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。 基金托管人兴业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。

阶段

阶段

过去三个月

118.20%

105.06%

91.93%

78.80%

65.66%

52,53%

39.40%

26.27%

13.13%

0.00%

姓名

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

序号

1

权益类投资

其中: 股票

买入返售金融资产

科学研究和技术服务业

教育

综合

合计

综合

合计

601318

601166

600519

000651

合计

018005

113020

110051

公允价值变动总额合计(元)

股指期货投资本期收益(元)

股指期货投资本期公允价值变动(元)

代码

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

其他应收款

待摊费用

其他

合计

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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。

公允价值变动总额合计(元)

国债期货投资本期收益(元)

6

9

报告期期间基金总申购份额

报告期期末基金份额总额

减:报告期期间基金总赎回份额

报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)

项目

基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

基金管理人高级管理人员

基金经理等人员

基金管理人股东

其他

国债期货投资本期公允价值变动(元)

债券代码

10

序号

序号

股票代码

卫生和社会工作

文化、体育和娱乐业

P

S

水利、环境和公共设施管理业

居民服务、修理和其他服务业

其他资产

合计

银行存款和结算备付金合计

其中: 买断式回购的买入返售金融资产

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

项目

净值增长率①

净值增长率①

自基金合同生效以来基金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C

其他指标

其他指标

职务

25.61 %

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A

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C

净值增长率标准差②

净值增长率标准差②

1.47 %

目录全部展开 目录全部收拢 《

-重要提示

表现

→基金产品概况

基金基本情况

-主要财务指标

中基金净值表现

└其他指标

中管理人报告

中主要财务指标和基金净值

┗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

--自基金合同生效以

来基金累计净值增 长率变动及其与同

期业绩比较基准收 益率变动的比较

-基金经理(或基金经

一管理人对报告期内本 基金运作遵规守信情

-公平交易专项说明

行情况

项说明

绩表现

的简要展望

说明

中投资组合报告

中报告期内基金的投资

策略和业绩表现说明

一报告期内基金的投 资策略和运作分析

└报告期内基金的业

一管理人对宏观经济、 证券市场及行业走势

─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

一公平交易制度的执

一异常交易行为的专

理小组)简介

况的说明

基金基本情况 项目 数值 基金简称 华安沪深300增强 场内简称 基金主代码 000312 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2013-09-27 报告期末基金份额总额 303, 471, 159, 52 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 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。 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 下属2级基金的基金简称 华安沪深300增强C 华安沪深300增强A 下属2级基金的场内简称 下属2级基金的交易代码 000312 000313 报告期末下属2级基金的份额总额 108, 525, 764. 62 194, 945, 394. 90

主要财务指标		主基金(元)	华安沪深300增强A(元)	华安沪深300增强C(元) 2019-01-01 - 2019-03-31		
			2019-01-01 - 2019-03-31			
本期已实现收益			20, 019, 152. 10		10, 070, 645.	
本期利润			59, 385, 970. 73	3	38, 930, 432.	
n权平均基金份额本期利润			0. 3222		0. 29	
期末基金资产净值			302, 760, 226. 19	16	62, 571, 567.	
期末基金份额净值			1. 5531		1. 498	

加权平均基金份额本期利润		0. 3222	0
期末基金资产净值		302, 760, 226. 19	162, 571, 567. 39
期末基金份额净值		1. 5531	1. 4980
		E的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基本他收入(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	
		基金净值表现	
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比	公较基准收益率的比较		

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率③

27. 19 %

业绩比较基准收益率标准差④

业绩比较基准收益率标准差④

1.48 %

1-3

1-3

-1.58 %

2-4

2-4

-0.01 %

单位:人民币元

报告期(2019-01-01至2019-03-31)

报告期(2019-03-31)

说明

占基金总资产的比例(%)

90.78

90.78

5.41

0.37

100.00

业绩比较基准收益率③ 1-3 2-4 阶段 业绩比较基准收益率标准差④ 净值增长率① 净值增长率标准差② 过去三个月 25. 49 % 1.47 % 27. 19 % 1.48 % -1.70%-0.01 % 自基金合同生效以来基金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

自基金合同生效以来基金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A 117.93%

104.82% 91.72% 78.62% 65.52% 52.41% 39.31% 26.21% 13.10% -0.00% - 🙌 -13.10% 2015-07-30 2018-04-30 2017-05-30 2013-09-27 2014-08-29 2016-06-29 2019-03-31 ·华安沪深300增强A — 业绩基准

-13.13% 2015-07-30 2016-06-29 2018-04-30 2013-09-27 2014-08-29 2017-05-30 2019-03-31 华安沪深300增强C — 业绩基准

其他指标

基金经理(或基金经理小组)简介

证券从业年限

任本基金的基金经理期限

离任日期

任职日期

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,同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 本基金的基金经理、指数与量化投资部高级总 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 许之彦 2017-12-25 15年 监、总经理助理 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50指数分级证券 投资基金的基金经理。2016年6月起担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金基金的 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、本基金的基 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。 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。2010年应届毕业进入华安基 金,先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015年3月至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。2019年1月起,同时担任华安量化多因 子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2015年3月至2015年12月,同时担任华安中证高分 本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总 孙晨进 2017-12-25 红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安事件驱动量化策略混合 型证券投资基金的基金经理。2017年1月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基 金、华安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。 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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。

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

公平交易专项说明

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

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。

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。 报告期内基金的投资策略和运作分析 |基金管理人通过多因子策略力争稳定超额收益。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。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。我们根据多因子策略,在严格控制风险的基础上力争超额收益,积极布局了春季行情,对科技新兴产业加大关注,看好复苏期的反转机会。 报告期内基金的业绩表现

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,将缓慢改善产业链结构。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,并将严格控制风险,挖掘新兴行业成长机会,力争稳健

投资组合报告

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

的风险可控的收益。 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至2019年03月31日,本基金A类份额净值为1.5531元,本报告期份额净值增长率为25.61%,同期业绩比较基准增长率为27.19%。本基金C类份额净值为1.4980元,本报告期份额净值增长率为25.49%,同期业绩比较基准增长率为27.19%。

报告期末基金资产组合情况 金额(元) 433, 453, 868. 24

433, 453, 868. 24

25, 835, 351. 50

1, 789, 670. 82

477, 465, 782. 16

2 固定收益投资 16, 386, 891. 60 3. 43 其中:债券 16, 386, 891. 60 3.43 资产支持证券 3 贵金属投资 金融衍生品投资

报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 序号 农、林、牧、渔业 A 采矿业 C 制造业 电力、热力、燃气及水生产和供应业 D 建筑业 批发和零售业 G 交通运输、仓储和邮政业 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技术服务业 J 金融业 房地产业 租赁和商务服务业

报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合 公允价值(元) 行业类别 占基金资产净值比例(%) 代码 农、林、牧、渔业 采矿业 制造业 C 电力、热力、燃气及水生产和供应业 建筑业 批发和零售业 交通运输、仓储和邮政业 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技术服务业 金融业 房地产业 租赁和商务服务业 科学研究和技术服务业 N 水利、环境和公共设施管理业 0 居民服务、修理和其他服务业 教育 卫生和社会工作 文化、体育和娱乐业

601229 上海银行 834, 600 9, 998, 508. 00 2. 15 招商银行 267, 933 9, 088, 287. 36 1.95 600036 恒瑞医药 120, 761 7, 900, 184. 62 1.70 600276 7, 561, 309. 80 东兴证券 547, 921 1.62 601198 中兴通讯 000063 245, 691 7, 174, 177. 20 1.54 6, 753, 289. 62 1.45 002415 海康威视 192, 566 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(%) 国家债券 2 央行票据 3 金融债券 15, 352, 535. 10 3.30 其中: 政策性金融债 3.30 15, 352, 535. 10 企业债券 4 企业短期融资券 5 6 中期票据 7 可转债(可交换债) 1, 034, 356. 50 0. 22 8 同业存单 其他 9

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

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

数量(张)

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

股票名称

债券名称

国开1701

桐昆转债

中天转债

名称

中国平安

兴业银行

贵州茅台

格力电器

数量(股)

424, 360

808, 875

16, 957

252, 439

16, 386, 891. 60

153, 510

7, 320

1, 230

公允价值(元)

公允价值变动(元)

74, 180, 722. 07

20, 540, 401. 08

194, 945, 394. 90

华安沪深300增强A

15, 352, 535. 10

898, 822. 80

135, 533. 70

公允价值(元)

32, 718, 156. 00

14, 697, 258. 75

14, 481, 108. 43

11, 917, 645. 19

占基金资产净值比例(%)

占基金资产净值比例(%)

风险指标说明

单位:人民币元

446, 853. 22

582, 042. 64

760, 774. 96

1, 789, 670. 82

76, 338, 149. 53

154, 063, 524. 95

108, 525, 764. 62

单位: 份

华安沪深300增强C

7.03

3. 16

3. 11

2.56

3. 52

3. 30

0. 19

0.03

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 序号 贵金属代码 贵金属名称 公允价值(元) 数量(份) 占基金资产净值比例(%) 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名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 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 名称 代码 持仓量(买/卖) 公允价值变动(元) 合约市值(元) 风险说明

本基金投资股指期货的投资政策 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 本期国债期货投资政策 无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

合约市值(元)

持仓量(买/卖)

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

注: 本基金本报告期末未持有国债期货。 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 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。

其他资产构成 名称 金额(元) 序号 存出保证金 应收证券清算款 应收股利 应收利息 5 应收申购款

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 单位: 份 项目 华安沪深300增强 华安沪深300增强A 华安沪深300增强C 报告期期初基金份额总额 141, 305, 073. 91 186, 251, 140. 04

303, 471, 159. 52

华安沪深300增强

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期期末管理人持	持有的本基金份额							
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)			_	-	_	_		
基金管理人运用	目固有资金投资本基金交易明细							
序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)		交易金额 (元)	适用费率		
合计								
			注: 无	己。				
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况								
	- 	上+ → // 於正 ½ 址.	叶	11). + 11/1 AFE 34, 344.	# Hand See Fig. 47 Week Fig. 42	ルン・トゥ ハン ヴェ マントトナーナー Hill 17日		
	项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限		
基金管理人固有资金	金		-%		-%			

报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有基金情况 投资者类别 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 产品特有风险 影响投资者决策的其他重要信息

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

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》

存放地点

查阅方式

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。 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。

下属2级基金的风险收益特征

主要财务指标