

**华安沪深 300 量化增强证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示 .....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况 .....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	52
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	52
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.11 投资组合报告附注 .....	53
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	错误！未定义书签。
8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	错误! 未定义书签。
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>错误! 未定义书签。</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## 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	
基金主代码	000312	
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	66,099,542.98 份	
基金合同存续期	不定期	
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	25,474,341.89 份	40,625,201.09 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	021-62677777-212004
	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（2016年1月1日至2016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	-3,591,682.65	-5,899,766.76
本期利润	-3,170,764.50	-4,622,041.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1303	-0.1104
本期加权平均净值利润率	-9.69%	-8.36%
本期基金份额净值增长率	-9.46%	-9.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016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	9,664,959.60	14,438,479.03
期末可供分配基金份额利润	0.3794	0.3554
期末基金资产净值	35,139,301.49	55,063,680.12
期末基金份额净值	1.379	1.355
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016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	37.90%	35.50%
-------------	--------	--------

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	0.36%	0.94%	-0.47%	0.93%	0.83%	0.01%
过去三个月	-1.22%	1.05%	-1.89%	0.96%	0.67%	0.09%
过去六个月	-9.46%	1.93%	-14.69%	1.75%	5.23%	0.18%
过去一年	-16.37%	2.30%	-28.00%	2.19%	11.63%	0.11%
自基金合同生效起至今	37.90%	1.81%	30.71%	1.78%	7.19%	0.03%

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	0.30%	0.95%	-0.47%	0.93%	0.77%	0.02%
过去三个月	-1.31%	1.06%	-1.89%	0.96%	0.58%	0.10%
过去六个月	-9.67%	1.93%	-14.69%	1.75%	5.02%	0.18%
过去一年	-16.77%	2.30%	-28.00%	2.19%	11.23%	0.11%
自基金合同生效起至今	35.50%	1.81%	30.71%	1.78%	4.79%	0.03%

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

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(但须符合中国证监会相关规定)。

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 2016 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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢东旭	基金经理	2015-01-21	-	5 年	经济学硕士研究生，5 年证券、基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。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。
牛勇	基金经理	2014-12-30	-	12 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），12 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。

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、发送邮件、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风控部门的监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同

基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度，股市经历较大下跌，期间发生 2 次熔断，随后展开一波反弹陷入僵持，股市进入震荡行情。在剧烈波动的行情中，基本面量化多因子选股策略表现稳定而强劲。二季度，大盘维持震荡；“权威人士”对经济运行定调后，维稳频繁，增加了投资难度，模型预测能力衰减，我们缩小了风险暴露。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.379 元，本报告期份额净值增长率为-9.46%，本基金 C 类份额净值为 1.355 元，本报告期份额净值增长率为-9.67%，同期业绩比较基准增长率为-14.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期 2016 年下半年可能是一个震荡上行的市场。在当前的点位上，我们认为下行的空间不会太大，除非发生金融危机。

尽管今年境内外不确定性因素很多，国内经济基本面较弱，也面临去产能调结构的压力，但我们认为 A 股市场还是有一定的机会。根本的驱动因素还是大量资金依然缺少合适的投资方向，而 A 股市场在风险释放之后依然会是一个不错的选择；尤其是下半年，楼市投资面临到顶，股市会有不错的机会。另外，当前时点中小创的估值仍然相对偏高，大幅领先蓝筹股的可能性很低。

我们将继续依托量化模型，审慎操作，争取获得明显的超额收益。作为沪深 300 增指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过多因子选股模型进行适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

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

###### (1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

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

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大

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

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

#### （2）托管银行

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

#### （3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

#### 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

#### 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

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,588,547.27	5,745,779.71
结算备付金		1,794,969.98	1,341,555.64
存出保证金		175,967.56	103,861.46
交易性金融资产	6.4.7.2	85,535,708.59	84,905,686.04
其中：股票投资		85,535,708.59	84,890,186.04
基金投资		-	-
债券投资		-	15,500.00
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		1,504,729.21	1,225,208.62
应收利息	6.4.7.5	2,892.42	3,122.23
应收股利		-	-
应收申购款		663,469.16	573,294.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		95,266,284.19	93,898,507.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款	6.4.7.3	-	1,784,158.89
应付赎回款		4,357,604.48	800,256.48
应付管理人报酬		76,216.00	72,685.31
应付托管费		11,432.39	10,902.78
应付销售服务费		19,028.90	18,520.55
应付交易费用	6.4.7.7	401,676.06	297,964.73
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	197,344.75	346,030.59
负债合计		5,063,302.58	3,330,519.33
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	66,099,542.98	60,024,807.69
未分配利润	6.4.7.10	24,103,438.63	30,543,180.73
所有者权益合计		90,202,981.61	90,567,988.42
负债和所有者权益总计		95,266,284.19	93,898,507.75

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，A 类份额净值 1.379 元，C 类份额净值 1.355 元，基金份额总额 66,099,542.98 份，其中 A 类基金份额总额 25,474,341.89 份，C 类基金份额总额 40,625,201.09 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-4,825,742.88</b>	<b>25,114,085.13</b>
1.利息收入		59,513.81	77,428.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,507.01	77,427.89
债券利息收入		6.80	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）		-6,587,797.62	51,429,601.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,075,992.76	51,010,711.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,238.17	-
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	478,956.97	418,890.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,698,643.00	-26,455,717.58
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	3,897.93	62,772.37
<b>减：二、费用</b>		<b>2,967,063.53</b>	<b>2,284,664.76</b>
1. 管理人报酬		436,624.58	565,210.52
2. 托管费		65,493.68	84,781.55
3. 销售服务费		109,722.20	169,888.10
4. 交易费用	6.4.7.18	2,106,579.27	1,260,149.97
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	248,643.80	204,634.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,792,806.41</b>	<b>22,829,420.37</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,792,806.41</b>	<b>22,829,420.37</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	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）	60,024,807.69	30,543,180.73	90,567,988.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,792,806.41	-7,792,806.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,074,735.29	1,353,064.31	7,427,799.60
其中：1.基金申购款	86,701,754.58	28,159,618.28	114,861,372.86
2.基金赎回款	-80,627,019.29	-26,806,553.97	-107,433,573.26
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）	66,099,542.98	24,103,438.63	90,202,981.61
项目	上年度可比期间		
	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

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：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:  $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

### 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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	5,588,547.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,588,547.27

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	84,476,352.27	85,535,708.59	1,059,356.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	84,476,352.27	85,535,708.59	1,059,356.32

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,050.01
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	726.93
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	44.20
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	71.28
合计	2,892.42

#### 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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	401,676.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	401,676.06

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	152.25
预提费用	147,192.50
应付指数使用费	50,000.00
合计	197,344.75

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	22,402,071.35	22,402,071.35
本期申购	5,731,620.20	5,731,620.20
本期赎回（以“-”号填列）	-2,659,349.66	-2,659,349.66
本期末	25,474,341.89	25,474,341.89

华安沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	37,622,736.34	37,622,736.34
本期申购	80,970,134.38	80,970,134.38
本期赎回（以“-”号填列）	-77,967,669.63	-77,967,669.63
本期末	40,625,201.09	40,625,201.09

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	14,336,953.32	-2,609,641.45	11,727,311.87

本期利润	-3,591,682.65	420,918.15	-3,170,764.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,587,499.20	-479,086.97	1,108,412.23
其中：基金申购款	2,863,709.16	-835,612.02	2,028,097.14
基金赎回款	-1,276,209.96	356,525.05	-919,684.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,332,769.87	-2,667,810.27	9,664,959.60

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	23,136,749.75	-4,320,880.89	18,815,868.86
本期利润	-5,899,766.76	1,277,724.85	-4,622,041.91
本期基金份额交易产生的变动数	1,399,248.57	-1,154,596.49	244,652.08
其中：基金申购款	36,699,094.14	-10,567,573.00	26,131,521.14
基金赎回款	-35,299,845.57	9,412,976.51	-25,886,869.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,636,231.56	-4,197,752.53	14,438,479.03

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,709.58
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	15,489.70
其他	1,307.73
合计	59,507.01

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,153,015,095.78
减：卖出股票成本总额	1,160,091,088.54
买卖股票差价收入	-7,075,992.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期



	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,747.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	48,500.00
减：应收利息总额	9.18
买卖债券差价收入	9,238.17

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	478,956.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	478,956.97

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	1,698,643.00
——股票投资	1,698,643.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,698,643.00

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	3,192.22
转换费收入	705.71
合计	3,897.93

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,106,579.27
银行间市场交易费用	-
合计	2,106,579.27

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	27,847.82
信息披露费	119,344.68
银行汇划费用	1,451.30
指数使用费	100,000.00
合计	248,643.80

### 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

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	436,624.58	565,210.52
其中：支付销售机构的客户维护费	165,440.86	215,162.20

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

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,493.68	84,781.55

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	-	20,524.24	20,524.24
兴业银行	-	46,814.17	46,814.17
合计	-	67,338.41	67,338.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,588,547.27	42,709.58	5,782,147.55	67,672.34

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（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

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
000537	广宇发展	2016-04-13	重大事项停牌	8.01	2016-07-20	8.81	16,800.00	131,908.00	134,568.00	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项停牌	16.72	2016-07-08	17.37	36,300.00	587,524.81	606,936.00	-
002059	云南旅游	2016-06-01	重大事项停牌	8.56	-	-	6,200.00	51,570.51	53,072.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项停牌	12.44	-	-	41,566.00	487,981.76	517,081.04	-
002630	华西能源	2016-06-25	重大事项停牌	11.06	-	-	8,900.00	93,615.00	98,434.00	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	187,900.00	536,773.68	518,604.00	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项停牌	14.36	-	-	3,300.00	47,925.90	47,388.00	-

注：本基金截至 2016 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 2016 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 2016 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。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

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，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。

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 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年 12 月 31 日：0.02%)。

#### 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 2016 年 06 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,588,547.27	-	-	-	5,588,547.27
结算备付金	1,794,969.98	-	-	-	1,794,969.98
存出保证金	175,967.56	-	-	-	175,967.56
交易性金融资产	-	-	-	85,535,708.59	85,535,708.59
应收证券清算款	-	-	-	1,504,729.21	1,504,729.21
应收利息	-	-	-	2,892.42	2,892.42
应收申购款	11,200.00	-	-	652,269.16	663,469.16
资产总计	7,570,684.81	-	-	87,695,599.38	95,266,284.19
负债					



应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,357,604.48	4,357,604.48
应付管理人报酬	-	-	-	76,216.00	76,216.00
应付托管费	-	-	-	11,432.39	11,432.39
应付销售服务费	-	-	-	19,028.90	19,028.90
应付交易费用	-	-	-	401,676.06	401,676.06
其他负债	-	-	-	197,344.75	197,344.75
负债总计	-	-	-	5,063,302.58	5,063,302.58
利率敏感度缺口	7,570,684.81	-	-	82,632,296.80	90,202,981.61
<b>上年度末</b>					
<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	5,745,779.71	-	-	-	5,745,779.71
结算备付金	1,341,555.64	-	-	-	1,341,555.64
存出保证金	103,861.46	-	-	-	103,861.46
交易性金融资产	-	-	15,500.00	84,890,186.04	84,905,686.04
应收证券清算款	-	-	-	1,225,208.62	1,225,208.62
应收利息	-	-	-	3,122.23	3,122.23
应收申购款	230,199.40	-	-	343,094.65	573,294.05
资产总计	7,421,396.21	-	15,500.00	86,461,611.54	93,898,507.75
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,784,158.89	1,784,158.89
应付赎回款	-	-	-	800,256.48	800,256.48
应付管理人报酬	-	-	-	72,685.31	72,685.31
应付托管费	-	-	-	10,902.78	10,902.78
应付销售服务费	-	-	-	18,520.55	18,520.55
应付交易费用	-	-	-	297,964.73	297,964.73
其他负债	-	-	-	346,030.59	346,030.59
负债总计	0.00	0.00	0.00	3,330,519.33	3,330,519.33
利率敏感度缺口	7,421,396.21	0.00	15,500.00	83,131,092.21	90,567,988.42

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：0.02%)，因此市场利

率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例	公允价值	占基金资产 净值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	85,535,708.59	94.83	84,890,186.04	93.73
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>85,535,708.59</b>	<b>94.83</b>	<b>84,890,186.04</b>	<b>93.73</b>

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约 492	增加约 436
	2. 业绩比较基准下降5%	减少约 492	减少约 436

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	85,535,708.59	89.79
	其中：股票	85,535,708.59	89.79
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,383,517.25	7.75
7	其他各项资产	2,347,058.35	2.46
8	合计	95,266,284.19	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,874,223.93	3.19
C	制造业	25,623,952.60	28.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,966,581.24	5.51
E	建筑业	3,010,047.00	3.34
F	批发和零售业	4,227,291.00	4.69
G	交通运输、仓储和邮政业	3,497,165.00	3.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,538,341.60	6.14
J	金融业	24,940,082.86	27.65
K	房地产业	5,413,623.36	6.00
L	租赁和商务服务业	1,538,512.00	1.71

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,780,528.00	1.97
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	1,922,864.00	2.13
S	综合	202,496.00	0.22
	合计	85,535,708.59	94.83

### 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

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	600036	招商银行	198,166	3,467,905.00	3.84
2	601318	中国平安	83,200	2,665,728.00	2.96
3	600837	海通证券	127,600	1,967,592.00	2.18
4	600016	民生银行	196,100	1,751,173.00	1.94
5	600104	上汽集团	75,300	1,527,837.00	1.69
6	600000	浦发银行	95,460	1,486,312.20	1.65
7	601169	北京银行	140,700	1,459,059.00	1.62
8	601377	兴业证券	172,200	1,272,558.00	1.41
9	002415	海康威视	58,200	1,248,972.00	1.38
10	601336	新华保险	29,700	1,199,880.00	1.33
11	601818	光大银行	315,300	1,185,528.00	1.31
12	600153	建发股份	95,300	1,143,600.00	1.27
13	000069	华侨城 A	178,200	1,140,480.00	1.26
14	000623	吉林敖东	42,200	1,052,890.00	1.17
15	000402	金融街	104,500	1,015,740.00	1.13
16	600637	东方明珠	40,500	982,935.00	1.09
17	600048	保利地产	113,300	977,779.00	1.08
18	601618	中国中冶	262,400	968,256.00	1.07
19	600028	中国石化	193,800	914,736.00	1.01
20	601888	中国国旅	20,200	888,396.00	0.98
21	600642	申能股份	152,500	875,350.00	0.97
22	601898	中煤能源	162,200	836,952.00	0.93
23	600999	招商证券	50,090	826,485.00	0.92
24	000166	申万宏源	97,100	816,611.00	0.91
25	600485	信威集团	45,400	809,936.00	0.90
26	000060	中金岭南	76,700	799,981.00	0.89

27	600030	中信证券	47,000	762,810.00	0.85
28	600585	海螺水泥	51,900	754,626.00	0.84
29	600208	新湖中宝	177,900	752,517.00	0.83
30	300085	银之杰	24,900	744,510.00	0.83
31	600018	上港集团	142,100	724,710.00	0.80
32	600373	中文传媒	34,800	722,100.00	0.80
33	601328	交通银行	123,967	697,934.21	0.77
34	600406	国电南瑞	51,800	692,566.00	0.77
35	000895	双汇发展	32,900	686,952.00	0.76
36	300104	乐视网	12,900	682,539.00	0.76
37	601333	广深铁路	173,400	677,994.00	0.75
38	600519	贵州茅台	2,300	671,416.00	0.74
39	600900	长江电力	53,400	666,966.00	0.74
40	000725	京东方 A	283,600	655,116.00	0.73
41	000028	国药一致	10,000	651,000.00	0.72
42	601628	中国人寿	30,619	637,487.58	0.71
43	600352	浙江龙盛	73,200	630,984.00	0.70
44	600741	华域汽车	44,000	616,440.00	0.68
45	002739	万达院线	7,700	615,230.00	0.68
46	000728	国元证券	36,300	606,936.00	0.67
47	601099	太平洋	97,700	598,901.00	0.66
48	600252	中恒集团	134,600	584,164.00	0.65
49	601009	南京银行	60,700	569,973.00	0.63
50	600223	鲁商置业	107,600	548,760.00	0.61
51	600578	京能电力	125,300	536,284.00	0.59
52	600271	航天信息	22,500	535,500.00	0.59
53	600682	南京新百	18,700	532,389.00	0.59
54	600804	鹏博士	28,900	526,847.00	0.58
55	600827	百联股份	43,600	526,688.00	0.58
56	600816	安信信托	31,100	524,657.00	0.58
57	600998	九州通	29,700	520,047.00	0.58
58	600005	武钢股份	187,900	518,604.00	0.57
59	002465	海格通信	41,566	517,081.04	0.57
60	000709	河钢股份	184,100	509,957.00	0.57
61	600011	华能国际	66,600	500,832.00	0.56
62	600863	内蒙华电	164,600	497,092.00	0.55
63	601608	中信重工	92,200	495,114.00	0.55
64	000800	一汽轿车	45,000	489,600.00	0.54
65	002420	毅昌股份	55,800	485,460.00	0.54
66	601988	中国银行	150,400	482,784.00	0.54
67	002450	康得新	28,000	478,800.00	0.53
68	601866	中海集运	120,900	478,764.00	0.53
69	600196	复星医药	25,100	477,402.00	0.53
70	601688	华泰证券	24,800	469,216.00	0.52

71	601933	永辉超市	112,500	464,625.00	0.52
72	601718	际华集团	60,200	459,928.00	0.51
73	000503	海虹控股	11,400	458,394.00	0.51
74	300315	掌趣科技	43,400	455,266.00	0.50
75	002027	分众传媒	26,800	442,468.00	0.49
76	600795	国电电力	145,100	425,143.00	0.47
77	600068	葛洲坝	71,000	413,220.00	0.46
78	600309	万华化学	21,600	373,680.00	0.41
79	600535	天士力	10,200	364,752.00	0.40
80	000785	武汉中商	31,800	354,570.00	0.39
81	000826	启迪桑德	11,100	339,105.00	0.38
82	601098	中南传媒	18,300	331,413.00	0.37
83	000690	宝新能源	48,600	329,508.00	0.37
84	000776	广发证券	19,350	324,306.00	0.36
85	000157	中联重科	76,100	314,293.00	0.35
86	601288	农业银行	94,800	303,360.00	0.34
87	600570	恒生电子	4,500	300,465.00	0.33
88	002294	信立泰	10,700	291,040.00	0.32
89	600886	国投电力	43,200	285,120.00	0.32
90	000100	TCL 集团	85,500	281,295.00	0.31
91	600867	通化东宝	13,400	277,246.00	0.31
92	601111	中国国航	40,800	275,808.00	0.31
93	600021	上海电力	26,712	274,332.24	0.30
94	600115	东方航空	41,300	272,993.00	0.30
95	601633	长城汽车	32,100	270,924.00	0.30
96	002195	二三四五	22,000	270,380.00	0.30
97	600703	三安光电	13,300	265,601.00	0.29
98	002594	比亚迪	4,300	262,343.00	0.29
99	000538	云南白药	4,000	257,200.00	0.29
100	002236	大华股份	19,550	256,105.00	0.28
101	600666	奥瑞德	7,300	253,748.00	0.28
102	002064	华峰氨纶	52,300	251,040.00	0.28
103	000926	福星股份	21,300	249,849.00	0.28
104	600683	京投发展	26,989	249,378.36	0.28
105	600426	华鲁恒升	28,200	248,442.00	0.28
106	601339	百隆东方	39,100	248,285.00	0.28
107	600572	康恩贝	38,300	248,184.00	0.28
108	601100	恒立液压	21,200	247,192.00	0.27
109	002486	嘉麟杰	52,800	247,104.00	0.27
110	600657	信达地产	49,600	247,008.00	0.27
111	000888	峨眉山 A	20,500	246,820.00	0.27
112	002333	罗普斯金	25,100	244,474.00	0.27
113	002051	中工国际	12,400	243,908.00	0.27
114	601857	中国石油	33,600	242,928.00	0.27

115	300145	中金环境	11,100	242,868.00	0.27
116	601398	工商银行	54,000	239,760.00	0.27
117	002034	美欣达	6,600	237,468.00	0.26
118	600348	阳泉煤业	36,500	232,505.00	0.26
119	601601	中国太保	8,580	232,003.20	0.26
120	600221	海南航空	72,900	231,093.00	0.26
121	600066	宇通客车	11,500	227,700.00	0.25
122	000488	晨鸣纸业	28,500	226,290.00	0.25
123	600100	同方股份	15,100	225,896.00	0.25
124	601006	大秦铁路	34,600	222,824.00	0.25
125	000935	四川双马	32,900	221,417.00	0.25
126	600111	北方稀土	16,500	219,615.00	0.24
127	600425	青松建化	51,400	218,450.00	0.24
128	002399	海普瑞	12,500	218,250.00	0.24
129	600428	中远航运	38,200	214,302.00	0.24
130	600170	上海建工	55,000	210,650.00	0.23
131	000540	中天城投	33,600	209,328.00	0.23
132	000425	徐工机械	68,400	209,304.00	0.23
133	600369	西南证券	28,800	209,088.00	0.23
134	601668	中国建筑	39,200	208,544.00	0.23
135	601117	中国化学	37,700	208,481.00	0.23
136	601179	中国西电	41,100	208,377.00	0.23
137	600256	广汇能源	50,800	208,280.00	0.23
138	600415	小商品城	33,600	207,648.00	0.23
139	601139	深圳燃气	25,900	207,200.00	0.23
140	002293	罗莱生活	15,100	206,870.00	0.23
141	002238	天威视讯	14,280	206,631.60	0.23
142	000625	长安汽车	15,100	206,417.00	0.23
143	600372	中航电子	10,500	204,435.00	0.23
144	601390	中国中铁	29,100	202,827.00	0.22
145	300255	常山药业	24,400	202,520.00	0.22
146	600895	张江高科	11,200	202,496.00	0.22
147	601021	春秋航空	4,200	201,348.00	0.22
148	600446	金证股份	5,600	201,320.00	0.22
149	002016	世荣兆业	24,200	199,892.00	0.22
150	600031	三一重工	39,400	197,788.00	0.22
151	600239	云南城投	42,600	197,664.00	0.22
152	601919	中国远洋	38,500	195,580.00	0.22
153	600027	华电国际	39,400	195,030.00	0.22
154	600007	中国国贸	9,600	193,920.00	0.21
155	600157	永泰能源	49,100	193,454.00	0.21
156	002424	贵州百灵	11,200	192,640.00	0.21
157	000729	燕京啤酒	25,300	192,027.00	0.21
158	000056	皇庭国际	7,500	191,100.00	0.21



159	300146	汤臣倍健	14,100	190,914.00	0.21
160	600820	隧道股份	22,500	188,775.00	0.21
161	002081	金螳螂	18,800	188,376.00	0.21
162	300019	硅宝科技	10,100	181,699.00	0.20
163	600383	金地集团	17,300	179,228.00	0.20
164	600061	国投安信	10,000	178,200.00	0.20
165	600518	康美药业	11,700	177,723.00	0.20
166	601669	中国电建	31,000	177,010.00	0.20
167	000793	华闻传媒	17,900	176,852.00	0.20
168	000778	新兴铸管	37,300	173,072.00	0.19
169	601991	大唐发电	43,800	170,382.00	0.19
170	600074	保千里	11,200	167,104.00	0.19
171	603456	九洲药业	6,400	165,248.00	0.18
172	000537	广宇发展	16,800	134,568.00	0.15
173	600887	伊利股份	7,900	131,693.00	0.15
174	601808	中海油服	9,200	111,780.00	0.12
175	600398	海澜之家	9,200	103,960.00	0.12
176	002630	华西能源	8,900	98,434.00	0.11
177	601088	中国神华	5,799	81,591.93	0.09
178	000156	华数传媒	3,400	63,070.00	0.07
179	000876	新希望	6,500	54,080.00	0.06
180	002059	云南旅游	6,200	53,072.00	0.06
181	600649	城投控股	3,300	47,388.00	0.05
182	002304	洋河股份	600	43,152.00	0.05
183	600583	海油工程	6,100	42,151.00	0.05
184	000963	华东医药	500	33,700.00	0.04
185	600038	中直股份	747	30,985.56	0.03
186	600893	中航动力	600	20,790.00	0.02
187	600340	华夏幸福	800	19,504.00	0.02
188	600718	东软集团	900	16,488.00	0.02
189	600188	兖州煤业	900	9,846.00	0.01
190	300426	唐德影视	100	6,820.00	0.01
191	002007	华兰生物	200	6,280.00	0.01
192	300133	华策影视	300	4,671.00	0.01
193	300027	华谊兄弟	200	2,708.00	0.00
194	600109	国金证券	200	2,696.00	0.00
195	002595	豪迈科技	100	2,137.00	0.00
196	000027	深圳能源	300	1,914.00	0.00
197	600270	外运发展	100	1,749.00	0.00
198	000910	大亚科技	100	1,545.00	0.00
199	002250	联化科技	100	1,432.00	0.00
200	002700	新疆浩源	100	1,428.00	0.00
201	600688	上海石化	200	1,220.00	0.00
202	601998	中信银行	201	1,139.67	0.00

203	000811	烟台冰轮	100	1,122.00	0.00
204	000708	大冶特钢	100	1,120.00	0.00
205	000978	桂林旅游	100	1,051.00	0.00
206	600010	包钢股份	300	858.00	0.00
207	600261	阳光照明	100	706.00	0.00
208	600693	东百集团	100	672.00	0.00
209	601369	陕鼓动力	100	638.00	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	601998	中信银行	13,485,269.03	14.89
2	600036	招商银行	13,140,393.33	14.51
3	600016	民生银行	12,475,939.03	13.78
4	601818	光大银行	11,207,004.29	12.37
5	601318	中国平安	10,188,139.81	11.25
6	601601	中国太保	9,892,853.07	10.92
7	601988	中国银行	8,782,913.70	9.70
8	600015	华夏银行	8,539,109.48	9.43
9	002142	宁波银行	8,396,084.63	9.27
10	000001	平安银行	8,032,443.70	8.87
11	601398	工商银行	8,007,159.00	8.84
12	601336	新华保险	8,004,670.00	8.84
13	000898	鞍钢股份	7,767,801.68	8.58
14	603885	吉祥航空	7,625,855.14	8.42
15	601169	北京银行	7,484,813.85	8.26
16	601238	广汽集团	7,480,163.13	8.26
17	600000	浦发银行	7,443,178.18	8.22
18	601939	建设银行	7,415,347.00	8.19
19	002475	立讯精密	7,120,809.65	7.86
20	000895	双汇发展	6,948,079.53	7.67
21	600804	鹏博士	6,886,220.02	7.60
22	002146	荣盛发展	6,867,141.93	7.58
23	601628	中国人寿	6,742,384.95	7.44
24	600415	小商品城	6,738,529.09	7.44
25	601009	南京银行	6,736,253.09	7.44
26	600741	华域汽车	6,661,474.70	7.36
27	601288	农业银行	6,656,889.00	7.35
28	600398	海澜之家	6,515,476.15	7.19

29	601618	中国中冶	6,487,771.18	7.16
30	600208	新湖中宝	6,407,090.15	7.07
31	600900	长江电力	6,297,117.45	6.95
32	000963	华东医药	6,276,108.25	6.93
33	000069	华侨城 A	6,201,415.13	6.85
34	601328	交通银行	6,192,214.14	6.84
35	002236	大华股份	6,043,536.42	6.67
36	600637	东方明珠	6,008,416.84	6.63
37	002594	比亚迪	5,961,067.43	6.58
38	600998	九州通	5,941,919.75	6.56
39	601800	中国交建	5,866,738.02	6.48
40	600705	中航资本	5,856,399.24	6.47
41	600837	海通证券	5,811,828.85	6.42
42	000712	锦龙股份	5,785,874.99	6.39
43	601333	广深铁路	5,767,775.00	6.37
44	601111	中国国航	5,753,414.94	6.35
45	300144	宋城演艺	5,742,029.49	6.34
46	600703	三安光电	5,721,524.66	6.32
47	601888	中国国旅	5,570,615.65	6.15
48	000046	泛海控股	5,520,922.80	6.10
49	600688	上海石化	5,502,691.96	6.08
50	601098	中南传媒	5,477,587.81	6.05
51	600060	海信电器	5,473,844.51	6.04
52	002465	海格通信	5,460,974.64	6.03
53	000539	粤电力 A	5,426,981.18	5.99
54	600309	万华化学	5,332,729.45	5.89
55	000937	冀中能源	5,297,990.36	5.85
56	000825	太钢不锈	5,296,494.51	5.85
57	601688	华泰证券	5,276,773.04	5.83
58	600674	川投能源	5,237,147.25	5.78
59	600372	中航电子	5,227,826.37	5.77
60	600028	中国石化	5,201,721.18	5.74
61	600188	兖州煤业	5,186,491.10	5.73
62	002736	国信证券	5,168,439.93	5.71
63	600350	山东高速	5,037,955.47	5.56
64	601898	中煤能源	4,986,267.00	5.51
65	600196	复星医药	4,951,113.68	5.47
66	600585	海螺水泥	4,837,966.77	5.34
67	601186	中国铁建	4,812,417.86	5.31
68	000540	中天城投	4,806,384.54	5.31
69	000402	金融街	4,784,112.58	5.28
70	000157	中联重科	4,777,553.48	5.28
71	601231	环旭电子	4,761,460.87	5.26
72	600999	招商证券	4,751,738.26	5.25

73	601179	中国西电	4,612,649.66	5.09
74	601992	金隅股份	4,608,817.63	5.09
75	600535	天士力	4,602,625.03	5.08
76	002415	海康威视	4,565,871.09	5.04
77	002410	广联达	4,480,895.57	4.95
78	601933	永辉超市	4,471,642.90	4.94
79	600104	上汽集团	4,443,543.38	4.91
80	600027	华电国际	4,443,399.00	4.91
81	000826	启迪桑德	4,442,981.98	4.91
82	000425	徐工机械	4,404,560.00	4.86
83	600383	金地集团	4,363,947.90	4.82
84	002470	金正大	4,293,368.34	4.74
85	600660	福耀玻璃	4,271,491.54	4.72
86	600011	华能国际	4,249,707.24	4.69
87	600038	中直股份	4,228,550.40	4.67
88	002304	洋河股份	4,224,454.14	4.66
89	000166	申万宏源	4,221,688.00	4.66
90	000039	中集集团	4,203,555.96	4.64
91	000783	长江证券	4,192,973.26	4.63
92	601866	中海集运	4,190,007.16	4.63
93	600029	南方航空	4,164,361.08	4.60
94	600373	中文传媒	4,161,510.10	4.59
95	600066	宇通客车	4,148,231.48	4.58
96	002294	信立泰	4,139,394.66	4.57
97	601021	春秋航空	4,089,495.68	4.52
98	600690	青岛海尔	4,057,007.00	4.48
99	600827	百联股份	3,934,911.00	4.34
100	600340	华夏幸福	3,910,654.98	4.32
101	000060	中金岭南	3,869,410.00	4.27
102	000728	国元证券	3,851,613.15	4.25
103	600406	国电南瑞	3,750,186.92	4.14
104	002038	双鹭药业	3,736,924.59	4.13
105	600783	鲁信创投	3,713,387.09	4.10
106	600276	恒瑞医药	3,700,870.69	4.09
107	600157	永泰能源	3,693,180.67	4.08
108	600578	京能电力	3,682,070.62	4.07
109	300124	汇川技术	3,660,971.73	4.04
110	600048	保利地产	3,649,295.00	4.03
111	000778	新兴铸管	3,636,139.98	4.01
112	603993	洛阳钼业	3,625,643.15	4.00
113	600886	国投电力	3,605,997.15	3.98
114	603288	海天味业	3,564,945.54	3.94
115	002024	苏宁云商	3,541,896.00	3.91
116	000686	东北证券	3,513,486.04	3.88

117	000623	吉林敖东	3,508,056.85	3.87
118	002153	石基信息	3,502,640.06	3.87
119	600648	外高桥	3,496,330.00	3.86
120	000999	华润三九	3,486,156.75	3.85
121	600369	西南证券	3,464,867.00	3.83
122	600332	白云山	3,433,403.49	3.79
123	600867	通化东宝	3,425,934.00	3.78
124	600021	上海电力	3,367,763.30	3.72
125	000100	TCL 集团	3,306,578.00	3.65
126	000400	许继电气	3,306,027.40	3.65
127	601117	中国化学	3,299,401.99	3.64
128	600718	东软集团	3,281,851.00	3.62
129	000729	燕京啤酒	3,278,485.08	3.62
130	000876	新 希 望	3,277,518.41	3.62
131	000800	一汽轿车	3,256,872.03	3.60
132	600018	上港集团	3,195,171.66	3.53
133	000568	泸州老窖	3,172,540.21	3.50
134	600317	营口港	3,165,121.42	3.49
135	600583	海油工程	3,163,915.00	3.49
136	600256	广汇能源	3,162,383.44	3.49
137	601377	兴业证券	3,158,104.92	3.49
138	600863	内蒙华电	3,125,500.58	3.45
139	600050	中国联通	3,123,814.00	3.45
140	000027	深圳能源	3,114,032.90	3.44
141	002202	金风科技	3,113,054.45	3.44
142	300059	东方财富	3,101,166.91	3.42
143	601607	上海医药	3,095,357.52	3.42
144	601608	中信重工	3,083,150.31	3.40
145	002241	歌尔股份	3,040,310.88	3.36
146	600633	浙报传媒	3,019,425.54	3.33
147	002500	山西证券	2,989,229.14	3.30
148	000338	潍柴动力	2,972,996.00	3.28
149	601668	中国建筑	2,964,036.00	3.27
150	002007	华兰生物	2,961,648.00	3.27
151	601633	长城汽车	2,894,570.72	3.20
152	601991	大唐发电	2,892,972.00	3.19
153	002008	大族激光	2,875,337.72	3.17
154	601016	节能风电	2,844,897.99	3.14
155	600115	东方航空	2,835,934.75	3.13
156	600030	中信证券	2,772,350.54	3.06
157	002399	海普瑞	2,760,916.29	3.05
158	600887	伊利股份	2,758,038.00	3.05
159	000831	*ST 五稀	2,719,314.00	3.00
160	601225	陕西煤业	2,690,675.62	2.97

161	600485	信威集团	2,682,538.00	2.96
162	300058	蓝色光标	2,655,021.65	2.93
163	000423	东阿阿胶	2,620,176.90	2.89
164	601958	金钼股份	2,609,420.24	2.88
165	300027	华谊兄弟	2,582,440.77	2.85
166	601919	中国远洋	2,534,073.00	2.80
167	600005	武钢股份	2,529,563.00	2.79
168	600019	宝钢股份	2,526,064.60	2.79
169	000883	湖北能源	2,524,013.00	2.79
170	300003	乐普医疗	2,498,668.95	2.76
171	300133	华策影视	2,490,143.56	2.75
172	000156	华数传媒	2,461,397.18	2.72
173	000629	*ST 钒钛	2,445,816.00	2.70
174	601211	国泰君安	2,432,271.70	2.69
175	600089	特变电工	2,416,551.00	2.67
176	601808	中海油服	2,394,304.90	2.64
177	601088	中国神华	2,392,369.37	2.64
178	600642	申能股份	2,388,959.00	2.64
179	002195	二三四五	2,380,654.28	2.63
180	600068	葛洲坝	2,366,298.48	2.61
181	600221	海南航空	2,349,025.00	2.59
182	000061	农产品	2,343,540.16	2.59
183	300015	爱尔眼科	2,340,547.58	2.58
184	001979	招商蛇口	2,324,536.00	2.57
185	300070	碧水源	2,292,614.37	2.53
186	601857	中国石油	2,271,787.00	2.51
187	000776	广发证券	2,270,514.50	2.51
188	600362	江西铜业	2,269,298.90	2.51
189	601018	宁波港	2,260,645.00	2.50
190	600352	浙江龙盛	2,250,868.00	2.49
191	600570	恒生电子	2,242,578.00	2.48
192	002385	大北农	2,239,928.22	2.47
193	600717	天津港	2,189,754.40	2.42
194	600547	山东黄金	2,176,370.00	2.40
195	601928	凤凰传媒	2,158,619.55	2.38
196	600166	福田汽车	2,156,528.00	2.38
197	000063	中兴通讯	2,139,140.10	2.36
198	601872	招商轮船	2,109,924.76	2.33
199	601158	重庆水务	2,089,700.00	2.31
200	601899	紫金矿业	2,067,965.00	2.28
201	600010	包钢股份	2,064,831.00	2.28
202	600820	隧道股份	2,058,593.00	2.27
203	601099	太平洋	2,054,052.00	2.27
204	000858	五粮液	2,052,740.00	2.27

205	600252	中恒集团	2,048,957.00	2.26
206	600315	上海家化	2,040,562.00	2.25
207	000709	河钢股份	2,009,108.00	2.22
208	601339	百隆东方	2,002,250.63	2.21
209	600649	城投控股	1,974,086.53	2.18
210	002422	科伦药业	1,952,722.48	2.16
211	600839	四川长虹	1,945,171.00	2.15
212	300146	汤臣倍健	1,935,928.95	2.14
213	002081	金螳螂	1,910,330.76	2.11
214	300104	乐视网	1,839,177.13	2.03

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	601998	中信银行	14,743,526.52	16.28
2	601818	光大银行	13,988,080.00	15.44
3	600016	民生银行	11,467,654.97	12.66
4	601601	中国太保	10,298,254.77	11.37
5	600015	华夏银行	10,155,633.45	11.21
6	600036	招商银行	10,155,601.89	11.21
7	601318	中国平安	9,491,037.12	10.48
8	601988	中国银行	9,348,597.00	10.32
9	600398	海澜之家	8,879,183.60	9.80
10	000898	鞍钢股份	8,861,279.75	9.78
11	002142	宁波银行	8,754,943.70	9.67
12	601398	工商银行	8,616,566.13	9.51
13	601288	农业银行	8,247,068.16	9.11
14	000001	平安银行	8,118,782.50	8.96
15	002475	立讯精密	7,980,104.92	8.81
16	601939	建设银行	7,949,307.92	8.78
17	603885	吉祥航空	7,871,707.75	8.69
18	601238	广汽集团	7,598,426.07	8.39
19	600415	小商品城	7,082,105.81	7.82
20	601336	新华保险	6,913,857.60	7.63
21	000963	华东医药	6,828,255.92	7.54
22	002146	荣盛发展	6,823,049.99	7.53
23	601111	中国国航	6,800,852.19	7.51
24	000825	太钢不锈	6,720,261.00	7.42
25	600188	兖州煤业	6,718,360.30	7.42

26	600804	鹏博士	6,655,533.58	7.35
27	600703	三安光电	6,600,238.87	7.29
28	000895	双汇发展	6,333,434.71	6.99
29	600000	浦发银行	6,275,659.68	6.93
30	601009	南京银行	6,213,735.20	6.86
31	601800	中国交建	6,198,011.43	6.84
32	601169	北京银行	6,096,517.32	6.73
33	000539	粤电力 A	6,094,485.09	6.73
34	002594	比亚迪	6,086,152.00	6.72
35	601628	中国人寿	6,084,537.60	6.72
36	600705	中航资本	6,080,934.98	6.71
37	600741	华域汽车	6,015,371.92	6.64
38	600208	新湖中宝	5,997,646.80	6.62
39	300144	宋城演艺	5,909,106.01	6.52
40	002304	洋河股份	5,870,820.63	6.48
41	601992	金隅股份	5,768,040.65	6.37
42	000712	锦龙股份	5,747,397.62	6.35
43	600196	复星医药	5,729,506.69	6.33
44	002236	大华股份	5,717,993.22	6.31
45	000937	冀中能源	5,709,535.92	6.30
46	600027	华电国际	5,642,015.02	6.23
47	002736	国信证券	5,607,883.99	6.19
48	600060	海信电器	5,596,198.03	6.18
49	600900	长江电力	5,595,840.57	6.18
50	601328	交通银行	5,537,186.94	6.11
51	000783	长江证券	5,517,663.01	6.09
52	000046	泛海控股	5,517,432.60	6.09
53	601898	中煤能源	5,507,300.49	6.08
54	601618	中国中冶	5,403,842.30	5.97
55	600688	上海石化	5,389,953.00	5.95
56	002465	海格通信	5,381,469.10	5.94
57	600998	九州通	5,380,742.78	5.94
58	600276	恒瑞医药	5,346,297.31	5.90
59	600674	川投能源	5,222,418.85	5.77
60	600028	中国石化	5,197,159.41	5.74
61	600999	招商证券	5,185,074.80	5.73
62	600372	中航电子	5,144,297.20	5.68
63	601098	中南传媒	5,108,557.03	5.64
64	601333	广深铁路	5,096,935.50	5.63
65	600309	万华化学	5,021,232.17	5.54
66	000069	华侨城 A	4,941,309.00	5.46
67	000425	徐工机械	4,936,571.00	5.45
68	600350	山东高速	4,912,063.18	5.42
69	601021	春秋航空	4,859,316.07	5.37



70	601888	中国国旅	4,842,586.79	5.35
71	600637	东方明珠	4,826,719.51	5.33
72	601231	环旭电子	4,824,575.69	5.33
73	601688	华泰证券	4,819,626.25	5.32
74	601179	中国西电	4,756,609.11	5.25
75	601186	中国铁建	4,694,528.60	5.18
76	000540	中天城投	4,640,562.56	5.12
77	600029	南方航空	4,614,939.73	5.10
78	600535	天士力	4,551,435.90	5.03
79	600660	福耀玻璃	4,545,169.16	5.02
80	000157	中联重科	4,489,474.26	4.96
81	600066	宇通客车	4,428,253.74	4.89
82	000826	启迪桑德	4,427,001.89	4.89
83	600585	海螺水泥	4,420,371.63	4.88
84	000039	中集集团	4,337,972.97	4.79
85	002410	广联达	4,332,159.18	4.78
86	600038	中直股份	4,306,524.93	4.76
87	600383	金地集团	4,284,261.53	4.73
88	002470	金正大	4,235,895.37	4.68
89	601788	光大证券	4,224,157.70	4.66
90	601899	紫金矿业	4,070,017.63	4.49
91	601933	永辉超市	4,068,855.61	4.49
92	603993	洛阳钼业	4,042,798.11	4.46
93	600578	京能电力	4,022,660.93	4.44
94	600867	通化东宝	3,981,495.10	4.40
95	600690	青岛海尔	3,979,450.05	4.39
96	002153	石基信息	3,979,041.63	4.39
97	600837	海通证券	3,978,873.83	4.39
98	600332	白云山	3,977,042.64	4.39
99	000400	许继电气	3,971,589.79	4.39
100	002038	双鹭药业	3,953,737.25	4.37
101	603288	海天味业	3,953,433.20	4.37
102	000402	金融街	3,879,136.00	4.28
103	600340	华夏幸福	3,876,915.00	4.28
104	002294	信立泰	3,861,672.15	4.26
105	601991	大唐发电	3,759,410.68	4.15
106	002024	苏宁云商	3,756,116.99	4.15
107	600011	华能国际	3,734,963.37	4.12
108	600783	鲁信创投	3,725,026.75	4.11
109	600406	国电南瑞	3,689,433.00	4.07
110	300124	汇川技术	3,660,283.68	4.04
111	600317	营口港	3,638,953.18	4.02
112	002415	海康威视	3,623,367.12	4.00
113	600256	广汇能源	3,609,231.81	3.99

114	601866	中海集运	3,600,517.62	3.98
115	600648	外高桥	3,549,671.90	3.92
116	000686	东北证券	3,544,755.20	3.91
117	002007	华兰生物	3,538,274.01	3.91
118	000999	华润三九	3,505,986.09	3.87
119	600827	百联股份	3,504,921.65	3.87
120	600373	中文传媒	3,457,637.15	3.82
121	600019	宝钢股份	3,435,552.00	3.79
122	600157	永泰能源	3,431,946.00	3.79
123	601607	上海医药	3,427,264.42	3.78
124	000166	申万宏源	3,423,935.61	3.78
125	000728	国元证券	3,389,513.35	3.74
126	300059	东方财富	3,371,459.69	3.72
127	000778	新兴铸管	3,366,903.40	3.72
128	600718	东软集团	3,365,180.83	3.72
129	600886	国投电力	3,326,513.31	3.67
130	600633	浙报传媒	3,313,679.50	3.66
131	000568	泸州老窖	3,307,318.50	3.65
132	600369	西南证券	3,303,325.23	3.65
133	300003	乐普医疗	3,293,913.21	3.64
134	000876	新 希 望	3,286,495.00	3.63
135	000729	燕京啤酒	3,285,703.00	3.63
136	002202	金风科技	3,248,921.00	3.59
137	002500	山西证券	3,215,590.00	3.55
138	600583	海油工程	3,155,619.00	3.48
139	000060	中金岭南	3,138,440.00	3.47
140	601117	中国化学	3,090,711.75	3.41
141	002241	歌尔股份	3,075,338.00	3.40
142	000027	深圳能源	3,074,340.53	3.39
143	600050	中国联通	3,020,319.00	3.33
144	000338	潍柴动力	2,992,880.00	3.30
145	600021	上海电力	2,973,100.00	3.28
146	002008	大族激光	2,967,732.08	3.28
147	000100	TCL 集团	2,964,666.00	3.27
148	601857	中国石油	2,954,645.00	3.26
149	600104	上汽集团	2,943,716.53	3.25
150	600863	内蒙华电	2,805,401.50	3.10
151	601016	节能风电	2,790,454.00	3.08
152	000800	一汽轿车	2,754,961.25	3.04
153	300015	爱尔眼科	2,751,601.80	3.04
154	601668	中国建筑	2,712,314.58	2.99
155	600887	伊利股份	2,707,005.00	2.99
156	600048	保利地产	2,685,811.50	2.97
157	000423	东阿阿胶	2,672,002.73	2.95

158	601633	长城汽车	2,668,357.37	2.95
159	601608	中信重工	2,644,213.00	2.92
160	002399	海普瑞	2,641,891.10	2.92
161	000061	农产品	2,638,761.18	2.91
162	601958	金钼股份	2,631,971.00	2.91
163	300133	华策影视	2,630,035.54	2.90
164	601919	中国远洋	2,587,576.00	2.86
165	000831	*ST 五稀	2,580,804.75	2.85
166	300027	华谊兄弟	2,552,766.00	2.82
167	600115	东方航空	2,531,851.95	2.80
168	601225	陕西煤业	2,531,349.80	2.79
169	000883	湖北能源	2,528,183.00	2.79
170	300058	蓝色光标	2,522,557.81	2.79
171	601928	凤凰传媒	2,512,521.00	2.77
172	300070	碧水源	2,482,323.00	2.74
173	600018	上港集团	2,452,545.84	2.71
174	000623	吉林敖东	2,426,334.00	2.68
175	600166	福田汽车	2,397,784.90	2.65
176	001979	招商蛇口	2,396,224.68	2.65
177	600089	特变电工	2,380,162.45	2.63
178	000156	华数传媒	2,339,922.83	2.58
179	601018	宁波港	2,313,966.00	2.55
180	601211	国泰君安	2,307,028.00	2.55
181	601088	中国神华	2,303,834.50	2.54
182	300017	网宿科技	2,296,481.96	2.54
183	600315	上海家化	2,294,968.21	2.53
184	000629	*ST 钒钛	2,293,084.00	2.53
185	002385	大北农	2,288,326.25	2.53
186	601808	中海油服	2,270,350.89	2.51
187	600547	山东黄金	2,252,943.22	2.49
188	600362	江西铜业	2,239,153.12	2.47
189	002195	二三四五	2,217,296.82	2.45
190	000858	五粮液	2,175,739.83	2.40
191	600717	天津港	2,171,126.68	2.40
192	000063	中兴通讯	2,157,987.62	2.38
193	600221	海南航空	2,142,466.96	2.37
194	600570	恒生电子	2,120,001.00	2.34
195	600030	中信证券	2,103,745.00	2.32
196	601158	重庆水务	2,078,829.10	2.30
197	601872	招商轮船	2,043,004.86	2.26
198	600010	包钢股份	2,031,134.00	2.24
199	600005	武钢股份	2,022,970.00	2.23
200	000776	广发证券	2,010,186.00	2.22
201	600649	城投控股	1,971,572.01	2.18

202	002422	科伦药业	1,926,309.54	2.13
203	600068	葛洲坝	1,923,108.00	2.12
204	600839	四川长虹	1,916,195.00	2.12
205	600485	信威集团	1,911,704.03	2.11
206	600820	隧道股份	1,853,032.00	2.05
207	002081	金螳螂	1,835,050.40	2.03
208	002292	奥飞娱乐	1,817,290.42	2.01

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,159,037,968.09
卖出股票的收入（成交）总额	1,153,015,095.78

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

##### 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

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	175,967.56
2	应收证券清算款	1,504,729.21
3	应收股利	-
4	应收利息	2,892.42
5	应收申购款	663,469.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,347,058.35
---	----	--------------

#### 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	834	30,544.77	0.00	0.00%	25,474,341.89	100.00%
华安沪深 300 增强 C	1,386	29,311.11	0.00	0.00%	40,625,201.09	100.00%
合计	2,220	29,774.57	0.00	0.00%	66,099,542.98	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

本基金的基金管理人所有从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 0。

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 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	22,402,071.35	37,622,736.34
本报告期基金总申购份额	5,731,620.20	80,970,134.38
减：本报告期基金总赎回份额	2,659,349.66	77,967,669.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,474,341.89	40,625,201.09

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	2	2,311,963,401.90	100.00%	748,383.15	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. 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
上海证券	57,747.35	100.00%	-	-	-	-



## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新希望”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-12
5	关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-14
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“京能电力”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-14
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新海宜”、“蓝色光标”、“宁波港”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-16
8	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
9	关于旗下部分基金增加泰信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	2016-01-25
10	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-03
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“卓翼科技”、“浦发银行”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-19
12	关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
13	关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25

		司网站	
14	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24
15	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
16	关于华安旗下基金参加工商银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
17	关于旗下部分基金参加东亚银行(中国)有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
18	关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
19	华安基金管理有限公司关于以自有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
20	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
21	关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
22	关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-26
23	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
24	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
25	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
26	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
27	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-13
28	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优	《上海证券报》、《证券时	-

	惠的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
29	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“光线传媒”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
30	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州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	2016-05-25
31	关于旗下部分基金增加大连银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-28
32	关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-02
33	关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-03
34	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-03
35	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
36	关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-14
37	关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-21
38	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	2016-06-23
39	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28

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

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 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

二〇一六年八月二十六日