华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之证券股A与证券股B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:2015年6月18日
公告日期:2015年6月15日

一、重要声明与提示

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之证券股A与证券股B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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之证券股A与证券股B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2015年5月25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《华安中证全指证券公司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:华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金。

2、基金类型:股票型。

3、基金运作方式:契约型开放式。

4、本基金的基金份额包括华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称“证券股基”,基金代码“160419”)、华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之A类份额(场内简称“证券股A”,基金代码“150301”)与华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之B类份额(场内简称“证券股B”,基金代码“150302”)。其中,证券股A份额和证券股B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、证券股基份额的申购和赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对证券股基份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。证券股A、证券股B只上市交易,不接受申购和赎回。

7、证券股基份额的跨系统转托管:通过场内、场外方式认购证券股基份额的基金份额持有人可以通过认购证券股基份额的销售机构办理跨系统转托管业务。

8、份额配对转换:份额配对转换是指证券股基场内份额与证券股A份额、证券股B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份场内证券股基份额申请转换成1份证券股A份额与1份证券股B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份证券股A份额与1份证券股B份额申请转换成2份场内证券股基份额的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并,场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

每个会计年度的12月15日为定期份额折算基准日,本基金将对证券股A份额和证券股基份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算。证券股A份额每个期末的约定应得收益,即证券股A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,将被折算为场内证券股基份额分配给证券股A份额持有人。证券股基份额持有人持有的每2份证券股基份额将获得按照1份证券股A份额份额的新增证券股基份额。持有场外证券股基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外证券股基份额;持有场内证券股基份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内证券股基份额。经过上述份额折算,证券股A份额的参考净值和证券股基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

当证券股基份额的基金份额净值大于或等于1.5000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证券股B份额和证券股基份额进行不定期份额折算,份额折算后本基金将确保证券股A份额和证券股B份额的份额数比例为1:1,份额折算后证券股B份额和证券股基份额的基金份额(参考)净值均调整为证券股A份额的参考净值。

当证券股B份额的参考净值小于或等于0.2500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证券股A份额、证券股B份额和证券股基份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保证券股A份额和证券股B份额的份额数比例为1:1,份额折算后证券股基份额的基金份额净值以及证券股A份额和证券股B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、证券股A与证券股B的终止运作:经基金份额持有人大会决议通过,证券股A与证券股B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证券股基、证券股A与证券股B各自的基金份额持有人或其代理人所持证券股基、证券股A与证券股B各自表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

10、基金份额总额:截至2015年6月11日,本基金的基金份额总额为249,384,967.95份,其中,证券股基为46,316,587.95份,证券股A为101,534,190.00份,证券股B为101,534,190.00份。

11、基金份额(参考)净值:截至2015年6月11日,证券股基的基金份额净值为0.9938元,证券股A的基金份额参考净值为1.0006元,证券股B的基金份额参考净值为0.9871元。

12、本次上市交易的两类基金份额总额:证券股A份额101,534,190.00份,证券股B份额101,534,190.00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:2015年6月18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[2015]911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:2015年5月28日至2015年6月3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、基金份额发售机构(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

代销券商:华安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司

(2)场内销售机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位,包括:

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚志证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

如果会员单位有所增加或减少,请以深圳证券交易所的具体规定为准。

8、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

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5,645户,净认购金额(不含认购费)为249,366,591.33元人民币,有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为18,376.62人民币,共计249,384,967.95元。本次募集所有资金已于2015年6月9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。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售,按照每份基金份额1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集249,384,967.95份基金份额,其中场外认购的基金份额为46,316,587.95份;场内认购的基金份额为203,068,380.00份。

10、本基金募集备案情况:根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关约定,本基金募集结果符合备案条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2015年6月9日获中国证监会书面确认,基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日:2015年6月9日

12、基金合同生效日的基金份额总额:249,384,967.95份

(二)本基金的日常申购、赎回情况

本基金管理人将于2015年6月19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[2015]278号。

2、上市交易日期:2015年6月18日。

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在在具有基金代销业务资格的深圳证券交易所各会员单位证券营业部场可参与基金交易。

4、本次上市交易的基金份额场内简称:证券股A、证券股B。

5、本次上市交易的基金份额交易代码:证券股A为150301;证券股B为150302。

6、本次上市交易的基金份额总额:证券股A为101,534,190.00份;证券股B为101,534,190.00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(参考)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(参考)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份额(参考)净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定:对于场外的证券股基份额办理跨系统转托管到场内(证券登记结算系统)后,可以向具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位,根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成证券股A和证券股B,分拆后的证券股A和证券股B可以在深圳证券交易所场内上市流通。对于托管在场内的证券股基份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为证券股A和证券股B即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期:2015年6月19日,具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

(一)基金份额持有情况(截至2015年6月11日)

本基金持有人户数为5,645户,平均每户持有的基金份额为44,178.03份;证券股A份额为718户,平均每户持有的基金份额为141,412.52份;证券股B份额为718户,平均每户持有的基金份额为141,412.52份。

(二)场内基金份额持有人结构(截至2015年6月11日)

1、场内机构投资者持有的本次上市交易的证券股A份额39,180,271份,占比38.5883%;场内个人投资者持有的本次上市交易的证券股A份额62,353,919份,占比61.4117%;

2、场内机构投资者持有的本次上市交易的证券股B份额39,180,282份,占比38.5883%;场内个人投资者持有的本次上市交易的证券股B份额62,353,908份,占比61.4117%;

(三)场内证券股A份额前十名持有人情况(截至2015年6月11日)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内份额比例
1	齐鲁证券有限公司客户信用交易担保证券账户	19,205,415	18.92%
2	王毅	15,000,583	14.77%
3	深圳前海新丰富投资管理有限公司-新丰富创富1号	5,000,218	4.92%
4	李怡名	5,000,194	4.92%
5	招商证券股份有限公司	4,000,155	3.94%
6	上海证券有限责任公司	3,000,145	2.95%
7	广发证券股份有限公司	3,000,116	2.95%
8	中信证券股份有限公司	2,500,097	2.46%
9	国信证券股份有限公司	2,091,101	2.06%
10	傅莉明	1,000,068	0.98%

(四)场内证券股B份额前十名持有人情况(截至2015年6月11日)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占场内份额比例
1	齐鲁证券有限公司客户信用交易担保证券账户	19,205,419	18.92%
2	王毅	15,000,583	14.77%
3	深圳前海新丰富投资管理有限公司-新丰富创富1号	5,000,219	4.92%
4	李怡名	5,000,194	4.92%
5	招商证券股份有限公司	4,000,156	3.94%
6	上海证券有限责任公司	3,000,146	2.95%
7	广发证券股份有限公司	3,000,117	2.95%
8	中信证券股份有限公司	2,500,097	2.46%
9	国信证券股份有限公司	2,091,102	2.06%
10	傅莉明	1,000,068	0.98%

(五)截止到2015年6月11日,基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为20,402.44份,占该基金总份额的比例为0.008181%。其中,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0份。

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:朱学华

3、总经理:朱学华

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:基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

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

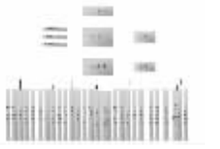
公司按照建立和完善公司治理结构的要求,设立董事会和监事会。

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:

截至至2015年3月31日,公司目前共有员工296人(含香港公司),主要来自国内外证券公司等金融机构,其中89%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:钱解

电话:(021)38969722

14、本基金基金经理

许之彦先生,理学博士,11年证券、基金从业经验,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2009年9月起同时担任上证180ETF及其联接基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014年11月起担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。

钱晶先生,金融工程硕士,FRM(金融风险管理师),组约大学金融工程硕士,上海交通大学工学学士,4年证券、基金从业经验。自2011年7月至2014年11月在国信证券经济研究所金融工程部,从事量化研究、分级基金研究工作。2014年12月加入华安基金管理有限公司,任量化分析师。2015年5月起担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理。

(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:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

4、住所:北京市西城区金融大街25号

5、成立时间:2004年09月17日

6、基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】12号

7、托管部门信息披露联系人:田肯

8、客服电话:(010)6759 5096

9、中国建设银行基本情况。

中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。

截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。

截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。

截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大:自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。

2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

10、主要人员情况。

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,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,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、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。

张力婷,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

11、基金托管业务经营情况。

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2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国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。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

(三)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京西城区太平桥大街17号

办公地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

电话:(010)59378839

传真:(010)59378907

联系人:朱立元

(四)基金验资机构

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层

办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人:吴港平

电话:(021)22288888

传真:(021)22280000

联系人:徐艳

经办会计师:徐艳、蒋燕华

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本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。

本基金截至2015年6月11日资产负债表如下:

单位:人民币元

项目	
资产:	
银行存款	176,333,366.94
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	71,569,433.80
其中:股票投资	71,569,433.80
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	–
应收证券清算款	–
应收利息	14,961.99
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	18,376.62
资产合计:	247,936,139.35
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	13,652.87
应付托管费	3,003.63
应付销售服务费	–
应付交易费用	65,999.42
应付税费	–
应付利息	–
应付利润	–
其他负债	4,205.10
负债合计	86,861.02
所有者权益:	
实收基金	249,384,967.95
未分配利润	-1,535,689.62
所有者权益合计	247,849,278.33
负债与所有者权益合计:	247,936,139.35

八、基金投资组合

截至2015年6月11日,本基金的投资组合情况如下:

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	71,569,433.80	28.87
	其中:股票	71,569,433.80	28.87
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	176,333,366.94	71.12
7	其他资产	33,338.61	0.01
8	合计	247,936,139.35	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 积极投资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股票。

2.2 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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	–	–
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	71,569,433.80	28.88
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	71,569,433.80	28.88

3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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前十名股票投资明细

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	600837	海通证券	473,556	12,809,689.80	5.17
2	600030	中信证券	366,400	11,754,112.00	4.74
3	000776	广发证券	195,200	5,455,840.00	2.20
4	601688	华泰证券	184,000	5,433,520.00	2.19
5	600999	招商证券	153,600	5,027,328.00	2.03
6	601377	兴业证券	240,000	4,087,200.00	1.65
7	000783	长江证券	219,200	3,901,760.00	1.57
8	601901	方正证券	252,600	3,768,792.00	1.52
9	600109	国金证券	103,200	3,284,856.00	1.33
10	601099	太平洋	163,200	2,614,464.00	1.05

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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4 报告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。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少本基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1本基金投资的中信证券(600030)和海通证券(600837)因存在违规为到期融资融券合约展期问题,2015年1月16日受到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金投资的招商证券(600999)因向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正,广发证券(000776)因向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,且涉及客户数量较多,2015年1月16日受到中国证监会责令限期改正的行政监管措施。报告期内,基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	14,961.99
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	18,376.62
9	合计	33,338.61

11.4 报告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。

11.5.1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不存在流通受限的情况。

11.5.2 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不存在流通受限的情况。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基上市交易后履行托管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、深圳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《基法法》、《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、基金管理人报解的计提和支付、基金托管人报解的计提和支付、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,督促基金管理人纠正。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中证全指证券公司指数分级证券投资基金募集的文件

(二)《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《华安中证全指证券公司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本基金管理人的住所。

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(www.huaan.com.cn)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人华安基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4008850099。

附件:基金合同摘要

第一部分、基金合同当事人及权利义务

一、基金管理人

(一)基金管理人简况

名称:华安基金管理有限公司

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

法定代表人:朱学华

设立日期: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:15亿元

存续期限:持续经营

联系电话:(021)38969999

(二)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召开基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会或其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

(12)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