

（续前表）

网址: www.hbg.com.cn 客户服务热线: 4001-9626 (116) 华泰证券股份有限公司 住所: 深圳市福田区华强北路101号 办公地址: 深圳市福田区华强北路101号 联系人: 李勇 电话: 0755-8262442 传真: 0755-8262442	基金名称: 华泰沪深300指数证券投资基金 基金代码: 001911 基金简称: 华泰沪深300 基金管理人: 华泰证券股份有限公司 基金托管人: 交通银行股份有限公司 基金销售机构: 华泰证券股份有限公司 基金募集机构: 华泰证券股份有限公司 基金募集日期: 2015年4月17日 基金合同生效日期: 2015年5月11日 基金合同期限: 不定期
--	---

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002032	国农科技	15,537,058	299,948,325.48	6.31
2	600048	华鲁能源	25,499,916	292,994,034.84	6.17
3	300077	国民技术	7,333,662	291,513,064.50	6.14
4	600887	伊泰股份	8,653,962	286,930,427.30	6.12
5	601166	兴业银行	12,868,701	236,269,356.36	4.97
6	300070	华讯方舟	4,499,841	195,023,108.94	4.11
7	601633	长城汽车	2,869,962	146,798,633.92	3.13
8	600282	中远海运	4,055,336	139,278,464.44	2.95
9	002572	索菲亚	4,244,554	132,414,884.80	2.79
10	002601	特力股份	4,499,772	131,978,312.76	2.78

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,050,000.00	2.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	162,521,060.00	3.42
4	企业短期融资券	162,521,060.00	3.42
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	262,571,060.00	5.53

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	011801	国债1301	1,866,500	162,521,060.00	3.42
2	019428	14债附息2	500,000	50,075,000.00	1.05
3	019501	15债附息1	500,000	49,975,000.00	1.05
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	应付债券	1,907,769.64	
2	应收证券清算款	19,912,193.98	
3	应收股利	-	
4	应收利息	3,919,972.51	
5	应收申购款	12,532,678.24	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	预收	-	
9	其他	37,443,648.38	

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	误差③
2009年12月11日至2009年12月31日	1.50%	0.54%	-0.02%	1.30%
2010年1月1日至2010年12月31日	-3.94%	1.28%	-9.12%	1.28%
2011年1月1日至2011年12月31日	-30.05%	1.31%	-19.67%	1.04%
2012年1月1日至2012年12月31日	11.29%	1.24%	7.04%	4.25%
2013年1月1日至2013年12月31日	-1.84%	1.26%	-5.30%	3.46%
2014年1月1日至2014年12月31日	23.89%	1.07%	41.16%	0.97%
2015年1月1日至2015年6月30日	31.42%	1.37%	12.08%	1.46%

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
赎回金额(F=C-E)	11,940,000.00
净赎回金额(F+H-I+G)	11,939,500.00
净赎回金额(F+H-I)	11,939,000.00
转入基金份额(J=I/G)	9,951,673.57
转入基金份额(K=H/J)	913.89

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
净赎回金额(F+H-I+G)	1,193.50
净赎回金额(F+H-I)	1,193.00
转入基金份额(J=I/G)	995.00
转入基金份额(K=H/J)	91.39

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
赎回金额(F=C-E)	1,194.00
赎回金额(F=C-E)	1,1