华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

【2016】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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华安中国A股增强指数
基金主代码	040002
交易代码	040002(前端) 041002(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月8日
报告期末基金份额总额	4,806,686,210.22份
投资目标	运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。
投资策略	(1)资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。 (2)股票投资:本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。 (3)其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。
业绩比较基准	95%×MSCI中国A股指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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	42,492,361.86
2.本期利润	11,968,940.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0027
4.期末基金资产净值	3,410,446,226.71
5.期末基金份额净值	0.710

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。

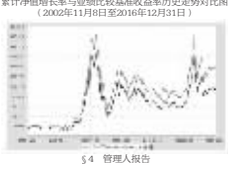
3.2 基金净值表现

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	1.00%	0.74%	0.60%	0.67%	0.40%	0.07%

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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2002年11月8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		
牛勇	本基金的基金经理	2010-09-02	-	12年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),12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5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师,2009年7月至2010年8月担任本基金的基金经理助理,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。2010年9月起同时担任本基金的基金经理。2010年11月起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。2012年6月至2015年8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月起担任华安沪深300量化增强型指数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,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《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、投资组合经理在授权范围内日主决策,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,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(4)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,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(5)股票投资:本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。(6)其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

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,美国经济继续复苏,失业率维持低位,通胀水平小幅回升,联储12月底宣布加息,符合市场预期,并且继续发表偏鹰派言论引导市场加息预期,美元指数上行明显,中长期国债收益率加速上行;欧元区经济复苏缓慢,失业率维持高位,通胀水平维持低位,英国脱欧影响逐渐淡出,各国宽松政策低于预期,各国中长期国债收益率受到美债影响明显上行。国内经济探底回升,贸易、消费保持稳定,固定资产投资触底微升,工业生产继续回暖,库存水平继续改善;通胀方面,蔬菜价格触顶回升,猪肉价格涨幅维持低位,CPI同比增速有所回升,但是整体维持低位,PPI同比增速因大宗商品上涨较多由负转正。人民币兑美元贬值,外汇流出有所增加,央行继续通过公开市场和MLF操作对市场流动性进行精细化管理,顺短放长拍升货币市场利率中枢,抑制金融市场杠杆,四季度货币市场总体波动较大,波动频率上升、受通胀回升、央行拍升利率中枢、美国大选超预期和美联储加息影响,利率债收益率在四季度大幅上行;信用风险事件在四季度有零星复发,受流动加剧和债市大幅调整影响,信用债在四季度收益率亦有较大幅度调整,信用利差有所扩大。

报告期内,基金配置以高等级短融、逆回购、定存和大额存单为主,适当运用杠杆,通过较高的票息收入和积极的价差操作赚取超额收益。通过审慎和积极的管理,在把握流动性的基础上,积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

投资回报:0.6782% 比较基准:0.3403%。

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年一季度,美国经济持续回暖,"特朗普经济学"预期持续影响市场,联储频频释放鹰派信号,预计美联储继续加息概率较大,影响全球流动性趋紧;欧洲经济复苏缓慢,地缘政治不确定性因素仍大,预计货币政策仍将维持宽松。国内经济仍在缓慢复苏,供给侧改革和房地产调控政策对经济影响将逐渐显现,中短期看利空经济,长期有利于经济结构调整,CPI在一季度或因季节效应有所走高,PPI同比因大宗商品价格上涨继续回升;一季度换汇额度重置,人民币贬值预期增强,外汇流出压力仍存,国内货币政策边际从紧,预计央行仍将以公开市场和MLF操作为主,不排除一季度有一次降准的可能,资金面预计较四季度有所趋紧;财政政策继续发力,托底经济。综上,预计债券市场在各多空因素影响下,利率债收益率将持续震荡,信用债利差有走阔趋势,防信用风险仍是重中之重。

操作方面,我们将积极关注债市的投资机会,特别是中高评级短融,甄选个券进行配置和波段操作。同时也会关注逆回购、定存和大额存单的价格走势,把握利率冲高时点锁定收益。在控制组合流动性和安全性风险的基础上,为投资者积极赚取高收益。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

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。

§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	3,229,348,451.31	94.16
	其中:股票	3,229,348,451.31	94.16
2	固定收益投资	2,314,348.24	0.07
	其中:债券	2,314,348.24	0.07
	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	191,651,701.76	5.59
7	其他各项资产	6,319,332.77	0.18
8	合计	3,429,633,834.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1按投资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	1,870,447.95	0.05
B	采矿业	134,604.96	0.00
C	制造业	175,788,877.60	5.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,971,117.14	0.12
E	建筑业	10,191,272.23	0.30
F	批发和零售业	5,553,861.26	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	2,256,710.87	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,050,604.63	0.62
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	10,642,253.06	0.31
L	租赁和商务服务业	1,203,606.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	59,895.03	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,198,368.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,534,389.30	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,198,375.26	0.04
S	综合	-	-
	合计	238,761,163.29	7.00

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	9,935,769.66	0.29
B	采矿业	88,419,704.73	2.59
C	制造业	1,479,532,429.36	43.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,642,006.37	1.31
E	建筑业	174,384,390.85	5.11
F	批发和零售业	72,531,437.35	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	82,147,663.47	2.41
H	住宿和餐饮业	5,185,667.04	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,237,301.94	3.17
J	金融业	700,275,093.69	20.53
K	房地产业	118,894,691.48	3.49
L	租赁和商务服务业	34,936,508.41	1.02
M	科学研究和技术服务业	107,200.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	50,660,755.93	1.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,627,225.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	11,248,713.40	0.33
S	综合	5,820,729.34	0.17
	合计	2,990,587,288.02	87.69

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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	601318	中国平安	2,201,738	78,007,577.34	2.29
2	600519	贵州茅台	220,904	73,815,071.60	2.16
3	002475	立讯精密	2,933,809	60,876,536.75	1.79
4	601989	中国重工	7,808,825	55,364,569.25	1.62
5	600000	浦发银行	3,203,815	51,933,841.15	1.52
6	601818	光大银行	12,253,075	47,909,523.25	1.40
7	000858	五粮液	1,368,348	47,180,639.04	1.38
8	601166	兴业银行	2,877,205	46,438,088.70	1.36
9	600038	中直股份	930,314	45,045,803.88	1.32
10	600048	保利地产	4,191,983	38,272,804.79	1.12

5.3.2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

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	603968	醋化股份	859,900	20,861,174.00	0.61
2	300458	全志科技	210,500	19,246,015.00	0.56
3	002452	长高集团	1,874,100	17,616,540.00	0.52
4	600195	中牧股份	784,842	16,677,892.50	0.49
5	600133	东湖高新	1,197,623	9,844,461.06	0.29

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(可交换债)	2,314,348.24	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,314,348.24	0.07

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	110031	航信转债	8,920	968,533.60	0.03
2	128013	洪涛转债	4,860	548,499.60	0.02
3	110035	白云转债	3,950	492,012.00	0.01
4	128009	歌尔转债	2,524	305,303.04	0.01

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本期国债期货投资政策

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

无

5.11报告期末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。

5.11.2报告期末基金投资的前十名股票中,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报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	775,495.80
2	应收证券清算款	2,795,050.90
3	应收股利	-
4	应收利息	41,754.75
5	应收申购款	2,707,031.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,319,332.77

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	128009	歌尔转债	305,303.04	0.01
2	110035	白云转债	492,012.00	0.01
3	110031	航信转债	968,533.60	0.03

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	4,223,338,624.85
报告期基金总申购份额	1,092,513,298.77
减:报告期基金总赎回份额	509,165,713.40
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,806,686,210.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》

2、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》

3、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金托管协议》

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

华安汇财通货币市场基金

【2016】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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华安汇财通货币
基金主代码	000709
交易代码	000709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月17日
报告期末基金份额总额	2,869,889,284.18份
投资目标	在力求本金安全、确保资产流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。
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	人民币七天通知存款利率(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	中国工商银行股份有限公司

§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	15,489,082.45
2.本期利润	15,489,082.45
3.期末基金资产净值	2,869,889,284.18

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和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

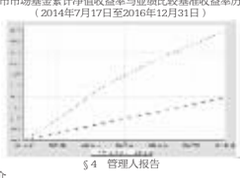
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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3个月	0.6782%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.3379%	0.0025%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2自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

华安汇财通货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年7月17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		
贺涛	本基金的基金经理,固定收益部总监	2014-07-17	-	19年	金融学硕士(金融工程方向),19年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008年4月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月起同时担任华安可转换债券型证券投资基金的基金经理。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6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理,固定收益部助理总监。2013年8月起担任固定收益部副总监。2013年10月起同时担任华安现金富利投资基金、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、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年7月起同时担任本基金的基金经理。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5月起担任固定收益部总监。2015年5月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年9月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月起同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安睿罗定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望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日日鑫货币市场基金、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、华安新乐享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。

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《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、投资组合经理在授权范围内日主决策,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,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资端和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。 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

2016年4季度,宏观经济整体情况较为稳定。从高频数据来看,12月中采PMI51.4,维持在荣枯分界线之上。11月工业增加值6.2%,较上期提高0.1%,固定资产投资同比增速8.3%,与上期持平,全社会发电量同比出现好转,工业企业利润增速有所回升。预计2017年,在"积极的财政政策和稳健中性的货币政策"之下,宏观经济低位运行的状态仍将延续。

16年12月,在债市去杠杆的背景下,叠加美联储加息的催化剂,债券市场利率中枢水平迅速上移,对权益类资产的估值也产生了一定的压制作用,后续仍需密切关注市场利率的变化。年内主要的风险因素包括但不限于央行货币政策实质性收紧,美联储加息节奏超预期等。

投资管理上,基金采取完全复制的管理方法跟踪指数,并利用量化工具进行精细化管理,从而控制每日跟踪误差,以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2016年12月31日,本基金份额净值为1.166元,本报告期份额净值增长率为1.04%,同期业绩比较基准增长率为1.66%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年4季度,沪深300指数上涨1.75%,上证综指上涨3.29%,沪深300指数跑输上证综指。

对于沪深300指数,我们认为当前其主要吸引力在于估值较低。沪深300当前平均估值13倍左右,估值层面具有较高的安全边际。因此,我们认为沪深300指数可以作为投资者的中长期资产配置标的。

作为基金管理人,我们继续坚持多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

本基金报告期内基金持有人数不低于200人;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	固定收益投资	779,152,699.83	26.04
	其中:债券	779,152,699.83	26.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,157,601,416.39	38.69
	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	1,041,573,596.26	34.81
4	其他各项资产	13,967,178.99	0.47
5	合计	2,992,294,891.47	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.27
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	120,779,618.83 / 4.21
	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20%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20%。

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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天情况。

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	57.46	4.21
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	16.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	25.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	1