华安沪深300量化增强证券投资基金

2015 年度报告摘要

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
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安沪深300增强	
基金主代码	000312	
交易代码	000312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月27日	
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	
报告期末基金份额总额	60,024,807.69份	
下属分级基金的基金简称	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	000312	000313
报告期末下属分级基金的份额总额	22,402,071.36份	37,622,736.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越标的指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品,在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×同期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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱刚	张志永
	联系电话	021-38969999	021-62677777-212004
	电子邮箱	qiangang@huaan.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008850099	95561
传真		021-68816314	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年		2014年		2013年9月27日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C
本期已实现收益	8,327,021.95	27,802,165.09	2,399,463.82	9,097,508.94	99,580.23	207,688.26
本期利润	3,775,062.72	10,714,545.84	5,488,446.56	31,999,531.35	-311,981.73	-4,371,462.42
加权平均基金份额本期利润	0.2008	0.2338	0.3972	0.2480	-0.0106	-0.0114
本期加权平均净值利润率	13.39%	15.61%	39.99%	25.82%	-1.07%	-1.15%
本期基金份额净值增长率	8.24%	7.53%	44.75%	43.81%	-2.80%	-3.00%
	2015年末		2014年末		2013年末	
	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C
期末可供分配基金份额利润	0.5236	0.5001	0.1832	0.1736	-0.0280	-0.0300
期末基金资产净值	34,129,383.22	56,438,606.20	26,694,565.07	91,095,933.21	17,148,985.15	181,149,488.31
期末基金份额净值	1.523	1.500	1.407	1.395	0.972	0.970

注:1.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。

2.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。

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)。

4.本基金于2013年9月27日成立。合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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

1.华安沪深300增强A:

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
过去三个月	22.04%	1.63%	15.67%	1.59%	6.37%	0.04%
过去六个月	-7.64%	2.61%	-15.75%	2.54%	8.11%	0.07%
过去一年	8.24%	2.38%	5.32%	2.36%	2.92%	0.02%
自基金合同生效起至今	52.30%	1.78%	53.69%	1.78%	-1.39%	0.00%

2.华安沪深300增强C:

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
过去三个月	21.8%	1.63%	15.67%	1.59%	6.18%	0.04%
过去六个月	-7.86%	2.61%	-15.75%	2.54%	7.89%	0.07%
过去一年	7.53%	2.38%	5.32%	2.36%	2.21%	0.02%
自基金合同生效起至今	50.00%	1.78%	53.69%	1.78%	-3.69%	0.00%

1.本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×同期商业银行税后活期存款基准利率。

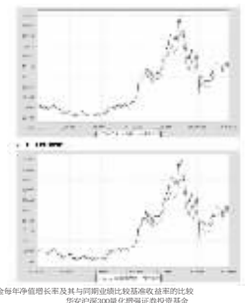
2.根据基金合同的规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产不低于非现金基金资产的80%;非现金基金资产的80%;剔除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

3.2.2 日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

华安沪深300量化增强证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

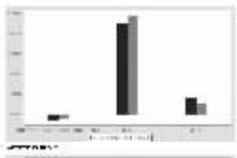
(2013年9月27日至2015年12月31日)



3.2.3 日基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沪深300量化增强证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注:本基金基金合同生效日为2013年9月27日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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批准成立于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本15亿元人民币,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2015年12月31日,公司旗下共管理安心回报混合、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、华安宝利混合、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、华安沪深300量化增强、华安稳健收益债券、华安可转债、华安保证300指数(LOF)、华安科技动力混合、华安同享红债券、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、华安资源驱、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、华安保证债券债券、华安安信消费混合、华安纯债证券1年期、华安黄金易ETF、华安黄金易ETF联接、华安沪深300量化增强、华安年年红债券、华安丰收先锋混合、华安中证银分地产ETF、华安中证银分医药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、华安高分红股票增强、华安中证银分医药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、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安德顺养老混合发起式、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、华安乐盛保本混合等71只开放式基金、管理资产规模达到156.46亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会成员情况

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		
牛勇	本基金的基金经理	2014-12-30		11年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师)。11年证券金融从业经历。曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作,2008年6月加入华安基金管理有限公司担任风险管理与金融工程部高级经理,2009年6月至2012年12月担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2010年9月起同时担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2010年6月至2012年12月担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2012年4月至2015年6月同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理,2014年12月起担任本基金的基金经理。
谢东旭	本基金的基金经理	2015-01-21	-	5年	经济学硕士研究生,5年证券、基金行业从业经验,具有基金从业资格证书。曾任光大银行金融市场部经理,中银证券研究部公募研究员,2012年2月加入华安基金,任系统化投资策略量分析师。2015年1月起担任本基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,国以公告日为准;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 管理人对投资决策委员会成员的承诺

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安沪深300量化增强证券投资基金基金合同》、《华安沪深300量化增强证券投资基金招募说明书》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 管理人对投资决策委员会成员的监督与约束说明

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,研究员作为公司管理的基投资组合提供研究报告,投资建议过程中,使用最会提供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,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行集中公平、超前批复、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,投资组合经理根据意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义开展进行申报。若该业务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,且以公司名义申报,则按资产规模大小顺序依次分配,(3)银行间市场业务遵循价格优先原则,先询先询价的控制原则,通过内部共同的wind库,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,以确保不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,且以公司名义报标,则按资源门优先原则原则,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,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行集中公平、超前批复、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,投资组合经理根据意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义开展进行申报。若该业务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,且以公司名义申报