

**华安沪深 300 量化增强证券投资基金**  
**2015 年年度报告**  
**2015 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：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 重要提示及目录

### 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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误！未定义书签。
<b>§5 托管人报告</b>	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
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	19
<b>§6 审计报告</b>	错误！未定义书签。
<b>§7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§8 投资组合报告</b>	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	65
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	65
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65

8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.11	投资组合报告附注 .....	66
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	错误! 未定义书签。
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	错误! 未定义书签。
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4	基金投资策略的改变 .....	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8	其他重大事件 .....	70
<b>§12</b>	<b>发起式基金发起资金持有份额情况 .....</b>	<b>错误! 未定义书签。</b>
<b>§13</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>错误! 未定义书签。</b>
<b>§14</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
14.1	备查文件目录 .....	75
14.2	存放地点 .....	76
14.3	查阅方式 .....	76

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 量化增强证券投资基金	
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	22,402,071.35 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	钱鲲	张志永
	联系电话	021-38969999	021-62677777-212004
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008850099	95561
传真		021-68863414	021-62159217
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	福州市湖东路154号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		朱学华	高建平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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	8,327,021.9 5	27,802,165. 09	2,399,463.52	9,097,508.94	99,580.23	207,688.26
本期利 润	3,775,052.7 2	10,714,545. 84	5,488,445.55	31,999,531.3 5	-311,981.73	-4,371,452.42
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%
3.1.2 期末 数据和指 标	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	11,727,311.	18,815,868.	3,463,671.00	11,331,186.40	-493,644.79	-5,595,436.79

供分配利润	87	86				
期末可供分配基金份额利润	0.5235	0.5001	0.1832	0.1736	-0.0280	-0.0300
期末基金资产净值	34,129,383.22	56,438,605.20	26,594,565.07	91,095,933.21	17,148,985.15	181,165,488.31
期末基金份额净值	1.523	1.500	1.407	1.395	0.972	0.970
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>		<b>2014 年末</b>		<b>2013 年末</b>	
	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
基金份额累计净值增长率	52.30%	50.00%	40.70%	39.50%	-2.80%	-3.00%

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	21.85%	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份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；扣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%。

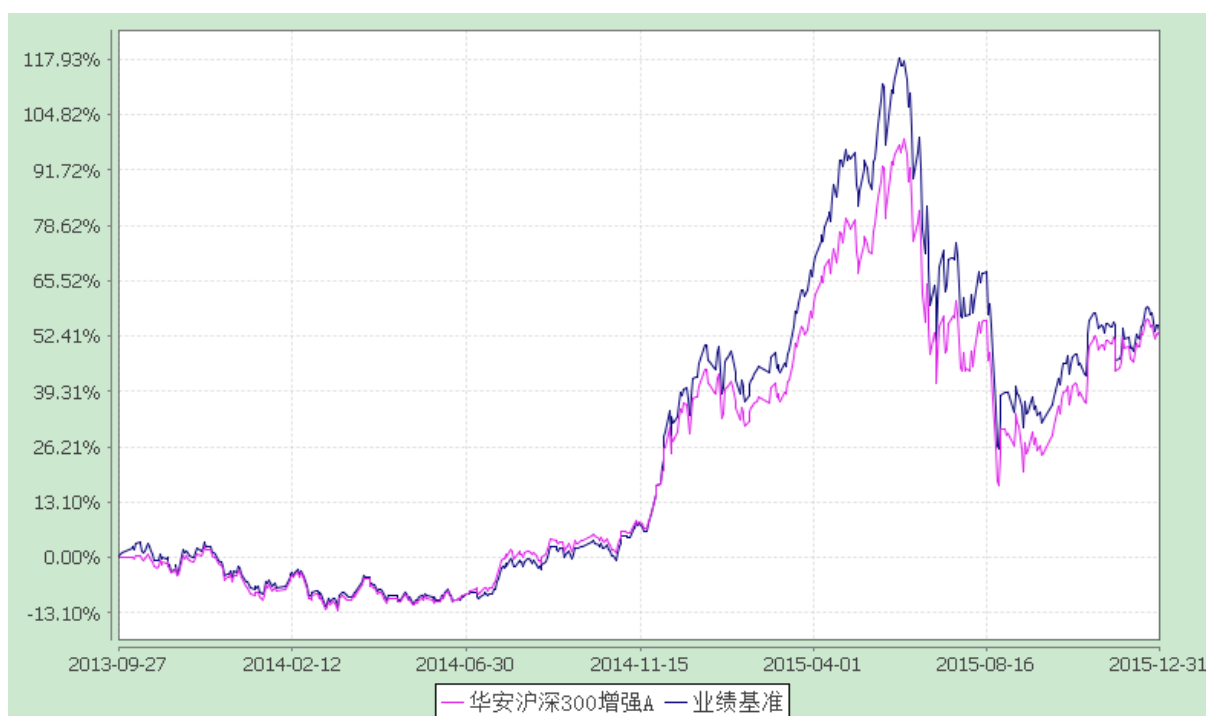
**3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

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 2015 年 12 月 31 日)

**1、华安沪深 300 增强 A**



## 2、华安沪深 300 增强 C

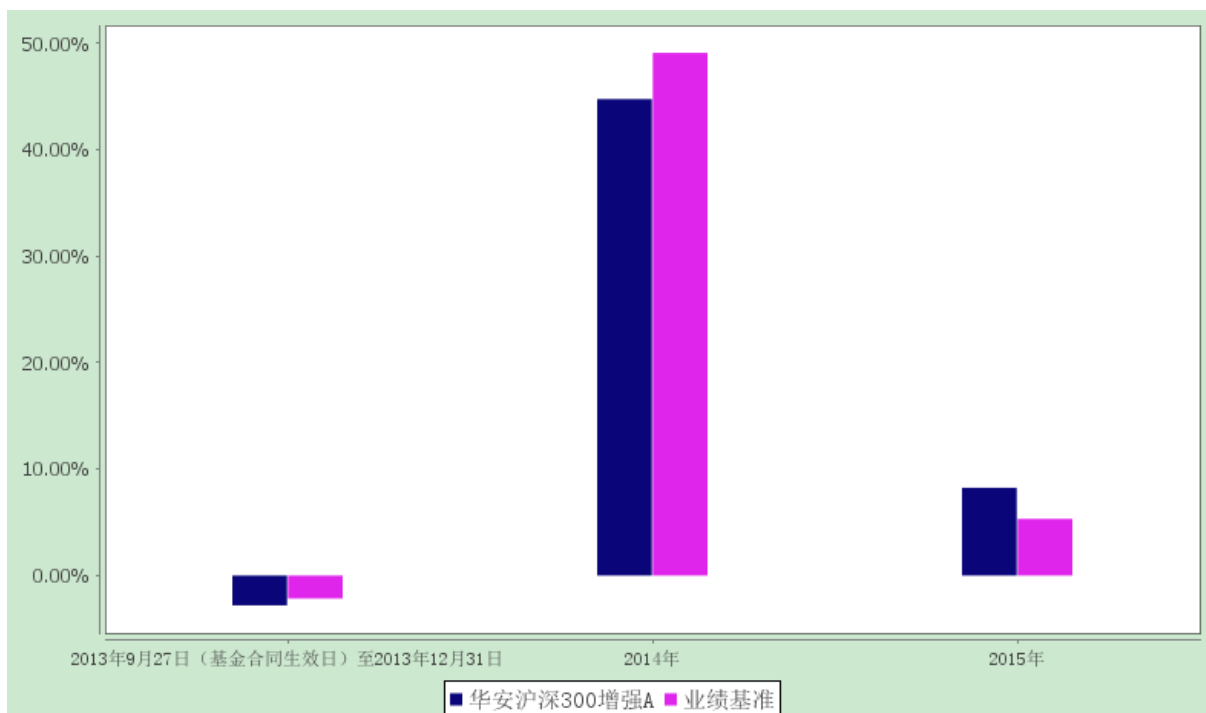


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

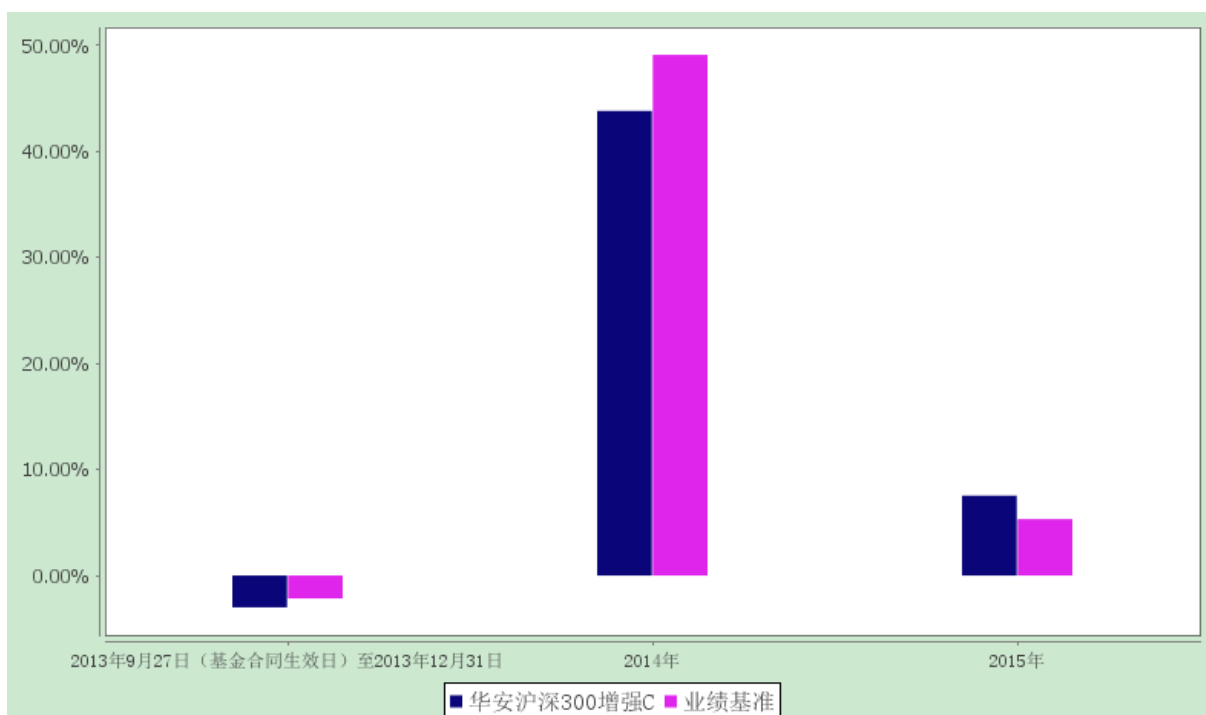
华安沪深 300 量化增强证券投资基金

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

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，公司旗下共管理华安创新混合、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、华安黄金易 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		
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 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 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 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。
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。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，任系统化投资部数量分析师。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，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合规守信情况的说明

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，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 1 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极少,但由于个股流动性较差,交易量稀少,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

2015 年中国经济延续了 2014 年以来的调整态势,经济下行压力增加,外需疲软,内需持续回落,制造业仍不景气,房地产拉动经济增长作用减弱。政府出台一系列“刺激”措施后,经济回落趋缓。

面对宏观经济下行压力,央行运用多种货币政策工具调节市场流动性,降低实体经济融资成本。鉴于央行的扩张性货币政策,我们认为价值股的表现 2015 年逐渐好转。我们在沪深 300 增强基金成分股内应用基本面量化选股策略,取得了不错的效果。

##### 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 A 类份额净值为 1.523 元,本报告期份额净值增长率为 8.24%,本基金 C 类份额净值为 1.500 元,本报告期份额净值增长率为 7.53%,同期业绩比较基准增长率为 5.32%。

#### 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 2016 年宏观经济,基本上仍面临内需不足、外需不稳、传统工业和房地产产能出清尚未结束,经济增长继续减速的局面,但不排除某些季度由于政策托底出现经济反弹。

货币政策方面，2016 年降息降准依然可期。降息后资金、股市和房地产市场成为降息最大的赢家。沪深 300 增强基金成分股在过去一个月经历较大跌幅后，风险得到充分释放，有望在 2016 年实现反弹。

作为沪深 300 增强指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，以量化基本面选股为主产生稳定的超额收益，并将在各类因子之间进行平衡配置，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。



本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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，台湾中信证券投资总监助理，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，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵敏：研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛,金融学硕士,固定收益部副总监。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。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财货币、华安年年红的基金经理,固定收益部副总监。

许之彦,指数投资部总监,理学博士,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,2005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,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安深证300指数证券投资基金(LOF)、华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部总监。

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非执业会员。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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

### 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。

## 4.8 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。

#### 4.9 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

无。

### §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

本托管人依据《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》与《华安沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》，自 2013 年 9 月 27 日起托管华安沪深 300 量化增强证券投资基金托管人报告（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 审计报告

普华永道中天审字(2016)第 20871 号

华安沪深 300 量化增强证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安沪深 300 量化增强证券投资基金(以下简称“华安沪深 300 增强基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安沪深 300 增强基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层

的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述华安沪深 300 增强基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安沪深 300 增强基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2015 年 3 月 23 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 量化增强证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,745,779.71	11,321,742.42
结算备付金		1,341,555.64	275,073.27
存出保证金		103,861.46	71,982.50
交易性金融资产	7.4.7.2	84,905,686.04	108,586,367.68
其中：股票投资		84,890,186.04	108,586,367.68
基金投资		-	-
债券投资		15,500.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,225,208.62	-
应收利息	7.4.7.5	3,122.23	5,510.03
应收股利		-	-
应收申购款		573,294.05	3,965,383.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>93,898,507.75</b>	<b>124,226,059.87</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		1,784,158.89	41.60
应付赎回款		800,256.48	5,889,230.66
应付管理人报酬		72,685.31	99,594.24
应付托管费		10,902.78	14,939.13
应付销售服务费		18,520.55	32,378.74
应付交易费用	7.4.7.7	297,964.73	110,597.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	346,030.59	388,779.61
<b>负债合计</b>		<b>3,330,519.33</b>	<b>6,535,561.59</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	60,024,807.69	84,195,378.83
未分配利润	7.4.7.10	30,543,180.73	33,495,119.45
<b>所有者权益合计</b>		<b>90,567,988.42</b>	<b>117,690,498.28</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>93,898,507.75</b>	<b>124,226,059.87</b>

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，A 类份额净值 1.523 元，C 类份额净值 1.500 元，基金份额总额 60,024,807.69 份，其中 A 类基金份额总额 22,402,071.35 份，C 类基金份额总额 37,622,736.34 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>18,976,269.83</b>	<b>41,223,887.36</b>
1.利息收入		129,805.75	153,936.60

其中：存款利息收入	7.4.7.11	129,800.37	153,936.60
债券利息收入		5.38	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,396,132.97	15,049,691.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	39,432,003.08	11,479,522.57
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	2,094.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	962,035.89	3,570,168.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-21,639,588.48	25,991,004.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	89,919.59	29,255.00
<b>减：二、费用</b>		<b>4,486,671.27</b>	<b>3,735,910.46</b>
1. 管理人报酬		970,075.15	1,379,257.17
2. 托管费		145,511.23	206,888.58
3. 销售服务费		275,735.21	496,884.40
4. 交易费用	7.4.7.19	2,593,706.67	1,150,285.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	501,643.01	502,595.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,489,598.56</b>	<b>37,487,976.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,489,598.56</b>	<b>37,487,976.90</b>

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：华安沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 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）	84,195,378.83	33,495,119.45	117,690,498.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,489,598.56	14,489,598.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-24,170,571.14	-17,441,537.28	-41,612,108.42
其中：1.基金申购款	288,437,768.18	150,504,924.17	438,942,692.35
2.基金赎回款	-312,608,339.32	-167,946,461.45	-480,554,800.77
四、本期向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）	60,024,807.69	30,543,180.73	90,567,988.42
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	204,403,555.04	-6,089,081.58	198,314,473.46



二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,487,976.90	37,487,976.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-120,208,176.21	2,096,224.13	-118,111,952.08
其中：1.基金申购款	183,584,751.07	20,172,183.36	203,756,934.43
2.基金赎回款	-303,792,927.28	-18,075,959.23	-321,868,886.51
四、本期向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）	84,195,378.83	33,495,119.45	117,690,498.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 量化增强证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 1065 号《关于核准华安沪深 300 量化增强证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 552,000,462.87 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 634 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》于 2013 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 552,093,318.21 份，其中认购资金利息折合 92,855.34 份。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》和《华安沪深 300 量化增强证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认/申购费用的，称为 A 类；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。本基金 A 和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》的有关规定，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份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；扣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%。本基金的业绩比较基准为：本基金业绩比较基准为： $95% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5% \times \text{同期商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	5,745,779.71	11,321,742.42
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	5,745,779.71	11,321,742.42

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	85,529,472.72	84,890,186.04	-639,286.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	15,500.00	15,500.00	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,500.00	15,500.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		85,544,972.72	84,905,686.04	-639,286.68
项目	上年度末			
	2014 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		87,586,065.88	108,586,367.68	21,000,301.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		87,586,065.88	108,586,367.68	21,000,301.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,429.56	5,310.84
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	603.70	123.80
应收债券利息	2.38	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	39.79	42.99
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	46.80	32.40
合计	3,122.23	5,510.03

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	297,964.73	110,597.61
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	297,964.73	110,597.61

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	30.59	2,779.61
其他应付款	-	-
预提费用	296,000.00	336,000.00

应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	346,030.59	388,779.61

#### 7.4.7.9 实收基金

华安沪深 300 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	18,905,736.42	18,905,736.42
本期申购	51,788,691.82	51,788,691.82
本期赎回（以“-”号填列）	-48,292,356.89	-48,292,356.89
本期末	22,402,071.35	22,402,071.35

华安沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	65,289,642.41	65,289,642.41
本期申购	236,649,076.36	236,649,076.36
本期赎回（以“-”号填列）	-264,315,982.43	-264,315,982.43
本期末	37,622,736.34	37,622,736.34

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

华安沪深 300 增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,463,671.00	4,225,157.65	7,688,828.65
本期利润	8,327,021.95	-4,551,969.23	3,775,052.72
本期基金份额交易产生的变动数	2,546,260.37	-2,282,829.87	263,430.50

其中：基金申购款	30,063,474.17	-2,141,165.30	27,922,308.87
基金赎回款	-27,517,213.80	-141,664.57	-27,658,878.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,336,953.32	-2,609,641.45	11,727,311.87

华安沪深 300 增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,331,186.40	14,475,104.40	25,806,290.80
本期利润	27,802,165.09	-17,087,619.25	10,714,545.84
本期基金份额交易产生的变动数	-15,996,601.74	-1,708,366.04	-17,704,967.78
其中：基金申购款	126,143,063.60	-3,560,448.30	122,582,615.30
基金赎回款	-142,139,665.34	1,852,082.26	-140,287,583.08
本期已分配利润	-	-	0.00
本期末	23,136,749.75	-4,320,880.89	18,815,868.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	110,553.81	143,998.75
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	16,501.98	6,098.51
其他	2,744.58	3,839.34
合计	129,800.37	153,936.60

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,431,940,951.03	650,030,628.03
减：卖出股票成本总额	1,392,508,947.95	638,551,105.46
买卖股票差价收入	39,432,003.08	11,479,522.57

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,097.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,000.00	-
减：应收利息总额	3.00	-
买卖债券差价收入	2,094.00	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	962,035.89	3,570,168.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	962,035.89	3,570,168.75

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-21,639,588.48	25,991,004.44

——股票投资	-21,639,588.48	25,991,004.44
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-21,639,588.48	25,991,004.44

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	58,602.11	24,652.97
转换费收入	31,317.48	-
其他	-	-
基金转换费收入	-	4,602.03
合计	89,919.59	29,255.00

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	2,593,706.67	1,150,285.11
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,593,706.67	1,150,285.11

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
银行汇划费用	5,643.01	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行划款手续费	-	6,595.20
其他	-	-
合计	501,643.01	502,595.20

注：根据《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.016%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.016% / 当年天数。

**7.4.7.20 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	970,075.15	1,379,257.17
其中：支付销售机构的客户维护费	371,697.01	528,246.66

注：支付基金管理人 华安基金公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	145,511.23	206,888.58

注：支付基金托管人 兴业银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C	合计
华安基金公司	-	29,527.76	29,527.76
兴业银行	-	158,729.50	158,729.50
合计	-	188,257.26	188,257.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安沪深300增强A	华安沪深300增强C	合计
华安基金公司	-	18,243.26	18,243.26
兴业银行	-	463,894.53	463,894.53
合计	-	482,137.79	482,137.79

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金公司，再由华安基金公司计算并支付给各基金销售机构。

C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{C 类基金份额前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$



**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

华安沪深 300 增强 A

无。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,745,779.71	110,553.81	11,321,742.42	143,998.75

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新债未上市	100.00	100.00	155.00	15,500.00	15,500.00	-

注：无。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600578	京能电力	2015-11-04	重大资产重组	6.07	-	-	212,600.00	1,207,860.46	1,290,482.00	-
002567	唐人神	2015-11-23	重大事项	12.84	-	-	44,900.00	510,040.00	576,516.00	-
000657	中钨高新	2015-08-05	重大资产重组	16.01	-	-	30,700.00	511,663.87	491,507.00	-
002465	海格通信	2015-12-29	重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	19,300.00	335,371.00	322,117.00	-
002247	帝龙新材	2015-08-07	重大资产重组	20.71	2016-01-04	22.78	8,300.00	166,420.00	171,893.00	-
601018	宁波港	2015-08-03	重大资产重组	8.16	2016-02-22	7.34	17,600.00	183,324.57	143,616.00	-
600153	建发股份	2015-06-26	重大资产重组	14.69	-	-	9,700.00	152,038.46	142,493.00	-
000712	锦龙股份	2015-12-24	重大事项	29.12	2016-01-04	28.00	2,600.00	72,570.56	75,712.00	-
300104	乐视网	2015-12-04	重大资产重组	58.80	-	-	900.00	46,418.79	52,920.00	-
600271	航天信息	2015-10-09	重大资产重组	71.47	-	-	543.00	26,560.58	38,808.21	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2014 年 12 月 31 日：未持有)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,745,779.71	-	-	-	5,745,779.71
结算备付金	1,341,555.64	-	-	-	1,341,555.64
存出保证金	103,861.46	-	-	-	103,861.46
交易性金融资产	-	-	15,500.00	84,890,186.04	84,905,686.04
应收证券清算款	-	-	-	1,225,208.62	1,225,208.62
应收利息	-	-	-	3,122.23	3,122.23
应收申购款	230,199.40	-	-	343,094.65	573,294.05
资产总计	7,421,396.21	-	15,500.00	86,461,611.54	93,898,507.75
负债					

应付证券清算款	-	-	-	1,784,158.89	1,784,158.89
应付赎回款	-	-	-	800,256.48	800,256.48
应付管理人报酬	-	-	-	72,685.31	72,685.31
应付托管费	-	-	-	10,902.78	10,902.78
应付销售服务费	-	-	-	18,520.55	18,520.55
应付交易费用	-	-	-	297,964.73	297,964.73
其他负债	-	-	-	346,030.59	346,030.59
负债总计	0.00	0.00	0.00	3,330,519.33	3,330,519.33
利率敏感度缺口	7,421,396.21	0.00	15,500.00	83,131,092.21	90,567,988.42
<b>上年度末</b>					
<b>2014 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	11,321,742.42	-	-	-	11,321,742.42
结算备付金	275,073.27	-	-	-	275,073.27
存出保证金	71,982.50	-	-	-	71,982.50
交易性金融资产	-	-	-	108,586,367.68	108,586,367.68
应收利息	-	-	-	5,510.03	5,510.03
应收申购款	31,298.21	-	-	3,934,085.76	3,965,383.97
资产总计	11,700,096.40	-	-	112,525,963.47	124,226,059.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41.60	41.60
应付赎回款	-	-	-	5,889,230.66	5,889,230.66
应付管理人报酬	-	-	-	99,594.24	99,594.24
应付托管费	-	-	-	14,939.13	14,939.13
应付销售服务费	-	-	-	32,378.74	32,378.74
应付交易费用	-	-	-	110,597.61	110,597.61
其他负债	-	-	-	388,779.61	388,779.61
负债总计	-	-	-	6,535,561.59	6,535,561.59
利率敏感度缺口	11,700,096.40	-	-	105,990,401.88	117,690,498.28

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2014 年 12 月 31 日：未持有)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上，根据预期收益、风险预算和交易成本的水平，采用成熟的优化软件对股票投资组合进行优化。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 90%，其中沪深 300 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	84,890,186.04	93.73	108,586,367.68	92.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	84,890,186.04	93.73	108,586,367.68	92.26

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 436	增加约 578
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 436	减少约 578

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具



(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 81,584,121.83 元, 属于第二层次的余额为 3,321,564.21 元, 无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日: 第一层次 107,152,874.80 元, 第二层次 1,433,492.88 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	84,890,186.04	90.41
	其中：股票	84,890,186.04	90.41
2	固定收益投资	15,500.00	0.02
	其中：债券	15,500.00	0.02
	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	7,087,335.35	7.55
7	其他各项资产	1,905,486.36	2.03
8	合计	93,898,507.75	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	103,554.00	0.11
B	采矿业	8,398,643.95	9.27
C	制造业	31,410,776.03	34.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,208,786.24	5.75
E	建筑业	1,401,615.00	1.55
F	批发和零售业	1,858,255.61	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	4,648,726.81	5.13
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,958,926.66	3.27
J	金融业	24,961,180.93	27.56
K	房地产业	1,304,366.06	1.44
L	租赁和商务服务业	1,134,324.75	1.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	768,738.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	325,274.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	407,018.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	84,890,186.04	93.73

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601818	光大银行	1,060,600	4,496,944.00	4.97
2	601788	光大证券	164,800	3,780,512.00	4.17
3	600398	海澜之家	205,901	2,874,377.96	3.17
4	601899	紫金矿业	570,700	2,008,864.00	2.22
5	601318	中国平安	55,434	1,995,624.00	2.20
6	601288	农业银行	600,718	1,940,319.14	2.14
7	002304	洋河股份	26,832	1,839,065.28	2.03
8	600276	恒瑞医药	36,700	1,802,704.00	1.99
9	600015	华夏银行	139,330	1,691,466.20	1.87
10	600027	华电国际	236,139	1,605,745.20	1.77
11	601998	中信银行	221,478	1,599,071.16	1.77
12	601111	中国国航	183,500	1,574,430.00	1.74
13	601992	金隅股份	165,500	1,550,735.00	1.71
14	600196	复星医药	66,000	1,550,340.00	1.71
15	000825	太钢不锈	363,400	1,489,940.00	1.65
16	600999	招商证券	67,663	1,468,287.10	1.62
17	600188	兖州煤业	147,400	1,392,930.00	1.54
18	601898	中煤能源	224,359	1,357,371.95	1.50
19	000783	长江证券	107,700	1,337,634.00	1.48

20	600578	京能电力	212,600	1,290,482.00	1.42
21	600703	三安光电	52,000	1,262,560.00	1.39
22	601991	大唐发电	235,600	1,210,984.00	1.34
23	601988	中国银行	287,400	1,152,474.00	1.27
24	000898	鞍钢股份	220,100	1,049,877.00	1.16
25	601857	中国石油	120,900	1,009,515.00	1.11
26	600867	通化东宝	35,000	950,950.00	1.05
27	601021	春秋航空	14,900	908,900.00	1.00
28	600028	中国石化	179,900	892,304.00	0.99
29	300003	乐普医疗	23,024	888,726.40	0.98
30	601398	工商银行	190,300	871,574.00	0.96
31	000425	徐工机械	204,900	870,825.00	0.96
32	601939	建设银行	147,552	852,850.56	0.94
33	000539	粤电力 A	110,600	812,910.00	0.90
34	000963	华东医药	9,681	793,454.76	0.88
35	600019	宝钢股份	136,200	759,996.00	0.84
36	002475	立讯精密	23,471	749,898.45	0.83
37	300017	网宿科技	12,100	725,879.00	0.80
38	000400	许继电气	37,170	722,213.10	0.80
39	600256	广汇能源	108,100	721,027.00	0.80
40	600332	白云山	22,700	687,129.00	0.76
41	600663	陆家嘴	13,620	682,906.80	0.75
42	600016	民生银行	68,749	662,740.36	0.73
43	600406	国电南瑞	39,700	662,196.00	0.73
44	600317	营口港	136,400	647,900.00	0.72
45	002007	华兰生物	14,657	644,908.00	0.71
46	601600	中国铝业	128,939	640,826.83	0.71
47	600893	中航动力	13,400	603,402.00	0.67
48	600066	宇通客车	26,410	593,960.90	0.66
49	600415	小商品城	63,700	585,403.00	0.65
50	002567	唐人神	44,900	576,516.00	0.64
51	601179	中国西电	79,200	539,352.00	0.60
52	000657	中钨高新	30,700	491,507.00	0.54
53	600705	中航资本	31,300	487,654.00	0.54
54	601601	中国太保	14,747	425,598.42	0.47
55	601607	上海医药	21,100	420,101.00	0.46
56	601669	中国电建	51,700	415,151.00	0.46
57	603288	海天味业	11,373	402,035.55	0.44
58	601919	中国远洋	44,100	397,782.00	0.44
59	600519	贵州茅台	1,810	394,923.90	0.44
60	600535	天士力	9,412	385,139.04	0.43
61	601006	大秦铁路	44,100	380,142.00	0.42
62	601928	凤凰传媒	23,600	375,948.00	0.42
63	000937	冀中能源	70,400	354,816.00	0.39

64	601800	中国交建	26,000	348,660.00	0.38
65	600585	海螺水泥	20,100	343,710.00	0.38
66	600029	南方航空	40,000	342,800.00	0.38
67	600166	福田汽车	53,400	338,022.00	0.37
68	002038	双鹭药业	10,050	336,675.00	0.37
69	600000	浦发银行	18,356	335,364.12	0.37
70	002375	亚厦股份	21,200	334,324.00	0.37
71	600208	新湖中宝	69,900	333,423.00	0.37
72	002153	石基信息	2,202	332,502.00	0.37
73	300015	爱尔眼科	10,300	325,274.00	0.36
74	002465	海格通信	19,300	322,117.00	0.36
75	002415	海康威视	9,300	319,827.00	0.35
76	600489	中金黄金	32,200	319,746.00	0.35
77	600315	上海家化	8,000	315,920.00	0.35
78	300059	东方财富	6,022	313,324.66	0.35
79	600600	青岛啤酒	9,300	308,760.00	0.34
80	603993	洛阳钼业	68,900	307,294.00	0.34
81	601336	新华保险	5,858	305,846.18	0.34
82	000061	农产品	17,200	304,268.00	0.34
83	002047	宝鹰股份	27,000	303,480.00	0.34
84	600660	福耀玻璃	19,200	291,648.00	0.32
85	600036	招商银行	15,926	286,508.74	0.32
86	600804	鹏博士	11,800	279,896.00	0.31
87	601555	东吴证券	17,100	274,797.00	0.30
88	601231	环旭电子	18,700	270,402.00	0.30
89	300070	碧水源	5,200	269,204.00	0.30
90	002024	苏宁云商	19,800	266,310.00	0.29
91	600309	万华化学	14,400	257,040.00	0.28
92	000738	中航动控	8,000	252,960.00	0.28
93	000001	平安银行	20,900	250,591.00	0.28
94	000826	启迪桑德	6,300	249,606.00	0.28
95	000729	燕京啤酒	30,100	247,723.00	0.27
96	601888	中国国旅	4,125	244,653.75	0.27
97	601628	中国人寿	8,445	239,077.95	0.26
98	002230	科大讯飞	6,300	233,415.00	0.26
99	600863	内蒙华电	49,700	222,159.00	0.25
100	601333	广深铁路	44,000	220,440.00	0.24
101	601216	君正集团	19,100	218,695.00	0.24
102	300024	机器人	3,000	205,500.00	0.23
103	600958	东方证券	8,700	202,623.00	0.22
104	000411	英特集团	7,200	191,448.00	0.21
105	600172	黄河旋风	6,800	172,108.00	0.19
106	002247	帝龙新材	8,300	171,893.00	0.19
107	600211	西藏药业	3,900	170,742.00	0.19

108	000046	泛海控股	11,700	146,835.00	0.16
109	601018	宁波港	17,600	143,616.00	0.16
110	600153	建发股份	9,700	142,493.00	0.16
111	000989	九芝堂	4,300	138,546.00	0.15
112	300190	维尔利	5,600	135,968.00	0.15
113	300158	振东制药	6,600	133,650.00	0.15
114	002690	美亚光电	3,200	129,120.00	0.14
115	002594	比亚迪	2,000	128,800.00	0.14
116	002262	恩华药业	4,400	128,788.00	0.14
117	600005	武钢股份	36,200	125,614.00	0.14
118	300030	阳普医疗	6,000	117,360.00	0.13
119	000008	神州高铁	9,800	115,444.00	0.13
120	002010	传化股份	4,900	115,395.00	0.13
121	002563	森马服饰	9,200	114,080.00	0.13
122	002159	三特索道	3,700	113,960.00	0.13
123	300083	劲胜精密	2,400	113,568.00	0.13
124	300023	宝德股份	2,800	111,944.00	0.12
125	600562	国睿科技	1,800	111,942.00	0.12
126	600439	瑞贝卡	15,700	111,470.00	0.12
127	600162	香江控股	12,200	111,142.00	0.12
128	600449	宁夏建材	9,900	110,880.00	0.12
129	300150	世纪瑞尔	7,600	110,200.00	0.12
130	300021	大禹节水	6,900	110,124.00	0.12
131	002616	长青集团	4,100	109,183.00	0.12
132	300260	新莱应材	3,200	108,480.00	0.12
133	300465	高伟达	1,200	104,412.00	0.12
134	002714	牧原股份	2,200	103,554.00	0.11
135	300124	汇川技术	2,081	98,223.20	0.11
136	300451	创业软件	500	87,600.00	0.10
137	000750	国海证券	6,100	78,385.00	0.09
138	000712	锦龙股份	2,600	75,712.00	0.08
139	600038	中直股份	1,247	65,754.31	0.07
140	000728	国元证券	2,700	60,993.00	0.07
141	002252	上海莱士	1,500	59,655.00	0.07
142	300104	乐视网	900	52,920.00	0.06
143	000559	万向钱潮	2,200	49,786.00	0.05
144	000999	华润三九	1,823	49,767.90	0.05
145	600023	浙能电力	6,600	49,434.00	0.05
146	600837	海通证券	3,100	49,042.00	0.05
147	000538	云南白药	600	43,572.00	0.05
148	002673	西部证券	1,200	39,492.00	0.04
149	600271	航天信息	543	38,808.21	0.04
150	300002	神州泰岳	2,900	37,990.00	0.04
151	601958	金铂股份	4,200	34,776.00	0.04

152	600827	百联股份	1,855	33,148.85	0.04
153	600717	天津港	2,903	32,716.81	0.04
154	601098	中南传媒	1,300	31,070.00	0.03
155	001979	招商蛇口	1,441	30,059.26	0.03
156	000917	电广传媒	700	18,592.00	0.02
157	600900	长江电力	1,259	17,072.04	0.02
158	600739	辽宁成大	500	11,300.00	0.01
159	002292	奥飞动漫	100	5,171.00	0.01

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	19,186,644.00	16.30
2	601318	中国平安	18,169,257.68	15.44
3	600000	浦发银行	15,863,253.04	13.48
4	600016	民生银行	15,355,628.69	13.05
5	601398	工商银行	14,325,132.00	12.17
6	600015	华夏银行	14,253,250.51	12.11
7	000001	平安银行	12,809,052.41	10.88
8	601939	建设银行	12,799,866.92	10.88
9	601818	光大银行	12,596,986.74	10.70
10	600999	招商证券	11,782,378.36	10.01
11	601601	中国太保	11,511,696.37	9.78
12	601998	中信银行	11,114,550.95	9.44
13	600030	中信证券	11,085,243.00	9.42
14	600036	招商银行	10,405,498.40	8.84
15	600383	金地集团	9,972,956.85	8.47
16	600837	海通证券	9,937,525.59	8.44
17	601988	中国银行	9,862,454.00	8.38
18	601006	大秦铁路	9,508,642.92	8.08
19	601009	南京银行	9,472,641.37	8.05
20	000333	美的集团	9,120,739.34	7.75
21	601668	中国建筑	8,961,075.00	7.61
22	600887	伊利股份	8,397,313.64	7.14
23	601328	交通银行	8,231,986.74	6.99
24	601628	中国人寿	7,708,314.42	6.55
25	600028	中国石化	7,559,356.22	6.42
26	000157	中联重科	7,475,350.57	6.35

27	600703	三安光电	7,352,333.96	6.25
28	002304	洋河股份	7,335,965.95	6.23
29	601788	光大证券	7,319,175.97	6.22
30	000783	长江证券	7,266,690.00	6.17
31	000776	广发证券	7,225,556.45	6.14
32	000729	燕京啤酒	6,965,447.02	5.92
33	600398	海澜之家	6,938,697.88	5.90
34	000728	国元证券	6,914,820.83	5.88
35	000895	双汇发展	6,574,116.09	5.59
36	601766	中国中车	6,547,121.00	5.56
37	000002	万 科 A	6,532,007.00	5.55
38	000039	中集集团	6,341,749.06	5.39
39	601231	环旭电子	6,113,970.00	5.19
40	600535	天士力	6,106,229.66	5.19
41	600372	中航电子	5,838,134.58	4.96
42	300017	网宿科技	5,815,317.27	4.94
43	601169	北京银行	5,723,870.63	4.86
44	601336	新华保险	5,663,110.50	4.81
45	601088	中国神华	5,588,326.85	4.75
46	600038	中直股份	5,586,700.40	4.75
47	600900	长江电力	5,560,643.84	4.72
48	002007	华兰生物	5,526,448.84	4.70
49	600068	葛洲坝	5,520,231.88	4.69
50	601377	兴业证券	5,441,310.00	4.62
51	600795	国电电力	5,417,234.45	4.60
52	600208	新湖中宝	5,416,497.00	4.60
53	002202	金风科技	5,405,052.30	4.59
54	601888	中国国旅	5,399,963.00	4.59
55	600637	东方明珠	5,284,523.88	4.49
56	600011	华能国际	5,236,222.10	4.45
57	000625	长安汽车	5,197,836.11	4.42
58	600585	海螺水泥	5,177,624.03	4.40
59	601098	中南传媒	5,148,378.69	4.37
60	300124	汇川技术	5,123,351.49	4.35
61	600048	保利地产	5,108,693.00	4.34
62	300146	汤臣倍健	5,101,847.58	4.33
63	300059	东方财富	5,097,824.12	4.33
64	000069	华侨城 A	5,080,607.00	4.32
65	600109	国金证券	5,054,180.93	4.29
66	601899	紫金矿业	5,039,622.00	4.28
67	600019	宝钢股份	5,009,294.92	4.26
68	600104	上汽集团	4,989,994.16	4.24
69	600166	福田汽车	4,942,423.00	4.20
70	000999	华润三九	4,931,056.87	4.19



71	601991	大唐发电	4,858,712.79	4.13
72	002153	石基信息	4,858,683.06	4.13
73	600089	特变电工	4,825,592.36	4.10
74	601555	东吴证券	4,811,592.56	4.09
75	601117	中国化学	4,792,693.18	4.07
76	600804	鹏博士	4,791,042.76	4.07
77	600717	天津港	4,778,666.48	4.06
78	600348	阳泉煤业	4,731,384.17	4.02
79	601333	广深铁路	4,719,312.01	4.01
80	002475	立讯精密	4,687,836.21	3.98
81	601688	华泰证券	4,646,045.18	3.95
82	601857	中国石油	4,641,380.90	3.94
83	000963	华东医药	4,613,233.63	3.92
84	600369	西南证券	4,548,303.73	3.86
85	000898	鞍钢股份	4,524,364.00	3.84
86	600340	华夏幸福	4,432,168.68	3.77
87	600277	亿利洁能	4,402,423.00	3.74
88	600519	贵州茅台	4,372,813.65	3.72
89	600066	宇通客车	4,349,029.93	3.70
90	002142	宁波银行	4,307,954.80	3.66
91	601111	中国国航	4,301,626.39	3.66
92	601901	方正证券	4,262,845.20	3.62
93	000831	五矿稀土	4,169,299.50	3.54
94	002456	欧菲光	4,135,240.16	3.51
95	601607	上海医药	4,126,200.34	3.51
96	000725	京东方 A	3,994,520.42	3.39
97	002470	金正大	3,992,251.14	3.39
98	000651	格力电器	3,990,067.49	3.39
99	600188	兖州煤业	3,984,760.09	3.39
100	000778	新兴铸管	3,978,693.13	3.38
101	002008	大族激光	3,959,079.89	3.36
102	600362	江西铜业	3,939,791.60	3.35
103	000858	五粮液	3,931,059.42	3.34
104	601600	中国铝业	3,921,286.39	3.33
105	600196	复星医药	3,914,780.54	3.33
106	600029	南方航空	3,882,622.98	3.30
107	000983	西山煤电	3,868,571.16	3.29
108	000100	TCL 集团	3,847,073.00	3.27
109	000063	中兴通讯	3,840,441.40	3.26
110	000581	威孚高科	3,829,368.37	3.25
111	600406	国电南瑞	3,820,012.00	3.25
112	600317	营口港	3,790,640.99	3.22
113	600315	上海家化	3,787,531.37	3.22
114	600177	雅戈尔	3,785,369.00	3.22

115	002736	国信证券	3,755,173.45	3.19
116	601933	永辉超市	3,739,293.53	3.18
117	601179	中国西电	3,731,369.00	3.17
118	600005	武钢股份	3,692,678.00	3.14
119	000825	太钢不锈	3,650,399.46	3.10
120	600276	恒瑞医药	3,646,952.21	3.10
121	000538	云南白药	3,634,557.76	3.09
122	002051	中工国际	3,634,186.48	3.09
123	600023	浙能电力	3,573,787.00	3.04
124	601800	中国交建	3,550,406.69	3.02
125	600886	国投电力	3,542,873.00	3.01
126	000623	吉林敖东	3,536,162.71	3.00
127	000568	泸州老窖	3,509,013.17	2.98
128	002038	双鹭药业	3,504,576.67	2.98
129	601699	潞安环能	3,483,274.66	2.96
130	000750	国海证券	3,464,173.00	2.94
131	000046	泛海控股	3,441,883.77	2.92
132	000402	金融街	3,432,709.82	2.92
133	600352	浙江龙盛	3,428,648.01	2.91
134	300003	乐普医疗	3,396,153.38	2.89
135	600827	百联股份	3,378,026.30	2.87
136	600809	山西汾酒	3,352,639.93	2.85
137	600256	广汇能源	3,323,024.00	2.82
138	000166	申万宏源	3,307,431.67	2.81
139	600027	华电国际	3,305,339.05	2.81
140	002594	比亚迪	3,282,182.03	2.79
141	600497	驰宏锌锗	3,258,735.65	2.77
142	002252	上海莱士	3,247,736.60	2.76
143	000686	东北证券	3,223,891.00	2.74
144	600060	海信电器	3,200,134.76	2.72
145	002081	金螳螂	3,190,890.64	2.71
146	600050	中国联通	3,183,686.36	2.71
147	600873	梅花生物	3,181,852.00	2.70
148	002241	歌尔声学	3,157,910.92	2.68
149	600031	三一重工	3,150,522.00	2.68
150	002344	海宁皮城	3,126,860.72	2.66
151	600642	申能股份	3,079,463.54	2.62
152	601992	金隅股份	3,077,776.02	2.62
153	002375	亚厦股份	3,068,567.50	2.61
154	600674	川投能源	3,067,980.66	2.61
155	601186	中国铁建	3,033,752.00	2.58
156	300015	爱尔眼科	3,028,108.33	2.57
157	000400	许继电气	3,022,459.70	2.57
158	600518	康美药业	3,003,978.49	2.55

159	300104	乐视网	2,999,898.50	2.55
160	600867	通化东宝	2,994,693.00	2.54
161	300027	华谊兄弟	2,970,902.00	2.52
162	600085	同仁堂	2,967,103.02	2.52
163	300024	机器人	2,912,574.00	2.47
164	002415	海康威视	2,904,546.43	2.47
165	600893	中航动力	2,884,603.90	2.45
166	600115	东方航空	2,870,451.00	2.44
167	600648	外高桥	2,853,659.30	2.42
168	600018	上港集团	2,844,161.70	2.42
169	000060	中金岭南	2,837,595.08	2.41
170	600009	上海机场	2,821,278.71	2.40
171	002450	康得新	2,794,443.06	2.37
172	600958	东方证券	2,714,628.00	2.31
173	600741	华域汽车	2,695,861.77	2.29
174	600578	京能电力	2,675,981.96	2.27
175	600660	福耀玻璃	2,672,750.59	2.27
176	601989	中国重工	2,651,324.00	2.25
177	601021	春秋航空	2,638,535.00	2.24
178	600597	光明乳业	2,633,170.00	2.24
179	002653	海思科	2,611,457.14	2.22
180	600221	海南航空	2,554,496.00	2.17
181	002422	科伦药业	2,551,900.41	2.17
182	000425	徐工机械	2,533,232.62	2.15
183	002500	山西证券	2,532,154.40	2.15
184	000338	潍柴动力	2,522,198.00	2.14
185	600583	海油工程	2,499,546.36	2.12
186	002065	东华软件	2,486,507.80	2.11
187	601390	中国中铁	2,468,246.00	2.10
188	300070	碧水源	2,436,380.42	2.07
189	600863	内蒙华电	2,429,351.00	2.06
190	601929	吉视传媒	2,427,217.75	2.06
191	000009	中国宝安	2,413,165.29	2.05
192	600998	九州通	2,398,231.65	2.04
193	600309	万华化学	2,378,833.09	2.02
194	000793	华闻传媒	2,369,167.90	2.01
195	603288	海天味业	2,360,336.47	2.01
196	600875	东方电气	2,356,228.06	2.00

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	21,805,595.53	18.53
2	601288	农业银行	19,055,256.58	16.19
3	600000	浦发银行	18,468,218.70	15.69
4	600016	民生银行	18,028,455.49	15.32
5	000001	平安银行	14,793,656.12	12.57
6	600015	华夏银行	14,667,267.38	12.46
7	601398	工商银行	14,037,807.56	11.93
8	600036	招商银行	13,939,831.38	11.84
9	600837	海通证券	13,497,044.23	11.47
10	601601	中国太保	13,056,554.47	11.09
11	600030	中信证券	12,631,552.73	10.73
12	601939	建设银行	12,473,477.01	10.60
13	600383	金地集团	10,451,781.09	8.88
14	601818	光大银行	10,152,450.06	8.63
15	601009	南京银行	10,081,712.95	8.57
16	601328	交通银行	9,921,392.48	8.43
17	600999	招商证券	9,853,958.98	8.37
18	601998	中信银行	9,626,232.06	8.18
19	601668	中国建筑	9,574,212.20	8.14
20	000333	美的集团	9,515,604.66	8.09
21	601988	中国银行	9,381,049.60	7.97
22	600887	伊利股份	9,270,244.09	7.88
23	601006	大秦铁路	9,099,324.68	7.73
24	000776	广发证券	9,008,425.93	7.65
25	601766	中国中车	8,150,623.55	6.93
26	000002	万科 A	7,948,870.04	6.75
27	000729	燕京啤酒	7,772,881.96	6.60
28	601628	中国人寿	7,373,469.45	6.27
29	000157	中联重科	7,301,457.87	6.20
30	000728	国元证券	7,241,177.90	6.15
31	600028	中国石化	7,199,495.30	6.12
32	601169	北京银行	7,081,049.65	6.02
33	000895	双汇发展	6,825,974.15	5.80
34	600068	葛洲坝	6,808,818.22	5.79
35	000039	中集集团	6,687,819.54	5.68
36	600637	东方明珠	6,577,114.63	5.59
37	601377	兴业证券	6,569,898.15	5.58
38	601688	华泰证券	6,468,484.48	5.50
39	600703	三安光电	6,375,759.13	5.42

40	600038	中直股份	6,284,013.77	5.34
41	600372	中航电子	6,201,984.14	5.27
42	600795	国电电力	6,140,651.76	5.22
43	601231	环旭电子	6,134,216.74	5.21
44	000783	长江证券	6,062,944.96	5.15
45	002202	金风科技	5,976,603.29	5.08
46	601336	新华保险	5,968,631.40	5.07
47	600369	西南证券	5,907,273.75	5.02
48	600900	长江电力	5,869,692.67	4.99
49	600535	天士力	5,827,663.86	4.95
50	601098	中南传媒	5,799,190.96	4.93
51	601333	广深铁路	5,594,025.49	4.75
52	002304	洋河股份	5,543,373.90	4.71
53	300146	汤臣倍健	5,489,711.32	4.66
54	600011	华能国际	5,431,374.50	4.61
55	601088	中国神华	5,417,446.70	4.60
56	600109	国金证券	5,393,039.11	4.58
57	601888	中国国旅	5,277,754.69	4.48
58	600208	新湖中宝	5,264,192.18	4.47
59	300017	网宿科技	5,255,440.57	4.47
60	300124	汇川技术	5,243,459.09	4.46
61	000069	华侨城 A	5,230,277.32	4.44
62	000625	长安汽车	5,198,166.98	4.42
63	601117	中国化学	5,102,834.81	4.34
64	002007	华兰生物	5,101,156.93	4.33
65	600104	上汽集团	5,060,183.17	4.30
66	600804	鹏博士	5,043,195.16	4.29
67	002008	大族激光	5,013,473.15	4.26
68	000999	华润三九	5,000,502.34	4.25
69	600029	南方航空	4,991,378.74	4.24
70	000778	新兴铸管	4,987,375.92	4.24
71	000402	金融街	4,981,696.21	4.23
72	600048	保利地产	4,896,771.80	4.16
73	600585	海螺水泥	4,892,273.14	4.16
74	000651	格力电器	4,867,960.85	4.14
75	600089	特变电工	4,841,955.42	4.11
76	300059	东方财富	4,824,715.38	4.10
77	600277	亿利洁能	4,813,136.56	4.09
78	002153	石基信息	4,807,261.63	4.08
79	600050	中国联通	4,733,095.50	4.02
80	601607	上海医药	4,709,524.17	4.00
81	600340	华夏幸福	4,708,244.35	4.00
82	600166	福田汽车	4,705,418.26	4.00
83	002456	欧菲光	4,681,697.69	3.98

84	600348	阳泉煤业	4,680,695.24	3.98
85	600886	国投电力	4,657,561.92	3.96
86	600717	天津港	4,647,683.00	3.95
87	002142	宁波银行	4,621,987.82	3.93
88	601901	方正证券	4,487,529.88	3.81
89	000831	五矿稀土	4,457,021.63	3.79
90	600873	梅花生物	4,424,321.85	3.76
91	000725	京东方 A	4,418,367.40	3.75
92	600060	海信电器	4,411,343.93	3.75
93	601555	东吴证券	4,397,624.84	3.74
94	600809	山西汾酒	4,353,431.37	3.70
95	601179	中国西电	4,301,414.16	3.65
96	002475	立讯精密	4,262,717.24	3.62
97	000686	东北证券	4,232,052.79	3.60
98	600642	申能股份	4,222,328.49	3.59
99	600019	宝钢股份	4,197,967.66	3.57
100	000568	泸州老窖	4,194,983.82	3.56
101	000963	华东医药	4,193,537.80	3.56
102	002470	金正大	4,186,564.25	3.56
103	600352	浙江龙盛	4,149,114.11	3.53
104	601933	永辉超市	4,137,359.45	3.52
105	600827	百联股份	4,065,041.14	3.45
106	600398	海澜之家	4,034,282.13	3.43
107	000858	五 粮 液	4,013,953.17	3.41
108	000623	吉林敖东	4,009,838.49	3.41
109	000581	威孚高科	3,973,636.27	3.38
110	600362	江西铜业	3,939,877.94	3.35
111	600519	贵州茅台	3,932,383.76	3.34
112	000063	中兴通讯	3,890,862.81	3.31
113	002736	国信证券	3,866,220.00	3.29
114	000166	申万宏源	3,840,226.02	3.26
115	002051	中工国际	3,836,476.10	3.26
116	600177	雅戈尔	3,828,817.36	3.25
117	000100	TCL 集团	3,800,348.22	3.23
118	600066	宇通客车	3,793,911.42	3.22
119	000983	西山煤电	3,790,252.20	3.22
120	000898	鞍钢股份	3,773,300.86	3.21
121	600497	驰宏锌锗	3,768,689.81	3.20
122	601857	中国石油	3,707,324.58	3.15
123	601788	光大证券	3,696,057.70	3.14
124	600023	浙能电力	3,657,224.60	3.11
125	000538	云南白药	3,641,545.94	3.09
126	601991	大唐发电	3,534,191.49	3.00
127	600315	上海家化	3,533,897.60	3.00

128	601600	中国铝业	3,507,378.15	2.98
129	600188	兖州煤业	3,493,544.49	2.97
130	000338	潍柴动力	3,482,947.28	2.96
131	002241	歌尔声学	3,447,570.25	2.93
132	002038	双鹭药业	3,445,568.96	2.93
133	601186	中国铁建	3,441,960.44	2.92
134	600005	武钢股份	3,438,225.10	2.92
135	002344	海宁皮城	3,428,314.61	2.91
136	600875	东方电气	3,389,455.39	2.88
137	600406	国电南瑞	3,356,072.42	2.85
138	600583	海油工程	3,355,129.48	2.85
139	601699	潞安环能	3,346,003.46	2.84
140	600085	同仁堂	3,335,210.12	2.83
141	601111	中国国航	3,304,629.83	2.81
142	600597	光明乳业	3,279,906.86	2.79
143	601390	中国中铁	3,272,969.62	2.78
144	002252	上海莱士	3,272,688.37	2.78
145	600674	川投能源	3,254,384.10	2.77
146	002375	亚厦股份	3,191,646.27	2.71
147	002594	比亚迪	3,161,439.66	2.69
148	000060	中金岭南	3,105,868.72	2.64
149	002001	新 和 成	3,105,480.71	2.64
150	300027	华谊兄弟	3,084,974.64	2.62
151	000046	泛海控股	3,075,275.85	2.61
152	000750	国海证券	3,061,875.41	2.60
153	600115	东方航空	3,049,807.08	2.59
154	600648	外高桥	3,016,410.84	2.56
155	601669	中国电建	3,004,966.68	2.55
156	601899	紫金矿业	2,991,295.76	2.54
157	600009	上海机场	2,989,099.19	2.54
158	600031	三一重工	2,982,322.24	2.53
159	600317	营口港	2,968,183.00	2.52
160	002410	广联达	2,955,276.99	2.51
161	002450	康得新	2,951,429.20	2.51
162	601633	长城汽车	2,932,351.20	2.49
163	600518	康美药业	2,896,521.28	2.46
164	601800	中国交建	2,886,277.75	2.45
165	002081	金 螳 螂	2,867,691.30	2.44
166	002653	海思科	2,863,483.44	2.43
167	300015	爱尔眼科	2,852,206.95	2.42
168	600018	上港集团	2,829,130.89	2.40
169	601989	中国重工	2,799,432.80	2.38
170	600741	华域汽车	2,778,659.47	2.36
171	600863	内蒙华电	2,763,102.12	2.35

172	002422	科伦药业	2,738,394.73	2.33
173	000709	河钢股份	2,685,499.69	2.28
174	600958	东方证券	2,678,827.35	2.28
175	002415	海康威视	2,659,496.40	2.26
176	000800	一汽轿车	2,630,237.62	2.23
177	300104	乐视网	2,614,706.00	2.22
178	000425	徐工机械	2,601,268.67	2.21
179	002065	东华软件	2,589,138.82	2.20
180	600256	广汇能源	2,571,702.26	2.19
181	600893	中航动力	2,562,682.22	2.18
182	000009	中国宝安	2,548,522.92	2.17
183	600221	海南航空	2,540,574.10	2.16
184	600309	万华化学	2,530,602.82	2.15
185	300024	机器人	2,523,250.49	2.14
186	002024	苏宁云商	2,511,694.11	2.13
187	002640	跨境通	2,467,996.80	2.10
188	002500	山西证券	2,448,075.87	2.08
189	000400	许继电气	2,445,345.00	2.08
190	600998	九州通	2,441,691.80	2.07
191	300070	碧水源	2,438,269.51	2.07
192	600839	四川长虹	2,426,474.90	2.06
193	002129	中环股份	2,422,562.88	2.06
194	601929	吉视传媒	2,400,417.00	2.04
195	600660	福耀玻璃	2,393,437.14	2.03
196	300003	乐普医疗	2,375,952.00	2.02
197	000027	深圳能源	2,375,423.96	2.02
198	601158	重庆水务	2,370,076.52	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,390,452,354.79
卖出股票的收入（成交）总额	1,431,940,951.03

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	15,500.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,500.00	0.02

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	155	15,500.00	0.02

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,861.46
2	应收证券清算款	1,225,208.62
3	应收股利	-
4	应收利息	3,122.23
5	应收申购款	573,294.05
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,905,486.36

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安沪深 300 增强 A	659	33,994.04	-	-	22,402,071.35	100.00%
华安沪深 300 增强 C	1,239	30,365.40	-	-	37,622,736.34	100.00%
合计	1,898	31,625.29	-	-	60,024,807.69	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

1、分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沪深 300 增强 A	华安沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2013 年 9 月 27 日）基金份额总额	36,175,885.32	515,917,432.89
本报告期期初基金份额总额	18,905,736.42	65,289,642.41
本报告期基金总申购份额	51,788,691.82	236,649,076.36
减：本报告期基金总赎回份额	48,292,356.89	264,315,982.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,402,071.35	37,622,736.34

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

（1）2015 年 1 月 22 日，基金管理人发布了华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理变更公告，新增谢东旭先生为本基金的基金经理，与牛勇先生共同管理本基金。

（2）2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

（3）2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(4) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 56,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券有限责任公司	2	2,818,453,430.74	100.00%	873,497.97	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
上海证券有限责任公司	11,097.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-05
2	华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2015-01-22

		和公司网站	
3	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海长量基金为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-01-23
4	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-03
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京增财基金销售为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-06
6	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-07
7	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-12
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-13
9	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金销售为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-17
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-18
11	关于华安旗下部分基金参加好买基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-25
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-03-31
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-04-04
14	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-04-08
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华域汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-04-14
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-05-07
17	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深	《上海证券报》、《证券	2015-05-29

	圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
18	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-02
19	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-02
20	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金在官方京东店开展认购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-10
21	华安基金管理有限公司关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-10
22	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
24	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-26
25	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-29
26	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-06-30
27	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-07-01
28	华安基金管理有限公司关于公司及高管投资旗下基金相关事宜的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-07-07
29	关于华安旗下部分基金增加申万宏源证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-07-09
30	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“友好集团”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-07-09
31	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新宁物流”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-07-10



32	华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-11
33	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“东方园林”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-13
34	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加同花顺申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-14
35	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“西安饮食”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-15
36	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加一路财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-16
37	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒天明泽为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-24
38	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-24
39	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双龙股份”、“碧水源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-13
40	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中金公司优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-19
41	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-20
42	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-24
43	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“华谊兄弟”、“北大荒”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-26
44	华安基金管理有限公司关于华安旗下基金调整单笔最低申购金额的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-27
45	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“蓝色光标”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-27
46	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“铜陵有色”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2015-08-28

		和公司网站	
47	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆金所为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-08-31
48	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长机构客户认购、申购费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-09-02
49	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-09-11
50	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“雅本化学”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-20
51	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富济财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-26
52	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加乐融多源为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-26
53	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-26
54	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“航天信息”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-28
55	华安基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-10-30
56	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大泰金石投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-11-04
57	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加诺亚正行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-11-07
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“北京银行”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-11-12
59	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-11-13
60	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“青岛金王”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2015-11-14
61	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增	《上海证券报》、《证券	2015-11-25

	加利得为销售机构并参加费率优惠活动的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
62	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-11-27
63	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加君德为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-02
64	华安基金管理有限公司关于参加京东费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-03
65	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新兰德为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-07
66	华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金调整单笔最低赎回份额、单笔最低转出份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-10
67	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-10
68	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“渤海活塞”、“碧水源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-24
69	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-25
70	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加平安银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-31
71	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-31
72	华安基金管理有限公司关于旗下基金因指数熔断交易规则实施调整开放时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-31

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》

- 2、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 量化增强证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 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>。

## 12.3 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  
二〇一六年三月二十八日