华安物联网主题股票型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3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3月17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	华安物联网主题股票
基金主代码	001028
交易代码	001028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月17日
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
报告期末基金份额总额	2,265,142,124.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业,在严格控制风险的前提下,力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略,一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择方面通过对物联网相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱艇	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

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3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	-51,111,619.49
本期利润	-31,075,697.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0101
本期基金份额净值增长率	-5.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0534
期末基金资产净值	2,144,158,508.77
期末基金份额净值	0.947

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)。

4.本基金于2015年3月17日成立。截止本报告期末,本基金成立不足一年。

5.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

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	38.25%	2.27%	15.48%	1.38%	22.77%	0.89%
过去六个月	-2.87%	3.64%	-12.02%	2.19%	9.15%	1.45%
自基金合同生效起至今	-5.30%	3.19%	4.95%	2.12%	-10.25%	1.07%

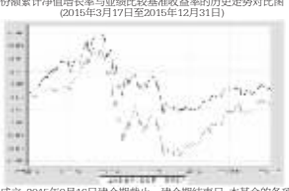
注:本基金业绩比较基准:80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

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等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等)、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券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(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金的股票资产投资比例为基金资产的80%-95%,其中,投资于物联网相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

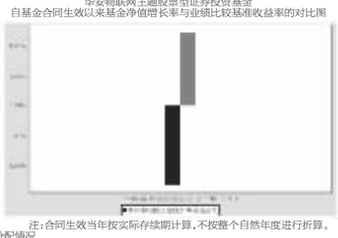
华安物联网主题股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年3月17日至2015年12月31日)



注:本基金于2015年3月17日成立,2015年9月16日建仓期截止。建仓期结束日,本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

3.2.3 自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

华安物联网主题股票型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按实际存续期计算,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

本基金过去三年没有利润分配。

§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英泰科安投资管理股份有限公司。

截至2015年12月31日,公司旗下共管理安创新基金、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置证券投资基金、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、华安交易型货币市场基金、华安增强债券、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、华安人国新济股票、华安新活力混合、华安顺灵活配置混合、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、华安高分红指数增强、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年鑫定期开放债券、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、华安乐惠保本混合等71只开放式基金。管理资产规模达到1558.45亿元人民币。

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		
翁启森	本基金的基金经理,基金投资部兼全球投资部高级总监、总经理助理	2015-03-17	-	19年	工业工程学硕士,19年证券、基金行业从业经历,具有中国大陆基金从业资格。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副总经理,台湾保德信投信基金经理兼投资监助理,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,任全球投资部总监,2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013年6月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014年3月起同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月起同时担任华安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合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,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有关法律法规及《华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同》、《华安物联网主题股票型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、邮件发送、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swiut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,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,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,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易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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,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10次,未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量较少,但由于个股流动性较差、交易量小,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

015年是我国经济结构转型的重要一年,A股市场走势先扬后抑,各大指数均取得正收益,但分化较为明显。全年来看,以信息技术、移动互联网、大数据、新兴消费为主的新兴领域大幅领先于其它板块,反映了资本市场对经济结构调整和转型起到支撑和贡献作用。本基金基于对宏观经济缓慢筑底和经济结构逐步转型的判断,将主要仓位配置在反映新经济的TMT板块,并着重加强了对新技术、新消费、新产业的配置比例。

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0.947元,报告期份额净值增长率为-5.30%,同期业绩比较基准增长率为4.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来国内宏观经济下行压力仍然较大,在经历了2015年大幅、快节奏降准降息后,2016年货币市场放水空间缩小,考虑到居民因储蓄率降低带来的资产端负债转移,以及海外及风险新增资金入市的因素,2016年市场仍然有望呈现结构性行情。在经历了2015年年中股指大幅杀跌之后,场外的大部分杠杆资金逐步被清理,不少成长性板块估值相对合理。放眼全球,新兴产业仍然是资本市场追逐的热点,以互联网、基因、先进制造为主的板块,仍然在全球享受着高估值和超额收益。我国正处于鼓励创新创业的起步阶段,在未来资本市场的结构性行情之中,新兴成长、先进制造、消费升级等领域仍将有望延续较好的业态,并成为A股超额收益的主要来源。因此,从配置上来看,本基金未来仍将维持对新兴成长、先进制造、消费升级等新兴板块的重点配置,个股选择上偏重在估值安全边际和成长空间较为平衡的标的,规避前期涨幅过大、逻辑分歧较大的高估值标的。

4.6 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:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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总监,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,台湾中信证券投信总监助理,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,任全球投资部总监,2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013年6月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014年3月起同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月起同时担任华安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合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,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有关法律法规及《华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同》、《华安物联网主题股票型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、邮件发送、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swiut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,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,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,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易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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,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10次,未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量较少,但由于个股流动性较差、交易量小,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

015年是我国经济结构转型的重要一年,A股市场走势先扬后抑,各大指数均取得正收益,但分化较为明显。全年来看,以信息技术、移动互联网、大数据、新兴消费为主的新兴领域大幅领先于其它板块,反映了资本市场对经济结构调整和转型起到支撑和贡献作用。本基金基于对宏观经济缓慢筑底和经济结构逐步转型的判断,将主要仓位配置在反映新经济的TMT板块,并着重加强了对新技术、新消费、新产业的配置比例。

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0.947元,报告期份额净值增长率为-5.30%,同期业绩比较基准增长率为4.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来国内宏观经济下行压力仍然较大,在经历了2015年大幅、快节奏降准降息后,2016年货币市场放水空间缩小,考虑到居民因储蓄率降低带来的资产端负债转移,以及海外及风险新增资金入市的因素,2016年市场仍然有望呈现结构性行情。在经历了2015年年中股指大幅杀跌之后,场外的大部分杠杆资金逐步被清理,不少成长性板块估值相对合理。放眼全球,新兴产业仍然是资本市场追逐的热点,以互联网、基因、先进制造为主的板块,仍然在全球享受着高估值和超额收益。我国正处于鼓励创新创业的起步阶段,在未来资本市场的结构性行情之中,新兴成长、先进制造、消费升级等领域仍将有望延续较好的业态,并成为A股超额收益的主要来源。因此,从配置上来看,本基金未来仍将维持对新兴成长、先进制造、消费升级等新兴板块的重点配置,个股选择上偏重在估值安全边际和成长空间较为平衡的标的,规避前期涨幅过大、逻辑分歧较大的高估值标的。

4.6 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:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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总监,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,台湾中信证券投信总监助理,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,任全球投资部总监,2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013年6月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014年3月起同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月起同时担任华安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。

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中执业会员。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

本基金的基金经理翁启森作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师郑杭翔、蒋燕华签字出具了安永华明(2016)审字第60971571_B20号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安物联网主题股票型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资产:	-
银行存款	119,889,339.56
结算备付金	1,057,140.47
存出保证金	655,645.60
交易性金融资产	2,020,187,284.77
其中:股票投资	2,020,187,284.77
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	10,222,601.25
应收利息	25,271.95
应收股利	-
应收申购款	512,397.70
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,152,549,681.30
负债和所有者权益	本期末 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	-
应付赎回款	3,854,414.78
应付管理人报酬	2,737,368.96
应付托管费	456,228.17
应付销售服务费	-
应付交易费用	930,443.53
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	412,717.09
负债合计	8,391,172.53
所有者权益:	-
实收基金	2,265,142,124.13
未分配利润	-120,983,615.36
所有者权益合计	2,144,158,508.77
负债和所有者权益总计	2,152,549,681.30

注:(1)报告截止日2015年12月31日,基金净值为0.947元,基金份额总额2,265,142,124.13份。

(2)本基金合同于2015年3月17日生效。

7.2 利润表

会计主体:华安物联网主题股票型证券投资基金

本报告期:2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	18,201,187.24
1.利息收入	12,903,636.47
其中:存款利息收入	8,299,249.16
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	4,604,387.31
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-32,924,053.48
其中:股票投资收益	-40,840,269.53
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	7,916,216.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	20,035,921.69
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	18,185,682.56
减:二、费用	49,276,885.04
1. 管理人报酬	34,823,862.03
2. 托管费	5,803,976.99
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	8,231,110.60
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	417,935.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-31,075,697.80
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-31,075,697.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安物联网主题股票型证券投资基金

本报告期:2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	4,787,382,240.64	-	4,787,382,240.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-31,075,697.80	-31,075,697.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-2,522,240,116.51	-89,907,917.56	-2,612,148,034.07
其中:1.基金申购款	1,792,537,058.84	275,941,330.21	2,068,478,389.05
2.基金赎回款	-4,314,777,175.35	-365,849,247.77	-4,680,626,423.12
四、本期末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)	2,265,142,124.13	-120,983,615.36	2,144,158,508.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从71至74,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:袁国富,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金本体说

华安物联网主题股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证监会监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]78号《关于准予华安物联网主题股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2015年2月9日至2015年3月13日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571_B12号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年3月17日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币4,784,476,993.31元,在募集期间产生的存款利息为人民币2,905,281.33元,以实收基金(本息)合计为人民币4,787,382,240.64元,折合4,787,382,240.64份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等)、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的80%-95%,其中,投资于物联网相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准:80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及会计核算有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号(年度报告的内容与格式)》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号(会计报表附注的编制及披露)》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年3月17日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基记账本位币和