

**华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
2013 年半年度报告
2013 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 19 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

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

10	重大事件揭示.....	3
10.1	基金份额持有人大会决议	3
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	3
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	3
10.4	基金投资策略的改变	3
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	3
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	3
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	3
10.8	其他重大事件.....	3
11	备查文件目录.....	3
11.1	备查文件目录.....	3
11.2	存放地点.....	3
11.3	查阅方式.....	3

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安深证300指数证券投资基金(LOF)
基金简称	华安深证300指数(LOF)(场内简称:华安S300)
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月2日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	277,372,277.89份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳
上市日期	2011年10月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	95%×深证300价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 冯颖	唐州徽

	联系电话	021-38969999	95566
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		李勍	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,055,743.64
本期利润	-11,899,815.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0391
本期加权平均净值利润率	-4.34%
本期基金份额净值增长率	-6.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-53,435,752.15
期末可供分配基金份额利润	-0.1926
期末基金资产净值	223,936,525.74
期末基金份额净值	0.807
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-19.30%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 1 个月	-15.14%	1.89%	-14.93%	1.94%	-0.21%	-0.05%
过去 3 个月	-8.40%	1.46%	-7.54%	1.49%	-0.86%	-0.03%
过去 6 个月	-6.71%	1.39%	-5.03%	1.43%	-1.68%	-0.04%
过去 1 年	-10.13%	1.36%	-8.64%	1.37%	-1.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-19.30%	1.37%	-24.50%	1.41%	5.20%	-0.04%

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

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011 年 9 月 2 日至 2013 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 只封闭式证券投资基金，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、华安双月鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、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、华安安信消费等 38 只开放式基金。管理资产规模达到 782.67 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数投资部高级总监	2011-09-02	-	9年	理学博士，8年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008年4月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009年9月起同时担任华安上证 180ETF 及 180ETF 联接基金的基金经理。2010年11月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任本基金的基金经理。

- 注：1、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。
 2、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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）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，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、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，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 2 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单只股票的数量极少，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

上半年，美国经济温和复苏，其他海外市场依然维持弱复苏。国内宏观经济延续增速下降趋势，经济转型的压力凸显，传统型行业，包括煤炭、钢铁、机械等行业出现较大幅度的调整。国内并没有出台比较积极的财政和货币政策，相反，对银行、信托等加强了监管，六月份银行间流动性出现异常趋近。A 股市场主板出现了幅度的调整，但市场分化加剧，创业板出现较大幅度的上涨，信息技术、医药、电子等为代表的新兴产业表现优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内深 300LOF 基金份额净值增长率为 -6.71%，同期业绩比较基准增长率为 -5.03%，基金净值表现落后比较基准 1.68%，主要是在此期间的申购和赎回冲击造成的。上半年日跟踪误差为 0.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，国内经济增长下降趋势将得到缓解，国内依然存在长期维持较高增长动力和需求，另一方面，国内推出相对温的政策依然是值得期待，譬如在棚户区改造、信息技术建设、节能环保的投入、医疗教育、文化产业等方面还将新的亮点。

作为深证市场代表的宽基指数，深证 300 指数覆盖度广，包括深证市场的蓝筹股，也包括电子、信息技术等新兴产业。我们认为深 300 指数已经具有较好的中长期投资价值。作为深证 300 的管理人，我们将继续秉承既定的投资目标与策略，规范运作、勤勉尽责，充分拟合指数，减少跟踪误差，为投资者提供优质的深证 300 指数投资工具。

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：首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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：

尚志民,工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

翁启森，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。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，负责 QDII 基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金（QDII）、华安大中华升级基金(QDII)的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，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，现任华安优选基金经理、投资研究部总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券、华安 7 日鑫短期理财的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，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，华安中国 A 股增强指数。现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理,指数投资部总监。

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

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,428,308.18	16,079,147.78
结算备付金		342,469.00	93,329.29
存出保证金		62,194.53	24,053.47
交易性金融资产	6.4.7.2	211,784,900.34	245,428,119.90
其中：股票投资		211,730,574.77	245,379,519.90
基金投资		-	-
债券投资		54,325.57	48,600.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,362.67	3,942.57
应收股利		-	-
应收申购款		356,842.60	4,954.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		226,978,077.32	261,633,547.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		1,807,491.92	-
应付赎回款		708,954.71	476,134.73
应付管理人报酬		94,490.68	106,347.97
应付托管费		18,898.13	21,269.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	183,846.55	70,068.34
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	227,869.59	367,765.68
负债合计		3,041,551.58	1,041,586.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	277,372,277.89	301,240,008.96
未分配利润	6.4.7.10	-53,435,752.15	-40,648,047.62
所有者权益合计		223,936,525.74	260,591,961.34
负债和所有者权益总计		226,978,077.32	261,633,547.63

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.807元，基金份额总额277,372,277.89份。

6.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、 收入		-10,180,532.99	27,435,529.99
1. 利息收入		78,356.80	122,631.98
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	78,260.40	75,672.96
债券利息收入		96.40	46,959.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,474,511.16	-10,936,502.19
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	838,560.21	-12,753,069.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	1,635,950.95	1,816,567.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-12,955,559.16	37,978,552.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	222,158.21	270,847.56
减：二、费用		1,719,282.53	2,410,598.38
1. 管理人报酬		679,155.57	840,712.59
2. 托管费		135,831.14	168,142.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	627,682.10	1,098,935.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	276,613.72	302,807.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,899,815.52	25,024,931.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,899,815.52	25,024,931.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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)	301,240,008.96	-40,648,047.62	260,591,961.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,899,815.52	-11,899,815.52
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)	-23,867,731.07	-887,889.01	-24,755,620.08
其中：1.基金申购款	217,071,773.26	-19,564,574.77	197,507,198.49
2.基金赎回款	-240,939,504.33	18,676,685.76	-222,262,818.57
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)	277,372,277.89	-53,435,752.15	223,936,525.74
项目	上年度可比期间		
	2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	399,097,935.44	-65,995,328.68	-333,102,606.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,024,931.61	25,024,931.61
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)	-61,584,841.16	6,679,288.09	-54,905,553.07
其中：1.基金申购款	172,547,976.02	-10,778,813.97	161,769,162.05
2.基金赎回款	-234,132,817.18	17,458,102.06	-216,674,715.12
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)	337,513,094.28	-34,291,108.98	303,221,985.30

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：

基金管理公司负责人：李勍，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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,830,415.01 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意，本基金 146,584,08.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，在封闭期满可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2013 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>}、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。

(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 2013 年 6 月 30 日	
活期存款		14,428,308.18
定期存款		-
其他存款		-
合计		14,428,308.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	246,689,157.50	211,730,574.77	-34,958,582.73
债券	交易所市场	48,600.00	54,325.57
	银行间市场	-	-
	合计	48,600.00	54,325.57
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	246,737,757.50	211,784,900.34	-34,952,857.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,091.15
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	138.69
应收债券利息	103.32
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.31
其他	25.20
合计	3,362.67

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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	183,846.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	183,846.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,334.86
应付后端申购费	-
债券利息税	-
应付指数使用费	50,000.00
预提信息披露费	119,012.93

预提审计费用	27,769.02
预提上市年费	29,752.78
合计	227,869.59

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	301,240,008.96	301,240,008.96
本期申购	217,071,773.26	217,071,773.26
本期赎回(以“-”号填列)	-240,939,504.33	-240,939,504.33
本期末	277,372,277.89	277,372,277.89

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-32,299,525.04	-8,348,522.58	-40,648,047.62
本期利润	1,055,743.64	-12,955,559.16	-11,899,815.52
本期基金份额交易产生的变动数	2,887,384.66	-3,775,273.67	-887,889.01
其中：基金申购款	-23,360,759.17	3,796,184.40	-19,564,574.77
基金赎回款	26,248,143.83	-7,571,458.07	18,676,685.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,356,396.74	-25,079,355.41	-53,435,752.15

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		75,255.00
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		2,650.91
其他		354.49
合计		78,260.40

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	216,519,137.99
减：卖出股票成本总额	215,680,577.78
买卖股票差价收入	838,560.21

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 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,635,950.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,635,950.95

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1.交易性金融资产	-12,955,559.16
——股票投资	-12,961,284.73
——债券投资	5,725.57

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-12,955,559.16

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	222,158.21
合计	222,158.21

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

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	627,682.10
银行间市场交易费用	-
合计	627,682.10

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	27,769.02
信息披露费	99,012.93
银行汇划费用	6,578.99
上市年费	29,752.78
帐户维护费	13,500.00
指数使用费	100,000.00
合计	276,613.72

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

协议书》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的0.02%，收取下限为每季5万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	679,155.57	840,712.59
其中：支付销售机构的客户维护费	250,792.70	200,538.65

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,831.14	168,142.52

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日	期末余额	2012年1月1日至2012年6月30日	当期利息收入
中国银行股份有限公司	14,428,308.18	75,255.00	7,683,017.71	68,315.61

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2013 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000600	建投能源	2013-05-20	重大资产重组	4.07	2013-07-15	4.31	29,210	124,091.69	118,884.70	-
000683	远兴能源	2013-04-08	重大资产重组	4.80	2013-07-18	5.09	74,275	563,229.74	356,520.00	-
000928	中钢吉炭	2013-05-14	重大事项停牌	9.66	2013-08-14	10.63	23,051	280,714.10	222,672.66	-
000997	新大陆	2013-06-03	重大事项停牌	15.11	-	-	25,271	304,546.56	381,844.81	-
000999	华润三九	2013-06-03	重大事项停牌	29.60	2013-08-19	26.51	31,269	614,707.23	925,562.40	-

002252	上海莱士	2013-03-26	重大事项停牌	21.00	2013-07-02	22.80	15,500	211,665.47	325,500.00	-
300027	华谊兄弟	2013-06-05	重大事项停牌	28.55	2013-07-24	31.41	18,037	322,149.95	514,956.35	-

注：本基金截至2013年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2013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2013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

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪深证300指数，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理及投资风险管理、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中国银行，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 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02% (2012 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，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。

本基金所持有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和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 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	14,428,308.18	-	-	-	14,428,308.18
结算备付金	342,469.00	-	-	-	342,469.00
存出保证金	-	-	-	62,194.53	62,194.53

交易性金融资产	-	-	54,325.57	211,730,574.77	211,784,900.34
应收利息	-	-	-	3,362.67	3,362.67
应收申购款	10,387.68	-	-	346,454.92	356,842.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	14,781,164.86	-	54,325.57	212,142,586.89	226,978,077.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	708,954.71	708,954.71
应付管理人报酬	-	-	-	94,490.68	94,490.68
应付托管费	-	-	-	18,898.13	18,898.13
应付交易费用	-	-	-	183,846.55	183,846.55
其他负债	-	-	-	227,869.59	227,869.59
应付证券清算款	-	-	-	1,807,491.92	1,807,491.92
负债总计	-	-	-	3,041,551.58	3,041,551.58
利率敏感度缺口	14,781,164.86	-	54,325.57	209,101,035.31	223,936,525.74
上年度末 2012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	16,079,147.78	-	-	-	16,079,147.78
结算备付金	93,329.29	-	-	-	93,329.29
存出保证金	-	-	-	24,053.47	24,053.47
交易性金融资产	-	-	48,600.00	245,379,519.90	245,428,119.90
应收利息	-	-	-	3,942.57	3,942.57
应收申购款	596.42	-	-	4,358.20	4,954.62
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	16,173,073.49	-	48,600.00	245,411,874.14	261,633,547.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	476,134.73	476,134.73
应付管理人报酬	-	-	-	106,347.97	106,347.97
应付托管费	-	-	-	21,269.57	21,269.57
应付交易费用	-	-	-	70,068.34	70,068.34
其他负债	-	-	-	367,765.68	367,765.68

应付证券清算款	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	1,041,586.29	1,041,586.29
利率敏感度缺口	16,173,073.49	-	48,600.00	244,370,287.85	260,591,961.34

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2012 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比

		例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	211,730,574.77	94.55	245,379,519.90	94.16
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	211,730,574.77	94.55	245,379,519.90	94.16

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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约1,086.00万元	减少约1,304.00万元
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约1,086.00万元	增加约1,304.00万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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	211,730,574.77	93.28
	其中：股票	211,730,574.77	93.28
2	固定收益投资	54,325.57	0.02
	其中：债券	54,325.57	0.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	14,770,777.18	6.51
6	其他各项资产	422,399.80	0.19
7	合计	226,978,077.32	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,415,570.37	1.08
B	采矿业	6,930,529.55	3.09
C	制造业	118,293,352.07	52.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,870,434.89	1.28
E	建筑业	4,136,921.07	1.85
F	批发和零售业	8,270,472.26	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,367,060.23	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,892,113.41	3.08
J	金融业	29,996,472.06	13.40
K	房地产业	23,902,454.17	10.67
L	租赁和商务服务业	764,015.95	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,989,554.73	1.78
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	1,409,572.01	0.63
S	综合	492,052.00	0.22
	合计	211,730,574.77	94.55

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科 A	1,176,424	11,587,776.40	5.17
2	000776	广发证券	988,920	10,957,233.60	4.89
3	000001	平安银行	1,039,373	10,362,548.81	4.63
4	000157	中联重科	1,239,043	6,728,003.49	3.00
5	000651	格力电器	233,465	5,850,632.90	2.61
6	000024	招商地产	183,071	4,444,963.88	1.98
7	002024	苏宁云商	862,171	4,319,476.71	1.93
8	000858	五粮液	207,538	4,159,061.52	1.86
9	000783	长江证券	501,905	3,970,068.55	1.77
10	000527	美的电器	256,526	3,186,052.92	1.42
11	000063	中兴通讯	205,364	2,618,391.00	1.17
12	000895	双汇发展	65,676	2,524,585.44	1.13
13	000422	湖北宜化	358,156	2,417,553.00	1.08
14	000423	东阿阿胶	61,217	2,367,873.56	1.06
15	002236	大华股份	59,834	2,287,453.82	1.02
16	000402	金融街	446,957	2,239,254.57	1.00
17	000538	云南白药	25,501	2,142,339.01	0.96
18	000338	潍柴动力	122,280	2,121,558.00	0.95
19	002415	海康威视	54,031	1,909,455.54	0.85
20	000401	冀东水泥	224,350	1,844,157.00	0.82
21	000625	长安汽车	198,309	1,842,290.61	0.82
22	000060	中金岭南	274,964	1,820,261.68	0.81
23	000725	京东方 A	760,623	1,688,583.06	0.75
24	002353	杰瑞股份	24,281	1,675,389.00	0.75
25	002241	歌尔声学	44,961	1,631,634.69	0.73
26	002304	洋河股份	29,964	1,627,045.20	0.73
27	000983	西山煤电	198,362	1,618,633.92	0.72
28	000069	华侨城 A	310,481	1,605,186.77	0.72

29	000568	泸州老窖	64,030	1,522,633.40	0.68
30	002450	康得新	53,009	1,483,191.82	0.66
31	002142	宁波银行	169,475	1,435,453.25	0.64
32	000826	桑德环境	43,068	1,389,804.36	0.62
33	002038	双鹭药业	23,675	1,387,355.00	0.62
34	000100	TCL 集团	610,220	1,385,199.40	0.62
35	000581	威孚高科	40,975	1,368,155.25	0.61
36	000792	盐湖股份	74,718	1,265,722.92	0.57
37	002385	大北农	118,345	1,221,320.40	0.55
38	000970	中科三环	90,194	1,176,129.76	0.53
39	000728	国元证券	134,173	1,135,103.58	0.51
40	000661	长春高新	11,228	1,099,333.48	0.49
41	000768	中航飞机	122,300	1,088,470.00	0.49
42	000503	海虹控股	76,915	1,082,963.20	0.48
43	002456	欧菲光	22,388	1,067,012.08	0.48
44	000623	吉林敖东	71,614	1,044,132.12	0.47
45	000933	神火股份	225,369	1,005,145.74	0.45
46	300070	碧水源	26,395	994,563.60	0.44
47	002081	金 蟑 螂	34,507	982,414.29	0.44
48	002422	科伦药业	18,172	968,749.32	0.43
49	000562	宏源证券	107,078	941,215.62	0.42
50	000999	华润三九	31,269	925,562.40	0.41
51	000917	电广传媒	78,604	925,169.08	0.41
52	000998	隆平高科	43,754	907,020.42	0.41
53	002405	四维图新	64,200	897,516.00	0.40
54	000793	华闻传媒	89,283	894,615.66	0.40
55	000400	许继电气	32,832	889,090.56	0.40
56	000629	攀钢钒钛	374,990	881,226.50	0.39
57	000425	徐工机械	110,312	865,949.20	0.39
58	000963	华东医药	20,893	832,586.05	0.37
59	000012	南 玻 A	89,380	828,552.60	0.37
60	002063	远光软件	57,171	826,120.95	0.37
61	000878	云南铜业	84,966	824,170.20	0.37
62	002310	东方园林	21,518	823,924.22	0.37
63	000758	中色股份	79,337	803,683.81	0.36
64	002106	莱宝高科	51,496	790,463.60	0.35

65	300024	机器人	20,927	777,438.05	0.35
66	000039	中集集团	73,878	763,159.74	0.34
67	000630	铜陵有色	70,082	755,483.96	0.34
68	002146	荣盛发展	52,829	745,417.19	0.33
69	002007	华兰生物	32,906	743,017.48	0.33
70	002250	联化科技	37,093	741,489.07	0.33
71	002570	贝因美	26,400	737,880.00	0.33
72	002375	亚厦股份	23,786	732,608.80	0.33
73	002008	大族激光	64,663	723,578.97	0.32
74	002219	独一味	36,306	695,259.90	0.31
75	000729	燕京啤酒	121,527	693,919.17	0.31
76	000709	河北钢铁	364,959	675,174.15	0.30
77	000511	银基发展	154,055	673,220.35	0.30
78	000598	兴蓉投资	137,658	662,134.98	0.30
79	000937	冀中能源	74,186	655,062.38	0.29
80	002050	三花股份	52,812	644,306.40	0.29
81	002092	中泰化学	125,769	638,906.52	0.29
82	002004	华邦颖泰	44,317	624,426.53	0.28
83	002230	科大讯飞	13,358	617,139.60	0.28
84	002594	比亚迪	19,507	583,454.37	0.26
85	000982	中银绒业	72,388	579,827.88	0.26
86	000800	一汽轿车	47,084	579,133.20	0.26
87	000061	农产品	95,629	574,730.29	0.26
88	000690	宝新能源	122,313	571,201.71	0.26
89	002202	金风科技	105,833	570,439.87	0.25
90	002152	广电运通	51,624	566,831.52	0.25
91	002155	辰州矿业	70,364	565,726.56	0.25
92	000960	锡业股份	46,254	564,298.80	0.25
93	002129	中环股份	30,568	563,673.92	0.25
94	000848	承德露露	24,336	552,670.56	0.25
95	002065	东华软件	27,620	546,876.00	0.24
96	002051	中工国际	19,496	543,353.52	0.24
97	000816	江淮动力	150,377	542,860.97	0.24
98	000839	中信国安	83,479	538,439.55	0.24
99	000825	太钢不锈	207,552	533,408.64	0.24
100	002022	科华生物	35,752	529,487.12	0.24

101	300027	华谊兄弟	18,037	514,956.35	0.23
102	000540	中天城投	72,778	510,173.78	0.23
103	000680	山推股份	152,068	507,907.12	0.23
104	000786	北新建材	28,384	500,126.08	0.22
105	002005	德豪润达	53,194	494,704.20	0.22
106	000009	中国宝安	44,732	492,052.00	0.22
107	002073	软控股份	57,820	485,109.80	0.22
108	300104	乐视网	18,582	482,202.90	0.22
109	000900	现代投资	62,619	480,287.73	0.21
110	002428	云南锗业	42,358	479,492.56	0.21
111	000778	新兴铸管	96,785	475,214.35	0.21
112	000049	德赛电池	7,502	450,120.00	0.20
113	000762	西藏矿业	38,953	448,349.03	0.20
114	002001	新和成	30,199	445,133.26	0.20
115	000975	银泰资源	54,447	442,109.64	0.20
116	000969	安泰科技	56,153	435,747.28	0.19
117	002292	奥飞动漫	19,349	433,224.11	0.19
118	000735	罗牛山	79,971	417,448.62	0.19
119	000726	鲁泰 A	48,081	405,803.64	0.18
120	000876	新希望	40,867	402,539.95	0.18
121	002140	东华科技	16,196	401,822.76	0.18
122	000046	泛海建设	81,832	399,340.16	0.18
123	000559	万向钱潮	72,780	382,095.00	0.17
124	000997	新大陆	25,271	381,844.81	0.17
125	000616	亿城股份	132,417	377,388.45	0.17
126	000587	金叶珠宝	36,502	373,415.46	0.17
127	000031	中粮地产	101,622	370,920.30	0.17
128	000518	四环生物	115,052	367,015.88	0.16
129	000686	东北证券	22,251	361,356.24	0.16
130	000926	福星股份	49,875	359,598.75	0.16
131	000652	泰达股份	109,800	359,046.00	0.16
132	000667	名流置业	200,997	357,774.66	0.16
133	000683	远兴能源	74,275	356,520.00	0.16
134	002407	多氟多	33,201	354,918.69	0.16
135	000006	深振业 A	82,854	352,958.04	0.16
136	000962	东方钽业	34,903	352,520.30	0.16

137	002028	思源电气	22,362	351,754.26	0.16
138	002340	格林美	38,107	351,727.61	0.16
139	000541	佛山照明	56,209	347,933.71	0.16
140	000528	柳工	53,196	345,774.00	0.15
141	000563	陕国投 A	21,455	337,916.25	0.15
142	300146	汤臣倍健	7,564	332,740.36	0.15
143	000869	张裕 A	9,700	331,158.00	0.15
144	002476	宝莫股份	52,029	329,343.57	0.15
145	002424	贵州百灵	22,903	329,116.11	0.15
146	002252	上海莱士	15,500	325,500.00	0.15
147	002203	海亮股份	46,346	324,422.00	0.14
148	000939	凯迪电力	66,262	324,021.18	0.14
149	000877	天山股份	55,936	323,869.44	0.14
150	002267	陕天然气	31,455	323,042.85	0.14
151	002048	宁波华翔	38,618	322,846.48	0.14
152	000636	风华高科	59,929	320,020.86	0.14
153	002396	星网锐捷	22,470	319,972.80	0.14
154	000050	深天马 A	26,860	315,067.80	0.14
155	000426	兴业矿业	37,668	314,527.80	0.14
156	000027	深圳能源	62,479	314,269.37	0.14
157	002104	恒宝股份	24,260	313,196.60	0.14
158	000078	海王生物	50,387	312,399.40	0.14
159	000852	江钻股份	23,754	308,802.00	0.14
160	002204	大连重工	29,929	307,370.83	0.14
161	000525	红太阳	20,356	305,136.44	0.14
162	000996	中国中期	24,820	305,037.80	0.14
163	002646	青青稞酒	15,047	304,551.28	0.14
164	000731	四川美丰	36,643	304,503.33	0.14
165	002161	远望谷	39,791	303,207.42	0.14
166	000807	云铝股份	81,266	302,309.52	0.13
167	000612	焦作万方	35,645	301,913.15	0.13
168	002176	江特电机	29,587	301,195.66	0.13
169	000513	丽珠集团	7,971	297,318.30	0.13
170	000887	中鼎股份	46,784	294,739.20	0.13
171	002011	盾安环境	28,919	293,238.66	0.13
172	000790	华神集团	28,862	290,640.34	0.13

173	002041	登海种业	13,649	289,768.27	0.13
174	002262	恩华药业	13,002	289,294.50	0.13
175	000488	晨鸣纸业	80,954	289,005.78	0.13
176	002261	拓维信息	19,928	288,158.88	0.13
177	000059	辽通化工	63,562	287,935.86	0.13
178	000650	仁和药业	59,086	287,748.82	0.13
179	000961	中南建设	29,067	284,275.26	0.13
180	000028	国药一致	10,162	283,723.04	0.13
181	002500	山西证券	47,899	283,562.08	0.13
182	002244	滨江集团	33,312	279,820.80	0.12
183	000799	酒鬼酒	17,302	279,427.30	0.12
184	000930	中粮生化	70,439	277,529.66	0.12
185	002233	塔牌集团	47,407	275,908.74	0.12
186	000988	华工科技	47,847	274,641.78	0.12
187	000718	苏宁环球	46,658	274,349.04	0.12
188	002223	鱼跃医疗	14,518	273,664.30	0.12
189	000501	鄂武商 A	24,398	273,257.60	0.12
190	000601	韶能股份	81,272	267,384.88	0.12
191	002299	圣农发展	29,287	264,754.48	0.12
192	002167	东方锆业	26,956	263,899.24	0.12
193	000566	海南海药	26,046	263,845.98	0.12
194	000977	浪潮信息	10,875	263,283.75	0.12
195	000850	华茂股份	60,150	261,652.50	0.12
196	002479	富春环保	35,103	255,549.84	0.11
197	002056	横店东磁	20,242	254,644.36	0.11
198	000088	盐田港	75,859	252,610.47	0.11
199	002030	达安基因	27,472	246,973.28	0.11
200	000608	阳光股份	48,298	244,870.86	0.11
201	002029	七匹狼	33,668	240,726.20	0.11
202	002277	友阿股份	32,154	239,225.76	0.11
203	000571	新大洲 A	64,241	238,334.11	0.11
204	000655	金岭矿业	32,207	238,331.80	0.11
205	000829	天音控股	42,772	237,812.32	0.11
206	300156	天立环保	21,891	237,079.53	0.11
207	000973	佛塑科技	68,327	236,411.42	0.11
208	000860	顺鑫农业	21,727	236,389.76	0.11

209	000089	深圳机场	66,029	234,402.95	0.10
210	002069	獐子岛	19,567	231,868.95	0.10
211	002168	深圳惠程	31,152	230,836.32	0.10
212	000417	合肥百货	44,035	228,101.30	0.10
213	002123	荣信股份	32,875	227,823.75	0.10
214	000830	鲁西化工	61,647	225,011.55	0.10
215	000928	中钢吉炭	23,051	222,672.66	0.10
216	000021	长城开发	49,805	221,632.25	0.10
217	000823	超声电子	26,889	219,683.13	0.10
218	002013	中航精机	18,331	216,855.73	0.10
219	002128	露天煤业	24,704	215,912.96	0.10
220	002064	华峰氨纶	30,900	214,446.00	0.10
221	002249	大洋电机	28,271	212,315.21	0.09
222	000750	国海证券	20,544	212,014.08	0.09
223	000789	江西水泥	25,044	210,369.60	0.09
224	002006	精功科技	29,821	207,554.16	0.09
225	000550	江铃汽车	13,521	207,006.51	0.09
226	000968	煤气化	28,331	206,249.68	0.09
227	001696	宗申动力	43,601	204,924.70	0.09
228	000795	太原刚玉	20,907	203,425.11	0.09
229	000099	中信海直	32,284	201,129.32	0.09
230	000042	深长城	7,764	200,854.68	0.09
231	000036	华联控股	69,509	196,710.47	0.09
232	002237	恒邦股份	14,139	192,855.96	0.09
233	002254	泰和新材	30,287	192,019.58	0.09
234	000592	中福实业	53,467	191,946.53	0.09
235	000537	广宇发展	36,346	191,179.96	0.09
236	002025	航天电器	18,476	190,857.08	0.09
237	000931	中关村	41,089	189,831.18	0.08
238	002183	怡亚通	28,593	189,285.66	0.08
239	300137	先河环保	10,027	187,304.36	0.08
240	000777	中核科技	12,409	186,631.36	0.08
241	000698	沈阳化工	48,085	186,569.80	0.08
242	000572	海马汽车	55,664	184,804.48	0.08
243	000780	平庄能源	34,378	184,609.86	0.08
244	002122	天马股份	51,503	183,865.71	0.08

245	000301	东方市场	66,858	181,853.76	0.08
246	002153	石基信息	9,000	180,180.00	0.08
247	000659	珠海中富	93,332	180,130.76	0.08
248	000090	深天健	25,674	178,691.04	0.08
249	000159	国际实业	33,785	175,682.00	0.08
250	002408	齐翔腾达	15,088	172,757.60	0.08
251	002091	江苏国泰	13,360	172,744.80	0.08
252	300077	国民技术	11,175	171,424.50	0.08
253	000822	山东海化	54,664	168,365.12	0.08
254	000989	九芝堂	15,169	167,769.14	0.07
255	002218	拓日新能	26,391	161,512.92	0.07
256	000901	航天科技	14,500	160,660.00	0.07
257	002130	沃尔核材	27,614	159,608.92	0.07
258	002191	劲嘉股份	17,887	154,722.55	0.07
259	000703	恒逸石化	17,970	154,721.70	0.07
260	000410	沈阳机床	29,580	152,041.20	0.07
261	000752	西藏发展	13,800	146,004.00	0.07
262	000987	广州友谊	17,009	145,767.13	0.07
263	002097	山河智能	25,788	145,702.20	0.07
264	000596	古井贡酒	6,966	145,450.08	0.06
265	002079	苏州固锝	30,652	136,707.92	0.06
266	000828	东莞控股	33,177	136,689.24	0.06
267	000543	皖能电力	23,331	135,319.80	0.06
268	002190	成飞集成	10,919	134,522.08	0.06
269	300003	乐普医疗	11,441	128,711.25	0.06
270	000927	一汽夏利	34,950	125,820.00	0.06
271	002093	国脉科技	25,252	125,502.44	0.06
272	000600	建投能源	29,210	118,884.70	0.05
273	002154	报喜鸟	19,204	116,184.20	0.05
274	000713	丰乐种业	13,870	112,763.10	0.05
275	002171	精诚铜业	18,039	111,120.24	0.05
276	002242	九阳股份	18,139	104,662.03	0.05
277	000708	大冶特钢	18,671	99,703.14	0.04
278	300224	正海磁材	6,857	99,015.08	0.04
279	000951	中国重汽	11,532	97,214.76	0.04
280	000759	中百集团	17,673	96,317.85	0.04

281	000514	渝 开 发	30,057	95,881.83	0.04
282	000707	双环科技	25,858	94,640.28	0.04
283	002032	苏 泊 尔	7,707	92,715.21	0.04
284	002399	海普瑞	5,186	92,310.80	0.04
285	002269	美邦服饰	7,700	68,068.00	0.03
286	000022	深赤湾 A	5,933	61,940.52	0.03
287	002136	安 纳 达	7,927	53,427.98	0.02
288	000539	粤电力 A	9,025	40,793.00	0.02
289	002601	佰利联	2,423	36,878.06	0.02
290	000755	山西三维	7,689	26,680.83	0.01
291	000761	本钢板材	6,762	17,851.68	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	000001	平安银行	21,196,418.52	8.13
2	000776	广发证券	19,851,605.38	7.62
3	000858	五 粮 液	13,931,081.13	5.35
4	000002	万 科 A	10,841,567.81	4.16
5	000157	中联重科	9,736,675.05	3.74
6	000983	西山煤电	8,521,458.25	3.27
7	000024	招商地产	8,041,535.83	3.09
8	002237	恒邦股份	7,853,272.50	3.01
9	002024	苏宁云商	7,418,864.00	2.85
10	002142	宁波银行	6,559,036.00	2.52
11	000651	格力电器	6,236,824.39	2.39
12	002304	洋河股份	5,583,652.10	2.14
13	300027	华谊兄弟	4,506,111.40	1.73
14	300156	天立环保	4,472,848.12	1.72
15	000060	中金岭南	4,319,912.68	1.66

16	000401	冀东水泥	3,733,841.23	1.43
17	000422	湖北宜化	3,675,977.47	1.41
18	000783	长江证券	3,316,698.01	1.27
19	000568	泸州老窖	3,178,322.65	1.22
20	000933	神火股份	3,108,040.42	1.19

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	000858	五粮液	17,570,459.65	6.74
2	000001	平安银行	16,178,600.35	6.21
3	000002	万科 A	12,042,457.62	4.62
4	000776	广发证券	11,291,465.20	4.33
5	300027	华谊兄弟	9,026,106.56	3.46
6	000651	格力电器	7,875,517.87	3.02
7	000983	西山煤电	7,667,871.84	2.94
8	002237	恒邦股份	7,392,870.29	2.84
9	002142	宁波银行	7,035,759.58	2.70
10	002024	苏宁云商	5,944,794.37	2.28
11	002304	洋河股份	5,823,331.76	2.23
12	000024	招商地产	5,603,620.17	2.15
13	000568	泸州老窖	5,255,980.60	2.02
14	000157	中联重科	4,915,647.75	1.89
15	000060	中金岭南	4,377,646.12	1.68
16	300156	天立环保	4,154,178.00	1.59
17	000800	一汽轿车	3,725,687.58	1.43
18	000063	中兴通讯	3,380,271.00	1.30
19	000933	神火股份	3,363,964.27	1.29
20	000402	金融街	2,870,771.72	1.10

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	194,992,917.38
卖出股票的收入（成交）总额	216,519,137.99

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	54,325.57	0.02
8	其他	-	-
9	合计	54,325.57	0.02

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

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	127001	海直转债	486	54,325.57	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	62,194.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,362.67
5	应收申购款	356,842.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,399.80

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127001	海直转债	54,325.57	0.02

7.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,704	102,578.51	37,055,120.73	13.36%	240,317,157.16	86.64%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	姚清福	2,860,556.00	11.29%
2	上海东会财务管理咨询有限公司	2,200,700.00	8.69%
3	刘素清	900,000.00	3.55%
4	何笑容	500,062.00	1.97%
5	杜鹃	400,116.00	1.58%
6	周炜	400,072.00	1.58%
7	赵冰	389,033.00	1.54%
8	李岩	320,100.00	1.26%
9	韩家来	300,025.00	1.18%
10	范增强	300,025.00	1.18%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	168,325.61	0.06%

注：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

基金合同生效日（2011 年 9 月 2 日）基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	301,240,008.96
本报告期基金总申购份额	217,071,773.26
减：本报告期基金总赎回份额	240,939,504.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	277,372,277.89

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：

无

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：

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。本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监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例 (%)		比例 (%)	
长江证券股份有限公司	1	411,158,571.69	100.00%	363,834.24	100.00%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1.本报告期内，本基金无新增交易单元。

2.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。

3.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服务能力进行评估。

(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。

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（%）
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资及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	2013-02-19
2	关于旗下部分基金增加好买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	2013-02-22
3	关于旗下部分基金增加天天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	2013-02-25
4	关于旗下部分基金参加上海天天基金销售	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-26

	有限公司申购费率优惠活动的公告	券时报》、《中国证券报》和公司网站	
5	关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司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	2013-02-27
6	关于旗下部分基金增加数米基金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	2013-03-14
7	关于华安旗下部分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	2013-03-28
8	关于华安旗下部分基金参加好买基金定期定额业务及参加基金定投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	2013-04-11
9	关于旗下基金增加上海长量基金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	2013-04-12
10	关于增加旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-28
11	关于旗下部分基金增加诺亚正行（上海）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	2013-06-04
12	关于电子直销平台开通“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	2013-01-18
13	关于基金电子交易平台延长工商银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	2013-02-05
14	关于电子直销平台开通“货币通：余额理财”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-03-28
15	关于电子直销平台开通“货币通：快速取现”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-04-10
16	关于基金电子交易平台延长工商银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	2013-05-04

		报》和公司网站	
17	关于电子直销平台“货币通：快速取现”业务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-13
18	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-18
19	华安基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-18
20	关于电子直销平台开通“货币通：跨行取现”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-30
21	关于基金电子直销平台开展工商银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	2013-06-17
22	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-26

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

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
二〇一三年八月二十四日