华安日日鑫货币市场基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

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16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安日日鑫货币	
基金主代码	040038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月26日	
报告期末基金份额总额	1,125,164,936.96份	
投资目标	为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考察宏观经济形势、市场资金面走势、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
下属分级基金的交易代码	040038	040039
报告期末下属分级基金的份额总额	389,914,489.01份	735,250,447.95份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
1.本期已实现收益	4,903,875.31	6,402,378.54
2.本期利润	4,903,875.31	6,402,378.54
3.期末基金资产净值	389,914,489.01	735,250,447.95

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安日日鑫货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0089%	0.0039%	0.2693%	0.0000%	0.7396%	0.0039%

2、华安日日鑫货币B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0694%	0.0039%	0.2693%	0.0000%	0.8001%	0.0039%

注:本基金收益分配按月结转份额。

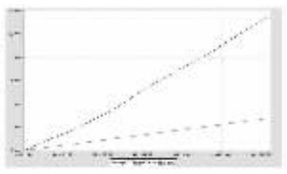
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金

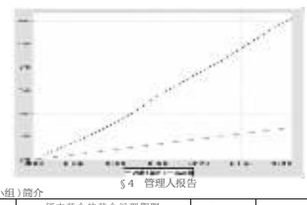
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年11月26日至2015年6月30日)

1、 华安日日鑫货币A



2.华安日日鑫货币B



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙丽娜	本基金的基金经理	2014-8-30	-	4年	硕士研究生,4年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理。2014年8月起担任本基金及华安汇财通货币市场基金、华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。
郑可成	本基金的基金经理、固定收益部助理总监	2012-11-26	-	13年	硕士研究生,13年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在闽发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建信托投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。 2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月起同时担任本基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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、交易执行等方面全面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,超过授权限制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以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易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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,出现同日反向交易或交易交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,国内经济依然相对较弱,货币政策保持较为宽松,央行降息降准,市场流动性充裕,股票市场大幅上涨,投资者加杠杆意识较强,但随着场外配资等问题暴露和监管层加大检查力度,市场在过度上涨和高杠杆下带来了快速调整。本基金坚持跟踪误差管理,尽管经历了规模大幅上涨,但运作依然平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为3.8984元,本报告期份额净值增长率为9.01%,同期业绩比较基准增长率为8.37%。日跟踪误差为0.036%,年化为0.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,在低利率环境和国内创新转型的背景下,政府投资也会加快,房地产市场已经有所回暖。国内宏观经济有望逐步企稳,我们认为,中长期中国经济转型的道路虽有坎坷,但还是要充满信心。国内市场近期第一次经历了杠杆牛市后的暴跌,市场可能需要时间消化,但市场有望恢复理性,市场主流资金重新回到蓝筹市场,我们对以蓝筹为核心的上证180指数相对乐观。作为上证180ETF的管理人,我们将继续秉承既定的投资目标与策略,规范运作,勤勉尽责,充分权合指数,减少跟踪误差,为投资者提供优质的上证180指数投资工具。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	629,946,754.23	49.04
	其中:债券	629,946,754.23	49.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	496,376,784.56	38.65
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	127,554,656.94	9.93
4	其他资产	30,569,309.15	2.38
5	合计	1,284,447,504.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	9.10
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	151,069,524.46	13.43
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限期末情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过90天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过90天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	69.67	13.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	14.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	6.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	11.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	111.43	13.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,074,798.68	5.34
	其中:政策性金融债	60,074,798.68	5.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	569,871,955.55	50.65
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	629,946,754.23	55.99
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071533004	15华融证券CP004	600,000	59,988,617.58	5.33
2	071526002	15兴业证券CP002	500,000	49,994,357.05	4.44
3	071525005	15国都证券CP005	500,000	49,991,336.44	4.44
4	071530003	15财通证券CP003	400,000	39,999,227.15	3.55
5	071516004	15华泰证券CP004	400,000	39,999,107.18	3.55
6	140218	14国开18	300,000	30,016,984.71	2.67
7	071524003	15东兴证券CP003	300,000	30,007,317.75	2.67
8	071536002	15华安证券CP002	300,000	30,002,068.97	2.67
9	071521003	15渤海证券CP003	300,000	29,997,743.44	2.67
10	071530005	15财通证券CP005	300,000	29,994,390.78	2.67

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	5次
报告期内偏离度的最高值	0.2739%
报告期内偏离度的最低值	0.0758%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1585%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。

5.8.2 本报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 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	应收利息	5,934,529.68
4	应收申购款	24,634,779.47
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	30,569,309.15

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
报告期期初基金份额总额	507,334,773.40	370,457,760.26
报告期期间基金总申购份额	1,311,782,591.95	1,145,030,914.10
减:报告期期间基金总赎回份额	1,429,202,876.34	780,238,226.41
报告期期末基金份额总额	389,914,489.01	735,250,447.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	申购	2015-04-07	185,000,000.00	185,000,000.00	0.00%
2	赎回	2015-04-09	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.00%
3	申购	2015-04-22	55,000,000.00	55,000,000.00	0.00%
4	申购	2015-04-30	15,000,000.00	15,000,000.00	0.00%
5	申购	2015-05-07	35,000,000.00	35,000,000.00	0.00%
6	申购	2015-05-14	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
7	赎回	2015-05-20	-6,000,000.00	-6,000,000.00	0.00%
8	申购	2015-05-21	56,000,000.00	56,000,000.00	0.00%
9	申购	2015-05-28	38,000,000.00	38,000,000.00	0.00%
10	赎回	2015-06-02	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
11	申购	2015-06-05	55,000,000.00	55,000,000.00	0.00%
12	赎回	2015-06-18	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
13	赎回	2015-06-26	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
合计			368,000,000.00	368,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安日日鑫货币市场基金基金合同》

2、《华安日日鑫货币市场基金基金招募说明书》

3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

上证180交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

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16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安上证180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年4月13日
报告期末基金份额总额	2,355,557,679.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	采取抽样复制的指数跟踪方法,即根据定量化的选股指标,选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合,并通过优化模型确定投资组合中个股的权重,以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	上证180指数
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	3,536,685,282.67
2.本期利润	2,429,777,945.20
3.加权平均基金份额本期利润	1.333
4.期末基金资产净值	9,182,905,167.05
5.期末基金份额净值	3.8984

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。

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。

3.2 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

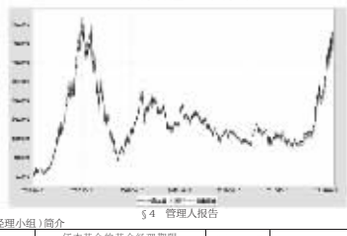
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.01%	2.59%	8.37%	2.61%	0.64%	-0.02%

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

上证180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

(2006年4月13日至2015年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、指数与量化投资事业总部高级总监	2009-9-5	-	11年	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月起同时担任本基金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。2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。
章海默	本基金的基金经理、指数投资部助理总监	2012-12-22	-	11年	复旦大学管理学院工商管理硕士,复旦大学经济学学士,11年基金从业经历。曾在安永华明会计师事务所工作,2003年9月加入华安基金管理有限公司,任基金运营部基金核算主管,2009年12月至2012年12月担任华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2011年9月至2012年12月担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2012年12月起担任上证180交易型开放式指数证券投资基金及本基金的基金经理。2013年6月起担任指数投资部助理总监。2013年12月起同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年11月起担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金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 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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、交易执行等方面全面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,超过授权限制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以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易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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,出现同日反向交易或交易交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,国内经济依然相对较弱,货币政策保持较为宽松,央行降息降准,市场流动性充裕,股票市场大幅上涨,投资者加杠杆意识较强,但随着场外配资等问题暴露和监管层加大检查力度,市场在过度上涨和高杠杆下带来了快速调整。本基金坚持跟踪误差管理,尽管经历了规模大幅上涨,但运作依然平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.5222元,本报告期份额净值增长率为10.18%,同期业绩比较基准增长率为7.96%,超额收益2.22%。跟踪误差0.09%,年化跟踪误差1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,在市场发生剧烈波动之后,市场的风险偏好恢复往往需要一定时间,从历史经验来看,可能需要1-2个季度。同时,在IPO暂缓后,低风险偏好的打新资金或流向其他资产类别寻求避险。市场将又重新回到存量博弈的模式,对基本面和公司选择的要求将越来越高。之前依赖资金推动的模式,将逐步转化为基本面驱动的模式。作为上证180ETF联接基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相似合的原则,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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	19,768,000.00	3.00
	其中:股票	19,768,000.00	3.00
2	基金投资	591,700,122.70	89.91
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	38,514,857.95	5.85
8	其他资产	8,090,801.82	1.23
9	合计	658,073,782.47	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	华安上证180交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	591,700,122.70	91.81

5.3 报告期末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	12,810,000.00	1.99
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	6,958,000.00	1.08
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	19,768,000.00	3.07

注:此处股票投资含可退替代款估值增值2,888,642.48元。

5.2 报告期末权行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极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	6,508,499.40	0.07
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	-	-
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	6,508,499.40	0.07

5.2.2 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	31,342,712.96	0.34
B	采矿业	485,868,123.71	5.29
C	制造业	2,170,034,347.18	23.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	284,638,740.83	3.10
E	建筑业	480,705,142.19	5.23
F	批发和零售业	120,744,038.40	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	356,760,584.17	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	363,729,471.47	3.96
J	金融业	3,884,934,231.23	42.31
K	房地产业	425,310,363.99	4.63
L	租赁和商务服务业	46,659,008.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	7,204,072.00	0.08
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	57,224,410.66	0.62
S	综合	26,558,916.04	0.29
	合计	8,741,714,162.83	95.20

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告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) |