华安日日鑫货币市场基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§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2016年1月18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10月1日起至12月31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	1,340,876,778.31份	
投资目标	为满足投入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,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、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,确定各类资产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	373,339,854.99份	967,536,923.32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10月1日-2015年12月31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	2,425,270.25	7,844,792.06
2. 本期利润	2,425,270.25	7,844,792.06
3. 期末基金资产净值	373,339,854.99	967,536,923.32

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	0.7008%	0.0011%	0.2722%	0.0000%	0.4286%	0.0011%

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	0.7616%	0.0011%	0.2722%	0.0000%	0.4894%	0.0011%

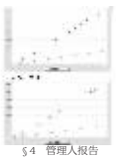
注:本基金收益分配按月结转份额。

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12月31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		
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部副理总监。	2012-11-26	-	14年	硕士研究生,14年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在国发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2006年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2006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顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015年11月起,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月起,同时担任华安安惠保本混合型证券投资基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2014-8-30	-	5年	硕士研究生,5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顺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。

4.4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

经历三季度整体大幅下跌后,四季度市场整体大幅上涨。前期跌幅较大的个股整体表现较好,但行业、个股分化加剧。上半年表现较好的互联网金融超跌反弹后持续性不强,市场持续挖掘新的符合行业趋势的细分领域,另外一些重组或并购复牌的"准新股"表现抢眼。

升级主题在三季度末维持了上季度较高的仓位,在市场反弹中表现较好。随着市场的反弹,组合减持了计算机行业配置比例,增加了前期滞涨板块的比例,但整体依然围绕创新和改革的思路,寻找受益的消费升级、生产资料升级的品种。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.713元,本报告期份额净值增长率为38.59%,同期业绩比较基准增长率为13.66%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,2016年经济环境相比2015年可能会有变化,但是创新、改革的大方向没有变化。组合的结构依然围绕消费升级、生产资料升级这两条线索下的品种展开。

未来一段时间,"旧经济"的问题仍未完全解决,"新经济"仍在培育,整体增速难以回到过去,通胀不高,宽松的货币条件还在,市场仍然存在机会。另一方面,在目前的基准利率下,降息的空间比2015年有限,杠杆水平难以回到上半年峰值。此外,供给端随着注册制的推进可能比2015年大。2016年,二级市场供需环境将出现微妙变化。

经济结构升级的趋势仍在持续。供给侧改革,一方面淘汰落后产能、另一方面对高品质产品和服务的供给升级同样值得关注。国内新兴中产阶层的消费能力远未充分释放,但与这种消费能力匹配的产品和服务供给远不足,因此催生了"海淘"等现象。我们欣喜地看到年底国产电影的票房火爆、一些国产现象级电视剧在年轻人中热议,表明国内公司尤其是一些上市公司抓住了经济结构升级和消费服务升级的趋势。我们将持续挖掘这样的标的,努力创造良好收益。

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	838,884,888.10	54.78
	其中:债券	838,884,888.10	54.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	453,478,720.22	29.61
	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	222,511,774.65	14.53
4	其他资产	16,583,813.29	1.08
5	合计	1,531,459,196.26	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	16.70	
	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	186,999,706.50	13.95
	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基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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	26.58	13.95
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	32.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	27.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	14.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	11.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.97	13.95

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	70,016,827.49	5.22
	其中:政策性金融债	70,016,827.49	5.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	589,934,082.41	44.00
6	中期票据	-	-
7	同业存单	178,933,978.20	13.34
8	其他	-	-
9	合计	838,884,888.10	62.56
10	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	111510314	15兴业CD314	600,000	59,551,128.78	4.44
2	110402	11农发02	500,000	50,007,975.16	3.73
3	111509220	15浦发CD220	500,000	49,604,206.31	3.70
4	111513003	15浙商CD003	400,000	39,980,026.55	2.98
5	041562036	15阳泉CP004	300,000	30,064,802.00	2.24
6	071525006	15国都证券CP006	300,000	29,996,820.97	2.24
7	071525007	15国都证券CP007	300,000	29,995,445.01	2.24
8	011599942	15南方水泥SCP008	300,000	29,995,190.46	2.24
9	041561041	15金元CP001	300,000	29,989,445.45	2.24
10	011599565	15京能洁能SCP004	300,000	29,989,118.67	2.24

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1751%
报告期内偏离度的最低值	0.1016%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1322%

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 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	8,956,049.45
4	应收申购款	7,627,763.84
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,583,813.29

§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	378,561,867.37	1,060,614,737.08
报告期期间基金总申购份额	517,308,403.15	377,098,564.87
减:报告期期间基金总赎回份额	522,530,415.53	470,176,378.63
报告期期末基金份额总额	373,339,854.99	967,536,923.32

§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	2015-10-14	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
2	赎回	2015-10-21	-9,000,000.00	-9,000,000.00	0.00%
3	申购	2015-10-26	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
4	申购	2015-11-02	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
5	申购	2015-11-05	55,000,000.00	55,000,000.00	0.00%
6	赎回	2015-11-16	-10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
7	赎回	2015-11-25	-25,000,000.00	-25,000,000.00	0.00%
8	赎回	2015-12-29	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
合计			46,000,000.00	46,000,000.00	

§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

二〇一六年一月二十一日

华安深证300指数证券投资基金(LOF)

【2015】第四季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安深证300指数(LOF)
场内简称	华安S300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月2日
报告期末基金份额总额	24,080,120.41份
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。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
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
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。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-118,931.05
2.本期利润	7,548,527.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.3101
4.期末基金资产净值	35,393,103.49
5.期末基金份额净值	1.470

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。

3.2 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

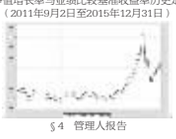
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.29%	1.96%	24.15%	1.92%	2.14%	0.04%

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

华安深证300指数证券投资基金(LOF)

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

(2011年9月2日至2015年12月31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	2011-9-2	-	12年	理学博士,12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月起同时担任上证180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。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月起同时担任本基金的基金经理。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。2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理	2015-3-20	-	5年	硕士研究生,5年基金行业从业经验,具有基金从业资格证书。2010年应届毕业进入华安基金,先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015年3月起担任本基金及华安中证高分红指数增强型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 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。

4.4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

四季度,宏观经济下行的趋势并没有发生太大的变化,判断四季度GDP增速仍在6.9%左右,全年应能实现7%左右的GDP增长目标。四季度来看,工业增加值呈现小幅回升的态势,CPI小幅上涨、PPI降幅收窄。下半年,国内量化宽松氛围下经济运行整体平稳,但是对2016年度的分歧在加大。四季度市场以深300为代表的深市指数呈现震荡上行的态势,本基金的净值也有所上涨。这得益于前期市场下跌期间一批中小盘股被严重低估。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.470元,本报告期份额净值增长率为26.29%,同期业绩比较基准增长率为24.15%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,经济正处于结构转换、风险释放的关键期,供给侧改革、技术创新尚未能使经济走出低迷,可能是中国经济破局的关键一年。因此2016年宏观经济运行的基本面改善空间不大,预计GDP增速将进一步放缓至6.5%左右,货币政策和财政政策有望共同发力稳增长,2016年预计还将会有降息或降准空间,及相应的财政政策和行业政策。展望后市,2016年大盘指数宽幅震荡的概率较大。作为深证300指数基金的管理人,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。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

§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	33,455,274.11	93.40
	其中:股票	33,455,274.11	93.40
2	固定收益投资	10,100.00	0.03
	其中:债券	10,100.00	0.03
	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	2,327,304.14	6.50
7	其他资产	25,862.29	0.07
8	合计	35,818,540.54	100.00

5.2 报告期末按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

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

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	325,119.19	0.92
B	采矿业	414,578.06	1.17
C	制造业	19,222,428.12	54.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,092.53	1.53
E	建筑业	379,052.42	1.07
F	批发和零售业	920,141.54	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	82,000.14	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,771,489.12	10.66
J	金融业	2,438,349.86	6.89
K	房地产业	2,573,139.89	7.27
L	租赁和商务服务业	916,243.12	2.59
M	科学研究和技术服务业	3,978.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	600,191.28	1.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	138,643.44	0.39
R	文化、体育和娱乐业	1,006,794.96	2.84
S	综合	121,032.44	0.34
	合计	33,455,274.11	94.53

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)	占基金资产净值比例(%)
1	000982	中银绒业	180,133	1,565,355.77	4.42
2	000002	万 科A	57,388	1,401,988.84	3.96
3	000651	格力电器	28,045	626,805.75	1.77
4	000725	京东方A	169,063	502,117.11	1.42
5	300104	乐视网	8,531	501,622.80	1.42
6	000333	美的集团	14,039	460,759.98	1.30
7	000001	平安银行	38,365	459,996.35	1.30
8	002024	苏宁云商	32,844	441,751.80	1.25
9	000876	新 希 望	21,513	408,531.87	1.15
10	300059	东方财富	7,590	394,907.70	1.12

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票投资。

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	公允价值(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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,100.00	0.03
8	其他	-	-
9	合计	10,100.00	0.03

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	101	10,100.00	0.03

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。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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的,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,360.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	480.99
5	应收申购款	20,021.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,862.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	10,100.00	0.03

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存