

(上接B045版)

客户服务电话:020-83963933  
网址: www.gzs.com.cn  
32)上海证券有限责任公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号  
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号  
法定代表人:龚德雄  
电话:(021) 53519888  
传真:(021) 53519888  
客户服务电话:4008918918  
网址:www.shzq.com  
33)新时代证券有限责任公司  
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501  
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层  
法定代表人:刘汝军  
电话:(010) 83261149  
传真:(010) 83561094  
客户服务电话:400-698-9898?  
网址:www.xsdzq.cn  
34)东莞证券有限责任公司  
注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号  
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼  
法定代表人:张运勇  
电话:(0769) 22119351  
传真:(0769) 22119423  
客户服务电话: 0769-95328  
网址:www.dgzq.com.cn  
35)中原证券股份有限公司  
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号  
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号  
法定代表人:菅明军  
电话:(0371) 65586670  
传真:(0371) 65586665  
客户服务电话:96377  
网址:www.ccnew.com  
36)国都证券有限责任公司  
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层  
法定代表人:常喆  
电话:(010) 84183389  
传真:(010) 64482090  
客户服务电话:400-818-8118  
网址:www.guodu.com  
37)国盛证券有限责任公司  
注册地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦  
办公地址:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦  
法定代表人:曾小普  
电话:(0791) 6289771  
传真:(0791) 6289395  
客户服务电话:4008222111  
网址:www.gsstock.com  
38)齐鲁证券有限公司  
注册地址:山东省济南市经七路86号  
办公地址:山东省济南市经七路86号  
法定代表人:李玮  
传真:(0531) 68889752  
客户服务电话:96538  
网址:www.qlzq.com.cn  
39)中航证券有限公司  
注册地址:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层  
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层  
法定代表人:王宜四  
电话:(0791) 6768763  
传真:(0791) 6789414  
客户服务电话:4008966567  
网址:www.avicsec.com  
40)西部证券股份有限公司  
注册地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层  
办公地址:西安市东新街232号信托大厦16-17层  
法定代表人:刘建武  
电话:(029) 87406172  
客户服务电话:96582  
网址:www.westsecu.com.cn  
41)华福证券有限责任公司  
注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层  
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层  
法定代表人:黄金琳  
电话:(0591) 87383623  
传真:(0591) 87383610  
客户服务电话:(0591) 96326  
网址:www.hfzq.com.cn  
42)瑞银证券有限责任公司  
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
法定代表人:程宜祚  
电话:(010) 59226788  
传真:(010) 59226799  
客户服务电话:400-887-8827  
网址:www.ubssecurities.com  
43)中国中投证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层  
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层  
法定代表人:胡长生(代)  
电话:(0755) 82023442  
传真:(0755) 82026539  
客户服务电话:400-600-8008  
网站:http://www.china-invs.cn/  
44)中山证券有限责任公司  
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新研发大楼7层、8层  
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新研发大楼7层、8层  
法定代表人:黄扬录  
电话:(0755) 82943755  
传真:(0755) 82949511  
客户服务电话:4001022011  
网址:www.zszq.com.cn  
45)上海华信证券有限责任公司  
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼  
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼  
法定代表人:杨晓敏  
电话:(021) 38784818  
传真:(021) 68775878  
客户服务电话:(021) 38784818  
网址:http://www.shhxzq.com  
46)江海证券有限公司  
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号  
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号  
法定代表人:孙名扬  
电话:(0451) 82236863  
传真:(0451) 82287211  
客户服务电话:40066-62288  
网址:www.jhzq.com.cn  
47)华宝证券有限责任公司  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
法定代表人:陈林  
电话:(021) 50122107  
传真:(021) 50122078  
客户服务电话:4008209898  
网址:www.cnhbstock.com  
48)厦门证券有限公司  
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
法定代表人:傅毅辉  
电话:(0592) 5161642  
传真:(0592) 5161140  
客户服务电话:(0592) 5163588  
网址:www.xmzq.cn  
49)中天证券股份有限公司  
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲  
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲  
法定代表人:马功勋

电话:(024) 23266917  
传真:(024) 23255606  
客户服务电话:4006180315  
网址:www.stockren.com  
50)上海天天基金销售有限公司  
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室  
办公地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼  
法定代表人:其实  
电话:4001818188  
网址: www.1234567.com.cn  
51)上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室  
法定代表人:杨文斌  
电话:400-700-9665  
传真:021-68596916??  
网址: www.showbuy.com  
52)诺亚正行(上海)基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区 飞虹路360弄9号3724室  
办公地址:上海杨浦区泰皇岛路32号东码头园区C栋 2楼  
法定代表人:汪静波  
电话:021-38600676  
传真: 021-38509777  
客户服务电话:400-821-5399  
网址: www.noah-fund.com  
53)杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号  
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼  
法定代表人:陈柏青  
电话:4000-766-123  
网址: www.fund123.cn  
54)上海长量基金销售投资顾问有限公司  
注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区浦大道55号裕景国际B座16层  
法定代表人:张跃伟  
电话:021-58788678  
传真:021-58787698  
客服电话:400-089-1289  
网址: www.e-rich.com.cn  
55)深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资置地大厦8楼  
法定代表人:薛峰  
客服电话:4006-788-887  
网址:www.zlfund.cn www.jmmw.com  
56)中国国际金融股份有限公司  
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座6层、26层、27层及28层  
法定代表人:丁学东  
电话:(010) 65051166  
传真:(010) 65051156  
客户服务电话:(010) 65051166  
网址:www.cicc.com.cn  
57)北京展恒基金销售有限公司  
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号  
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层  
法定代表人:闫振杰  
电话:(+86-10) 400-888-6661  
传真:(+86-10)62020088-8802  
客户服务电话:4008886661  
网址:www.myfj.cn  
58)北京恒天明泽基金销售有限公司  
地址: 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层  
法定代表人:梁越  
客服电话:4008980618  
网址:www.chtfund.com/  
59)一路财富(北京)信息科技有限公司  
地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208  
法定代表人:吴雪涛  
客服电话:4000011566  
网址:www.yilucaifu.com  
60)海银基金销售有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元  
办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元  
法定代表人:刘惠  
联系电话:021-80133888  
传真号码:021-80134113  
客户服务电话: 400-808-1016  
网站: http://www.fundhaiyin.com  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构为本基金的场外发  
售机构,并及时公告。  
2.场内发售机构  
本基金的场内发售机构为具有基金代销售资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可  
在深圳证券交易所网站查询)。  
(二)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:金颖  
电话:(010) 59378835  
传真:(010) 59378839  
联系人:朱立元  
(三)律师事务所和经办律师  
名称:通力律师事务所  
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人:韩朝  
电话:(021) 31358666  
传真:(021) 31358600  
联系人:王利民  
经办律师:秦悦民、王利民  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦6 楼  
首席合伙人:杨绍信  
联系电话:(021) 23238988  
传真:(021) 23238800  
联系人:周伟  
经办会计师:汪隼、周伟  
四.基金的名称  
本基金名称:华安深证300指数证券投资基金(L0F)  
五.基金的类型  
本基金类型:上市契约开放式。  
六.基金的投资目标  
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。  
七.基金的投资方向  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票  
(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票)、债券、货币市场工具、权证、  
资产支持证券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  
的相关规定)。  
本基金以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象,为更好实现投资目标,本  
基金可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  
证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,  
可以将其纳入投资范围。  
八.基金的投资策略  
(一)投资策略  
本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制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,并根据标的指数的成份股及其权重  
的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法  
规禁止或限制等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成  
份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟  
踪标的指数的目的。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股  
将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权  
重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。  
正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不得超过  
4%。当预期指数成份股或权重调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因市场

因素影响或法律法规限制等特殊情形导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人  
将对基金的投资组合进行适当调整,采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

基于流动性管理的需要,本基金投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策  
性金融债,目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产;同时,本基金也将适当参与  
债券配售,提高基金资产的投资收益。

(二)投资管理  
1.投资决策依据  
(1)法律法规和本《基金合同》的有关规定;  
(2)标的指数编制、调整等相关规定;  
(3)对证券市场发展趋势的研究与判断。  
2.投资决策体系

本基金管理人实行三级决策体系下的基金经理负责制。三级决策体系的责任主体是投  
资决策委员会、投资协调小组和基金经理。决策管理的原则是集体决策、分层授权、职责明  
确和运作规范。投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,投资协调小组是基金投资的  
协调机构和中间桥梁,投资协调小组由基金投资部、被动投资部、研究发展部、固定收益部  
的负责人及业务骨干组成。基金经理是基金运作的直接管理人。

3.投资管理程序  
研究支持、投资决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的  
投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。  
(1)研究支持:被动投资部依托公司整体研究平台,整合外部研究机构的研究成果开  
展标的指数跟踪,通过对成份股公司行为等相关信息的搜集与分析,进行基金资产流动性  
分析、跟踪误差及其归因分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据被动投资部金融工程小组提供的研究报告,定期  
召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的  
决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理以完全复制标的指数成份  
股权重的方式来构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适  
当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行:集中交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。  
(5)绩效评估:风险管理部定期和不定期对投资组合的偏离度和跟踪误差进行跟踪和  
评估,并对风险隐患提出预警。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来  
源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、成份股  
公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,采  
取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。  
(7)合规监察:合规监察稽核部对整个投资管理流程进行实时监督。

基金管理人人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上  
述投资管理程序做出调整,并在基金招募说明书更新中公告。

#### 九.基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准: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

如果深证300价格指数被停止编制及发布,或深证300价格指数由其他指数替代(单纯  
更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致深证300价格指数不宜继续作为标的指  
数,或证券市场出现其他更合适投资的指数作为本基金的指数,本基金管理人可以依  
据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指  
数和投资对象(包括但不限于依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素  
选择确定新的标的指数),并相应变更业绩比较基准。基金管理人应在调整后3个工作日内  
至少一种中国证监会指定媒体上公告,并在更新的招募说明书中列示。

#### 十.基金的风险收益特征

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。

#### 十一.基金投资组合报告

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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15日复核  
了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年6月30日。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,473,222.08	90.97
	其中:股票	41,473,222.08	90.97
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	4,064,647.40	8.89
7	其他资产	63,348.99	0.14
8	合计	45,591,218.47	100.00

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	431,500.43	0.99
B	采矿业	903,534.85	2.07
C	制造业	25,148,298.01	57.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	810,117.07	1.86
E	建筑业	539,666.28	1.24
F	批发和零售业	1,296,694.46	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	307,229.52	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,068,671.29	11.63
J	金融业	1,920,189.69	4.41
K	房地产业	1,735,835.45	3.98
L	租赁和商务服务业	857,022.32	1.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	814,568.81	1.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	63,487.68	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,453,076.13	3.33
S	综合	121,330.09	0.28
	合计	41,473,222.08	96.18

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,741.10
5	000858 五粮液	18,869	598,147.30
6	000002 万科A	39,491	573,409.32
7	000069 华侨城A	36,987	489,091.26
8	000768 中航飞机	10,514	458,200.12
9	002415 海康威视	9,959	446,163.20
10	300144 宋城演艺	5,600	428,232.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000982 中顺纸业	180,133	1,615,793.01
2	000333 美的集团	23,339	870,077.92
3	000651 格力电器	13,248	846,547.20
4	300659 东方财富	10,790	680,7