

华安沪深 300 量化增强证券投资基金更新的招募说明书摘要

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

二〇一六年十一月

重要提示

华安沪深 300 量化增强证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会 2013 年 8 月 8 日《关于核准华安沪深 300 量化增强证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]1065 号）准予注册。本基金基金合同自 2013 年 9 月 27 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

投资有风险。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并

不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书摘要所载内容截止日为 2016 年 9 月 27 日，有关财务数据截止日和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日。

目 录

一、基金管理人	2
二、基金托管人	6
三、相关服务机构	7
四、基金的名称	24
五、基金的类型	25
六、基金的投资目标	25
七、基金的投资方向	25
八、基金的投资策略	26
九、基金的业绩比较基准	30
十、基金的风险收益特征	31
十一、基金投资组合报告	31
十二、基金的业绩	35
十三、费用概览	36
十四、对招募说明书更新部分的说明	40

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31—32 层
- 3、法定代表人：朱学华
- 4、设立日期：1998 年 6 月 4 日
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20 号
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、组织形式：有限责任公司

8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务

9、存续期间：持续经营

10、联系电话：（021）38969999

11、客户服务电话：40088-50099

12、联系人：王艳

13、网址：www.huaan.com.cn

（二）注册资本和股权结构

1、注册资本：1.5 亿元人民币

2、股权结构

持股单位 持股占总股本比例

上海国际信托有限公司 20%

上海电气（集团）总公司 20%

上海锦江国际投资管理有限公司 20%

上海工业投资（集团）有限公司 20%

国泰君安投资管理股份有限公司 20%

（三）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业简历、学历及兼职情况等。

（1）董事会

朱学华先生，大专学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份有限公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛

集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited 董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资管理有限公司监事。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长，固定资产投资审计处副处长（主持工作）、处长，上海市审计局财政审计处处长，上海电气（集团）总公司财务总监。现任上海电气（集团）总公司副总裁、财务总监。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略管理部总经理。

独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

（2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局（原上海证管办）机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，中小企业融资部总经理等职

务。现任国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副总裁、华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，研究生学历。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监助理。现任华安基金管理有限公司集中交易部总监。

（3）高级管理人员

朱学华先生，大专学历，17年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，15年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

章国富先生，博士研究生学历，28年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监、华安基金管理有限公司督察长。现任华安基金管理有限公司副总经理。

薛珍女士，研究生学历，15年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

牛勇先生：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。

谢东旭先生：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。

历任基金经理：

董梁先生，2013年9月27日至2014年12月30日担任本基金基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司股票投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童威先生，总经理

翁启森先生，总经理助理

杨明先生，投资研究部高级总监

许之彦先生，指数投资部高级总监

贺涛先生，固定收益部总监

苏圻涵先生，全球投资部助理总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至2016年6月30日，公司目前共有员工331人（不含香港公司），其中56.5%具有硕士及以上学历，84.6%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

办公地址：福建省福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

成立日期：1988年8月26日

注册资本：190.52亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

联系电话：（021）62677777-212035

联系人：周频

（二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。根据 2015 年年报，截至 2015 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额近 5.30 万亿元；全年实现营业收入 1,543.48 亿元，实现归属于母公司股东的净利润 502.07 亿元。

（三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）华安基金管理有限公司上海业务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31—32 层

电话：（021）38969960

传真：（021）58406138

联系人：姚佳岑

（2）华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 522 室

电话：（010）57635999

传真：（010）66214061

联系人：刘雯

（3）华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路 8 号高德置地夏广场 D 座 504 单元

电话：（020）38082891

传真：（020）38082079

联系人：林承壮

（4）华安基金管理有限公司西安分公司

地址：西安市碑林区南关正街 88 号长安国际中心 A 座 706 室

电话：（029）87651812

传真：（029）87651820

联系人：翟均

（5）华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段 19 号威斯顿联邦大厦 12 层 1211K-1212L

电话：（028）85268583

传真：（028）85268827

联系人：张晓帆

（6）华安基金管理有限公司沈阳分公司

地址：沈阳市沈河区北站路 59 号财富中心 E 座 2103 室

电话：（024）22522733

传真：（024）22521633

联系人：杨贺

（7）华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：（021）33626962

联系人：谢伯恩

2、代销机构

（1）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

电话：0591-87824863

传真：0591-87842633

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：（86）10-66596688

传真：（86）10-66594568

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

（3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107571

网址：www.icbc.com.cn

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（6）平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系电话：（0755）82080387

传真号码：（0755）82080386

客户服务电话：95511

网址：bank.pingan.com

(7) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：冀光恒

电话：0086-21-38576709

传真：0086-21-50105085

客户服务电话：（021）962999

网址：www.srcb.com

(8) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：95553、4008888001

网址：www.htsec.com

(9) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(10) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(11) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

(12) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

(13) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：4008918918

网址：www.shzq.com

(14) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 6 层、26 层、27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

电话：(010) 65051166

传真：(010) 65051156

客户服务电话：(010) 65051166

网址：www.cicc.com.cn

(15) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

联系人：吴卫东

法定代表人：王莉

电话：021-20835787

传真：021-20835879

客户服务电话：400-920-0022

网址：licaikexun.com

(16) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

电话：4006788887

传真：0755-82080798

网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

（17）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人：易峥

电话：0571-88920879

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772；0571-88920897

网址：www.5ifund.com

（18）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

网址：<http://www.csc108.com/>

（19）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层

法定代表人：田德军

客户服务电话：4006989898

网址：<http://www.xsdzq.cn>

（20）华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

客户服务电话：96518

网址：<http://www.hazq.com>

（21）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦

20楼2005室

办公地址：北京西城区太桥大街 19 号

法定代表人：李季

客户服务电话：4008000562

网址：www.swhysc.com

(22) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(23) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

(24) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.e-rich.com.cn

(25) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-888-6661

网址：www.myfp.cn

(26) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客户服务电话：400-001-8811

网址: www.zcvc.com.cn

(27) 太平洋证券股份有限公司

注册地址: 云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址: 云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人: 李长伟

客户服务电话: 0871-68898130

网址: <http://www.tpyzq.com>

(28) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋 2 楼

法定代表人: 汪静波

客户服务电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(29) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层(邮编:200031)

法定代表人: 李梅

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

客服电话: 021-96250500

网址: www.swhysc.com

(30) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

办公地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人: 张晶

联系电话: 021-33323998

传真号码: 021-33323993

客户服务电话: 400-820-2819

网址: fund.bundtrade.com

(31) 泉州银行股份有限公司

注册地址: 泉州市云鹿路 3 号

办公地址: 泉州市云鹿路 3 号

法定代表人: 傅子能

联系电话：0595-22551071

传真号码：0595-22505215

（32）一路财富（北京）信息科技有限公司

地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

网址：www.yilucaifu.com

（33）海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

法定代表人：刘惠

联系电话：021-80133888

传真号码：021-80133413

客户服务电话：400-808-1016

网址：<http://www.fundhaiyin.com>

（34）北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com/

（35）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真号码：021-22066653

（36）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

客户服务电话：400-046-6788

网址：www.66zichan.com

(37) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

网址：www.jinqianwo.cn

(38) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：www.jimufund.com

(39) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系电话：021-22267987

网址：www.dtfunds.com

(40) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道1号宝利国际广场南塔12楼

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629021

网站：www.yingmi.cn

(41) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

客户服务电话：4000676266

网址：www.leadbank.com.cn

(42) 北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室

办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室

法定代表人：李振

客户服务电话：400-066-9355

网站：www.kst treasure.com

（43）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：陈操

客户服务电话：400-850-7771

网址：<https://t.jrj.com>

（44）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人：彭运年

客户服务电话：4008909998

网址：www.jnlc.com

（45）泰信财富投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

办公地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

法定代表人：李静

客户服务电话：400-168-7575

网址：www.taixincf.com

（46）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人：陈继武

客户服务电话：4000178000

网址：www.lingxianfund.com

（47）上海中正达广投资管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

客户服务电话：400-6767-523

网址：www.zzwealth.cn

(48) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

联系电话：0512-65280149

传真号码：0512-69868370

(49) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系电话：010-57418813

传真号码：010-57569671

(50) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系电话：(010) 65983311

传真号码：(010) 65983333

(51) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人：谢永林

电话：4008866338

传真：(0755) 82400862

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(52) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号

办公地址：大连市中山区中山路 88 号

法定代表人：陈占维

电话：0411-82311410

传真：0411-82311410

客户服务电话：4006640099

公司网址: www.bankofd1.com

(53) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人: 何沛良

联系电话: 0769-22866254

传真号码: 0769-22866282

(54) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层

法定代表人: 蒋煜

联系电话: 010-5817 0859

传真号码: 010-5817 0800

(55) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TAN YIK KUAN

(56) 北京广源达信投资管理有限公司

注册地址: 北京是西城区新街口外大街28号C座六层605室

办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区浦项中心B座19层

法定代表人: 齐剑辉

联系电话: 4006236060

传真号码: 010-82055860

(57) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A

法定代表人: 高峰

联系电话: 0755-83655588

传真号码: 0755-83655518

(58) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02

办公地址: 深圳市南山区科苑路18号东方科技大厦18楼

法定代表人： 陈姚坚

联系电话： 0755-84034499

传真号码： 0755-84034477

(59) 上海天天基金销售有限公司

注册地址： 浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址： 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼东方财富大厦 2 楼

法定代表人： 其实

电话： 4001818188

网址： www.1234567.com.cn

(60) 江苏常熟农村商业银行股份有限公司

地址： 江苏省常熟市新世纪大道 58 号

法定代表人： 宋建明

客户服务电话： 4009962000、0512-962000 或前往常熟农商银行各营业网点进行咨询。

网址： www.csrcbank.com

(61) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

住所： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人： 钟斐斐

客户服务电话： 4000618518

传真： 010-61840699

网站： <https://danjuanapp.com/>

(62) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址： 上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址： 上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人： 申健

客服电话： 021-20219931

公司网站： <https://8.gw.com.cn>

(63) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址： 北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

办公地址： 北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A

法定代表人： 梁蓉

联系电话： 010-66154828

传真号码： 010-88067526

(64) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人： 王伟刚

联系电话： 010-56282140

传真号码： 010-62680827

(65) 江苏昆山农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省昆山市前进东路 828 号

办公地址：江苏省昆山市前进东路 828 号

法定代表人： 张哲清

联系电话： (0512) 57379810

传真号码： (0512) 57376090

(66) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

办公地址：北京市海淀区海淀北二街 10 号泰鹏大厦 12 层

法定代表人： 张琪

联系电话： 010-62675369

传真号码： 010-82607516

(67) 嘉兴银行股份有限公司

注册地址：嘉兴市建国南路 409 号

办公地址：嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人： 夏林生

联系电话： 0573-96528

传真号码： 0573-82099678

(68) 宁波银行股份有限公司

地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人： 陆华裕

客户服务电话： 95574

网址： www.nbcb.com.cn

(二) 登记机构

名称：华安基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31—32 层

法定代表人：朱学华

电话：（021）38969999

传真：（021）33627962

联系人：赵良

客户服务中心电话：40088-50099

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张兰

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：周祎

经办会计师：单峰、周祎

四、基金的名称

本基金名称：华安沪深 300 量化增强证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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%。

八、基金的投资策略

（一）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。

1、股票投资策略

（1）标的指数

本基金的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代（单纯更

名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象；并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

（2）多因子量化增强模型

1) 因子分析

本基金基于标的指数成分股及其他股票的各项历史数据，对价值、成长、趋势、情绪、分析师预期等方面的因子在不同市场环境下对个股表现的影响进行统计分析，找到可能影响股票回报的因子。具体分析的因子包括以下几个类别：

价值指标：P/E、企业价值/EBITDA、P/B、PEG 等；

成长指标：主营业务利润复合增长率等；

盈利指标：净资产报酬率、总资产报酬率等；

运营指标：存货周转率、总资产周转率等；

一致预期指标：分析师预测数据；

市场行为指标：动量、反转、换手率等。

2) 模型的构建

在按类别分析的基础上，本基金进一步利用统计分析建立单个因子与未来超额回报关系，即因子预测能力，筛选出针对不同市场环境的有效因子，并根据预测能力和因子间相关性来最终构建多因子量化增强模型。

3) 模型的应用与调整

在正常的市场情况下，本基金将主要依据多因子量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场趋势的变化。

在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，基金经理将根据公司研究团队结论及市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。

（3）风险监控与组合优化

1) 风险监控模型

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，本基金将建立专门的风险预算控制模型，力争将组合相对于沪深 300 的跟踪误差控制在一定范围内。

2) 组合优化模型

在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上，基金管理人将根据预期收益、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。

2、债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。

3、股指期货投资策略

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。

4、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）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%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数构成比例进行投资的情形除外；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数构成比例进行投资的部分不计算在内；

- (4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
 - (5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
 - (6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
 - (7) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
 - (8) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
 - (9) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值的轧差合计不得超过基金资产的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
 - (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。
- 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（三）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（四）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

九、基金的业绩比较基准

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。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7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。

本投资组合报告所载数据截至2016年6月30日。

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 85,535,708.59 89.79

其中：股票 85,535,708.59 89.79

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 7,383,517.25 7.75

7 其他各项资产 2,347,058.35 2.46

8 合计 95,266,284.19 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 --

B 采矿业 2,874,223.93

3.19

C 制造业 25,623,952.60 28.41

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 4,966,581.24 5.51

E 建筑业 3,010,047.00 3.34

F 批发和零售业 4,227,291.00 4.69

G 交通运输、仓储和邮政业 3,497,165.00 3.88

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 5,538,341.60 6.14

J 金融业 24,940,082.86 27.65

K 房地产业 5,413,623.36 6.00

L 租赁和商务服务业 1,538,512.00 1.71

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 1,780,528.00 1.97

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业 1,922,864.00 2.13

S 综合 202,496.00 0.22

合计 85,535,708.59 94.83

3 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	600036	招商银行	198,166	3,467,905.00	3.84
2	601318	中国平安	83,200	2,665,728.00	2.96
3	600837	海通证券	127,600	1,967,592.00	2.18
4	600016	民生银行	196,100	1,751,173.00	1.94
5	600104	上汽集团	75,300	1,527,837.00	1.69
6	600000	浦发银行	95,460	1,486,312.20	1.65
7	601169	北京银行	140,700	1,459,059.00	1.62
8	601377	兴业证券	172,200	1,272,558.00	1.41
9	002415	海康威视	58,200	1,248,972.00	1.38
10	601336	新华保险	29,700	1,199,880.00	1.33

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

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投资。

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。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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投资股指期货。

9.2 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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1 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，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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	175,967.56
2	应收证券清算款	1,504,729.21
3	应收股利	-
4	应收利息	2,892.42
5	应收申购款	663,469.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,347,058.35

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

下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。

（一）基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

（截止时间 2016 年 06 月 30 日）

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

自基金合同生效（2013 年 9 月 27 日）起至 2013 年 12 月 31 日 -2.80% 0.91% -2.16% 1.06% -0.64% -0.15%

2014/01/01-2014/12/31 44.75% 1.15% 49.09% 1.15% -4.34% 0.00%

2015/01/01-2015/12/31 8.24% 2.38% 5.32% 2.36% 2.92% 0.02%

2016/01/01-2016/06/30 -9.46% 1.93% -14.69% 1.75% 5.23% 0.18%

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

自基金合同生效(2013年9月27日)起至2013年12月31日 -3.00% 0.91% -2.16% 1.06% -0.84% -0.15%

2014/01/01-2014/12/31 43.81% 1.15% 49.09% 1.15% -5.28% 0.00%

2015/01/01-2015/12/31 7.53% 2.38% 5.32% 2.36% 2.21% 0.02%

2016/01/01-2016/06/30 -9.67% 1.93% -14.69% 1.75% 5.02% 0.18%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、标的指数使用许可费和数据提供费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(二) 与基金运作有关的费用

- 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（三）与基金销售有关的费用

1、申购、赎回费用

（1）申购费用

本基金 A 类基金份额在投资者申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费。

本基金对通过直销机构申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。

通过直销机构申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率为每笔 500 元。

其它投资人申购本基金 A 类基金份额的申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示：

单笔申购金额 (M) 申购费率

$M < 100$ 万 1.2%

$100 \text{ 万} \leq M < 300$ 万 0.8%

$300 \text{ 万} \leq M < 500$ 万 0.5%

$M \geq 500$ 万 每笔 1000 元

申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于

本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（2）赎回费用

本基金 A 类基金份额在投资者赎回时收取赎回费，赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减；C 类基金份额不收取赎回费。具体费率如下表所示：

份额类型 赎回费率（持有期限 Y）

A 类基金份额 Y<1 年 0.5%

1 年≤Y<2 年 0.15%

Y≥2 年 0

C 类基金份额 0

其中，1 年为 365 天，2 年为 730 天，以此类推。

赎回费用由赎回本基金 A 类基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（3）销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（四）基金的标的指数使用费

根据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，本基金标的的指

数使用费年费率为 0.016%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016%的年费率计提。指数使用费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用费收取下限为每季度 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

除管理费、托管费、销售服务费和指数使用费之外的基金费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（五）不列入基金费用的项目

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（六）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。

（七）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资

管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

章节 主要更新内容

三、基金管理人 更新了基金管理人相关信息。

五、相关服务机构 更新了相关服务机构的信息至最新。

九、基金的投资 更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。

十、基金的业绩 更新了基金合同生效以来本基金的业绩。

二十一、对基金投资人的服务 更新了开通基金直销交易资金的结算银行；更新了开通基金电子直销交易资金结算的第三方支付渠道；电子直销交易服务平台交易功能中删除“赎回转认购”、“直销转托管”功能，详见招募说明书。

二十二、其他应披露事项 披露了自 2016 年 3 月 27 日至 2016 年 9 月 27 日期间本基金的公告信息，详见招募说明书。

华安基金管理有限公司

二〇一六年十一月十一日