华安沪深300量化增强证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:二〇一八年三月二十七日

§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,并报董事长签发。

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2018年3月26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2017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量化增强	
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	937,767,783.17份	
基金合同存续期	不定期	
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	670,964,881.71份	266,812,901.46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,成本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	95%×沪深300指数收益率+5×同期商业银行活期存款基准利率
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	qiangkun@huaan.com.cn	zhangzhy@fsbc.com.cn
客户服务电话		4008880099	95561
传真		021-68863414	021-62156217

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	2017年		2016年		2015年	
	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	24,530,686.79	25,514,102.46	28,357.06	-383,416.84	8,327,021.95	27,802,165.09
本期利润	45,631,296.17	44,938,842.78	-801,805.80	-1,295,431.30	3,775,052.72	10,714,545.84
加权平均基金份额本期利润	0.2290	0.2856	-0.0020	-0.0302	0.2008	0.2338
本期基金份额净值增长率	29.63%	29.03%	-3.02%	-3.47%	8.24%	7.53%

3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015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	0.4353	0.3928	0.4769	0.4480	0.5235	0.5001
期末基金资产净值	1,054,968,663.79	407,239,815.57	39,671,585.21	69,626,868.56	34,129,383.22	56,438,605.20
期末基金份额净值	1.5723	1.5263	1.4770	1.4480	1.5230	1.5000

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	3.93%	1.01%	4.82%	0.76%	-0.89%	0.25%
过去六个月	11.64%	0.91%	9.44%	0.66%	2.20%	0.25%
过去一年	29.63%	0.80%	20.70%	0.60%	8.93%	0.20%
过去三年	36.08%	1.67%	13.42%	1.60%	22.66%	0.07%
自基金成立起至今	91.47%	1.52%	65.67%	1.48%	25.80%	0.04%

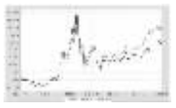
2.华安沪深300增强C

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	3.79%	1.01%	4.82%	0.76%	-1.03%	0.25%
过去六个月	11.37%	0.91%	9.44%	0.66%	1.93%	0.25%
过去一年	29.03%	0.80%	20.70%	0.60%	8.33%	0.20%
过去三年	33.93%	1.67%	13.42%	1.60%	20.51%	0.07%
自基金成立起至今	86.94%	1.52%	65.67%	1.48%	21.17%	0.04%

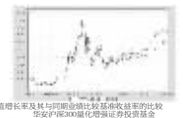
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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历史走势对比图
(2013年9月27日至2017年12月31日)

1.华安沪深300增强A



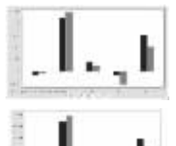
2.华安沪深300增强C



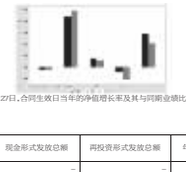
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

1.华安沪深300增强A



2.华安沪深300增强C



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

1.华安沪深300增强A

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
2017年	0.360	300,482,542.27	834,673,727.23	1,135,156,269.50	-
合计	0.360	300,482,542.27	834,673,727.23	1,135,156,269.50	-

2.华安沪深300增强C:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
2017年	0.360	144,632,844.86	401,757,899.86	546,390,744.72	-
合计	0.360	144,632,844.86	401,757,899.86	546,390,744.72	-

§4 管理人报告

4.1 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4月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本3.6亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海汇业投资(集团)有限公司、上海银江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司—华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至2017年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳健收益债、华安黄金易ETF、华安纳斯达克100指数、华安全球美元收益债券等90只开放式基金,管理资产规模达到185.32亿元人民币。

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		
牛勇	本基金的基金经理	2014-12-30	-	13年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),13年证券金融从业经历,曾在泰福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任风险管理与金融工程高级金融工程师,2009年7月至2010年8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助理,2010年4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5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,2016年12月起,同时担任华安事件驱动量化策略超额收益证券投资基金的基金经理。
谢东旭	本基金的基金经理	2015-01-21	2017-01-26	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,中信证券研究部量化分析师,2012年2月加入华安基金,任系统化投资策略分析师。2015年1月至2017年1月担任本基金的基金经理。
许之彦	本基金的基金经理,指数与量化投资部高级总监	2017-12-25	-	14年	厦门大学工业工程专业硕士,14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,2006年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级策略分析师,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月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)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月至2015年12月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4月起同时担任华安中证全指非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。2017年12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。
孙晨进	本基金的基金经理	2017-12-25	-	7年	硕士研究生,7年基金行业从业经验,具有基金从业资格证书。2010年就加盟进入华安基金,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月起担任华安保证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2015年3月至2015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,同时担任华安新型城镇化策略混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月起同时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,据以公告日为准。证券从业的内容,证券从业的内容是根据中国证券业协会颁布的关于基金从业资格管理办法的相关规定,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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.3.1 公平公易制度和执行情况

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、交易执行等方面全面纳入公平交易管理中,控制其他信息(如研究环节、研究员作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)出现信息发散、越权发送、滥用研究信息等情况,并通过内部稽核、监察稽核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流程,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时,各投资组合经理在决策过程中,根据公司投资管理系统提供的投资组合管理风险控制模块提供的相关信息,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制度,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交易顺序,比例分配。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理在建议进行业务申报,集中交易部门以投资组合名义对外进行申报。若成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,则优先满足投资决策委员会指令的投资组合。(3)银行间市场业务遵循价格优先、先到先成的控制原则,通过内部共享的wind终端,发布询价需求和结果,做到信息公开,若基多个投资组合进行一般市场投标,则各投资组合经理应以各投资组合名义对外进行申报。若成业务以公司名义进行投标,以确保中签结果以价格优先、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,则优先满足投资决策委员会指令的投资组合。(4)银行间市场交易遵循价格优先、时间优先原则,先到先成的控制原则,通过内部共享的wind终端,发布询价需求和结果,做到信息公开,若基多个投资组合进行一般市场投标,则各投资组合经理应以各投资组合名义对外进行申报。若成业务以公司名义进行投标,以确保中签结果以价格优先、比例分配原则进行分配。(5)交易所大宗交易业务,遵循价格优先、比例分配原则进行分配。(6)场外业务,在投资组合内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(7)公司在内部操作风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(8)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(9)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(10)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(11)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(12)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(13)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(14)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(15)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(16)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(17)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(18)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(19)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(20)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(21)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(22)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(23)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(24)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(25)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(26)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(27)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(28)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(29)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(30)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(31)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(32)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(33)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(34)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(35)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(36)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(37)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(38)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(39)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(40)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(41)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(42)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(43)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(44)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(45)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(46)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(47)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(48)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(49)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(50)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(51)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(52)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(53)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(54)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(55)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(56)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(57)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(58)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(59)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(60)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(61)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(62)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(63)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(64)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(65)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(66)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(67)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(68)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(69)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(70)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(71)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(72)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(73)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(74)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(75)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(76)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(77)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(78)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(79)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(80)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(81)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(82)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(83)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(84)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(85)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(86)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(87)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(88)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(89)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(90)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(91)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(92)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(93)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(94)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(95)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(96)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(97)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(98)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(99)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(100)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。

4.3.2 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》等有关法律法律法规及基金合同,积极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、交易执行等方面全面纳入公平交易管理中,控制其他信息(如研究环节、研究员作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)出现信息发散、越权发送、滥用研究信息等情况,并通过内部稽核、监察稽核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流程,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时,各投资组合经理在决策过程中,根据公司投资管理系统提供的投资组合管理风险控制模块提供的相关信息,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制度,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交易顺序,比例分配。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理在建议进行业务申报,集中交易部门以投资组合名义对外进行申报。若成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,则优先满足投资决策委员会指令的投资组合。(3)银行间市场业务遵循价格优先、先到先成的控制原则,通过内部共享的wind终端,发布询价需求和结果,做到信息公开,若基多个投资组合进行一般市场投标,则各投资组合经理应以各投资组合名义对外进行申报。若成业务以公司名义进行投标,以确保中签结果以价格优先、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,则优先满足投资决策委员会指令的投资组合。(4)银行间市场交易遵循价格优先、时间优先原则,先到先成的控制原则,通过内部共享的wind终端,发布询价需求和结果,做到信息公开,若基多个投资组合进行一般市场投标,则各投资组合经理应以各投资组合名义对外进行申报。若成业务以公司名义进行投标,以确保中签结果以价格优先、比例分配原则进行分配。(5)交易所大宗交易业务,遵循价格优先、比例分配原则进行分配。(6)场外业务,在投资组合内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(7)公司在内部操作风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(8)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(9)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(10)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(11)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(12)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(13)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(14)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(15)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(16)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(17)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(18)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(19)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(20)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(21)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(22)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(23)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(24)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(25)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(26)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(27)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(28)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(29)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(30)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(31)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(32)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(33)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(34)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(35)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(36)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(37)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(38)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(39)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(40)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(41)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(42)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(43)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(44)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(45)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(46)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(47)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(48)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(49)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(50)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(51)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(52)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(53)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(54)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(55)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(56)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(57)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(58)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(59)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(60)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限额的业务需逐级上报,由有权人员进行审批。(61)公司在内部风控模块设置单笔业务授权限额,超过授权限