华安沪深300指数分级证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市日期：２０１２年７月２３日
公告日期：２０１２年７月１８日

一、重要声明与提示

华安沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年5月29日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及华安基金管理有限公司网站（www.huaan.com.cn）上的《华安沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：华安沪深300指数分级证券投资基金。

2、基金类型：股票型。

3、本基金的基金份额包括华安沪深300指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称“华安300”，基金代码“160417”）、华安沪深300指数分级证券投资基金之A类份额（场内简称“华安300 A”，基金代码“150104”）与华安沪深300指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称“华安300 B”，基金代码“150105”）。其中，华安300A份额和华安300B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

4、本基金的存续期限为不定期。

5、华安300的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对华安300份额进行申购与赎回；华安300A、华安300B只上市交易，不接受申购和赎回。

6、份额配对转换：份额配对转换是指华安300场内份额与华安300A份额、华安300B份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

（1）分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每2份华安300场内份额申请转换成1份华安300A份额与1份华安300B份额的行为。

（2）合并

合并指基金份额持有人将其持有的每1份华安300A份额与1份华安300B份额申请转换成2份华安300场内份额的行为。

7、定期份额折算

每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）为定期份额折算基准日，本基金将对华安300A份额和华安300份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算。华安300A份额每个期末的约定应得收益，即华安300A份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出1.000元部分，将被折算为场内华安300份额分配给华安300A份额持有人。华安300份额持有人持有的每2份华安300份额将获得按照1份华安300A份额分配的新增华安300份额。持有场外华安300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华安300份额；持有场内华安300份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华安300份额。经过上述份额折算，华安300A份额的参考净值和华安300份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

8、不定期份额折算

当华安300份额的基金份额净值大于或等于2.000元时，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安300A份额、华安300B份额和华安300份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保华安300A份额和华安300B份额的比例为1:1，份额折算后华安300A份额、华安300B份额和华安300份额的基金份额净值均调整为1.000元。

当华安300B份额的参考净值小于或等于0.300元后，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安300A份额、华安300B份额和华安300份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华安300A份额和华安300B份额的比例为1:1，份额折算后华安300份额的基金份额净值以及华安300A份额和华安300B份额的参考净值均调整为1.000元。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

9、华安300A与华安300B的终止运作：经基金份额持有人大会决议通过，华安300A与华安300B可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的华安300、华安300A与华安300B各自的基金份额持有人或其代理人所持华安300、华安300A与华安300B各自表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

10、基金份额总额：截至2012年7月16日，本基金的基金份额总额为607，313，857.99份，其中，华安300为212，734，025.99份，华安300A为197，289，916.00份，华安300B为197，289，916.00份。

11、基金份额净值：截至2012年7月16日，华安300的基金份额净值为0.999元，华安300A的基金份额净值为1.004元，华安300B的基金份额净值为0.994元。

12、本次上市交易的两类基金份额总额：华安300A份额197，289，916.00份，华安300B份额197，289，916.00份

13、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

14、上市交易日期：2012年7月23日

15、基金管理人：华安基金管理有限公司

16、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

17、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可［2012］278号文

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2012年6月1日至2012年6月18日

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构（排名不分先后）

（1）场外销售机构

直销机构：华安基金管理有限公司

代销银行：中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司

代销券商：中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中山证券有限责任公司。

（2）场内销售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。具体名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人不就此事项进行公告。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的有效认购总户数为2，932户，净认购金额（不含认购费）为607，221，793.60 元人民币，有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为92，064.39 人民币，共计607，313，857.99 元。本次募集所有资金已于 2012年6月25日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管账户。

10、基金合同生效日：2012年6月25日

11、基金合同生效日的基金份额总额：607，313，857.99份

（二）本基金的日常申购、赎回情况

本基金管理人将于2012年7月23日起开始办理本基金的申购和赎回业务，具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回业务公告中规定。

（三）基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上［2012］235号。

2、上市交易日期：2012年7月23日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市交易的基金份额场内简称：华安300A、华安300B。

5、本次上市交易的基金份额交易代码：华安300A为150104；华安300B为150105。

6、本次上市交易的基金份额总额：华安300A为197，289，916.00份；华安300B为197，289，916.00份。

7、基金资产净值的披露：基金管理人每个开放日（T 日）对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人在 T日内将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，由深交所于T+1日通过行情系统揭示T日基金份额净值。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人的开放式基金账户下，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内（即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统）后，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成华安300A和华安300B后，即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）场内基金份额持有情况（截至2012年7月16日）

本基金持有人户数为2，932户，平均每户持有的基金份额为207，132.97份；华安300A份额为2，237户，平均每户持有的基金份额为88，154.56份；华安300B份额为2，237户，平均每户持有的基金份额为88，154.56份。

（二）场内基金份额持有人结构（截至2012年7月16日）

1、场内机构投资者持有的本次上市交易的华安300A份额60，063，101.00份，占比30.4441%；场内个人投资者持有的本次上市交易的华安300A份额137，226，815.00份，占比69.5559%；

2、场内机构投资者持有的本次上市交易的华安300B份额60，063，098.00份，占比30.4441%；场内个人投资者持有的本次上市交易的华安300B份额137，226，818.00份，占比69.5559%；

（三）场内华安300A份额前十名持有人情况（截至2012年7月16日）

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内份额比例
1	中钢投资有限公司	19，994，833.00	10.13%
2	徐铭	10，001，222.00	5.07%
3	中信证券股份有限公司	5，000，389.00	2.53%
4	民生证券有限责任公司	5，000，388.00	2.53%
5	美高仕科技发展有限公司	5，000，333.00	2.53%
6	红塔证券股份有限公司	5，000，333.00	2.53%
7	中国银河证券股份有限公司	5，000，333.00	2.53%
8	刘端美	4，000，267.00	2.03%
9	中融国际信托有限公司-中融安苏1号证券投资	3，250，361.00	1.65%
10	汪和君	2，500，277.00	1.27%

（四）场内华安300B份额前十名持有人情况（截至2012年7月16日）

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内份额比例
1	中钢投资有限公司	19，994，832.00	10.13%
2	徐铭	10，000，222.00	5.07%
3	民生证券有限责任公司	5，000，389.00	2.53%
4	中信证券股份有限公司	5，000，388.00	2.53%
5	美高仕科技发展有限公司	5，000，333.00	2.53%
6	红塔证券股份有限公司	5，000，333.00	2.53%
7	中国银河证券股份有限公司	5，000，333.00	2.53%
8	刘端美	4，000，266.00	2.03%
9	中融国际信托有限公司-中融安苏1号证券投资	3，250，361.00	1.65%
10	汪和君	2，500，278.00	1.27%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华安基金管理有限公司

2、法定代表人：李勤

3、总经理：李勤

4、注册资本：1.5亿元人民币

5、住所：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

6、办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

7、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字［1998］20号

8、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071

9、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

10、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气(集团)总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

11、内部组织结构及职能

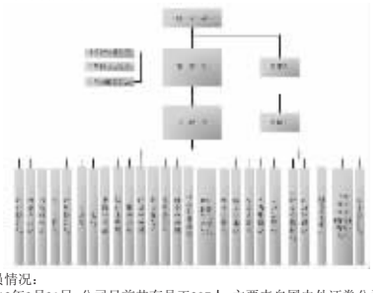
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九名董事组成，其中五家股东单位分别推荐一名董事，公司管理层推荐一名，另三名为独立董事。独立董事人数占董事会总人数的1/3，超过单一股东派出的董事人数。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

监事会由八名监事组成，其中三名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，新增业务部分（如财富管理中心）采用灵活高效的事业部制，设有投资研究、市场营销、运营及后台、风险控制等四大板块共25个部门以及1个香港全资子公司。公司组织架构如下图所示：



12、人员情况：

截至2012年3月31日，公司目前共有员工297人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中80.1%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

13、信息披露负责人：冯颖

电话：021）38969720

14、基金管理业务情况简介：

截至2012年3月31日，华安基金管理有限公司旗下共管理2只封闭式基金和25只开放式基金，资产规模达744.89亿元人民币。旗下管理的基金包括：华安安信封闭、华安安顺封闭、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、华安上证180ETF、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安上证180ETF联接、华安动态灵活配置混合、华安行业轮动股票、华安香港精选股票（QDII）、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安稳固收益债券、华安升级主题股票、华安大中华升级股票（QDII）、华安可转债债券、华安深证300指数LOF、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安标普全球石油指数（QDII-LOF）。

15、本基金基金经理

牛勇先生，复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），7 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3 日至2010年9 月2 日担任华安中国A 股增强指数证券投资基金的基金经理助理；2010年6 月18 日起至今担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2010 年9 月2 日起至今担任华安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18日起至今担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金；2010 年11 月18日起至今担任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。

张昊先生，密歇根大学金融工程硕士，4年证券、基金行业从业经历。曾在美国Trafelet Delta Funds担任量化分析师、风险对冲管理师等职。2009年6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。

（二）基金托管人

1、名称：中国建设银行股份有限公司

2、法定代表人：王洪章

3、注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

4、住所：北京市西城区金融大街25号

5、专门基金托管部门负责人及人员情况：中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

6、信息披露负责人：尹东

电话：010）67595003

7、托管业务情况简介：作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国“最佳资产托管银行”奖。

（三）基金验资机构

1、名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

2、住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

3、办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

4、法定代表人：杨绍信

5、电话：021）23238888

6、传真：021）23238800

7、联系人：金毅

8、经办注册会计师：汪棣、金毅

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在华安沪深300指数分级证券投资基金认购期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

华安沪深300指数分级证券投资基金截至2012年7月16日资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	
资 产：	
银行存款	32，312，705.27
结算备付金	2，927，721.79
存出保证金	878.15
交易性金融资产	91，530，137.75
其中：股票投资	91，530，137.75
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	480，000，000.00
应收证券清算款	-
应收利息	260，978.14
应收股利	53，092.52
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计：	607，085，513.62
负债和所有者权益	
负债：	
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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	265，784.38
应付托管费	58，472.57
应付销售服务费	-
应付交易费用	80，575.29
应付税费	-
应付利息	
应付利润	
其他负债	38，238.25
负债合计	443，070.49
所有者权益：	
实收基金	607，313，857.99
未分配利润	-671，414.86
所有者权益合计	606，642，443.13
负债与所有者权益合计：	607，085，513.62

注：报告截止日2012年7月16日，华安300份额净值为0.999，份额数为212，734，025.99。华安300A份额净值为1.004，份额数为197，289，916.00。华安300B份额净值为0.994，份额数为197，289，916.00。

八、基金投资组合

截至2012年7月16日，本基金的投资组合情况如下：

（一）期末（2012年7月16日）基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91，530，137.75	15.08
	其中：股票	91，530，137.75	15.08
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	480，000，000.00	79.07
	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	35，240，427.06	5.80
6	其他各项资产	314，948.81	0.05
7	合计	607，085，513.62	100.00

（二）期末（2012年7月16日）指数投资按行业分类的股票投资组合

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	614，036.00	0.10
B	采掘业	9，550，032.79	1.57
C	制造业	34，065，479.55	5.62
C0	食品、饮料	7，513，403.15	1.24
C1	纺织、服装、皮毛	352，816.00	0.06
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2，002，231.00	0.33
C5	电子	1，330，161.00	0.22
C6	金属、非金属	6，766，381.54	1.12
C7	机械、设备、仪表	11，545，781.98	1.90
C8	医药、生物制品	4，551，274.88	0.75
C99	其他制造业	3，430.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2，385，370.98	0.39
E	建筑业	3，135，416.00	0.52
F	交通运输、仓储业	2，778，752.00	0.46
G	信息技术业	2，329，067.00	0.38
H	批发和零售贸易	2，339，567.17	0.39
I	金融、保险业	26，599，196.84	4.38
J	房地产业	5，209，330.92	0.86
K	社会服务业	874，520.00	0.14
L	传播与文化产业	328，983.50	0.05
M	综合类	1，320，385.00	0.22
	合计	91，530，137.75	15.09

注：由于四舍五入原因，公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

（三）期末（2012年7月16日）积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本期未持有积极投资部分股票。

（四）期末（2012年7月16日）指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	64，012	2，789，002.84	0.46
2	600104	上汽集团	227，940	2，780，868.00	0.46
3	600016	民生银行	447，200	2，656，368.00	0.44
4	600036	招商银行	244，800	2，467，584.00	0.41
5	600519	贵州茅台	7，520	1，972，120.00	0.33
6	601328	交通银行	453，600	1，964，088.00	0.32
7	601166	兴业银行	149，600	1，834，096.00	0.30
8	600030	中信证券	136，000	1，698，640.00	0.28
9	600000	浦发银行	221，600	1，690，808.00	0.28
10	000002	万科A	168，000	1，634，640.00	0.27

（五）期末（2012年7月16日）积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

本基金本期未未持有积极投资股票。

（六）期末（2012年7月16日）按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

（七）期末（2012年7月16日）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期未未持有债券。

（八）期末（2012年7月16日）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

（九）期末（2012年7月16日）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

本基金本报告期未未持有权证。

（十）投资组合报告附注

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的，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。

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。

3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	878.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	53，092.52
4	应收利息	260，978.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	314，948.81

4 期末（2012年7月16日）持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未没有处于转股期的可转换债券。

5 期末（2012年7月16日）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中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同已于 2012年6月25日正式生效，基金管理人已于2012年6月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会核准华安沪深300指数分级证券投资基金募集的文件

（二）《华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同》

（三）《华安沪深300指数分级证券投资基金托管协议》

（四）《华安沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

1.基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

邮政编码：200120

法定代表人：李勤

成立时间：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字［1998］20号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

2.基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］12号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

3.基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资人自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。

华安沪深300A份额、华安沪深300B份额、华安沪深300份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。

4.基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）在符合有关法律法规和父券所规则的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理华安沪深300份额的申购和赎回申请；

（8）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

5.基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定受理华安沪深300份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（15）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（19）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

6.基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

（1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

（4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（6）依法召集基金份额持有人大会；

（7）按规定取得基金份额持有人名册资料；

（8）法律法规和基金合同规定的其他权利。

7.基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

（1）安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保