

---

华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)  
(华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF))

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一九年四月二十日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华安量化多因子混合（LOF）                             |
| 场内简称       | 华安量化                                       |
| 基金主代码      | 160415                                     |
| 交易代码       | 160415                                     |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式                                   |
| 基金合同生效日    | 2011年9月2日                                  |
| 报告期末基金份额总额 | 16,293,393.03份                             |
| 投资目标       | 通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时， |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略            | 本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。                                     |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司  |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安量化多因子混合（LOF）  |
| 下属分级基金的场内简称     | 华安量化  |
| 下属分级基金的交易代码     | 160415  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,293,393.03份  |

## 2.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华安深证300（LOF）   |
| 场内简称       | 华安S300   |
| 基金主代码      | 160415   |
| 交易代码       | 160415   |
| 基金运作方式     | 上市契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2011年9月2日  |
| 报告期末基金份额总额 | 31,085,420.67份   |
| 投资目标       | 本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略       | 本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 |

|        |  |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率                       |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |
| 基金管理人  | 华安基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 中国银行股份有限公司   |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2019年1月11日-<br>2019年3月31日) | 报告期<br>(2019年1月1日-<br>2019年1月10日) |
|----------------|------------------------------------|-----------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | -1,327,681.99                      | -707,508.10                       |
| 2.本期利润         | 3,874,745.17                       | 529,535.20                        |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2217                             | 0.0160                            |
| 4.期末基金资产净值     | 20,089,289.67                      | 21,209,884.44                     |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2330                             | 0.6820                            |

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2019年1月11日-2019年3月31日）

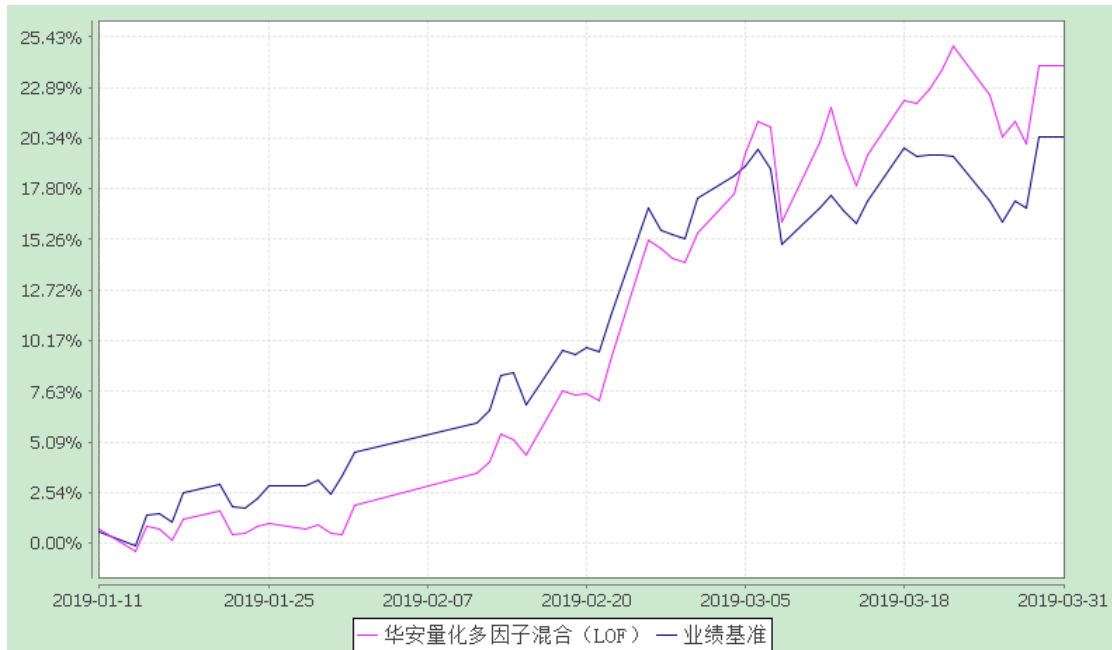
##### 3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段   | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个 | 23.95% | 1.54%     | 20.44%     | 1.28%         | 3.51% | 0.26% |

|   |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 月 |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|

### 3.2.1.2 自基金转型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

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2019年1月11日-2019年3月31日）



注：原华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 于 2019 年 1 月 11 日转型为华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)，截止本报告期末，华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 成立未及一年。本基金于 2019 年 1 月 11 日起，整体业绩比较基准由“95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%”。

### 3.2.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

（报告期：2019年1月1日-2019年1月10日）

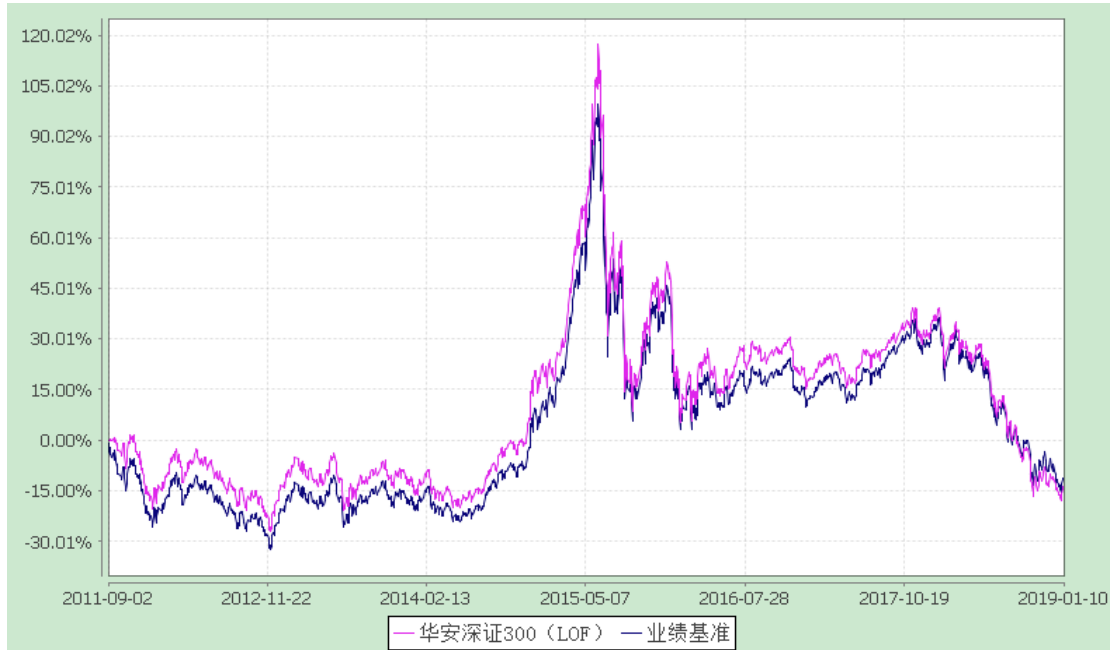
#### 3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段   | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个 | 2.56%  | 1.30%     | 2.53%      | 1.35%         | 0.03% | -0.05% |

|   |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 月 |  |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|--|

### 3.2.2.2 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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2011 年 9 月 2 日-2019 年 1 月 10 日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名  | 职务          | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|-------------|-------------|------------|--------|--|
|     |             | 任职日期        | 离任日期       |        |  |
| 许之彦 | 本基金的基金经理、指数 | 2011-09-02  | 2019-03-29 | 15 年   | 理学博士，15 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后 |

|                  |  |  |   |
|------------------|--|--|---|
| 与量化投资部高级总监、总经理助理 |  |  | <p>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，2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009年9月起同时担任上证180交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011年9月至2019年1月，同时担任华安深证300指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年1月至2019年3月，同时担任本基金的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014年11月至2015年12月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安创业板</p> |
|------------------|--|--|---|

|     |          |            |   |     |  |
|-----|----------|------------|---|-----|--|
|     |          |            |   |     | <p>50 指数分级证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>  |
| 孙晨进 | 本基金的基金经理 | 2015-03-20 | - | 8 年 | <p>硕士研究生，8 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。</p> <p>2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。</p> <p>2015 年 3 月至 2019 年 1 月，担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2019 年 1 月起，同时担任本基金的基金经理。</p> <p>2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月起，同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 1 月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起同时担任华安沪深</p> |



|    |          |            |   |     |   |
|----|----------|------------|---|-----|---|
|    |          |            |   |     | 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。   |
| 马丁 | 本基金的基金经理 | 2019-03-29 | - | 3 年 | 博士研究生，3 年证券基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。<br>2018 年 1 月加入华安基金，担任指数与量化投资部基金经理助理。<br>2019 年 3 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，

---

确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风控部门的监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风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；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

### **4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

---

基金管理人通过多因子与基本面结合的选股策略管理本产品。2019年第一季度，宏观经济数据持续下行，工业企业利润大幅下滑。但是市场乐观情绪居高不下，季度末 PMI 数据超预期抬升，进一步助推了复苏预期。年初社融数据超预期，政策对中小企业的支持举措逐步落地，融资难问题基本得到解决，我国经济韧性再次得到确认。出口贸易摩擦趋势向好，有望中短期内得以解决。我们根据量化策略分析，积极布局春季行情，加大对景气确定性反转和技术确定性革新的板块进行配置。同时，我们也关注价值明显低估的资产，建立价值安全垫，并看好复苏期的反转机会。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2019 年 3 月 31 日，华安量化多因子混合基金份额净值为 1.2330 元，本报告期（2019 年 1 月 11 日-2019 年 3 月 31 日）份额净值增长率为 23.95%，同期业绩比较基准增长率为 20.44%。截至 2019 年 1 月 10 日，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）份额净值为 0.6820 元，本报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 10 日）份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准增长率为 2.53%。

#### **4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望 2019 年，宏观经济数据尚未确定复苏，我们预计逆周期调控政策暂时不会退出。海外贸易摩擦压力减弱，预计宏观经济依然处在探底阶段。科创板等金融供给侧改革措施不断推出，资本市场定位提升，有利于风险偏好修复。工业上游材料价格依然较高，中下游利润率受到影响，对企业和消费端的减税有望对冲部分成本，并逐步改善产业链结构。国际主要指数纳入 A 股的步伐不断向前，海外资金是确定性很高的增量。我们继续看好市场对前期过度悲观的修复以及金融改革红利，挖掘新的增长驱动力，基于安全边际、长期产业格局等方面寻找机会，利用基本面量化的优势，力争稳健的风险可控的收益。

#### **4.4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

## **§ 5 投资组合报告**

### **5.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）**

（报告期：2019年1月11日-2019年3月31日）

#### **5.1.1 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              | 18,359,510.11 | 88.75        |
|    | 其中：股票             | 18,359,510.11 | 88.75        |
| 2  | 固定收益投资            | 86,633.76     | 0.42         |
|    | 其中：债券             | 86,633.76     | 0.42         |
|    | 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      | 2,205,587.05  | 10.66        |
| 7  | 其他各项资产            | 35,584.75     | 0.17         |
| 8  | 合计                | 20,687,315.67 | 100.00       |

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.1.2.1 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              | 675,529.60   | 3.36         |
| C  | 制造业              | 8,027,179.99 | 39.96        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 679,517.64   | 3.38         |
| E  | 建筑业              | 575,238.00   | 2.86         |
| F  | 批发和零售业           | 767,571.00   | 3.82         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 410,832.00   | 2.05         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 397,111.00   | 1.98         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 678,874.00   | 3.38         |
| J  | 金融业              | 4,643,484.00 | 23.11        |
| K  | 房地产业             | 993,791.18   | 4.95         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 130,580.70    | 0.65  |
| 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     | 379,801.00    | 1.89  |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 18,359,510.11 | 91.39 |

### 5.1.3 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  | 601318 | 中国平安 | 7,600   | 585,960.00 | 2.92         |
| 2  | 601009 | 南京银行 | 70,100  | 554,491.00 | 2.76         |
| 3  | 600390 | 五矿资本 | 54,600  | 553,098.00 | 2.75         |
| 4  | 002236 | 大华股份 | 30,000  | 492,600.00 | 2.45         |
| 5  | 600872 | 中炬高新 | 12,200  | 446,276.00 | 2.22         |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 17,600  | 436,128.00 | 2.17         |
| 7  | 002508 | 老板电器 | 13,000  | 418,600.00 | 2.08         |
| 8  | 300003 | 乐普医疗 | 15,600  | 413,400.00 | 2.06         |
| 9  | 601000 | 唐山港  | 126,800 | 410,832.00 | 2.05         |
| 10 | 600657 | 信达地产 | 71,300  | 398,567.00 | 1.98         |

### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 86,633.76 | 0.43         |
| 8  | 其他        | -         | -            |
| 9  | 合计        | 86,633.76 | 0.43         |

### 5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 110051 | 中天转债 | 490   | 53,993.10 | 0.27         |
| 2  | 128045 | 机电转债 | 142   | 16,673.64 | 0.08         |
| 3  | 110056 | 亨通转债 | 90    | 9,000.00  | 0.04         |
| 4  | 128048 | 张行转债 | 43    | 5,081.74  | 0.03         |
| 5  | 128047 | 光电转债 | 16    | 1,885.28  | 0.01         |

### 5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.1.7 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。

### 5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 5.1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.1.10.1本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 5.1.10.2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持有国债期货。

#### 5.1.10.2本期国债期货投资评价

无。

### 5.1.11投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 5.1.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 22,965.85 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 439.34    |
| 5  | 应收申购款   | 12,179.56 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 35,584.75 |

#### 5.1.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|
| 1  | 128045 | 机电转债 | 16,673.64 | 0.08         |

#### 5.1.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 5.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

(报告期: 2019年1月1日-2019年1月10日)

### 5.2.1 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               | 19,556,430.58 | 88.67        |
|    | 其中: 股票             | 19,556,430.58 | 88.67        |
| 2  | 固定收益投资             | 22,042.28     | 0.10         |
|    | 其中: 债券             | 22,042.28     | 0.10         |
|    | 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       | 1,777,380.70  | 8.06         |
| 7  | 其他各项资产             | 698,812.53    | 3.17         |
| 8  | 合计                 | 22,054,666.09 | 100.00       |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | 4,501.60   | 0.02         |
| C  | 制造业              | 728,342.00 | 3.43         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,476.00  | 0.17         |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | -          | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -            |



|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 166,574.00   | 0.79 |
| J | 金融业             | 25,200.00    | 0.12 |
| K | 房地产业            | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -            | -    |
| P | 教育              | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | 61,840.00    | 0.29 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 80,055.00    | 0.38 |
| S | 综合              | -            | -    |
|   | 合计              | 1,101,988.60 | 5.20 |

#### 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 678,342.66    | 3.20         |
| B  | 采矿业              | 63,748.16     | 0.30         |
| C  | 制造业              | 11,458,066.57 | 54.02        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 157,083.98    | 0.74         |
| E  | 建筑业              | 108,528.58    | 0.51         |
| F  | 批发和零售业           | 437,280.39    | 2.06         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 184,250.98    | 0.87         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,567,159.37  | 7.39         |
| J  | 金融业              | 1,499,538.19  | 7.07         |
| K  | 房地产业             | 1,379,719.17  | 6.51         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 184,406.54    | 0.87         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 48,728.00     | 0.23  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 87,248.29     | 0.41  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 228,291.68    | 1.08  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 330,344.02    | 1.56  |
| S | 综合            | 41,705.40     | 0.20  |
|   | 合计            | 18,454,441.98 | 87.01 |

### 5.2.3 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

#### 5.2.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1  | 000333 | 美的集团 | 22,165  | 870,862.85 | 4.11         |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 22,942  | 866,289.92 | 4.08         |
| 3  | 000002 | 万科A  | 21,295  | 534,717.45 | 2.52         |
| 4  | 300498 | 温氏股份 | 17,863  | 497,841.81 | 2.35         |
| 5  | 002415 | 海康威视 | 17,185  | 486,851.05 | 2.30         |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 8,752   | 436,374.72 | 2.06         |
| 7  | 000001 | 平安银行 | 39,268  | 396,606.80 | 1.87         |
| 8  | 000725 | 京东方A | 120,838 | 322,637.46 | 1.52         |
| 9  | 002304 | 洋河股份 | 2,741   | 252,692.79 | 1.19         |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 18,378  | 229,908.78 | 1.08         |

#### 5.2.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 7,600  | 106,792.00 | 0.50         |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 70,100 | 82,656.00  | 0.39         |
| 3  | 000860 | 顺鑫农业 | 54,600 | 65,018.00  | 0.31         |
| 4  | 300347 | 泰格医药 | 30,000 | 61,840.00  | 0.29         |
| 5  | 002180 | 纳思达  | 12,200 | 50,300.00  | 0.24         |

#### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 22,042.28 | 0.10         |
| 8  | 其他        | -         | -            |
| 9  | 合计        | 22,042.28 | 0.10         |

#### 5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 128045 | 机电转债 | 142   | 15,852.88 | 0.07         |
| 2  | 128048 | 张行转债 | 43    | 4,418.68  | 0.02         |
| 3  | 128047 | 光电转债 | 16    | 1,770.72  | 0.01         |

#### 5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.2.7 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。

#### 5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.2.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.2.10.2 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持有国债期货。

### 5.2.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 5.2.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 28,806.18 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息  | 960.38     |
| 5 | 应收申购款 | 4,186.62   |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | 664,859.35 |
| 9 | 合计    | 698,812.53 |

#### 5.2.11.4 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。

#### 5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

|               |               |
|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 3,391,222.12  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 11,159,044.01 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -7,024,205.75 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 16,293,393.03 |

### 6.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

单位：份

|              |               |
|--------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 34,834,086.06 |
| 报告期基金总申购份额   | 292,896.89    |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 4,041,562.28  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -             |
| 本报告期期末基金份额总额 | 31,085,420.67 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

#### 7.1.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

无。

#### 7.1.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

#### 8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

### 8.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

#### 8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |              |      |              | 报告期末持有基金情况 |       |
|---|----------------|------------------------|--------------|------|--------------|------------|-------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额         | 申购份额 | 赎回份额         | 持有份额       | 份额占比  |
| 个人  | -              | 20190101-20190110      | 7,011,220.20 | 0.00 | 7,011,220.20 | 0.00       | 0.00% |
| 产品特有风险  |                |                        |              |      |              |            |       |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |              |      |              |            |       |

### 8.3 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 2、《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》

---

### 3、《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

#### 9.2存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.huaan.com.cn>。

#### 9.3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  
二〇一九年四月二十日