华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

2016 半年度 报告摘要

2016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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年八月二十六日

1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安德国30(DAX)ETF(QDII)
场内简称	德国30
基金主代码	513030
交易代码	513030
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2014年8月8日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	217,779,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014年9月5日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数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票及其权重的变动进行相应调整。因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。 正常情况下,本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	德国DAX指数(DAX Index)收益率(经汇率调整后的总收益指数收益率)
风险收益特征	本基金属股票指数基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金为境外证券投资的基金,主要投资德国证券市场上市的德国企业,需要承担汇率风险、境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱崐	张燕
	联系电话	021-38969999	95555
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		140 Broadway New York,NY 1005
办公地址		140 Broadway New York,NY 1005
邮政编码		NY 1005

2.5 信息披露方式

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层、32层

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(2016年1月1日至2016年6月30日)
本期已实现收益	3,219,881.94
本期利润	-13,842,087.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0624
本期基金份额净值增长率	-6.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1514
期末基金资产净值	184,811,819.38
期末基金份额净值	0.849

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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
过去一个月	-5.03%	2.75%	-5.12%	2.78%	0.09%	-0.03%
过去三个月	-2.86%	1.79%	-2.28%	1.81%	-0.58%	-0.02%
过去六个月	-6.81%	1.67%	-6.34%	1.73%	-0.47%	-0.06%
过去一年	-11.65%	1.61%	-5.05%	1.69%	-6.60%	-0.08%
成立起至今	-15.10%	1.49%	-4.31%	1.61%	-10.79%	-0.12%

注:本基金的业绩比较基准为德国DAX指数(DAX Index)收益率(经汇率调整后的总收益指数收益率)。

根据本基金合同的有关规定:本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金,依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品和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相关规定)。

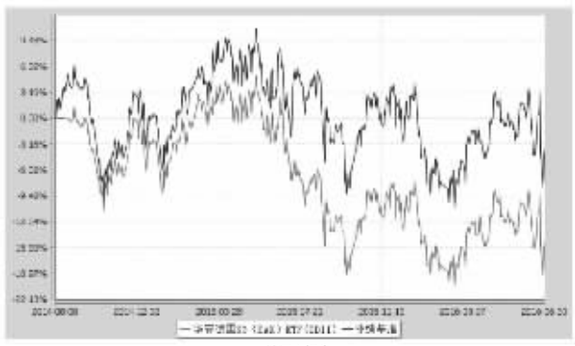
本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。

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

华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

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

(2014年8月8日至2016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2016年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、华安上证龙头企业ETF联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证300指数(LOF)、华安科技动力混合、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、华安月安鑫短期理财债券、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克100指数、华安黄金易ETF、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头(DAX)ETF、华安国际龙头(DAX)ETF联接、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证金指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板50指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板50ETF等77只开放式基金。管理资产规模达到1403.87亿元人民币。

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		
徐宜宜	基金经理	2014-08-08	-	10年	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),10年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职,2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5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职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)的基金经理。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及华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年12月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。

注: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。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

4.3 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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1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,超过授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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、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 。

4.4.2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,出现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%的次数为1次,未出现异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

德国30指数(DAX)在报告期内表现为震荡上升的走势,包含分红在内以欧元计价下跌近9.89%,该指数在报告期内振幅高达16.63%。DAX价格波动的主要原因是1) 一季度的时候德银在其大宗衍生品交易上的投资失误,造成其股价大跌,而德银所占份额在DAX30指数中达到了2.6%。这直接导致了DAX指数在一季度的时候顺势下滑。2)美元指数走强,股市承压。3)脱欧派以52%的得票率在英国是否脱离欧盟的公投中胜出,影响股市。4)公用事业、电信和保险业等上涨的板块带领股指走高。5)因对英国公投结果为退出欧盟的不安情绪有所缓解,且油价上涨和对追加货币刺激措施的期望也扶助市场表现。总体看,德国经济韧性较强,在欧元区内表现仍然最佳。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截止2016年6月30日,本基金份额净值为0.849元,本报告期份额净值增长率为-6.81%,同期业绩比较基准增长率为-6.34%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年我们预计欧洲经济在长期挣扎后有望表现较佳。首先是宽松的货币政策,其次经过多年消化,各国的财政状况已经明显改善,劳动生产率的全球竞争能力有所提高,劳动市场出现回暖势头,房地产领域资金流入明显,各类资产价格回升,而消费,特别是服务业PMI连续处于50以上。欧洲经济经过多年来的改革,去杠杆,正在部分重演美国经济几年前的复苏态势。而欧洲股市估值相对全球处于低位。但是,欧洲也面临地缘政治,移民等不利因素。

作为DAX ETF基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.7 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:基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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:

翁启森,基金投资部兼全球投资部高级总监,总经理助理,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。2008年4月加入华安基金管理有限公司,现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理,华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明,投资研究部高级总监,研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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,现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理,投资研究部高级总监。

贺涛,金融学硕士,固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安康保本的基金经理,固定收益部总监。

许之彦,指数投资部高级总监,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,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安深证300指数(LOF)、华安易富黄金ETF及联接、华安中证金指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板50指数分级、华安创业板50ETF的基金经理,指数投资部高级总监。

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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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:华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2016年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产:	-	-
银行存款	3,879,986.70	11,608,230.32
结算备付金	4,885,088.34	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	177,004,303.15	195,738,218.42
其中:股票投资	177,004,303.15	195,738,218.42
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
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	578.55	2,263.11
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	185,769,956.74	207,348,711.85
负债和所有者权益	**本期末 2016年6月30日**	**上年度末 2015年12月31日**
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	541,355.51	-
应付赎回款	-	463,412.31
应付管理人报酬	119,890.36	137,795.77
应付托管费	29,972.60	34,448.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	266,918.89	491,740.00
负债合计	958,137.36	1,127,397.03
所有者权益:	-	-
实收基金	217,779,000.00	226,279,000.00
未分配利润	-32,967,180.62	-20,057,685.18
所有者权益合计	184,811,819.38	206,221,314.82
负债和所有者权益总计	185,769,956.74	207,348,711.85

注:报告截止日2016年6月30日,基金份额净值0.849元,基金份额总额217,779,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入	-12,558,183.72	36,436,246.41
1.利息收入	10,529.23	188,688.91
其中:存款利息收入	10,529.23	188,688.91
债券利息收入	-	-
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)	4,203,767.19	40,642,403.39
其中:股票投资收益	-194,111.42	31,715,752.88
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,397,878.61	8,926,650.51
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-17,061,969.68	1,935,941.69
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	244,122.03	-875,678.91
5.其他收入(损失以"-"号填列)	45,367.51	-5,455,108.67
减:二、费用	1,283,904.02	3,885,263.24
1. 管理人报酬	755,427.95	2,534,068.13
2. 托管费	188,856.94	633,516.95
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,747.81	328,568.25
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	336,871.32	389,109.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-13,842,087.74	32,550,983.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-13,842,087.74	32,550,983.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	226,279,000.00	-20,057,685.18	206,221,314.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,842,087.74	-13,842,087.74
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)	-8,500,000.00	932,592.30	-7,567,407.70
其中:1.基金申购款	14,000,000.00	-2,303,801.61	11,696,198.39
2.基金赎回款	-22,500,000.00	3,236,393.91	-19,263,606.09
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)	217,779,000.00	-32,967,180.62	184,811,819.38
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	890,779,000.00	-38,924,099.52	851,854,900.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,550,983.17	32,550,983.17
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)	-494,500,000.00	-8,935,343.93	-503,435,343.93
其中:1.基金申购款	253,500,000.00	-3,772,234.21	249,727,765.79
2.基金赎回款	-748,000,000.00	-5,163,109.72	-753,163,109.72
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)	396,279,000.00	-15,308,460.28	380,970,539.72

注:报告期末基金份额净值为0.849元,其中:买入股票的差价收入0.000元,卖出股票的差价收入0.000元,任意一个交易日的最大浮盈为0.000元,任意一个交易日的最大浮亏为0.000元,持有的股票在报告期内没有发生过信用事件,本期国债利息收入0.000元,债券投资的应计利息0.000元,其他0.000元。

6.4.2.2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。

6.4.2.3报告期末前十名股票明细

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	BAYN GY	拜耳股份有限公司	23,600	15,664,500.00	8.48
2	SIE GY	西门子	22,900	15,505,561.38	8.39
3	BAS GY	巴斯夫欧洲公司	28,800	14,579,136.00	7.89
4	SAP GY	SAP公司	29,300	14,512,436.50	7.85
5	ALV GY	安联保险	14,300	13,478,107.50	7.29
6	DAI GY	戴姆勒克莱斯勒	31,200	12,314,952.00	6.66
7	DTE GY	德国电信	99,200	11,178,848.00	6.05
8	FRE GY	费森尤斯集团	12,200	5,922,154.50	3.20
9	ADS GY	阿迪达斯公司	6,100	5,778,644.38	3.13
10	DPW GY	德国邮政有限公司	30,000	5,569,968.75	3.01

7.4.2积极投资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益投资明细

无。

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BAYER AG-REG	BAYN GY	1,076,067.77	0.52
2	PROSIEBENSAT.1MEDIA SE	PSM GY	932,799.60	0.45

注:本项"买入金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	SIEMENS AG-REG	SIE GY	1,003,077.64	0.49
2	K+S AG-REG	SDF GY	940,214.10	0.46
3	ADIDAS AG	ADS GY	424,216.12	0.21
4	FRESENIUS SE & CO KGAA	FRE GY	301,050.60	0.15
5	VONOVIA SE	VNA GY	274,090.84	0.13
6	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	DBK GY	251,660.37	0.12
7	RWE AG	RWE GY	80,117.81	0.04
8	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GY	65,616.79	0.03
9	MERCK KGAA	MRK GY	64,825.43	0.03
10	COMMERZBANK AG	CBK GY	43,010.15	0.02
11	THYSSENKRUPP AG	TKA GY	38,821.69	0.02

注:本项"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	2,008,867.37
卖出收入(成交)总额	3,486,701.54

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(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11投资组合报告附注

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	578.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	578.55

7.11.4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。

7.11.5期末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。

报告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
1,800	120,988.33	170,340,861.00	78.22%	47,438,139.00	21.78%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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(2014年8月8日)基金份额总额	337,779,000.00
本报告期期初基金份额总额	226,279,000.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	22,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	217,779,000.00

注:总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

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

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。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

本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稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	1	4,419,501.14	80.42%	2,209.27	80.42%	-
Barclays Capital Asia Limited.	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	1	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	1	1,076,067.77	19.58%	538.05	19.58%	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:1、券商专用交易单元选择标准:

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持,具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下:

(1)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;

(2)具备高效、安全的通讯条件;可靠、诚