

信息披露

华安沪深300 量化增强证券投资基金

2018年第三季度报告

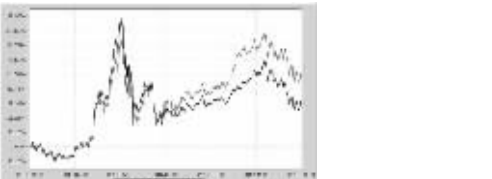


图2 华安沪深300 量化增强 C

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司
重要提示: 基金管理人及基金托管人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...

4 基金管理人报告

4.1 基金基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

曹理, 15年, 毕业于上海交通大学, 曾任交通银行、浦发银行、光大银行、招商证券、华安基金等机构投资经理...

曹理, 2015年12月25日至今, 基金经理

注: 此表列明任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告为准, 证券从业的年限从取得证券投资基金从业资格注册之日起计算...

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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: 封闭式基金交易费用, 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...

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字...

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明的执行情况
4.3.3 公平交易专项说明的结论

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注: 1. 本报告期末持有A股股票公允价值占基金资产净值比例4.52%, 其中公允价值变动损益为-1,224,368.87元...

5.3 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股票投资明细

Table with columns: 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(%)

注: 1. 本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股票投资明细...

5.4 报告期末按市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

Table with columns: 序号, 债券品种, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

注: 1. 本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...

5.5 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

Table with columns: 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(%)

注: 1. 本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...

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with columns: 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(%)

注: 1. 本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...

5.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.7.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
5.7.2 股指期货投资对基金资产净值变动的影响

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
5.8.2 国债期货投资对基金资产净值变动的影响

5.9 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细
5.9.2 期权投资对基金资产净值变动的影响

5.10 报告期末本基金投资的贵金属投资情况

5.10.1 报告期末贵金属持仓和损益明细
5.10.2 贵金属投资对基金资产净值变动的影响

5.11 报告期末本基金投资的境外证券投资情况

5.11.1 报告期末本基金投资的境外证券投资持仓和损益明细
5.11.2 境外证券投资对基金资产净值变动的影响

5.12 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.13 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.1 报告期末, 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况...

5.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

华安沪深300 量化增强证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司
重要提示: 基金管理人及基金托管人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...

4 基金管理人报告

4.1 基金基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

曹理, 15年, 毕业于上海交通大学, 曾任交通银行、浦发银行、光大银行、招商证券、华安基金等机构投资经理...

曹理, 2015年12月25日至今, 基金经理

注: 此表列明任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告为准, 证券从业的年限从取得证券投资基金从业资格注册之日起计算...

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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: 封闭式基金交易费用, 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...

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字...

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明的执行情况
4.3.3 公平交易专项说明的结论

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

华安沪深300 量化增强证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司
重要提示: 基金管理人及基金托管人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...

4 基金管理人报告

4.1 基金基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

曹理, 15年, 毕业于上海交通大学, 曾任交通银行、浦发银行、光大银行、招商证券、华安基金等机构投资经理...

曹理, 2015年12月25日至今, 基金经理

注: 此表列明任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告为准, 证券从业的年限从取得证券投资基金从业资格注册之日起计算...

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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: 封闭式基金交易费用, 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...

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字...

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明的执行情况
4.3.3 公平交易专项说明的结论

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

华安沪深300 量化增强证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司
重要提示: 基金管理人及基金托管人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...

4 基金管理人报告

4.1 基金基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理从业年限, 说明

曹理, 15年, 毕业于上海交通大学, 曾任交通银行、浦发银行、光大银行、招商证券、华安基金等机构投资经理...

曹理, 2015年12月25日至今, 基金经理

注: 此表列明任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告为准, 证券从业的年限从取得证券投资基金从业资格注册之日起计算...

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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: 封闭式基金交易费用, 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...

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 超额收益③, ④-⑤, ⑥-⑦

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, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字...

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 公平交易专项说明的执行情况
4.3.3 公平交易专项说明的结论

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...

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定期监控基金交易, 交易前由风控部进行公平交易监控, 事中由风控部进行实时监控...