华安日日鑫货币市场基金

【2016】第四季度报告

2016年12月31日

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:二〇一七年一月二十日

§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2017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2016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	9,019,960,403.33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	货币ETF
下属分级基金的交易代码	040038	040039	511600
报告期末下属分级基金的份额总额	223,769,425.92份	4,405,024,912.91份	4,391,166,064.50份

注:自2016年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为“货币ETF”,基金份额净值为100.00元。本表所列场内份额数据由值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为“华安日日鑫货币A”,基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为“华安日日鑫货币B”,基金份额净值为1.00元。

§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(2016年10月1日-2016年12月31日)		
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	货币ETF
1.本期已实现收益	1,522,401.09	12,183,889.84	15,909,331.42
2.本期利润	1,522,401.09	12,183,889.84	15,909,331.42
3.期末基金资产净值	223,769,425.92	4,405,024,912.91	4,391,166,064.50

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,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。

2.自2016年9月12日起,本基金增设H类份额类别。

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	0.5676%	0.0018%	0.2722%	0.0000%	0.2954%	0.0018%

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	0.6285%	0.0018%	0.2722%	0.0000%	0.3563%	0.0018%

3.货币ETF:

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	0.5663%	0.0018%	0.2722%	0.0000%	0.2941%	0.0018%

注:自2016年9月12日起,本基金增设H类份额。

本基金日成立起至2016年9月25日,利润分配是按月结转份额。自2016年9月30日起至今,利润分配是按日结转份额。

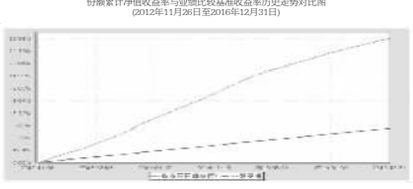
3.2.2 目基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金

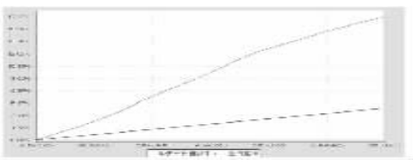
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年11月26日至2016年12月31日)

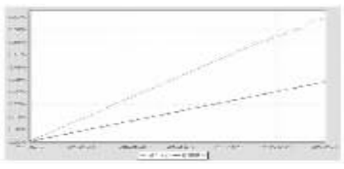
1.华安日日鑫货币A



2.华安日日鑫货币B



3.货币ETF



§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,固定收益部助理总监	2012-11-26	-	15年	硕士研究生,15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2006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,同时担任华安乐康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月起,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月起,同时担任华安安润灵活配置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	2014-08-30	-	6年	硕士研究生,6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。2016年10月起,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	6年	硕士研究生,具有基金从业资格证书.曾任安永华明会计师事务所审计师,2010年3月加入华安基金管理有限公司,先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作,2014年9月起担任基金经理助理,2016年3月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理.2016年11月起,同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理。
苏卿云	本基金的基金经理	2016-12-19	-	9年	硕士研究生,9年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016年7月加入华安基金,任指数与量化投资事业总部ETF业务负责人。2016年12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,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,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,公司风控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、以及公司名义进行的债券一级市场申购,不同投资组合间日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易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骗日反向交易的检查;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4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,海外主要发达经济体经济复苏规慢,各国货币政策出现分化,开始反思负利率的刺激效果和负面影响。美联储如期加息,特朗普当选美国总统超市场预期,新政预计将加大基建支出、企业减税力度等刺激政策,美股指数大涨,十年期国债收益率大幅上行,美元指数及美元兑主要货币走强,消费者信心指数提升;欧元区经济出现回暖态势,包括GDP、通胀、PMI和投资者信心指数等数据都有所改善,欧央行会议决议将延长QE期限,但银行业潜在风险不容小觑;日本持续面临低增长和通缩困境,日央行货币政策继续宽松。国内经济方面,四季度各项指标显示经济基本面有所改善,经济短期有企稳迹象,工业增加值继续稳定,固定资产投资回升,民间投资改善,货币与信贷稳定,社融超预期;央行在四季度的流动性管理主要通过公开市场操作+MLF等组合方式进行,维稳资金面波动,11月下旬以来,受同业去杠杆及邻近年末等因素叠加影响,银行间资金面扰动较大;央行维稳资金面之余继续加大长端资金投放比重,拉长操作久期,去金融杠杆意图明显。四季度外围及国内各项经济金融数据对债市构成利空,债市调整幅度较大,收益率大幅上行,10Y期国债收益率上行幅度接近30bp,3Y期AAA中短期票据上行幅度接近100bp,信用利差明显走扩,调整幅度之深超市场预期。

本报告期内,我们勤勉尽责,稳健操作,在保证组合流动性安全、剩余期限相对较短的前提下,甄选优质个券,捕捉流动性收紧资金利率冲高机会,投资定存和逆回购等品种锁定高收益,并适时根据市场变化调整组合结构,灵活把握投资机会,为持有人获得了可观的组合收益。

4.4.2报告期内基金所投资的业绩表现

华安日日鑫货币A:

投资回报:0.5676% 比较基准:0.2722%

华安日日鑫货币B:

投资回报:0.6285% 比较基准:0.2722%

华安日日鑫货币H:

投资回报:0.5663% 比较基准:0.2722%

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2017年,发达经济体反思负利率政策实施的弊端和不足,随着特朗普新政实施带来的联动效应,全球利率将面临上行压力,主要货币兑美元走势依然承压;国内经济方面,随着楼市调控政策的继续实施,楼市小周期见顶,地产相关消费逐步送至问落,房地产去杠杆趋向金融去杠杆的环境下,经济下行压力较大;而随着农业供给侧改革的推进,以及原油限产决议的签署,未来通胀存上行压力;央行货币政策定调稳健中性,未来基础货币投放机制发生变迁;货币周门调节模式下未来流动性波动将加大;明年债市风险不可低估,各方因素不明朗前提下,需要做好资产配置的久期控制,降低利率敏感度风险,适时采取双投操作,赚取价差收益。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握市场构性机会,通过月末时点锁定高收益同业存款和甄选优质中高等级短期融资券博取较高的持有收益,提高组合整体收益,为投资者创造更多价值。我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地保护持有人的利益。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	1,320,256,605.84	14.63
	其中:债券	1,320,256,605.84	14.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,670,517,965.77	29.59
	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	5,000,265,795.32	55.40
4	其他资产	34,040,194.72	0.38
5	合计	9,025,080,561.65	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	8.50
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2016-10-12	29.65	因出现日额赎回导致	在5个工作日调整合规
2	2016-10-13	26.20	因出现日额赎回导致	在5个工作日调整合规

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	31
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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120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	80.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	1.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	4.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	5.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.68	-

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合无平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 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	380,714,694.93	4.22
	其中:政策性金融债	380,714,694.93	4.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	739,734,101.07	8.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	199,807,809.84	2.22
8	其他	-	-
9	合计	1,320,256,605.84	14.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 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	111609395	16浦发CD395	2,000,000	199,807,809.84	2.22
2	100201	10国开01	1,000,000	100,080,007.09	1.11
3	011698463	16华电江苏SCP002	600,000	59,990,051.22	0.67
4	140407	14农发07	500,000	50,194,959.34	0.56
5	140421	14农发21	500,000	50,194,502.02	0.56
6	140310	14进出10	500,000	50,137,996.47	0.56
7	140401	14农发01	500,000	50,071,934.19	0.56
8	160204	16国开04	500,000	50,000,268.07	0.55
9	071621008	16渤海证券CP008	500,000	49,996,937.41	0.55
10	011698738	16广新控股SCP009	500,000	49,970,585.86	0.55

5.7“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	0.0767%
报告期内偏离度的最低值	-0.2311%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0635%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

无。

5.8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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.2本报告期内,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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3其他资产构成

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	33,114,101.61
4	应收申购款	926,093.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,040,194.72

§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	货币ETF
本报告期期初基金份额总额	295,935,548.28	1,408,076,950.54	3,019,479,428.15
报告期基金总申购份额	107,155,339.54	5,541,717,610.99	6,575,722,019.16
报告期基金总赎回份额	179,321,461.90	2,544,769,648.62	5,204,035,382.81
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	223,769,425.92	4,405,024,912.91	4,391,166,064.50

注:自2016年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为“货币ETF”,基金份额净值为100.00元。本表所列场内份额数据由值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为“华安日日鑫货币A”,基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为“华安日日鑫货币B”,基金份额净值为1.00元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2016-10-13	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
2	赎回	2016-10-26	-70,177,382.09	-70,177,382.09	0.00%
3	申购	2016-11-04	90,000,000.00	90,000,000.00	0.00%
4	赎回	2016-11-09	-74,000,000.00	-74,000,000.00	0.00%
5	赎回	2016-11-11	-10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
6	赎回	2016-11-23	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
7	赎回	2016-12-19	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
合计			-74,177,382.09	-74,177,382.09	

§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
二〇一七年一月二十日

华安深证300指数证券投资基金(LOF)

【2016】第四季度报告

2016年12月31日

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:二〇一七年一月二十日

§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2017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2016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	22,240,279.75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,即按照标的指数的成份股组成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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	-451,929.05
2.本期利润	-1,040,962.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0465
4.期末基金资产净值	26,584,237.94
5.期末基金份额净值	1.195

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

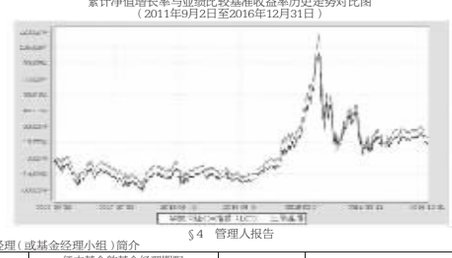
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.86%	0.79%	-3.30%	0.80%	-0.56%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金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)

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2016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	2011-09-02	-	13年	理学博士,13年证券、基金从业经验,COF(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,2006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。2016年6月起担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理	2015-03-20	-	6年	硕士研究生,6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月起担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年3月至2016年12月,同时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。2016年12月起,同时担任华安事件驱动量化策略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,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,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,公司风控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、以及公司名义进行的债券一级市场申购,不同投资组合间日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易利益输送的异常交易行为进行监控;风控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骗日反向交易的检查;风控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40次,未出现异常交易。

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年4季度,美国联邦公开市场委员会如预期加息25个基点,将基准利率区间提高至0.5%-0.75%。2017年基准利率预测中位数值则为1.4%,显示联邦公开市场委员会在2017年有三次升息可能。尽管加息符合市场预期,但略为鹰派之利率预测仍使美国国库债券收益率继续上扬,十年期美国国库债券收益率曾经高达2.64%,为2014年9月中以来高点,也使得高收益债及新兴市场债表现受影响。

在12月8日的欧洲央行利率会议中,决议延长购债期间至2017年12月,但将自2017年4月起,减少购债规模至600亿欧元,并放宽之前不可购买殖利率低于存款利率负0.4%债券的规定;行长德拉吉另暗示,若通胀前景或金融情势不如预期,可能再扩大购债规模或延长购债。

自从日本央行于9月21日宣布基准利率维持于负0.1%、购债规模亦保持于每年80兆日圆规模不变,但导入管控收益率曲线的新作法,计划透过持续购买日本政府债券的方式,让日本10年期日本政府债券收益率维持在0%的水准。日本央行行长更于年底将近之时指出,随着全球不利因素消退,预计日本经济将于2017年稳步复苏,亦表示,必要时该行可采行许多举措来刺激经济增长。

全球主要国家债券收益率在四季度从处于历史低点附近反弹,但在用地约事件未如预期中的大幅增多,信用利差随之也收窄。

第四季度,本基金不断进行优化,重点控制投资风险,在谨慎和严谨分析的基础上,保持了组合的平均信用等级,择机减持了相对利率风险偏高的长年期债券,从而稳定组合风险。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,华安全球美元收益债A份额净值为1.093元,C份额净值为1.090元;华安全球美元收益债A份额净值增长率为1.67%,C份额净值增长率为1.68%,同期业绩比较基准增长率为0.76%。

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。