

华安沪深300量化增强证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十二日

§ 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。

本基金经中国证监会于2010年6月10日根据《基金合同》批准设立。根据《基金合同》，本基金首次募集规模为人民币30亿元，其中认购费率为0%，申购费率为0.5%，赎回费率为0.5%；本基金的管理费率为0.5%，托管费率为0.1%，销售服务费率为0.2%，基金运作期间不收取其他费用。

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。投资者投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值每万份资产净值在份额净值公告日每万份资产净值之差额。

报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安沪深300 增强
基金代码	000312
基金运作方式	契约型开放式
基金的合同生效日	2013年 9月 27日
报告期末基金份额总额	179,682,091.94份
投资目标	本基金为增强型指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越标的指数的收益。
投资策略	本基金主要通过指数化投资，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、风格选择、个股选择等进行主动调整，力争在控制风险的前提下获取超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为-0.99%*沪深300指数收益率+5%*同期业绩比较基准活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金，低于股票基金。
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
下属基金份额的基金简称	华安沪深300 增强 A
下属基金份额的基金代码	000312
报告期末基金份额的总额	144,886,393.00份
报告期末基金份额的单位净值	164,795,698.04份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
华安沪深300 增强 A	华安沪深300 增强 C
1.本期已实现收益	-554,379.74
2.本期利润	-1,191,269.81
3.加权平均基金份额本期利润	-1,195,511.22
4.期末可供分配基金份额净值	-0.0765
5.期末基金资产净值	13,380,127.32
6.期末基金份额净值	147,621,670.04
7.期末可供分配基金份额净值	0.899
8.期末基金资产净值	0.896

3.2 基金净值表现				
阶段	净值增长率(①) 净增长比例(②) 收益率(%)	业绩比较基准收益率(%) ③	业绩比较基准收益 率(%)	④
过去三个月	-7.51% -1.5%	-7.49% 1.13%	-0.02% 0.02%	①-③ ②-④

3.2.1 基金净值表现				
阶段	净值增长率(①) 净增长比例(②) 收益率(%)	业绩比较基准收益率(%) ③	业绩比较基准收益 率(%)	④
过去三个月	-7.51% -1.5%	-7.49% 1.13%	-0.02% 0.02%	①-③ ②-④

3.2.2 基金净值表现				
阶段	净值增长率(①) 净增长比例(②) 收益率(%)	业绩比较基准收益率(%) ③	业绩比较基准收益 率(%)	④
过去三个月	-7.51% -1.5%	-7.49% 1.13%	-0.02% 0.02%	①-③ ②-④

