986,891.00	6.70
21	601601	中国太保	1,983,329.00	6.69
22	600104	上汽集团	1,970,705.00	6.65
23	000001	平安银行	1,834,798.00	6.19
24	000858	五 粮 液	1,776,827.00	5.99
25	601988	中国银行	1,762,684.00	5.95
26	000725	京东方 A	1,749,456.00	5.90
27	600276	恒瑞医药	1,673,035.25	5.64
28	600048	保利地产	1,597,226.00	5.39
29	601989	中国重工	1,542,042.00	5.20
30	600050	中国联通	1,536,555.00	5.18
31	601818	光大银行	1,506,448.00	5.08
32	601390	中国中铁	1,501,553.00	5.07
33	600019	宝钢股份	1,393,011.60	4.70
34	600015	华夏银行	1,386,556.00	4.68
35	600028	中国石化	1,342,729.00	4.53
36	601688	华泰证券	1,339,340.59	4.52
37	601186	中国铁建	1,336,701.00	4.51
38	002415	海康威视	1,271,124.00	4.29
39	600518	康美药业	1,192,076.16	4.02
40	002304	洋河股份	1,183,334.70	3.99
41	000776	广发证券	1,181,621.00	3.99
42	600958	东方证券	1,094,745.45	3.69
43	002450	康得新	1,071,721.00	3.62
44	601009	南京银行	987,646.00	3.33
45	600585	海螺水泥	987,601.00	3.33
46	601628	中国人寿	975,674.00	3.29
47	001979	招商蛇口	972,447.00	3.28

48	000538	云南白药	958,432.00	3.23
49	002024	苏宁云商	939,213.00	3.17
50	601006	大秦铁路	938,794.00	3.17
51	000063	中兴通讯	938,099.00	3.17
52	300104	乐视网	912,008.00	3.08
53	601939	建设银行	907,914.00	3.06
54	601857	中国石油	887,839.00	3.00
55	600999	招商证券	881,474.00	2.97
56	601899	紫金矿业	878,762.00	2.96
57	600795	国电电力	875,780.00	2.95
58	000166	申万宏源	872,813.19	2.94
59	002736	国信证券	856,883.00	2.89
60	601377	兴业证券	846,813.07	2.86
61	601336	新华保险	833,416.00	2.81
62	002142	宁波银行	810,086.00	2.73
63	601901	方正证券	791,788.00	2.67
64	600089	特变电工	789,962.48	2.67
65	600690	青岛海尔	787,786.00	2.66
66	300059	东方财富	785,669.00	2.65
67	601099	太平洋	779,122.00	2.63
68	601985	中国核电	775,361.00	2.62
69	000783	长江证券	774,182.00	2.61
70	000768	中航飞机	752,794.00	2.54
71	601088	中国神华	749,678.00	2.53
72	601669	中国电建	748,607.00	2.53
73	000839	中信国安	744,885.00	2.51
74	300072	三聚环保	743,949.00	2.51
75	000423	东阿阿胶	733,898.00	2.48
76	601600	中国铝业	730,833.00	2.47
77	002230	科大讯飞	727,714.00	2.46
78	600703	三安光电	727,250.00	2.45
79	300070	碧水源	721,941.00	2.44
80	601788	光大证券	709,971.98	2.40
81	600068	葛洲坝	708,810.00	2.39
82	600309	万华化学	707,359.00	2.39
83	600886	国投电力	698,017.00	2.36
84	000625	长安汽车	693,276.00	2.34
85	600010	包钢股份	690,452.00	2.33
86	600637	东方明珠	690,225.00	2.33
87	002241	歌尔股份	674,466.00	2.28
88	000503	海虹控股	669,372.00	2.26
89	600660	福耀玻璃	663,528.00	2.24
90	600109	国金证券	658,137.00	2.22
91	600705	中航资本	658,049.00	2.22

92	600031	三一重工	649,775.00	2.19
93	600111	北方稀土	643,269.00	2.17
94	000568	泸州老窖	641,396.00	2.16
95	000338	潍柴动力	635,170.00	2.14
96	600029	南方航空	634,759.00	2.14
97	600009	上海机场	629,625.16	2.12
98	601555	东吴证券	628,167.00	2.12
99	600066	宇通客车	627,399.00	2.12
100	002673	西部证券	626,103.48	2.11
101	002456	欧菲光	623,727.00	2.10
102	600196	复星医药	621,358.38	2.10
103	002594	比亚迪	620,352.00	2.09
104	601800	中国交建	615,762.00	2.08
105	600547	山东黄金	613,124.00	2.07
106	600893	航发动力	612,250.40	2.07
107	601618	XD 中国中	611,848.00	2.06
108	002466	天齐锂业	611,830.00	2.06
109	002739	万达电影	606,568.00	2.05
110	600383	金地集团	602,483.00	2.03
111	000100	TCL 集团	596,909.00	2.01
112	002202	金风科技	594,927.00	2.01

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 (%)
1	601318	中国平安	679,611.00	2.29
2	601166	兴业银行	668,720.00	2.26
3	600867	通化东宝	516,561.39	1.74
4	000778	新兴铸管	400,178.10	1.35
5	002085	万丰奥威	398,447.45	1.34
6	601258	庞大集团	367,508.93	1.24
7	300015	爱尔眼科	340,798.80	1.15
8	600839	四川长虹	333,686.40	1.13
9	000039	中集集团	330,909.56	1.12
10	600036	招商银行	320,415.58	1.08
11	300002	神州泰岳	297,176.64	1.00
12	600519	贵州茅台	294,761.00	0.99
13	600016	民生银行	291,702.00	0.98
14	600252	中恒集团	289,852.84	0.98

15	603885	吉祥航空	289,844.00	0.98
16	600875	东方电气	287,620.00	0.97
17	300058	蓝色光标	272,928.10	0.92
18	600873	梅花生物	268,407.12	0.91
19	601328	交通银行	256,238.00	0.86
20	300182	捷成股份	247,835.69	0.84

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	219,268,073.36
卖出股票的收入（成交）总额	22,838,185.69

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。

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投资

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。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 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。

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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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。

7.12.2 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。

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	48,219.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,220.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,439.64

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

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	600666	奥瑞德	328,512.00	0.13	重大资产重组

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(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	144	53,910.74	6,847,766.00	88.21%	915,380.00	11.79%
华安沪深 300 指 数分级 B	318	24,412.41	2,310,676.00	29.76%	5,452,470.00	70.24%
华安沪深 300 指 数分级	460	410,224.84	185,779,164.83	98.45%	2,924,262.60	1.55%
合计	922	221,507.29	194,937,606.83	95.45%	9,292,112.60	4.55%

8.2 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	5,517,114.00	71.07%
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）	1,320,652.00	17.01%
3	蔡捷	102,682.00	1.32%
4	李元	55,289.00	0.71%
5	解咏梅	54,000.00	0.70%
6	周敬	50,003.00	0.64%
7	罗广斌	42,139.00	0.54%
8	欧阳湘	41,500.00	0.53%
9	程竞蛟	41,099.00	0.53%
10	张凤贤	38,093.00	0.49%

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	29.39%
2	张永祥	591,200.00	7.62%
3	区艳芬	500,000.00	6.44%
4	黄好兰	296,400.00	3.82%
5	洪耀林	222,400.00	2.86%
6	梁万宜	212,800.00	2.74%
7	潘少平	198,970.00	2.56%
8	邓琦	182,400.00	2.35%
9	吴为军	177,200.00	2.28%
10	何凤珍	164,700.00	2.12%

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	2,414.67	0.00%

	合计	2,414.67	0.00%
--	----	----------	-------

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、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指数 分级 B	华安沪深 300 指数 分级
基金合同生效日（2012 年 6 月 25 日）基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	10,948,246.00	10,948,246.00	3,521,620.64
本报告期基金总申购份额	-	-	188,031,527.01
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	9,219,920.22
本报告期基金拆分变动份额	-3,185,100.00	-3,185,100.00	6,370,200.00
本报告期期末基金份额总额	7,763,146.00	7,763,146.00	188,703,427.43

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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	
中信证券	1	146,080,332.94	60.72%	136,044.74	61.14%	-
光大证券	1	62,324,934.28	25.91%	56,796.71	25.52%	-
东北证券	1	11,857,333.95	4.93%	11,042.73	4.96%	-
国泰君安	1	7,128,962.33	2.96%	6,496.66	2.92%	-
招商证券	3	5,908,706.22	2.46%	5,502.69	2.47%	-
天风证券	2	4,036,654.93	1.68%	3,678.70	1.65%	-
申万宏源	2	1,509,234.83	0.63%	1,375.38	0.62%	-
中泰证券	1	912,044.68	0.38%	831.17	0.37%	-
兴业证券	1	808,766.00	0.34%	753.36	0.34%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	36,774.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间 HS300A 份额停复牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-04
2	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金之	《上海证券报》、《证券时	2017-01-04

	华安沪深 300A 份额 2017 年度约定年基准收益率的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
3	关于华安沪深 300A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05
4	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05
5	关于旗下部分基金增加济安财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-11
6	关于旗下部分基金增加泰诚财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-18
7	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-08
8	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-13
9	华安基金管理有限公司关于华安华安双债添利债券型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“掌趣科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-04
11	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-15
12	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
13	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-28
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“山东黄金”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-22
15	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
16	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25

17	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
19	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
25	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-10
26	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-17
27	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
28	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万达信息”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-15
29	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27

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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	-	185,340,353.83	-	185,340,353.83	90.75%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 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；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日