

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)
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	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误! 未定义书签。
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误! 未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
6 半年度财务会计报告 (未经审计)	12
6.1 资产负债表	错误! 未定义书签。
6.2 利润表	错误! 未定义书签。
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	错误! 未定义书签。
6.4 报表附注	错误! 未定义书签。
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	错误! 未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
7.4 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	错误! 未定义书签。
7.5 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	错误! 未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动	错误! 未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误! 未定义书签。
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债券投资明细	错误! 未定义书签。
7.9 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	错误! 未定义书签。
7.10 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	错误! 未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误! 未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误! 未定义书签。
7.13 投资组合报告附注	错误! 未定义书签。
8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误! 未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误! 未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误! 未定义书签。
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	47
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误! 未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误! 未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误! 未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误! 未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	52
12 备查文件目录	错误! 未定义书签。
12.1 备查文件目录	错误! 未定义书签。
12.2 存放地点	错误! 未定义书签。
12.3 查阅方式	错误! 未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
基金简称	华安深证 300 指数（LOF）
场内简称	华安 S300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,423,316.34 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	2011 年 10 月 18 日

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。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

邮政编码	200120	100818
法定代表人	朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-275,606.79
本期利润	1,540,272.66
加权平均基金份额本期利润	0.0694
本期加权平均净值利润率	5.72%
本期基金份额净值增长率	5.69%
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	5,888,074.91
期末可供分配基金份额利润	0.2626
期末基金资产净值	28,311,391.25
期末基金份额净值	1.263
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	26.30%

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	7.03%	0.77%	7.00%	0.77%	0.03%	0.00%
过去三个月	2.60%	0.81%	2.72%	0.81%	-0.12%	0.00%
过去六个月	5.69%	0.77%	6.26%	0.77%	-0.57%	0.00%

过去一年	3.44%	0.83%	3.87%	0.83%	-0.43%	0.00%
过去三年	49.29%	1.90%	52.49%	1.82%	-3.20%	0.08%
自基金合同生效起至今	26.30%	1.64%	21.09%	1.60%	5.21%	0.04%

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

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

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

（2011 年 9 月 2 日至 2017 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。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 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理, 指数与量化投资事业总部高级总监	2011-09-02	-	13 年	理学博士, 13 年证券、基金从业经验, CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作, 2005 年加入华安基金管理有限公司, 曾任研究发展部数量策略分析师, 2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理, 2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、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。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

孙晨进	本基金的基金经理	2015-03-20	-	6 年	硕士研究生, 6 年基金行业从业经验, 具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金, 先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月起担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2015 年 3 月至 2015 年 12 月, 同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起, 同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起, 同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型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 年以来宏观经济增速总体仍处于 L 型区域的底部, 但是未来经济二次探底的可能性已经很低, 可能促使经济继续下行的力量来自去库存、房地产调控、金融去杠杆、财政整顿等, 但同时,

出口的复苏和制造业投资恢复等因素,也逐渐让投资者看到了经济企稳反弹的迹象。

上半年 A 股市场结构分化明显,从全市场范围看,以消费、金融为代表的少数股票走势较好,而以中小板、创业板为代表的成长股、小盘股经历了大面积趋势性下跌,直至 6 月初才触底反弹。主要原因有投资者对市场缺乏信心,抱团持仓流动性较好、现金流较稳定的大蓝筹、消费股等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.263 元,本报告期份额净值增长率为 5.69%,同期业绩比较基准增长率为 6.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年,预计全球经济复苏的态势将会延续,中国出口好转也是大概率事件,从而支撑经济增长。从供给来看,有助于增加国内资本存量,同时提高全要素生产率,重构中长期经济增长路径。从国内货币政策来看,维持紧平衡,逐步边际放松的概率较大,但政策的选择仍受限于国内经济增长和金融风险的权衡。同时,金融监管对实体经济的影响将逐渐体现出来。在名义增速下行,流动性边际上宽松的背景下,无风险利率可能存有余下行空间。在目前的经济环境下,管理人对下半年 A 股市场的走势较有信心。

作为深证 300LOF 基金的管理人,我们将勤勉尽责,继续坚持用复制指数的方法,紧跟基准指数,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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	1,583,304.84	1,768,143.34
结算备付金		4,155.26	-
存出保证金		272.61	1,544.74
交易性金融资产	6.4.7.2	26,842,079.93	25,170,108.71
其中: 股票投资		26,838,827.13	25,166,477.99
基金投资		-	-
债券投资		3,252.80	3,630.72
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		103,760.11	-
应收利息	6.4.7.5	282.07	359.73
应收股利		-	-
应收申购款		901.96	1,628.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,534,756.78	26,941,784.91
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		-	51,954.27
应付赎回款		36,062.17	2.49
应付管理人报酬		11,294.04	11,621.05
应付托管费		2,258.80	2,324.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,601.67	5,644.92
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	169,148.85	286,000.02
负债合计		223,365.53	357,546.97
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	22,423,316.34	22,240,279.75
未分配利润	6.4.7.10	5,888,074.91	4,343,958.19

所有者权益合计		28,311,391.25	26,584,237.94
负债和所有者权益总计		28,534,756.78	26,941,784.91

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.263 元，基金份额总额 22,423,316.34 份。

6.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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		1,857,857.00	-5,682,046.14
1.利息收入		5,841.75	6,861.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,835.08	6,851.00
债券利息收入		6.67	10.55
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）		35,165.91	187,848.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-141,655.25	11,106.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1,332.01
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	176,821.16	175,409.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,815,879.45	-5,880,115.74
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	969.89	3,360.03
减：二、费用		317,584.34	360,805.39
1. 管理人报酬		66,612.80	71,519.73
2. 托管费		13,322.49	14,303.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	8,771.12	17,636.03
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	228,877.93	257,345.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,540,272.66	-6,042,851.53
减：所得税费用		-	-

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		1,540,272.66	-6,042,851.53
--------------------	--	--------------	---------------

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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)	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	1,540,272.66	1,540,272.66
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)	183,036.59	3,844.06	186,880.65
其中: 1.基金申购款	1,805,832.50	360,868.56	2,166,701.06
2.基金赎回款	-1,622,795.91	-357,024.50	-1,979,820.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	22,423,316.34	5,888,074.91	28,311,391.25
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)	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-6,042,851.53	-6,042,851.53
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)	20,753.40	56,391.38	77,144.78
其中: 1.基金申购款	3,308,945.63	682,298.11	3,991,243.74
2.基金赎回款	-3,288,192.23	-625,906.73	-3,914,098.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基	24,100,873.81	5,326,522.93	29,427,396.74

金净值)			
------	--	--	--

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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(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[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 607,830,415.01 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(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 210,139.69 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意，本基金 146,584,08.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。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，在封闭期满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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的本基金投资范围主要为标的指数深证 300 价格指数成份股及其备选成份股，少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发等)、债券、现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%；其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：95%×深证 300 价格指数收益率 + 5%×商业银行税后活期存款基准利。

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》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 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	1,583,304.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,583,304.84

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	26,335,829.81	26,838,827.13	502,997.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,200.00	3,252.80
	银行间市场	-	-
	合计	3,200.00	3,252.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,339,029.81	26,842,079.93	503,050.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	278.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.71
应收债券利息	1.13
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.18
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.09
合计	282.07

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	4,601.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,601.67

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	135.92
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
预提上市年费	29,752.78
预提指数使用费	50,000.00
合计	169,148.85

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	22,240,279.75	22,240,279.75
本期申购	1,805,832.50	1,805,832.50
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,622,795.91	-1,622,795.91
本期末	22,423,316.34	22,423,316.34

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	12,604,169.69	-8,260,211.50	4,343,958.19
本期利润	-275,606.79	1,815,879.45	1,540,272.66
本期基金份额交易产生的	101,707.57	-97,863.51	3,844.06

变动数			
其中：基金申购款	1,015,887.80	-655,019.24	360,868.56
基金赎回款	-914,180.23	557,155.73	-357,024.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,430,270.47	-6,542,195.56	5,888,074.91

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	5,782.91
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	43.91
其他	8.26
合计	5,835.08

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	3,015,120.13
减：卖出股票成本总额	3,156,775.38
买卖股票差价收入	-141,655.25

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

无。

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	176,821.16

基金投资产生的股利收益	-
合计	176,821.16

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	1,815,879.45
——股票投资	1,816,257.37
——债券投资	-377.92
——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	1,815,879.45

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	969.89
合计	969.89

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	8,771.12
银行间市场交易费用	-
合计	8,771.12

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	865.00
上市年费	29,752.78
帐户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	228,877.93

注：根据《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》及《深证 300 指数使用许可协议书》，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：

$$\text{日指数许可使用费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.02\% / \text{当年天数}。$$

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	66,612.80	71,519.73
其中：支付销售机构的客户维护费	25,211.76	26,436.57

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 0.50% 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 × 0.50% / 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	13,322.49	14,303.95

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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
中国银行股份有限公司	1,583,304.84	5,782.91	1,673,772.97	6,702.10

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行保管，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。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

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
000061	农产品	2017-06-28	重大资产重组事项	9.06	-	-	4,135.00	64,258.36	37,463.10	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	45,428.00	155,911.04	155,818.04	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组事项	24.93	-	-	4,033.00	214,184.15	100,542.69	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项	6.54	2017-07-05	5.92	16,967.00	110,529.80	110,964.18	-
000693	*ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	-	-	1,360.00	29,419.08	17,000.00	-

000887	中鼎股份	2017-04-27	重大事项	22.09	2017-07-17	17.89	2,401.00	34,260.77	53,038.09	-
002010	传化智联	2017-06-30	重大事项	15.26	2017-07-04	16.77	1,700.00	30,804.00	25,942.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	4,818.00	55,976.23	49,769.94	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组事项	30.82	2017-07-17	27.74	2,136.00	95,756.88	65,831.52	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组事项	16.12	-	-	4,700.00	70,137.00	75,764.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	9,237.00	162,065.38	76,389.99	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组事项	16.99	-	-	4,501.00	60,006.46	76,471.99	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	5,110.00	119,462.59	103,426.40	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	-	-	1,977.00	38,967.25	39,994.71	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	-	-	10,000.00	95,177.21	76,800.00	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	10,500.00	34,230.00	25,620.00	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	1,650.00	86,559.64	41,349.00	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大资产重组事项	12.59	2017-07-03	12.70	1,930.00	39,038.37	24,298.70	-
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项	18.50	2017-07-07	18.88	1,590.00	72,368.65	29,415.00	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项	14.97	2017-08-09	14.50	6,082.00	61,697.39	91,047.54	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组事项	28.61	-	-	6,245.00	334,685.60	178,669.45	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组事项	23.36	-	-	2,171.00	59,494.32	50,714.56	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46	-	-	3,800.00	63,872.21	43,548.00	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02	-	-	2,100.00	74,222.08	42,042.00	-

			事项							
300367	东方网力	2016-12-15	重大事项	20.00	2017-07-03	18.01	2,600.00	64,768.00	52,000.00	-

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

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪深证 300 指数，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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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。本基金完全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。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

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、监察稽核部和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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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约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、存出保证金和债券投资等。

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	1,583,304.84	-	-	-	1,583,304.84
结算备付金	4,155.26	-	-	-	4,155.26
存出保证金	272.61	-	-	-	272.61
交易性金融资产	3,252.80	-	-	26,838,827.13	26,842,079.93
应收利息	-	-	-	282.07	282.07
应收申购款	-	-	-	901.96	901.96
应收证券清算款	-	-	-	103,760.11	103,760.11
资产总计	1,590,985.51	-	-	26,943,771.27	28,534,756.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,062.17	36,062.17
应付管理人报酬	-	-	-	11,294.04	11,294.04
应付托管费	-	-	-	2,258.80	2,258.80
应付交易费用	-	-	-	4,601.67	4,601.67
其他负债	-	-	-	169,148.85	169,148.85
负债总计	-	-	-	223,365.53	223,365.53
利率敏感度缺口	1,590,985.51	-	-	26,720,405.74	28,311,391.25
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	1,768,143.34	-	-	-	1,768,143.34
存出保证金	1,544.74	-	-	-	1,544.74
交易性金融资产	-	-	3,630.72	25,166,477.99	25,170,108.71
应收利息	-	-	-	359.73	359.73
应收申购款	-	-	-	1,628.39	1,628.39
资产总计	1,769,688.08	-	3,630.72	25,168,466.11	26,941,784.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2.49	2.49
应付管理人报酬	-	-	-	11,621.05	11,621.05
应付托管费	-	-	-	2,324.22	2,324.22
应付交易费用	-	-	-	5,644.92	5,644.92
应付证券清算款	-	-	-	51,954.27	51,954.27
其他负债	-	-	-	286,000.02	286,000.02
负债总计	-	-	-	357,546.97	357,546.97
利率敏感度缺口	1,769,688.08	-	3,630.72	24,810,919.14	26,584,237.94

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。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。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。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。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	上年度末

	2017 年 6 月 30 日		2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	26,838,827.13	94.80	25,166,477.99	94.67
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	26,838,827.13	94.80	25,166,477.99	94.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		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 142	增加约 142
	业绩比较基准下降 5%	减少约 142	减少约 142

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	26,838,827.13	94.06
	其中：股票	26,838,827.13	94.06
2	固定收益投资	3,252.80	0.01
	其中：债券	3,252.80	0.01
	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	1,587,460.10	5.56
7	其他各项资产	105,216.75	0.37
8	合计	28,534,756.78	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	727,869.25	2.57
B	采矿业	244,752.38	0.86

C	制造业	15,525,298.84	54.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	268,141.89	0.95
E	建筑业	411,727.26	1.45
F	批发和零售业	527,587.40	1.86
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	2,557,729.01	9.03
J	金融业	2,062,925.56	7.29
K	房地产业	1,485,677.33	5.25
L	租赁和商务服务业	447,608.70	1.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	488,997.59	1.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	229,436.32	0.81
R	文化、体育和娱乐业	587,547.18	2.08
S	综合	85,252.42	0.30
	合计	25,650,551.13	90.60

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	53,366.00	0.19
C	制造业	903,327.00	3.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	61,088.00	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	37,212.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,440.00	0.33
J	金融业	40,843.00	0.14
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	1,188,276.00	4.20

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	000651	格力电器	25,150	1,035,425.50	3.66
2	000333	美的集团	23,150	996,376.00	3.52
3	000725	京东方 A	133,889	556,978.24	1.97
4	000858	五粮液	9,774	544,020.84	1.92
5	000002	万科 A	21,456	535,756.32	1.89
6	002415	海康威视	16,267	525,424.10	1.86
7	300498	温氏股份	20,051	469,995.44	1.66
8	000001	平安银行	44,480	417,667.20	1.48
9	000063	中兴通讯	12,623	299,670.02	1.06
10	000776	广发证券	16,018	276,310.50	0.98
11	002450	康得新	12,205	274,856.60	0.97
12	002304	洋河股份	3,044	264,249.64	0.93
13	000538	云南白药	2,410	226,178.50	0.80
14	001979	招商蛇口	10,464	223,511.04	0.79
15	002230	科大讯飞	5,294	211,230.60	0.75
16	002024	苏宁云商	18,496	208,080.00	0.73
17	000423	东阿阿胶	2,810	202,010.90	0.71
18	000166	申万宏源	34,717	194,415.20	0.69
19	000568	泸州老窖	3,792	191,799.36	0.68

20	002241	歌尔股份	9,774	188,442.72	0.67
21	002236	大华股份	8,248	188,136.88	0.66
22	002466	天齐锂业	3,399	184,735.65	0.65
23	002456	欧菲光	10,077	183,099.09	0.65
24	002142	宁波银行	9,365	180,744.50	0.64
25	300104	乐视网	6,245	178,669.45	0.63
26	300072	三聚环保	4,801	177,877.05	0.63
27	300059	东方财富	14,529	174,638.58	0.62
28	000069	华侨城 A	17,085	171,875.10	0.61
29	000338	潍柴动力	12,672	167,270.40	0.59
30	000413	东旭光电	14,892	167,088.24	0.59
31	000783	长江证券	17,354	164,342.38	0.58
32	000625	长安汽车	11,337	163,479.54	0.58
33	002008	大族激光	4,558	157,889.12	0.56
34	300136	信维通信	3,900	156,078.00	0.55
35	000100	TCL 集团	45,428	155,818.04	0.55
36	002594	比亚迪	3,036	151,648.20	0.54
37	300070	碧水源	8,077	150,636.05	0.53
38	002673	西部证券	10,175	144,688.50	0.51
39	300124	汇川技术	5,616	143,432.64	0.51
40	000839	中信国安	14,255	142,407.45	0.50
41	002475	立讯精密	4,755	139,036.20	0.49
42	002202	金风科技	8,822	136,476.34	0.48
43	000768	中航飞机	7,079	130,536.76	0.46
44	300024	机器人	6,636	129,402.00	0.46
45	002736	国信证券	9,716	128,737.00	0.45
46	002027	分众传媒	9,300	127,968.00	0.45
47	002460	赣锋锂业	2,748	127,095.00	0.45
48	000728	国元证券	10,297	125,829.34	0.44
49	000895	双汇发展	5,213	123,808.75	0.44
50	300408	三环集团	5,800	121,742.00	0.43
51	002739	万达电影	2,382	121,410.54	0.43
52	000963	华东医药	2,400	119,280.00	0.42
53	000157	中联重科	25,168	113,004.32	0.40
54	002007	华兰生物	3,060	111,690.00	0.39
55	300003	乐普医疗	5,040	111,434.40	0.39
56	000656	金科股份	16,967	110,964.18	0.39
57	002508	老板电器	2,540	110,439.20	0.39
58	002572	索菲亚	2,693	110,413.00	0.39
59	000623	吉林敖东	4,681	107,148.09	0.38
60	002044	美年健康	6,300	107,100.00	0.38
61	000540	中天金融	15,373	106,842.35	0.38
62	002085	万丰奥威	5,459	106,177.55	0.38
63	000793	华闻传媒	10,359	104,833.08	0.37

64	000709	河钢股份	24,786	103,853.34	0.37
65	002252	上海莱士	5,110	103,426.40	0.37
66	002797	第一创业	11,120	102,415.20	0.36
67	300156	神雾环保	3,100	101,556.00	0.36
68	002065	东华软件	4,648	101,279.92	0.36
69	300017	网宿科技	8,348	100,760.36	0.36
70	000503	海虹控股	4,033	100,542.69	0.36
71	000826	启迪桑德	2,851	100,127.12	0.35
72	002310	东方园林	5,949	99,467.28	0.35
73	000630	铜陵有色	34,980	99,343.20	0.35
74	000060	中金岭南	8,712	97,574.40	0.34
75	000050	深天马 A	4,734	97,378.38	0.34
76	000661	长春高新	746	96,316.06	0.34
77	002340	格林美	15,813	95,668.65	0.34
78	300315	掌趣科技	11,592	94,590.72	0.33
79	002465	海格通信	8,738	93,846.12	0.33
80	000876	新希望	11,344	93,247.68	0.33
81	002146	荣盛发展	9,361	92,393.07	0.33
82	000066	中国长城	10,192	91,829.92	0.32
83	002405	四维图新	4,624	91,370.24	0.32
84	000425	徐工机械	24,302	91,132.50	0.32
85	300088	长信科技	6,082	91,047.54	0.32
86	000009	中国宝安	10,538	85,252.42	0.30
87	000997	新大陆	3,755	85,200.95	0.30
88	300115	长盈精密	2,867	83,659.06	0.30
89	000581	威孚高科	3,214	83,242.60	0.29
90	000750	国海证券	15,076	82,918.00	0.29
91	002081	金螳螂	7,505	82,404.90	0.29
92	002074	国轩高科	2,600	82,030.00	0.29
93	000686	东北证券	8,152	81,927.60	0.29
94	000998	隆平高科	3,701	81,496.02	0.29
95	000039	中集集团	4,502	81,171.06	0.29
96	000778	新兴铸管	12,062	80,815.40	0.29
97	000559	万向钱潮	7,515	79,809.30	0.28
98	300296	利亚德	4,200	78,960.00	0.28
99	002280	联络互动	7,250	78,880.00	0.28
100	000402	金融街	6,664	78,102.08	0.28
101	002426	胜利精密	10,000	76,800.00	0.27
102	002168	深圳惠程	4,501	76,471.99	0.27
103	002129	中环股份	9,237	76,389.99	0.27
104	000983	西山煤电	8,692	76,228.84	0.27
105	002075	沙钢股份	4,700	75,764.00	0.27
106	000786	北新建材	4,774	75,620.16	0.27
107	002092	中泰化学	5,931	75,323.70	0.27

108	300433	蓝思科技	2,560	74,470.40	0.26
109	002385	大北农	11,810	74,284.90	0.26
110	000970	中科三环	4,982	73,633.96	0.26
111	000917	电广传媒	6,431	72,670.30	0.26
112	300144	宋城演艺	3,458	72,168.46	0.25
113	300027	华谊兄弟	8,878	71,823.02	0.25
114	002038	双鹭药业	2,403	70,047.45	0.25
115	002183	怡亚通	8,084	69,764.92	0.25
116	000999	华润三九	2,191	69,564.25	0.25
117	002179	中航光电	2,210	68,929.90	0.24
118	002311	海大集团	3,733	68,201.91	0.24
119	002407	多氟多	3,100	68,169.00	0.24
120	002500	山西证券	7,104	68,056.32	0.24
121	002185	华天科技	9,338	67,607.12	0.24
122	002294	信立泰	1,885	67,219.10	0.24
123	000415	渤海金控	9,900	66,627.00	0.24
124	002573	清新环境	3,526	66,359.32	0.23
125	300015	爱尔眼科	2,852	66,337.52	0.23
126	002410	广联达	3,502	65,837.60	0.23
127	002049	紫光国芯	2,136	65,831.52	0.23
128	000400	许继电气	3,620	65,015.20	0.23
129	300033	同花顺	1,044	64,947.24	0.23
130	000028	国药一致	796	64,396.40	0.23
131	002422	科伦药业	3,838	63,403.76	0.22
132	000961	中南建设	9,664	63,009.28	0.22
133	002030	达安基因	2,883	62,820.57	0.22
134	000566	海南海药	4,694	62,242.44	0.22
135	002223	鱼跃医疗	2,622	62,088.96	0.22
136	002195	二三四五	8,670	61,990.50	0.22
137	000878	云南铜业	4,681	61,742.39	0.22
138	002470	金正大	8,112	61,083.36	0.22
139	000960	锡业股份	4,463	60,741.43	0.21
140	300055	万邦达	3,300	60,720.00	0.21
141	002400	省广股份	7,423	59,606.69	0.21
142	300058	蓝色光标	7,604	59,463.28	0.21
143	002273	水晶光电	2,868	59,166.84	0.21
144	000977	浪潮信息	3,400	58,888.00	0.21
145	300168	万达信息	4,043	58,825.65	0.21
146	000598	兴蓉环境	10,467	58,824.54	0.21
147	300383	光环新网	4,300	58,308.00	0.21
148	002051	中工国际	2,782	57,670.86	0.20
149	300418	昆仑万维	2,500	57,175.00	0.20
150	002138	顺络电子	3,068	57,003.44	0.20
151	300146	汤臣倍健	4,138	56,856.12	0.20

152	000046	泛海控股	6,475	56,526.75	0.20
153	000547	航天发展	5,400	56,430.00	0.20
154	000883	湖北能源	11,210	56,274.20	0.20
155	300244	迪安诊断	1,780	55,998.80	0.20
156	002439	启明星辰	3,000	55,800.00	0.20
157	000671	阳光城	9,550	55,581.00	0.20
158	002001	新和成	2,848	55,279.68	0.20
159	000792	盐湖股份	5,251	54,872.95	0.19
160	000825	太钢不锈	12,612	54,862.20	0.19
161	000988	华工科技	3,717	54,231.03	0.19
162	002004	华邦健康	6,900	54,027.00	0.19
163	000930	中粮生化	5,000	53,900.00	0.19
164	002108	沧州明珠	4,010	53,533.50	0.19
165	000887	中鼎股份	2,401	53,038.09	0.19
166	002019	亿帆医药	3,134	52,275.12	0.18
167	300367	东方网力	2,600	52,000.00	0.18
168	002491	通鼎互联	3,852	51,770.88	0.18
169	002714	牧原股份	1,900	51,718.00	0.18
170	000078	海王生物	8,505	51,285.15	0.18
171	000697	炼石有色	2,500	51,175.00	0.18
172	002555	三七互娱	2,000	51,140.00	0.18
173	000627	天茂集团	6,300	50,904.00	0.18
174	300134	大富科技	2,171	50,714.56	0.18
175	000738	航发控制	2,548	49,864.36	0.18
176	000758	中色股份	7,102	49,785.02	0.18
177	002013	中航机电	4,818	49,769.94	0.18
178	002152	广电运通	5,925	49,236.75	0.17
179	002343	慈文传媒	1,300	49,218.00	0.17
180	300002	神州泰岳	5,891	49,130.94	0.17
181	000938	紫光股份	800	48,896.00	0.17
182	000732	泰禾集团	2,930	48,872.40	0.17
183	002176	江特电机	5,600	48,832.00	0.17
184	000729	燕京啤酒	7,256	48,760.32	0.17
185	000979	中弘股份	18,510	48,496.20	0.17
186	002431	棕榈股份	4,397	48,454.94	0.17
187	002292	奥飞娱乐	2,866	48,435.40	0.17
188	002131	利欧股份	14,700	48,363.00	0.17
189	000800	一汽轿车	4,700	47,799.00	0.17
190	000516	国际医学	8,565	47,707.05	0.17
191	002250	联化科技	3,324	47,533.20	0.17
192	300253	卫宁健康	6,086	47,531.66	0.17
193	000006	深振业 A	5,390	47,485.90	0.17
194	002424	贵州百灵	2,515	47,432.90	0.17
195	300014	亿纬锂能	2,594	47,081.10	0.17

196	002701	奥瑞金	7,321	46,781.19	0.17
197	002501	利源精制	4,100	46,617.00	0.16
198	000008	神州高铁	6,400	46,592.00	0.16
199	002191	劲嘉股份	4,973	46,547.28	0.16
200	002665	首航节能	6,410	46,152.00	0.16
201	000592	平潭发展	8,348	46,080.96	0.16
202	000806	银河生物	3,400	45,900.00	0.16
203	002353	杰瑞股份	2,879	45,545.78	0.16
204	000031	中粮地产	6,030	45,405.90	0.16
205	300166	东方国信	3,360	45,124.80	0.16
206	300077	国民技术	3,287	44,999.03	0.16
207	000012	南玻 A	4,805	44,830.65	0.16
208	002624	完美世界	1,300	44,590.00	0.16
209	000898	鞍钢股份	7,830	44,317.80	0.16
210	000712	锦龙股份	2,686	43,969.82	0.16
211	300182	捷成股份	4,599	43,966.44	0.16
212	000027	深圳能源	6,500	43,745.00	0.15
213	000690	宝新能源	7,298	43,642.04	0.15
214	300267	尔康制药	3,800	43,548.00	0.15
215	002153	石基信息	1,903	43,255.19	0.15
216	300251	光线传媒	5,278	43,226.82	0.15
217	300133	华策影视	3,846	43,075.20	0.15
218	002002	鸿达兴业	5,420	42,438.60	0.15
219	002477	雏鹰农牧	9,504	42,102.72	0.15
220	002444	巨星科技	2,700	42,066.00	0.15
221	300291	华录百纳	2,100	42,042.00	0.15
222	300026	红日药业	8,875	41,801.25	0.15
223	002642	荣之联	1,650	41,349.00	0.15
224	300068	南都电源	2,400	40,416.00	0.14
225	300001	特锐德	2,400	40,224.00	0.14
226	002399	海普瑞	1,977	39,994.71	0.14
227	300199	翰宇药业	2,600	39,884.00	0.14
228	000156	华数传媒	2,666	39,750.06	0.14
229	000685	中山公用	3,588	39,288.60	0.14
230	002522	浙江众成	2,400	39,240.00	0.14
231	002390	信邦制药	4,500	39,195.00	0.14
232	300207	欣旺达	3,300	38,907.00	0.14
233	000687	华讯方舟	2,500	37,850.00	0.13
234	002268	卫士通	2,240	37,676.80	0.13
235	002018	华信国际	5,500	37,675.00	0.13
236	002643	万润股份	2,550	37,638.00	0.13
237	000061	农产品	4,135	37,463.10	0.13
238	300020	银江股份	2,700	37,368.00	0.13
239	000829	天音控股	3,411	36,838.80	0.13

240	002299	圣农发展	2,453	36,476.11	0.13
241	002489	浙江永强	5,716	36,468.08	0.13
242	002368	太极股份	1,317	36,467.73	0.13
243	000937	冀中能源	5,946	36,389.52	0.13
244	000718	苏宁环球	6,099	35,740.14	0.13
245	300273	和佳股份	2,910	35,385.60	0.12
246	000901	航天科技	1,299	35,280.84	0.12
247	300431	暴风集团	1,440	34,315.20	0.12
248	002276	万马股份	3,300	33,297.00	0.12
249	002326	永太科技	2,400	33,264.00	0.12
250	002709	天赐材料	800	32,936.00	0.12
251	002716	金贵银业	1,700	32,623.00	0.12
252	300073	当升科技	1,300	32,422.00	0.11
253	002437	誉衡药业	4,400	32,032.00	0.11
254	000762	西藏矿业	2,200	31,174.00	0.11
255	300496	中科创达	1,100	31,130.00	0.11
256	300010	立思辰	2,400	31,080.00	0.11
257	300085	银之杰	1,590	29,415.00	0.10
258	002657	中科金财	1,000	28,990.00	0.10
259	000062	深圳华强	1,007	26,715.71	0.09
260	000539	粤电力 A	4,947	26,367.51	0.09
261	002329	皇氏集团	2,700	25,947.00	0.09
262	002010	传化智联	1,700	25,942.00	0.09
263	002610	爱康科技	10,500	25,620.00	0.09
264	002563	森马服饰	3,000	25,440.00	0.09
265	300292	吴通控股	3,700	25,049.00	0.09
266	000957	中通客车	2,100	24,570.00	0.09
267	002681	奋达科技	1,930	24,298.70	0.09
268	000555	神州信息	1,300	21,710.00	0.08
269	002631	德尔未来	1,300	19,149.00	0.07
270	300474	景嘉微	400	14,160.00	0.05

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	002271	东方雨虹	2,700	100,170.00	0.35
2	002558	巨人网络	2,000	92,440.00	0.33
3	300159	新研股份	4,700	62,228.00	0.22
4	300197	铁汉生态	4,600	61,088.00	0.22
5	002366	台海核电	1,300	60,983.00	0.22
6	000488	晨鸣纸业	4,700	60,630.00	0.21

7	002217	合力泰	5,900	58,292.00	0.21
8	002583	海能达	3,400	54,706.00	0.19
9	000059	华锦股份	4,800	48,048.00	0.17
10	002408	齐翔腾达	4,200	46,536.00	0.16
11	002601	龙蟠佰利	2,700	44,226.00	0.16
12	300090	盛运环保	4,400	41,668.00	0.15
13	000563	陕国投 A	7,900	40,843.00	0.14
14	000807	云铝股份	5,600	40,432.00	0.14
15	002389	南洋科技	1,900	40,014.00	0.14
16	002506	协鑫集成	8,600	39,474.00	0.14
17	002493	荣盛石化	4,000	39,040.00	0.14
18	002411	必康股份	1,300	37,596.00	0.13
19	002352	顺丰控股	700	37,212.00	0.13
20	002155	湖南黄金	3,800	36,366.00	0.13
21	002602	世纪华通	1,000	36,260.00	0.13
22	002468	申通快递	1,400	35,574.00	0.13
23	000519	中兵红箭	2,400	30,240.00	0.11
24	300376	易事特	3,000	27,210.00	0.10
25	000693	*ST 华泽	1,360	17,000.00	0.06

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	300498	温氏股份	196,341.00	0.74
2	002271	东方雨虹	98,860.00	0.37
3	002558	巨人网络	92,206.00	0.35
4	002797	第一创业	84,748.00	0.32
5	300159	新研股份	61,710.00	0.23
6	002027	分众传媒	61,447.00	0.23
7	002366	台海核电	61,113.00	0.23
8	000488	晨鸣纸业	60,802.00	0.23
9	300197	铁汉生态	60,196.00	0.23
10	002217	合力泰	57,833.00	0.22
11	000725	京东方 A	54,261.00	0.20
12	000961	中南建设	53,429.00	0.20
13	002583	海能达	53,213.00	0.20
14	000333	美的集团	51,678.00	0.19
15	002415	海康威视	51,300.00	0.19
16	000858	五粮液	48,553.00	0.18

17	000059	华锦股份	48,304.00	0.18
18	002408	齐翔腾达	46,940.00	0.18
19	001979	招商蛇口	45,059.00	0.17
20	000050	深天马 A	44,788.00	0.17

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	000333	美的集团	104,418.84	0.39
2	000651	格力电器	87,884.58	0.33
3	000725	京东方 A	77,905.36	0.29
4	000858	五粮液	71,789.52	0.27
5	000001	平安银行	68,840.21	0.26
6	002024	苏宁云商	59,983.07	0.23
7	001979	招商蛇口	55,365.14	0.21
8	002415	海康威视	53,731.58	0.20
9	000783	长江证券	52,655.82	0.20
10	000002	万科 A	50,775.50	0.19
11	000776	广发证券	48,107.71	0.18
12	000063	中兴通讯	44,923.50	0.17
13	300274	阳光电源	44,366.43	0.17
14	002440	闰土股份	44,107.10	0.17
15	300079	数码视讯	41,945.10	0.16
16	000158	常山股份	41,244.00	0.16
17	002266	浙富控股	41,216.44	0.16
18	002022	科华生物	40,991.60	0.15
19	002460	赣锋锂业	40,343.72	0.15
20	000667	美好置业	39,256.00	0.15

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,927,382.36
卖出股票的收入（成交）总额	3,015,120.13

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,252.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,252.80	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	32	3,252.80	0.01

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

无。

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 2016 年 11 月 26 日, 广发证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]128 号), 被中国证监会处以责令改正, 给予警告, 没收违法所得 6,805,135.75 元, 并处以 20,415,407.25 元罚款的处罚, 原因为公司存在未能按规定审查、了解客户身份等违法违规行为。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。

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	272.61
2	应收证券清算款	103,760.11
3	应收股利	-
4	应收利息	282.07
5	应收申购款	901.96
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,216.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	3,252.80	0.01

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中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
1,160	19,330.45	0.00	0.00%	22,423,316.34	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	叶竞	1,993,321.92	8.89%
2	望月英里	1,988,251.57	8.87%
3	林志英	675,268.09	3.01%
4	朱若增	495,387.00	2.21%
5	李少芳	495,207.00	2.21%
6	袁宁	495,094.50	2.21%
7	蒋冰	495,094.50	2.21%
8	冯小莉	450,806.19	2.01%
9	金淑惠	396,093.60	1.77%
10	卢奕	342,421.46	1.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	297.00	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、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 9 月 2 日) 基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	22,240,279.75
本报告期基金总申购份额	1,805,832.50
减：本报告期基金总赎回份额	1,622,795.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,423,316.34

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	
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	4,587,040.06	78.52%	4,180.18	78.52%	-
长江证券	1	1,254,561.36	21.48%	1,143.25	21.48%	-

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	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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
2	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
3	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
4	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
5	华安基金关于参加平安银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
6	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
7	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
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南都电源”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	2017-03-21
9	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
10	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-22
11	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
12	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

		司网站	
13	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
14	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
15	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
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	2017-04-28
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“炼石有色”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	2017-04-28
18	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
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	2017-05-03
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	2017-05-04
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	2017-05-06
22	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
23	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
24	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
25	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“天夏智慧”、“长信科技”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	2017-06-10
26	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
27	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费	《上海证券报》、《证券时	2017-06-27

	率优惠活动时间公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
--	-----------	-----------------	--

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

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 2、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 3、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中国证监会批准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)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

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

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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日