华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安国企改革主题灵活配置混合
基金主代码	001445
交易代码	001445
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	1,351,461,471.42份
投资目标	本基金重点关注国企改革带来的市场投资机会,在严格控制风险的前提下,通过高安全边际的证券精选,力争为投资者带来资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的的资产配置策略。 在大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。 股票投资方面,本基金通过对国企改革相关上市公司的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-39,205,622.97
2.本期利润	-166,458,197.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1055
4.期末基金资产净值	1,171,403,370.10
5.期末基金份额净值	0.867

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(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。

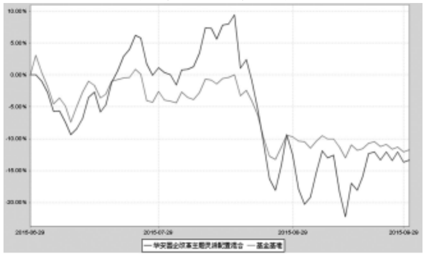
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-13.30%	3.10%	-13.96%	1.71%	0.66%	1.39%

3.2.2 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

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
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
(2015年6月29日至2015年9月30日)



注:本基金于2015年6月29日成立,2015年12月28日建仓期截止。

§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		
杨明	本基金的基金经理、投资研究部高级总监	2015-6-29	-	15年	中央财经大学硕士研究生,15年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004年10月加入华安基金管理有限公司,任研究发展部研究员。现任投资研究部总监。2013年6月起担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任投资研究部高级总监。2015年6月起同时担任本基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部助理总监	2015-6-29	-	11年	博士研究生,11年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任本基金的基金经理。
王嘉	本基金的基金经理	2015-7-17	-	13年	硕士,13年金融、证券行业从业经验。曾任上海市思也企业咨询有限公司研究员、上海市新理益投资管理有限公司研究员、莫尼塔投资咨询有限公司研究员、元大京华证券上海代表处研究员、兴业证券研究发展中心研究员。2010年5月加入华安基金,现任基金投资部基金经理。2015年7月起担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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。

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

2015年3季度,股市经历了两次较大幅度的调整。7月初延续了6月中旬以来的主动和被动去杠杆的剧烈冲击。此后8月中旬,人民币贬值又引发对中期币值趋势以及对中国经济前景的担忧。本基金在第一次去杠杆危机中应对相对得当,但在8月中下旬的调整中仓位偏高,且品种弹性较大,导致回撤幅度较大,3季度仅小幅跑赢基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年9月30日,本基金份额净值为0.867元,本报告期份额净值增长率为-13.30%,同期业绩比较基准增长率为-13.96%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对经济判断:从全球宏观环境看,包括中国在内的新兴市场币值开始企稳,美联储加息时点的预期不断延后,4季度全球宏观风险在降低,全球货币面临持续宽松的环境。就中国经济自身而言,3季度降息、降准,出台了针对基建投资、汽车和地产消费的刺激政策,国企改革的顶层设计方案出炉,政府稳增长的态度明显,措施也相对积极,预计3-4季度GDP会在7%附近,不会明显下台阶。

股市展望:经历3季度下跌后,市场去杠杆已较为充分,对经济基本面的预期也已经下修,系统性风险已经得到很大程度释放,四季度宏观经济超预期下滑的概率不大,股市的下行风险较小。从积极因素看,稳增长组合拳开始在部分领域初步得到体现,十三五规划可能对部分行业形成较为正面的刺激,主题版块将会较为活跃。

操作思路:维持中性偏高的仓位,相对看好核电、环保、消费升级和产业升级受益行业,并积极关注和选择选择部分优质国企改革标的。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	911,512,610.89	75.50
	其中:股票	911,512,610.89	75.50
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	294,227,554.36	24.37
7	其他资产	1,514,401.03	0.13
8	合计	1,207,254,566.28	100.00

5.2 报告期末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	12,490,000.00	1.07
C	制造业	513,094,952.35	43.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,725,500.00	2.96
E	建筑业	22,499,371.57	1.92
F	批发和零售业	22,659,320.20	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	43,869,244.02	3.75
H	住宿和餐饮业	28,050,000.00	2.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	33,055,000.00	2.82
L	租赁和商务服务业	30,845,200.00	2.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	122,046,426.67	10.42
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	16,300,000.00	1.39
S	综合	31,877,596.08	2.72
	合计	911,512,610.89	77.81

5.3 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	300285	国瓷材料	3,000,000	93,000,000.00	7.94
2	300070	碧水源	1,675,588	73,206,439.72	6.25
3	002366	丹甫股份	1,079,642	54,910,592.12	4.69
4	002152	广电运通	1,776,560	46,368,216.00	3.96
5	300156	神雾环保	1,287,701	40,626,966.55	3.47
6	600270	外运发展	1,899,976	37,562,525.52	3.21
7	002215	诺 普 信	3,000,000	36,180,000.00	3.09
8	600048	保利地产	4,000,000	31,960,000.00	2.73
9	600895	张江高科	1,676,004	31,877,596.08	2.72
10	601888	中国国旅	590,000	30,845,200.00	2.63

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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的,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,283,634.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,428.39
5	应收申购款	186,338.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,514,401.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	73,206,439.72	6.25	筹划重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	1,799,465,454.32
报告期期初基金份额总额	1,799,465,454.32
报告期期间基金总申购份额	184,406,662.70
减:报告期期间基金总赎回份额	632,410,645.60
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,351,461,471.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
2、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
3、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

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。

8.3 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
二〇一五年十月二十七日

华安创业板50指数分级证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月6日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安创业板50指数分级		
场内简称	创业50		
基金主代码	160420		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015年7月6日		
报告期末基金份额总额	144,428,220.44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。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差,追求尽可能贴近标的指数的表现,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4% 为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×创业板50指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)。		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华安创业板50指数分级A	华安创业板50指数分级B	华安创业板50指数分级
下属分级基金场内简称	创业50A	创业50B	创业50
下属分级基金的交易代码	150303	150304	160420
报告期末下属分级基金的份额总额	53,058,002份	53,058,003份	38,312,215.44份

§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(2015年7月6日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-15,209,520.51
2.本期利润	-16,925,137.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1695
4.期末基金资产净值	95,586,183.61
5.期末基金份额净值	0.6618

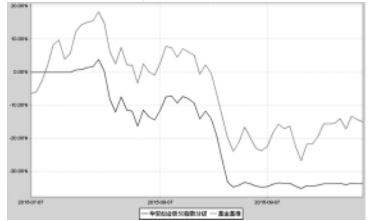
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-33.82%	2.90%	-15.05%	4.10%	-18.77%	-1.20%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

华安创业板50指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年7月6日至2015年9月30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,指数与量化投资事业总部高级总监	2015-7-6	-	12年	理学博士,12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月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)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月起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月起担任本基金的基金经理。
钱晶	本基金的基金经理	2015-7-6	-	4年	硕士,4年证券、基金行业从业经验,曾任国信证券分析师。2014年12月加入华安基金,任指数投资部量化分析师。2015年5月起担任华安沪深300指数分级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月起担任本基金的基金经理。2015年8月起担任华安中证细分医药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。

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。

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

报告期内,在股灾的背景下,市场出现全面下跌,上证综指下跌28.63%,创业板指下跌27.14%,创业板50指数下跌26.32%,表现略好于上证综指和创业板指。

操作上,基金运作主要着眼于控制每日跟踪误差和净值表现和业绩基准的偏差幅度。在实际操作过程中,在股灾二次探底期间,基金一度接近触发下折阀值,由于下折可能带来的风险,因此在仓位上做了一定的灵活调整,也导致了在市场反弹期间,净值表现跑输了跟踪指数。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年9月30日,本基金份额净值为0.6618元,本报告期份额净值增长率为-33.82%,同期业绩比较基准增长率为-15.05%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,市场经历"股灾",本次股灾的原因是多方面的,导火线是融资盘的清理,从场外配资盘开始,并一度影响到场内约2万亿的两融余额。尽管7月初政府出手,缓解了融资盘清理引发的流动性危机,但是投资者情绪已然发生了重大变化。政府救市后,上证综指在3700至4000一带盘整后,在8月中旬再度大幅下跌,并一度跌破2900点。

展望未来,我们认为股灾前后,市场面临的宏观环境并没有发生太大变化,基本面依旧疲弱,流动性方面,货币进一步宽松,7天回购利率中枢有所下行,我们预计宽裕的流动性有助于无风险利率保持在低位。但是,当前市场主要的症结还是在于投资者风险偏好的下降,并且,情绪修复的进程可能需要比较长的时间。

创业板50指数的成分股是最大的50家代表中国未来经济发展方向的创业板龙头企业,如果市场出现情绪上的好转,我们认为会有相当的超额收益。

作为基金管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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 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	12,852,091.62	13.39
	其中:股票	12,852,091.62	13.39
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	83,058,282.03	86.53
7	其他资产	81,772.92	0.09
8	合计	95,992,146.57	100.00

5.2 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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,905,310.03	4.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	200,376.00	0.21
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	3,540,809.21	3.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	961,906.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	388,841.00	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	277,160.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	3,577,689.38	3.74
S	综合	-	-
	合计	12,852,091.62	13.45

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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	300027	华谊兄弟	86,800	2,746,352.00	2.87
2	300058	蓝色光标	88,100	940,027.00	0.98
3	300059	东方财富	18,564	667,932.72	0.70
4	300216	千山药机	16,600	550,124.00	0.58
5	300024	机器人	8,900	504,630.00	0.53
6	300070	碧水源	8,900	388,841.00	0.41
7	300168	万达信息	12,500	380,625.00	0.40
8	300104	乐视网	8,000	327,040.00	0.34
9	300251	光线传媒	11,300	310,637.00	0.32
10	300017	网宿科技	5,315	280,153.65	0.29

5.3.2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

本基金本报告期末未持有积极股票投资

5.4 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

5.5 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

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,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。

5.11.2 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

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	34,740.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,388.48
5	应收申购款	101.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	31,542.62
8	其他	-
9	合计	81,772.92

5.11.4 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债券投资

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	388,841.00	0.41	重大事项停牌
2	300168	万达信息	380,625.00	0.40	重大事项停牌
3	300216	千山药机	550,124.00	0.58	重大事项停牌
4	300027	华谊兄弟	2,746,352.00	2.87	重大事项停牌
5	300058	蓝色光标	940,027.00	0.98	重大事项停牌

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安创业板50指数分级A	华安创业板50指数分级B	华安创业板50指数分级
基金合同生效日(2015年7月6日)基金份额总额	-	-	228,797,653.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	144,067,595.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	228,437,029.02
报告期期间基金拆分变动份额	53,058,002.00	53,058,003.00	-106,116,005.00
报告期期末基金份额总额	53,058,002.00	53,058,003.00	38,312,215.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《华安创业板50指数分级证券投资基金基金合同》
2、《华安创业板50指数分级证券投资基金招募说明书》
3、《华安创业板50指数分级证券投资基金托管协议》

9.2 存放地点

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。

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
二〇一五年十月二十七日

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安中国A股增强指数
基金主代码	040002
前端交易代码	040002
后端交易代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月8日
报告期末基金份额总额	3,462,192,073.44份
投资目标	运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。
投资策略	(1)资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。 (2)股票投资:本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。 (3)其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。
业绩比较基准	95% ×MSCI中国A股指数收益率 + 5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,763,651.00
2.本期利润	-904,922,664.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2424
4.期末基金资产净值	2,302,363,644.95
5.期末基金份额净值	0.665

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(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。

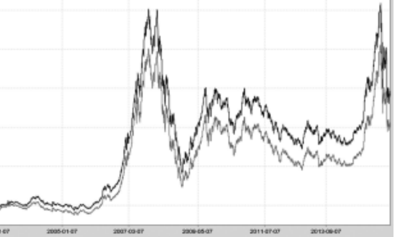
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-26.52%	3.75%	-27.83%	3.23%	1.31%	0.52%

3.2.2 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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
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
(2002年11月8日至2015年9月30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		
牛勇	本基金的基金经理	2010-9-2	-	11年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),11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月担任本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月起同时担任本基金的基金经理。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月起担任华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。

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。

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

三季度经济运行平稳,GDP同比增速与二季度持平,月度工业增加值、PMI呈现企稳迹象;货币政策继续维持宽松,央行相继年内第四次降息、第三次降准,中长期国债利率水平继续下行;外汇占款虽下降但国际贸易继续顺差,汇率平稳具有基础,汇率波动对市场预期影响已去;经过本季度初的去杠杆后,市场趋于稳定,且成长板块估值向合理位置回归。本基金整体超配成长性板块,维持对传统行业板块的低配。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为0.665元,本报告期份额净值增长率为 -26.52%,同期业绩比较基准增长率为-27.83%。截至2015年9月30日,本基金过去30个交易日日均跟踪偏离度为0.4%(按照基金合同和招募说明书规定)。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,各主要经济体大多维持量化宽松,美联储年内加息概率变小,以中国为首的新兴市场与大宗商品价格经过大幅调整后,系统性风险得到较大释放;国内资本市场融资水平已恢复至正常,估值回归至基本合理水平,成长性板块的长期配置价值开始显现。经济整体平稳下,市场将更多呈现结构性与主题性机会。作为MSCI中国A股增强型指数基金的管理人,我们将在跟踪指数的前提下,通过适度增强操作,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6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。

§5 投资组合报告

5.1 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	2,165,866,909.37	93.37
	其中:股票	2,165,866,909.37	93.37
2	固定收益投资	1,938,021.12	0.08
	其中:债券	1,938,021.12	0.08
	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	144,594,937.80	6.23
7	其他资产	7,165,355.84	0.31
8	合计	2,319,565,224.13	100.00

5.2 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	-	-
C	制造业	154,047,213.54	6.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,800,354.22	0.69
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,638,835.20	0.46
H	住宿和餐饮业	26,381,394.50	1.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,969,373.95	3.00
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	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	4,967,600.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	280,804,771.41	12.20

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	39,392,729.18	1.71
B	采矿业	55,621,489.91	2.42
C	制造业	711,372,206.21	30.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,256,018.85	3.44
E	建筑业	59,996,533.15	2.61
F	批发和零售业	69,028,567.48	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	112,121,340.22	4.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,041,024.60	3.17
J	金融业	429,046,513.41	18.64
K	房地产业	116,143,486.90	5.04
L	租赁和商务服务业	84,387,571.23	3.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,203,208.20	1.40
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	18,549,722.76	0.81
S	综合	4,901,725.86	0.21
	合计	1,885,062,137.96	81.88

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告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	601318	中国平安	2,960,138	88,389,720.68	3.84
2	601169	北京银行	5,559,877	47,870,540.97	2.08
3	601009	南京银行	2,971,477	43,116,131.27	1.87
4	601888	中国国旅	768,339	40,168,762.92	1.74
5	000858	五 粮 液	1,548,271	39,837,012.83	1.73
6	601166	兴业银行	2,413,605	35,142,088.80	1.53
7	600138	中青旅	1,614,347	32,448,374.70	1.41
8	600009	上海机场	1,065,774	29,543,255.28	1.28
9	000024	招商地产	997,158	28,409,031.42	1.23
10	600066	宇通客车	1,505,311	28,299,846.80	1.23

5.3.2 报告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	002354	天神娱乐	918,979	68,969,373.95	3.00
2	000708	大冶特钢	2,177,749	30,314,266.08	1.32
3	300118	东方日升	2,362,123	24,046,412.14	1.04
4	000049	德赛电池	566,885	21,586,980.80	0.94
5	600872	中炬高新	1,460,425	21,190,766.75	0.92

5.4 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	1,938,021.12	0.08
8	其他	-	-
9	合计	1,938,021.12	0.08

5.5 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	110031	航信转债	8,920	1,138,459.60	0.05
2	110030	格力转债	3,080	400,862.00	0.02
3	128009	歌尔转债	3,084	398,699.52	0.02

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,基金投资的前十名其他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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,859,462.47
2	应收证券清算款	3,756,327.04
3	应收股利	-
4	应收利息	29,598.92
5	应收申购款	1,519,967.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,165,355.84

5.11.4 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	110030	格力转债	400,862.00	0.02
2	128009	歌尔转债	398,699.52	0.02

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000858	五 粮 液	39,837,012.83	1.73	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000708	大冶特钢	30,314,266.08	1.32	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,038,210,369.90
报告期期间基金总申购份额	644,824,499.59
减:报告期期间基金总赎回份额	1,220,842,796.05
报告期期间基金拆分变动份额	0
报告期期末基金份额总额	3,462,192,073.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》
2、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》
3、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

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。

8.3 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
二〇一五年十月二十七日