

华安沪深 300 量化增强证券投资基金

2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
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合规守信情况的说明	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说明	11
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
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	12
5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
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	17
7	投资组合报告	31
7.1	期末基金资产组合情况	31
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	32
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	32
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12	投资组合报告附注	45

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	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
9	开放式基金份额变动	47
10	重大事件揭示	47
10.1	基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	47
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	其他重大事件	49
11	备查文件目录	51
11.1	备查文件目录	51
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深300量化增强证券投资基金	
基金简称	华安沪深300增强	
交易代码	000312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月27日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	53,778,315.82份	
下属分级基金的基金简称	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	000312	000313
报告期末下属分级基金的份额总额	11,855,399.24份	41,922,916.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准 = 95% × 沪深300 指数收益率 + 5% × 同期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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 钱鲲	张志永

	联系电话	021-38969999	021-6277777-212004
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008850099	95561
传真		021-68863414	021-62159217
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	福州市湖东路 154 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	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		朱学华	高建平

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(2015年1月1日至2015年6月30日)	
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C
本期已实现收益	12,412,455.45	36,872,682.50
本期利润	6,124,680.70	16,704,739.67
加权平均基金份额本期利润	0.3381	0.3046
本期加权平均净值利润率	21.57%	19.61%
本期基金份额净值增长率	17.20%	16.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C
期末可供分配利润	7,692,769.70	26,348,419.25
期末可供分配基金份额利润	0.6489	0.6285

期末基金资产净值	19,548,168.94	68,271,335.83
期末基金份额净值	1.649	1.628
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C
基金份额累计净值增长率	64.90%	62.80%

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

华安沪深 300 增强 A

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	-9.30%	3.26%	-7.22%	3.32%	-2.08%	-0.06%
过去三个月	5.17%	2.44%	9.90%	2.48%	-4.73%	-0.04%
过去六个月	17.20%	2.12%	25.26%	2.15%	-8.06%	-0.03%
过去一年	80.22%	1.72%	101.28%	1.75%	-21.06%	-0.03%
自基金合同生效起至今	64.90%	1.45%	83.24%	1.49%	-18.34%	-0.04%

华安沪深 300 增强 C

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	-9.40%	3.25%	-7.22%	3.32%	-2.18%	-0.07%
过去三个月	4.90%	2.44%	9.90%	2.48%	-5.00%	-0.04%
过去六个月	16.70%	2.12%	25.26%	2.15%	-8.56%	-0.03%
过去一年	78.70%	1.72%	101.28%	1.75%	-22.58%	-0.03%
自基金合同生效起至今	62.80%	1.45%	83.24%	1.49%	-20.44%	-0.04%

注：1、本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期商业银行税后活期存款基准利率。

2、根据基金合同的规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非

现金基金资产的 80%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

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 量化增强证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 9 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日)

华安沪深 300 增强 A



华安沪深 300 增强 C



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 9 月 27 日，合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等 67 只开放式基金。管理资产规模达到 1214.76 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛勇	本基金的基金经理	2014-12-30	-	10 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），10 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008

					年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 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助理，2010 年 6 月至 2012 年 12 月担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起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。2012 年 6 月至 2015 年 5 月同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起担任本基金的基金经理。
谢东旭	本基金的基金经理	2015-01-21	-	4 年	经济学硕士研究生，4 年证券、基金行业从业经验，具有基金从业资格。曾任光大银行金融市场部经理、中信证券研究部量化分析师。2012 年 2 月加入华安基金，任系统化投资部数量分析师。2015 年 1 月起担任本基金的基金经理。

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有关法律、法规及《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 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）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，在杠杆牛的驱动下，在央行降息，货币宽松等宏观利好刺激下，股市普涨；其中以创业板为代表的成长股表现抢眼，大幅度领先大蓝筹涨幅，我们在 4 月底逐步增加了小盘股的配置，取得了较好收益；6 月下旬，市场出现大幅下跌，持仓中成长股表现相对较差。在国家救市开始救市阶段，我们相应增加了金融股配置；此外，大额申购、赎回增加了操作难度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.649 元，本报告期份额净值增长率为 17.20%，本基金 C 类份额净值为 1.628 元，本报告期份额净值增长率为 16.70%，同期业绩比较基准增长率为 25.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，中国股市在 6 月下旬进行调整后，去杠杆的作用明显；下半年难以重演“疯牛”行情；中国经济整体将表现平稳，而经济结构转型和国企改革仍然会对股市产生较大的影响。中期看以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股下行空间有限，而存量资金博弈的特征导致成长股高涨行情难以再现，市场可能在一定范围内反复震荡；以创业板为代表的成长股由于估值较高面临继续调整的风险。基金管理人将继续依托量化模型，控制风险，审慎操作，争取获得稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经验的描述

(1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

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

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

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

(2) 托管银行

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

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 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

无。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 量化增强证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,782,147.55	11,321,742.42
结算备付金		1,351,194.33	275,073.27
存出保证金		169,397.01	71,982.50
交易性金融资产	6.4.7.2	81,212,418.39	108,586,367.68
其中：股票投资		81,199,340.49	108,586,367.68
基金投资		-	-
债券投资		13,077.90	-
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		572,713.71	-
应收利息	6.4.7.5	3,243.32	5,510.03
应收股利		-	-
应收申购款		4,490,349.73	3,965,383.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		93,581,464.04	124,226,059.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		518,176.65	41.60
应付赎回款		4,667,438.99	5,889,230.66
应付管理人报酬		75,809.65	99,594.24
应付托管费		11,371.44	14,939.13
应付销售服务费		22,931.70	32,378.74
应付交易费用	6.4.7.7	261,906.94	110,597.61
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	204,323.90	388,779.61
负债合计		5,761,959.27	6,535,561.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	53,778,315.82	84,195,378.83
未分配利润	6.4.7.10	34,041,188.95	33,495,119.45
所有者权益合计		87,819,504.77	117,690,498.28
负债和所有者权益总计		93,581,464.04	124,226,059.87

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，A 类份额净值 1.649 元，C 类份额净值 1.628 元，基金份额总额 53,778,315.82 份，其中 A 类基金份额总额 11,855,399.24 份，C 类基金份额总额 41,922,916.58 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		25,114,085.13	-9,530,702.42
1. 利息收入		77,428.64	79,756.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,427.89	79,756.32
债券利息收入		0.75	-
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）		51,429,601.70	-10,665,121.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	51,010,711.11	-12,454,473.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	418,890.59	1,789,352.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-26,455,717.58	1,046,377.89
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	62,772.37	8,284.40
减：二、费用		2,284,664.76	1,974,357.18
1. 管理人报酬		565,210.52	808,269.82
2. 托管费		84,781.55	121,240.53
3. 销售服务费		169,888.10	295,541.10
4. 交易费用	6.4.7.18	1,260,149.97	498,821.72
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	204,634.62	250,484.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,829,420.37	-11,505,059.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,829,420.37	-11,505,059.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	84,195,378.83	33,495,119.45	117,690,498.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,829,420.37	22,829,420.37
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)	-30,417,063.01	-22,283,350.87	-52,700,413.88
其中：1. 基金申购款	174,518,832.33	98,566,294.68	273,085,127.01
2. 基金赎回款	-204,935,895.34	-120,849,645.55	-325,785,540.89
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)	53,778,315.82	34,041,188.95	87,819,504.77
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	204,403,555.04	-6,089,081.58	198,314,473.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,505,059.60	-11,505,059.60
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)	-44,789,910.06	3,482,160.74	-41,307,749.32
其中：1. 基金申购款	32,569,622.08	-2,961,492.31	29,608,129.77
2. 基金赎回款	-77,359,532.14	6,443,653.05	-70,915,879.09
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)	159,613,644.98	-14,111,980.44	145,501,664.54

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 量化增强证券投资基金(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”)证监许可第 1065 号《关于核准华安沪深 300 量化增强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 量化增强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 552,000,462.87 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》于 2013 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 552,093,318.21 份,其中认购资金利息折合 92,855.34 份。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》和《华安沪深 300 量化增强证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认/申购费用的,称为 A 类;在投资者认/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类。本基金 A 和 C 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准为: $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

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 2015 年 8 月 28 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金 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 2015 年上半年度 财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述会计估计变更的说明以外,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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(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。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25% 计入应纳税所得额。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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	5,782,147.55
定期存款	-

其他存款	-
合计	5,782,147.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,658,834.17	81,199,340.49	-5,459,493.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	13,077.90
	银行间市场	-	-
	合计	9,000.00	13,077.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	86,667,834.17	81,212,418.39	-5,455,415.78

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,595.94
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	547.29
应收债券利息	0.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	30.67
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	68.67
合计	3,243.32

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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	261,906.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	261,906.94

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付赎回费	3,192.67
应付后端申购费	-
预提费用	146,783.76
应付指数使用费	54,347.47
合计	204,323.90

6.4.7.9 实收基金

华安沪深 300 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	18,905,736.42	18,905,736.42
本期申购	25,983,125.96	25,983,125.96
本期赎回（以“-”号填列）	-33,033,463.14	-33,033,463.14
本期末	11,855,399.24	11,855,399.24

华安沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	65,289,642.41	65,289,642.41
本期申购	148,535,706.37	148,535,706.37
本期赎回（以“-”号填列）	-171,902,432.20	-171,902,432.20
本期末	41,922,916.58	41,922,916.58

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

华安沪深 300 增强 A

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	3,463,671.00	4,225,157.65	7,688,828.65
本期利润	12,412,455.45	-6,287,774.75	6,124,680.70
本期基金份额交易产生的变动数	-5,623,122.32	-497,617.33	-6,120,739.65
其中：基金申购款	11,796,363.59	2,510,086.66	14,306,450.25
基金赎回款	-17,419,485.91	-3,007,703.99	-20,427,189.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,253,004.13	-2,560,234.43	7,692,769.70

华安沪深 300 增强 C

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	11,331,186.40	14,475,104.40	25,806,290.80
本期利润	36,872,682.50	-20,167,942.83	16,704,739.67
本期基金份额交易产生的变动数	-12,928,787.39	-3,233,823.83	-16,162,611.22
其中：基金申购款	73,317,758.50	10,942,085.93	84,259,844.43
基金赎回款	-86,246,545.89	-14,175,909.76	-100,422,455.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,275,081.51	-8,926,662.26	26,348,419.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,672.34
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	8,225.03
其他	1,530.52
合计	77,427.89

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	703,336,933.62
减：卖出股票成本总额	652,326,222.51
买卖股票差价收入	51,010,711.11

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益
6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	418,890.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	418,890.59

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-26,455,717.58
——股票投资	-26,459,795.48
——债券投资	4,077.90
——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	-26,455,717.58

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	43,336.88
转换费收入	19,435.49
合计	62,772.37

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,260,149.97
银行间市场交易费用	-
合计	1,260,149.97

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	27,769.02
信息披露费	119,014.74
银行汇划费用	3,503.39
指数使用费	54,347.47
合计	204,634.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的

情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

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 2015年1月1日至2015 年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	565,210.52	808,269.82
其中：支付销售机构的客户维护费	215,162.20	312,758.68

注：支付基金管理人华安基金管理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 2015年1月1日至2015 年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	84,781.55	121,240.53

注：支付基金托管人 兴业银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C	合计
华安基金	-	17,492.93	17,492.93
兴业银行	-	103,833.63	103,833.63
合计	-	121,326.56	121,326.56
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C	合计
华安基金公司	-	6,315.08	6,315.08
兴业银行	-	286,457.70	286,457.70
合计	-	292,772.78	292,772.78

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金公司，再由 华安基金公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额约定

的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,782,147.55	67,672.34	9,849,400.43	73,457.58

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600395	盘江股份	2015-06-09	非公开发行股票	15.71	2015-08-19	14.00	3,000	36,704.70	47,130.00	-
600778	友好集团	2015-06-02	协议转让股权	16.10	-	-	49,100	734,279.00	790,510.00	-
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	17.51	-	-	9,700	152,038.46	169,847.00	-
600277	亿利能源	2015-06-01	非公开发行股票	14.62	-	-	9,300	107,571.68	135,966.00	-
600886	国投电力	2015-06-24	非公开发行股票	14.87	-	-	18,200	232,063.94	270,634.00	-

600900	长江电力	2015-06-15	重大资产重组	14.35	-	-	28,100	367,625.65	403,235.00	-
601021	春秋航空	2015-06-26	非公开发行股票	126.09	2015-07-21	113.48	400	52,392.00	50,436.00	-
601216	内蒙君正	2015-06-29	非公开发行股票	24.07	2015-07-02	24.20	3,300	95,208.00	79,431.00	-
601633	长城汽车	2015-06-19	非公开发行股票	42.76	2015-07-13	38.50	2,000	99,127.93	85,520.00	-
002336	人人乐	2015-06-08	重大事项	25.53	2015-08-06	22.98	6,900	140,478.65	176,157.00	-
002589	瑞康医药	2015-05-21	非公开发行股票	104.25	-	-	5,000	439,446.80	521,250.00	-
000024	招商地产	2015-04-03	重大资产重组	36.43	-	-	14,545	357,650.44	529,874.35	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	非公开发行股票	12.96	-	-	11,993	96,637.32	155,429.28	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	非公开发行股票	20.75	-	-	93	1,805.66	1,929.75	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	4,800	95,846.14	113,136.00	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	24.50	-	-	4,000	82,026.36	98,000.00	-
000917	电广传媒	2015-05-28	发行股份收购资产	42.89	-	-	2,500	92,140.00	107,225.00	-
000963	华东医药	2015-06-26	定向增发	71.48	2015-08-05	69.20	1,200	82,544.99	85,776.00	-
002001	新和成	2015-06-30	员工持股计划	17.09	2015-07-13	18.49	29,205	600,783.01	499,113.45	-
002310	东方园林	2015-05-27	重大资产重组	38.30	-	-	3,200	105,940.09	122,560.00	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	发行股份购买资产	44.35	-	-	5,900	233,063.15	261,665.00	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	员工持股计划	29.21	2015-07-20	26.29	2,800	65,485.21	81,788.00	-

300007	汉威电子	2015-06 -29	重大事项	74.72	2015-08 -24	67.25	3,000	322,584.29	224,160.00	-
300123	太阳鸟	2015-05 -15	重大资产 重组	20.44	-	-	2,000	30,855.71	40,880.00	-
300163	先锋新材	2015-06 -30	重大事项	29.92	-	-	2,400	106,764.36	71,808.00	-

注：本基金截至 2015 年 06 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 2015 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 2015 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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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。本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2015 年 6 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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,782,147.55	-	-	-	5,782,147.55
结算备付金	1,351,194.33	-	-	-	1,351,194.33
存出保证金	169,397.01	-	-	-	169,397.01
交易性金融资产	-	-	13,077.90	81,199,340.49	81,212,418.39
应收证券清算款	-	-	-	572,713.71	572,713.71
应收利息	-	-	-	3,243.32	3,243.32
应收申购款	22,299.40	-	-	4,468,050.33	4,490,349.73
资产总计	7,325,038.29	-	13,077.90	86,243,347.85	93,581,464.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	518,176.65	518,176.65
应付赎回款	-	-	-	4,667,438.99	4,667,438.99
应付管理人报酬	-	-	-	75,809.65	75,809.65
应付托管费	-	-	-	11,371.44	11,371.44
应付销售服务费	-	-	-	22,931.70	22,931.70
应付交易费用	-	-	-	261,906.94	261,906.94
其他负债	-	-	-	204,323.90	204,323.90
负债总计	-	-	-	5,761,959.27	5,761,959.27
利率敏感度缺口	7,325,038.29	-	13,077.90	80,481,388.58	87,819,504.77
上年度末 2014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	11,321,742.42	-	-	-	11,321,742.42
结算备付金	275,073.27	-	-	-	275,073.27
存出保证金	71,982.50	-	-	-	71,982.50
交易性金融资产	-	-	-	108,586,367.68	108,586,367.68
应收利息	-	-	-	5,510.03	5,510.03

应收申购款	31,298.21	-	-	3,934,085.76	3,965,383.97
资产总计	11,700,096.40	-	-	112,525,963.47	124,226,059.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41.60	41.60
应付赎回款	-	-	-	5,889,230.66	5,889,230.66
应付管理人报酬	-	-	-	99,594.24	99,594.24
应付托管费	-	-	-	14,939.13	14,939.13
应付销售服务费	-	-	-	32,378.74	32,378.74
应付交易费用	-	-	-	110,597.61	110,597.61
其他负债	-	-	-	388,779.61	388,779.61
负债总计	-	-	-	6,535,561.59	6,535,561.59
利率敏感度缺口	11,700,096.40	-	-	105,990,401.88	117,690,498.28

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资较少，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资，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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上，根据预期收益、风险预算和交易成本的水平，采用成熟的优化软件对股票投资组合进行优化。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，其中沪深 300 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；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 2015年6月30日		上年度末 2014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	81,199,340.49	92.46	108,586,367.68	92.26
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	81,199,340.49	92.46	108,586,367.68	92.26

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）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	业绩比较基准下降5%	减少约427.00万元	减少约578.00万元
	业绩比较基准上升5%	增加约427.00万元	增加约578.00万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,199,340.49	86.77
	其中：股票	81,199,340.49	86.77

2	固定收益投资	13,077.90	0.01
	其中：债券	13,077.90	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	7,133,341.88	7.62
7	其他各项资产	5,235,703.77	5.59
8	合计	93,581,464.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	276,514.00	0.31
B	采矿业	3,199,452.97	3.64
C	制造业	26,445,953.87	30.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,208,935.00	1.38
E	建筑业	3,735,973.00	4.25
F	批发和零售业	2,392,468.92	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	2,588,070.16	2.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,097,934.44	3.53
J	金融业	31,417,065.73	35.77
K	房地产业	3,414,352.87	3.89
L	租赁和商务服务业	764,844.14	0.87
M	科学研究和技术服务业	18,342.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	839,078.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	530,205.74	0.60
R	文化、体育和娱乐业	1,220,280.65	1.39
S	综合	49,869.00	0.06
	合计	81,199,340.49	92.46

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

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	34,017	2,787,352.98	3.17
2	600036	招商银行	121,300	2,270,736.00	2.59

3	600016	民生银行	174,649	1,736,011.06	1.98
4	600000	浦发银行	100,981	1,712,637.76	1.95
5	600030	中信证券	62,810	1,690,217.10	1.92
6	601288	农业银行	414,718	1,538,603.78	1.75
7	600837	海通证券	69,189	1,508,320.20	1.72
8	601328	交通银行	163,527	1,347,462.48	1.53
9	000002	万科A	86,926	1,262,165.52	1.44
10	601398	工商银行	232,500	1,227,600.00	1.40
11	600519	贵州茅台	4,513	1,162,774.45	1.32
12	601377	兴业证券	75,700	1,036,333.00	1.18
13	600015	华夏银行	66,925	1,017,929.25	1.16
14	000333	美的集团	26,667	994,145.76	1.13
15	601688	华泰证券	41,370	956,888.10	1.09
16	002568	百润股份	7,200	947,016.00	1.08
17	601555	东吴证券	46,200	945,714.00	1.08
18	601988	中国银行	190,900	933,501.00	1.06
19	601800	中国交建	50,400	885,024.00	1.01
20	002470	金正大	40,400	877,084.00	1.00
21	600170	上海建工	93,500	877,030.00	1.00
22	600717	天津港	56,700	849,933.00	0.97
23	601018	宁波港	95,200	841,568.00	0.96
24	601106	中国一重	68,400	828,324.00	0.94
25	601668	中国建筑	99,600	827,676.00	0.94
26	002500	山西证券	44,275	800,934.75	0.91
27	601009	南京银行	35,100	800,280.00	0.91
28	600778	友好集团	49,100	790,510.00	0.90
29	601601	中国太保	26,100	787,698.00	0.90
30	601788	光大证券	28,800	776,160.00	0.88
31	601818	光大银行	130,300	698,408.00	0.80
32	002450	康得新	22,698	694,558.80	0.79
33	000001	平安银行	46,680	678,727.20	0.77
34	300104	乐视网	12,800	662,528.00	0.75
35	000750	国海证券	39,000	655,200.00	0.75
36	601699	潞安环能	65,610	634,448.70	0.72
37	601169	北京银行	47,500	632,700.00	0.72
38	000776	广发证券	27,800	629,670.00	0.72
39	000858	五粮液	19,750	626,075.00	0.71
40	002594	比亚迪	11,300	624,099.00	0.71
41	000999	华润三九	20,000	607,800.00	0.69
42	601808	中海油服	21,393	597,720.42	0.68
43	600150	中国船舶	11,400	587,100.00	0.67

44	600999	招商证券	21,800	576,828.00	0.66
45	000651	格力电器	8,900	568,710.00	0.65
46	000046	泛海控股	37,400	547,910.00	0.62
47	601857	中国石油	47,500	538,175.00	0.61
48	000024	招商地产	14,545	529,874.35	0.60
49	002589	瑞康医药	5,000	521,250.00	0.59
50	000568	泸州老窖	15,800	515,238.00	0.59
51	002001	新和成	29,205	499,113.45	0.57
52	601098	中南传媒	21,300	487,983.00	0.56
53	300234	开尔新材	22,000	470,360.00	0.54
54	600535	天士力	9,300	462,768.00	0.53
55	601939	建设银行	64,800	462,024.00	0.53
56	002142	宁波银行	21,300	450,495.00	0.51
57	300077	国民技术	9,700	412,638.00	0.47
58	000063	中兴通讯	17,220	410,008.20	0.47
59	600900	长江电力	28,100	403,235.00	0.46
60	000825	太钢不锈	55,593	395,266.23	0.45
61	002038	双鹭药业	6,900	390,885.00	0.45
62	300015	爱尔眼科	12,099	390,313.74	0.44
63	603588	高能环境	5,100	383,877.00	0.44
64	000061	农产品	18,700	381,480.00	0.43
65	600104	上汽集团	16,800	379,680.00	0.43
66	600309	万华化学	15,600	377,208.00	0.43
67	000686	东北证券	19,293	375,634.71	0.43
68	600048	保利地产	32,500	371,150.00	0.42
69	600196	复星医药	12,700	367,538.00	0.42
70	002475	立讯精密	10,149	343,137.69	0.39
71	000783	长江证券	24,526	342,137.70	0.39
72	600809	山西汾酒	12,093	341,506.32	0.39
73	600050	中国联通	46,093	337,861.69	0.38
74	600066	宇通客车	16,100	330,855.00	0.38
75	601919	中国远洋	26,400	329,472.00	0.38
76	600256	广汇能源	31,100	323,440.00	0.37
77	601991	大唐发电	38,900	310,422.00	0.35
78	002415	海康威视	6,900	309,120.00	0.35
79	300182	捷成股份	5,800	298,700.00	0.34
80	601628	中国人寿	9,533	298,573.56	0.34
81	601928	凤凰传媒	17,400	297,540.00	0.34
82	600637	百视通	7,025	295,612.00	0.34
83	300282	汇冠股份	5,400	290,574.00	0.33
84	002462	嘉事堂	5,400	286,740.00	0.33

85	000792	盐湖股份	10,100	286,638.00	0.33
86	601336	新华保险	4,601	280,937.06	0.32
87	600276	恒瑞医药	6,190	275,702.60	0.31
88	601186	中国铁建	17,500	273,525.00	0.31
89	600886	国投电力	18,200	270,634.00	0.31
90	002736	国信证券	10,600	265,954.00	0.30
91	600690	青岛海尔	8,700	263,871.00	0.30
92	002353	杰瑞股份	5,900	261,665.00	0.30
93	600958	东方证券	9,100	260,442.00	0.30
94	000983	西山煤电	26,400	250,272.00	0.28
95	600019	宝钢股份	28,100	245,594.00	0.28
96	600005	武钢股份	34,900	245,347.00	0.28
97	600585	海螺水泥	11,400	244,530.00	0.28
98	600028	中国石化	34,600	244,276.00	0.28
99	300216	千山药机	5,000	244,100.00	0.28
100	300075	数字政通	6,456	243,326.64	0.28
101	300334	津膜科技	8,300	241,945.00	0.28
102	002344	海宁皮城	12,200	239,486.00	0.27
103	601088	中国神华	11,292	235,438.20	0.27
104	000625	长安汽车	11,119	235,166.85	0.27
105	000538	云南白药	2,668	230,168.36	0.26
106	002679	福建金森	8,200	224,680.00	0.26
107	300007	汉威电子	3,000	224,160.00	0.26
108	601998	中信银行	28,500	219,735.00	0.25
109	601600	中国铝业	23,093	215,457.69	0.25
110	000018	中冠 A	6,100	201,300.00	0.23
111	600188	兖州煤业	14,600	200,750.00	0.23
112	601618	中国中冶	27,700	200,271.00	0.23
113	000728	国元证券	5,100	193,698.00	0.22
114	600118	中国卫星	3,400	193,664.00	0.22
115	600317	营口港	30,700	193,410.00	0.22
116	300024	机器人	2,500	193,150.00	0.22
117	600271	航天信息	2,900	187,659.00	0.21
118	300027	华谊兄弟	4,900	186,886.00	0.21
119	601669	中国电建	16,400	185,976.00	0.21
120	601117	中国化学	19,000	185,820.00	0.21
121	300236	上海新阳	5,700	180,690.00	0.21
122	000157	中联重科	22,100	179,231.00	0.20
123	002614	蒙发利	10,000	178,300.00	0.20
124	000402	金融街	12,600	178,038.00	0.20
125	600597	光明乳业	7,700	177,100.00	0.20

126	002336	人人乐	6,900	176,157.00	0.20
127	002202	金风科技	8,800	171,336.00	0.20
128	600373	中文传媒	7,100	170,116.00	0.19
129	600153	建发股份	9,700	169,847.00	0.19
130	000166	申万宏源	10,400	169,000.00	0.19
131	300201	海伦哲	10,500	166,950.00	0.19
132	300002	神州泰岳	10,900	166,116.00	0.19
133	002304	洋河股份	2,380	165,076.80	0.19
134	000338	潍柴动力	5,100	161,466.00	0.18
135	600009	上海机场	5,076	160,909.20	0.18
136	600739	辽宁成大	6,500	158,925.00	0.18
137	600352	浙江龙盛	11,000	155,870.00	0.18
138	000778	新兴铸管	11,993	155,429.28	0.18
139	002532	新界泵业	7,800	153,270.00	0.17
140	600129	太极集团	5,600	152,432.00	0.17
141	600406	国电南瑞	7,300	151,037.00	0.17
142	300005	探路者	5,500	150,700.00	0.17
143	600177	雅戈尔	8,100	147,906.00	0.17
144	000423	东阿阿胶	2,700	147,150.00	0.17
145	600340	华夏幸福	4,800	146,160.00	0.17
146	600383	金地集团	11,500	145,475.00	0.17
147	002241	歌尔声学	4,029	144,641.10	0.16
148	000503	海虹控股	2,900	142,100.00	0.16
149	300347	泰格医药	4,100	139,892.00	0.16
150	002230	科大讯飞	4,000	139,760.00	0.16
151	601888	中国国旅	2,100	139,230.00	0.16
152	300070	碧水源	2,800	136,612.00	0.16
153	600277	亿利能源	9,300	135,966.00	0.15
154	002215	诺普信	7,800	134,550.00	0.15
155	002302	西部建设	6,600	134,046.00	0.15
156	600593	大连圣亚	4,300	133,558.00	0.15
157	300124	汇川技术	2,700	129,600.00	0.15
158	600085	同仁堂	3,600	129,276.00	0.15
159	600674	川投能源	10,200	127,602.00	0.15
160	600369	西南证券	6,400	125,760.00	0.14
161	300289	利德曼	2,400	124,800.00	0.14
162	002310	东方园林	3,200	122,560.00	0.14
163	002465	海格通信	3,800	122,322.00	0.14
164	300327	中颖电子	5,710	121,451.70	0.14
165	002065	东华软件	4,200	120,750.00	0.14
166	002673	西部证券	4,200	119,154.00	0.14

167	601168	西部矿业	10,900	119,028.00	0.14
168	600252	中恒集团	5,000	115,000.00	0.13
169	000800	一汽轿车	4,600	114,448.00	0.13
170	600741	华域汽车	5,300	113,155.00	0.13
171	000839	中信国安	4,800	113,136.00	0.13
172	000895	双汇发展	5,300	113,049.00	0.13
173	600315	上海家化	2,600	112,840.00	0.13
174	300410	正业科技	1,800	110,700.00	0.13
175	000917	电广传媒	2,500	107,225.00	0.12
176	300378	鼎捷科技	1,300	105,482.00	0.12
177	600018	上港集团	13,300	105,203.00	0.12
178	601989	中国重工	7,100	105,080.00	0.12
179	000826	桑德环境	2,700	105,003.00	0.12
180	600663	陆家嘴	2,100	104,454.00	0.12
181	002366	丹甫股份	1,400	102,732.00	0.12
182	601607	上海医药	4,600	102,442.00	0.12
183	300003	乐普医疗	2,500	101,425.00	0.12
184	600332	白云山	2,900	99,934.00	0.11
185	000878	云南铜业	4,000	98,000.00	0.11
186	600372	中航电子	2,800	97,804.00	0.11
187	002129	中环股份	4,900	96,971.00	0.11
188	601231	环旭电子	5,500	93,555.00	0.11
189	600660	福耀玻璃	6,400	91,392.00	0.10
190	002570	贝因美	4,600	89,286.00	0.10
191	000963	华东医药	1,200	85,776.00	0.10
192	601633	长城汽车	2,000	85,520.00	0.10
193	300351	永贵电器	2,200	84,370.00	0.10
194	000712	锦龙股份	2,400	84,240.00	0.10
195	601222	林洋电子	2,400	84,216.00	0.10
196	000738	中航动控	2,500	82,900.00	0.09
197	002375	亚厦股份	2,800	81,788.00	0.09
198	600867	通化东宝	3,700	81,141.00	0.09
199	300049	福瑞股份	900	80,991.00	0.09
200	000032	深桑达 A	3,900	80,886.00	0.09
201	600054	黄山旅游	3,600	80,028.00	0.09
202	600316	洪都航空	2,300	79,534.00	0.09
203	601216	内蒙君正	3,300	79,431.00	0.09
204	000590	*ST 古汉	3,200	78,240.00	0.09
205	603000	人民网	1,500	78,195.00	0.09
206	600166	福田汽车	8,700	76,821.00	0.09
207	002146	荣盛发展	6,000	75,000.00	0.09

208	300251	光线传媒	2,991	74,475.90	0.08
209	300163	先锋新材	2,400	71,808.00	0.08
210	002007	华兰生物	1,600	70,864.00	0.08
211	601390	中国中铁	5,100	69,819.00	0.08
212	000898	鞍钢股份	8,800	64,240.00	0.07
213	000876	新希望	3,300	64,053.00	0.07
214	601929	吉视传媒	4,200	63,504.00	0.07
215	300210	森远股份	3,100	60,450.00	0.07
216	601992	金隅股份	4,900	58,555.00	0.07
217	600578	京能电力	6,400	57,152.00	0.07
218	002623	亚玛顿	1,300	56,680.00	0.06
219	002245	澳洋顺昌	6,000	56,100.00	0.06
220	603308	应流股份	1,900	55,556.00	0.06
221	002158	汉钟精机	2,300	55,200.00	0.06
222	002690	美亚光电	1,400	54,978.00	0.06
223	600647	同达创业	1,800	54,126.00	0.06
224	601799	星宇股份	1,400	53,536.00	0.06
225	300034	钢研高纳	1,500	53,235.00	0.06
226	002333	罗普斯金	2,700	53,217.00	0.06
227	601118	海南橡胶	5,300	51,834.00	0.06
228	300198	纳川股份	3,837	51,223.95	0.06
229	600398	海澜之家	2,800	50,764.00	0.06
230	601021	春秋航空	400	50,436.00	0.06
231	600697	欧亚集团	1,600	49,568.00	0.06
232	600549	厦门钨业	1,930	48,751.80	0.06
233	002399	海普瑞	1,400	47,586.00	0.05
234	600395	盘江股份	3,000	47,130.00	0.05
235	600783	鲁信创投	1,200	44,976.00	0.05
236	300209	天泽信息	1,900	44,745.00	0.05
237	300123	太阳鸟	2,000	40,880.00	0.05
238	600998	九州通	1,800	40,248.00	0.05
239	000060	中金岭南	2,100	39,039.00	0.04
240	600038	中直股份	600	37,170.00	0.04
241	603456	九洲药业	700	35,721.00	0.04
242	002653	海思科	1,300	35,100.00	0.04
243	300206	理邦仪器	1,000	32,020.00	0.04
244	601158	重庆水务	2,900	31,146.00	0.04
245	300367	东方网力	500	28,875.00	0.03
246	600486	扬农化工	800	28,784.00	0.03
247	300306	远方光电	900	25,326.00	0.03
248	002032	苏泊尔	1,000	24,610.00	0.03

249	300159	新研股份	1,200	22,800.00	0.03
250	600485	信威集团	500	21,945.00	0.02
251	002051	中工国际	700	20,846.00	0.02
252	300284	苏交科	900	18,342.00	0.02
253	002584	西陇化工	500	18,300.00	0.02
254	300064	豫金刚石	1,400	18,200.00	0.02
255	600109	国金证券	600	14,640.00	0.02
256	600600	青岛啤酒	200	9,318.00	0.01
257	600588	用友网络	200	9,176.00	0.01
258	300146	汤臣倍健	200	7,856.00	0.01
259	002456	欧菲光	200	6,748.00	0.01
260	002153	石基信息	50	6,499.50	0.01
261	600362	江西铜业	300	6,453.00	0.01
262	000970	中科三环	300	6,183.00	0.01
263	002252	上海莱士	93	6,085.92	0.01
264	002008	大族激光	200	5,744.00	0.01
265	300324	旋极信息	199	5,649.61	0.01
266	002081	金螳螂	200	5,638.00	0.01
267	000915	山大华特	100	5,600.00	0.01
268	000009	中国宝安	300	4,893.00	0.01
269	300058	蓝色光标	294	4,648.14	0.01
270	600705	中航资本	200	4,630.00	0.01
271	000400	许继电气	172	4,327.52	0.00
272	600100	同方股份	200	4,198.00	0.00
273	002422	科伦药业	100	4,004.00	0.00
274	000425	徐工机械	300	3,981.00	0.00
275	300097	智云股份	100	3,576.00	0.00
276	300302	同有科技	100	3,545.00	0.00
277	603288	海天味业	100	3,194.00	0.00
278	002024	苏宁云商	200	3,060.00	0.00
279	300341	麦迪电气	100	3,008.00	0.00
280	600804	鹏博士	100	2,986.00	0.00
281	300171	东富龙	100	2,809.00	0.00
282	601901	方正证券	236	2,806.04	0.00
283	600011	华能国际	200	2,806.00	0.00
284	600648	外高桥	74	2,595.92	0.00
285	300261	雅本化学	100	2,370.00	0.00
286	601958	金钼股份	200	2,356.00	0.00
287	600827	百联股份	100	2,081.00	0.00
288	000729	燕京啤酒	200	2,080.00	0.00
289	600642	申能股份	200	2,002.00	0.00

290	000638	万方发展	100	1,970.00	0.00
291	600031	三一重工	200	1,938.00	0.00
292	000793	华闻传媒	93	1,929.75	0.00
293	000883	湖北能源	200	1,744.00	0.00
294	600583	海油工程	93	1,549.38	0.00
295	300133	华策影视	50	1,350.00	0.00
296	000593	大通燃气	100	1,299.00	0.00
297	601099	太平洋	100	1,292.00	0.00
298	000055	方大集团	100	1,260.00	0.00
299	603993	洛阳钼业	100	1,236.00	0.00
300	000027	深圳能源	100	1,235.00	0.00
301	600489	中金黄金	93	1,196.91	0.00
302	000623	吉林敖东	35	1,176.00	0.00
303	601006	大秦铁路	74	1,038.96	0.00
304	601179	中国西电	100	1,025.00	0.00
305	601899	紫金矿业	200	1,024.00	0.00
306	000598	兴蓉环境	100	957.00	0.00
307	600887	伊利股份	46	869.40	0.00
308	601225	陕西煤业	100	818.00	0.00
309	000629	攀钢钒钛	66	353.76	0.00
310	000937	冀中能源	30	240.60	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	10,118,855.00	8.60
2	600000	浦发银行	8,821,621.55	7.50
3	601288	农业银行	8,075,266.00	6.86
4	600016	民生银行	7,486,313.60	6.36
5	600030	中信证券	7,089,062.00	6.02
6	000001	平安银行	7,060,917.35	6.00
7	600036	招商银行	6,287,501.58	5.34
8	600837	海通证券	6,080,524.25	5.17
9	600015	华夏银行	5,968,135.50	5.07
10	000002	万科A	5,583,021.00	4.74
11	601668	中国建筑	5,404,712.00	4.59
12	601398	工商银行	5,282,682.00	4.49
13	000333	美的集团	5,148,558.48	4.37
14	601009	南京银行	4,782,015.13	4.06

15	601988	中国银行	4,331,098.00	3.68
16	601088	中国神华	4,110,766.85	3.49
17	601328	交通银行	4,055,124.74	3.45
18	601169	北京银行	3,925,382.47	3.34
19	600900	长江电力	3,919,978.50	3.33
20	600048	保利地产	3,918,840.00	3.33
21	600028	中国石化	3,847,229.00	3.27
22	600104	上汽集团	3,842,187.16	3.26
23	600999	招商证券	3,773,238.26	3.21
24	600887	伊利股份	3,755,809.40	3.19
25	600383	金地集团	3,732,316.09	3.17
26	000651	格力电器	3,691,539.49	3.14
27	601006	大秦铁路	3,647,996.00	3.10
28	002202	金风科技	3,617,037.30	3.07
29	000858	五粮液	3,535,957.42	3.00
30	601818	光大银行	3,311,008.00	2.81
31	600585	海螺水泥	3,248,361.00	2.76
32	601766	中国中车	3,224,765.00	2.74
33	601901	方正证券	3,171,075.36	2.69
34	601117	中国化学	3,147,698.18	2.67
35	600089	特变电工	3,088,816.96	2.62
36	601601	中国太保	3,083,660.92	2.62
37	601377	兴业证券	3,014,217.00	2.56
38	000728	国元证券	2,949,388.88	2.51
39	000776	广发证券	2,943,647.38	2.50
40	601939	建设银行	2,890,814.00	2.46
41	600535	天士力	2,885,766.01	2.45
42	000157	中联重科	2,849,232.40	2.42
43	601998	中信银行	2,782,673.00	2.36
44	600019	宝钢股份	2,737,756.90	2.33
45	000895	双汇发展	2,660,074.80	2.26
46	601688	华泰证券	2,618,188.18	2.22
47	002450	康得新	2,613,884.06	2.22
48	600109	国金证券	2,552,165.00	2.17
49	601857	中国石油	2,541,729.90	2.16
50	000783	长江证券	2,532,828.00	2.15
51	000338	潍柴动力	2,522,198.00	2.14
52	601989	中国重工	2,508,295.00	2.13
53	601555	东吴证券	2,504,767.00	2.13
54	600795	国电电力	2,496,952.00	2.12
55	000039	中集集团	2,481,446.42	2.11

56	600372	中航电子	2,476,001.58	2.10
57	000750	国海证券	2,454,854.00	2.09
58	600068	葛洲坝	2,425,628.47	2.06
59	601628	中国人寿	2,408,410.00	2.05
60	600362	江西铜业	2,394,376.60	2.03
61	002415	海康威视	2,392,422.38	2.03
62	002422	科伦药业	2,380,545.41	2.02
63	000538	云南白药	2,358,402.39	2.00
64	601336	新华保险	2,356,314.07	2.00

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	13,256,550.93	11.26
2	600000	浦发银行	10,002,233.16	8.50
3	600016	民生银行	9,351,955.08	7.95
4	600837	海通证券	8,765,313.74	7.45
5	000001	平安银行	8,603,062.89	7.31
6	601288	农业银行	8,357,341.58	7.10
7	600036	招商银行	7,860,133.34	6.68
8	600030	中信证券	7,367,288.78	6.26
9	600015	华夏银行	6,891,919.22	5.86
10	000002	万科 A	5,684,586.94	4.83
11	601668	中国建筑	5,103,762.20	4.34
12	601398	工商银行	4,867,521.90	4.14
13	601009	南京银行	4,760,700.56	4.05
14	601169	北京银行	4,745,409.50	4.03
15	601818	光大银行	4,712,055.07	4.00
16	601328	交通银行	4,666,544.49	3.97
17	000333	美的集团	4,576,775.06	3.89
18	600887	伊利股份	4,565,564.03	3.88
19	601988	中国银行	4,269,951.60	3.63
20	000651	格力电器	4,221,678.85	3.59
21	600028	中国石化	4,206,977.02	3.57
22	601601	中国太保	4,165,929.19	3.54
23	002202	金风科技	4,137,181.69	3.52
24	000776	广发证券	3,984,469.45	3.39
25	600383	金地集团	3,911,419.86	3.32
26	601088	中国神华	3,878,108.39	3.30

27	601006	大秦铁路	3,844,938.70	3.27
28	600900	长江电力	3,840,909.93	3.26
29	601766	中国中车	3,768,086.55	3.20
30	601688	华泰证券	3,636,895.58	3.09
31	600068	葛洲坝	3,600,076.87	3.06
32	600104	上汽集团	3,583,579.17	3.04
33	000402	金融街	3,554,866.21	3.02
34	600048	保利地产	3,535,841.52	3.00
35	600050	中国联通	3,474,388.45	2.95
36	601117	中国化学	3,355,136.56	2.85
37	000338	潍柴动力	3,347,953.28	2.84
38	601377	兴业证券	3,328,228.40	2.83
39	600795	国电电力	3,226,587.70	2.74
40	000858	五粮液	3,123,244.17	2.65
41	600089	特变电工	3,104,125.42	2.64
42	000728	国元证券	3,083,366.90	2.62
43	600585	海螺水泥	3,075,622.14	2.61
44	601901	方正证券	3,072,284.12	2.61
45	600029	南方航空	3,009,669.24	2.56
46	601939	建设银行	2,998,710.51	2.55
47	600999	招商证券	2,898,211.70	2.46
48	601299	中国北车	2,879,033.97	2.45
49	000895	双汇发展	2,833,779.41	2.41
50	600109	国金证券	2,828,463.71	2.40
51	600875	东方电气	2,811,732.81	2.39
52	600642	申能股份	2,753,531.62	2.34
53	000039	中集集团	2,717,110.88	2.31
54	601336	新华保险	2,710,895.53	2.30
55	600535	天士力	2,671,913.34	2.27
56	600372	中航电子	2,661,623.18	2.26
57	000725	京东方 A	2,635,082.40	2.24
58	600369	西南证券	2,611,871.75	2.22
59	000425	徐工机械	2,597,594.67	2.21
60	600188	兖州煤业	2,594,004.19	2.20
61	600352	浙江龙盛	2,589,516.05	2.20
62	600019	宝钢股份	2,584,044.66	2.20
63	601998	中信银行	2,579,999.98	2.19
64	600011	华能国际	2,572,232.70	2.19
65	601989	中国重工	2,566,204.80	2.18
66	000729	燕京啤酒	2,565,936.66	2.18
67	002422	科伦药业	2,562,967.73	2.18

68	000157	中联重科	2,555,311.87	2.17
69	600277	亿利能源	2,536,004.56	2.15
70	002024	苏宁云商	2,509,194.11	2.13
71	601179	中国西电	2,486,446.36	2.11
72	000686	东北证券	2,440,317.09	2.07
73	600893	中航动力	2,435,977.22	2.07
74	600362	江西铜业	2,419,898.34	2.06
75	601607	上海医药	2,416,090.17	2.05
76	601390	中国中铁	2,394,871.62	2.03
77	601231	环旭电子	2,393,104.34	2.03

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	651,398,990.80
卖出股票的收入（成交）总额	703,336,933.62

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	13,077.90	0.01
8	其他	-	-
9	合计	13,077.90	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	110031	航信转债	90	13,077.90	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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的中信证券（600030）和海通证券（600837）因存在违规为到期融资融券合约展期问题，2015年1月16日受到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。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

序号	名称	金额
1	存出保证金	169,397.01
2	应收证券清算款	572,713.71

3	应收股利	-
4	应收利息	3,243.32
5	应收申购款	4,490,349.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,235,703.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(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 增强 A	673	17,615.75	-	-	11,855,399.24	100.00%
华安沪深 300 增强 C	1,376	30,467.24	-	-	41,922,916.58	100.00%
合计	2,049	26,246.13	-	-	53,778,315.82	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华安沪深 300 增强 A	1,000.00	0.008%
	华安沪深 300 增强 C	-	-
	合计	1,000.00	0.002%

注：1. 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2. 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 增强 A	华安沪深 300 增强 C
基金合同生效日(2013年9月27日)基金份额总额	36,175,885.32	515,917,432.89
本报告期期初基金份额总额	18,905,736.42	65,289,642.41
本报告期基金总申购份额	25,983,125.96	148,535,706.37
减：本报告期基金总赎回份额	33,033,463.14	171,902,432.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,855,399.24	41,922,916.58

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2015 年 1 月 22 日，基金管理人发布了华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理变更公告，新增谢东旭先生为本基金的基金经理，与牛勇先生共同管理本基金。

(2) 2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(3) 2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(4) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：
无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
上海证券有限责任公司	2	1,350,862,854.10	100.00%	404,764.47	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、本报告期内，本基金未变更交易单元。

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	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额

		额的比例		额的比例		额的比例
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-05
2	华安沪深300量化增强证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-22
3	关于旗下部分基金增加上海长量基金为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-23
4	关于旗下部分基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-03
5	关于旗下部分基金增加北京增财基金销售为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-06
6	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-07
7	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-12
8	关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-13
9	关于旗下部分基金增加好买基金销售为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-17
10	关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-18
11	关于华安旗下部分基金参加好买基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-25
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-31
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-04

	公告	券报》和公司网站	
14	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-08
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华域汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-14
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-05-07
17	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-05-29
18	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-02
19	关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-02
20	关于旗下部分基金在官方京东店开展认购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-10
21	关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-10
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	2015-06-12
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-12
24	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	2015-06-26
25	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的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-29
26	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-30

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 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一五年八月二十八日