

华安沪深300量化增强证券投资委员会2019年第一季度报告

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：2019-04-20

重要提示

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金基本情况

Table with 3 columns: 项目 (Item), 华安沪深300增强 (Huaan HS300 Enhanced), 数量 (Quantity). Rows include 基金简称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 前期末基金净值总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属基金的基金简称, 下属基金的基金代码, 下属基金的交易席位简称, 基金管理人直销基金的交易席位简称, 基金管理人网上交易基金的交易席位简称.

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 主题金(元) (Theme Gold in Yuan), 华安沪深300增强(A) 2019-01-01 - 2019-03-31, 华安沪深300增强(B) 2019-01-01 - 2019-03-31, 华安沪深300增强(C) 2019-01-01 - 2019-03-31. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(申购费、赎回费、基金赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

基金净值表现

Table with 5 columns: 阶段 (Period), 净值增长率④ (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差⑤ (Net Value Growth Rate Standard Deviation), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return Rate), 业绩比较基准收益率标准差⑥ (Benchmark Return Rate Standard Deviation), ①-③ (Difference 1-3), ④-⑥ (Difference 4-6). Rows include 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, 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对比表, 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对比表.



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期(2019-01-01至2019-03-31) (Reporting Period), 报告期末(2019-03-31) (Reporting End). Rows include 基金份额持有人户数, 基金份额持有人户数较期初变化.

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 6 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 在任本基金的基金经理期间 (Tenure as Manager), 离职日期 (Resignation Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks). Rows include 冯之卓, 冯之卓, 冯之卓, 冯之卓.

注：离任的基金经理解聘期间由公司董事会决定之日起，即以公告为准，证券基金合同遵照中国证监会相关规定及《证券投资基金法》的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等相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财产，在严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规及违背基金合同和招募说明书的情形。

公平交易专项说明

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》，对封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等各层面全面公平交易管理，并制定了一系列风险控制措施，确保各投资组合在授权范围内自主决策，通过投资授权、集中交易、统一执行、集中清算、集中核算、集中风控等手段，确保各投资组合在授权范围内自主决策，通过投资授权、集中交易、统一执行、集中清算、集中核算、集中风控等手段，确保各投资组合在授权范围内自主决策，通过投资授权、集中交易、统一执行、集中清算、集中核算、集中风控等手段，确保各投资组合在授权范围内自主决策。

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运营、交易等部门开展了公募基金、专户针对股票、债券、衍生品等金融品种的交易所申报的同日反向交易专项核查，并定期对合同内同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除基金管理人认为符合法律法规及基金合同约定的交易外，未发现异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金管理人通过多因子策略力求稳定超额收益。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，制造业景气度持续低迷，市场整体情绪偏弱，基金仓位整体偏低，有利于风险偏好修复。一季度市场材料价格持续回落，中下游需求疲软，对全球大宗商品的价格传导较为明显，短期大宗商品价格承压，国内主要指数整体承压，海外资金流动性紧张，我们继续看好市场短期在政策支持下企稳回升，并逐步实现反弹，控制仓位保持流动性，力争稳健的超额收益。

报告期内基金的投资组合报告

截至2019年03月31日，本基金投资组合资产净值为1,553.1元，本报告期净值增长率为25.41%，同期业绩比较基准增长率为27.19%，本基金本报告期净值为4,498.9元，本报告期净值增长率为25.49%，同期业绩比较基准增长率为27.19%。

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，我们预计短期政策效果不会显著，海外贸易摩擦压力减轻，预计宏观经济持续承压在短期难以扭转，资本市场整体偏低，有利于风险偏好修复。一季度市场材料价格持续回落，中下游需求疲软，对全球大宗商品的价格传导较为明显，短期大宗商品价格承压，国内主要指数整体承压，海外资金流动性紧张，我们继续看好市场短期在政策支持下企稳回升，并逐步实现反弹，控制仓位保持流动性，力争稳健的超额收益。

报告期内基金持有人或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金份额持有人数低于20人或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets). Rows include 权益类投资, 其中：股票, 固定收益类投资, 其中：债券, 货币市场投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其中：买入返售金融资产, 银行存款, 其他资产, 合计.

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 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 信息技术业, J 金融业, 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 农林牧渔, P 教育, Q 卫生和社会工作, R 文化、体育和娱乐业, S 综合, 合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1 603338 中国宝安, 2 601166 兴泰银行, 3 600519 贵州茅台, 4 600651 格力电器, 5 601229 上海银行, 6 600036 招商银行, 7 600776 中国交建, 8 601198 东兴证券, 9 600063 中远海运, 10 602415 海康威视.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 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), 8 其他债券, 9 其他, 10 合计.

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

Table with 5 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1 018005 国开1701, 2 113020 鹏盛转债, 3 130051 中兴转债.

报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号 (No.), 资产名称 (Asset Name), 数量(元) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include 1 资产支持证券, 2 资产支持证券, 3 资产支持证券, 4 资产支持证券, 5 资产支持证券.

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Rows include 公允价值变动总计(元), 国债期货投资本期收益(元), 国债期货投资本期公允价值变动(元).

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Rows include 公允价值变动总计(元), 国债期货投资本期收益(元), 国债期货投资本期公允价值变动(元).

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
报告期内，本基金投资的前十名股票没有受到监管部门立案调查的，也没有在报告期内编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1 存出保证金, 2 应收利息, 3 应收股利, 4 应收款项, 5 其他应收款, 6 其他流动资产, 7 待摊费用, 8 预付款项, 9 其他, 合计.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 项目 (Item), 华安沪深300增强 (Huaan HS300 Enhanced), 华安沪深300增强A (Huaan HS300 Enhanced A), 华安沪深300增强B (Huaan HS300 Enhanced B). Rows include 报告期期初基金份额总额, 报告期期末基金份额总额, 期间申购份额及总额, 期间赎回份额及总额, 期间净申购份额.

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 4 columns: 项目 (Item), 华安沪深300增强 (Huaan HS300 Enhanced), 华安沪深300增强A (Huaan HS300 Enhanced A), 华安沪深300增强B (Huaan HS300 Enhanced B). Rows include 报告期初基金管理人持有的基金份额, 报告期内基金管理人申购份额, 报告期内基金管理人赎回份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额占基金总份额比例.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(份) (Transaction Amount in Shares), 交易金额(元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate). Rows include 合计.

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

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额(股) (Holding Shares), 持有份额占基金总份额比例(%) (Percentage of Total Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 公允价值占基金总份额比例(%) (Percentage of Total Fair Value), 发起资金承诺持有份额. Rows include 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.

报告期内前十大股票持有基金份额比例合计超过20%的情况

Table with 7 columns: 投资类型 (Investment Type), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的股票名称 (Stock Name), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 期末占比 (End Ratio). Rows include 机构, 个人.

影响投资决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 《华安沪深300量化增强证券投资委员会2019年第一季度报告》
2. 《华安沪深300量化增强证券投资委员会招募说明书》
3. 《华安沪深300量化增强证券投资委员会托管协议》

存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所，并置于基金管理人互联网地址http://www.huamf.com.cn。

查阅方式

投资者若欲咨询基金管理人互联网网站，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。