# Disclosure 信息披露

# 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

#### 2016 第一季度 报告

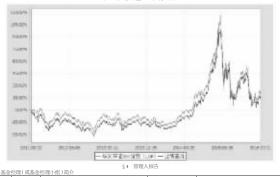
2016年3月31日

夏核内容不存在虚假记载、误导性 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。 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。
	§ 2 基金产品概况
基金简称	华安深证300指数 (LOF)
场内简称	华安8300
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	24,560,065,9819
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	本基金为被动式脱票指数基金。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
基金杆管人	中国银行股份有限公司

\$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,误导性陈注成重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带推任。

3.1 土安州为旧怀	单位:人民币元
主要财务指标	級告期 (2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-671,416.95
2.本期利润	-5,856,978.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2384
4.期末基金资产净值	30,191,999.36
5.期末基金份额净值	1.229
转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所列数字。	的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申晓赎回费。红利再投资费、基 收及(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

<ol> <li>2.本期已实现收益指:</li> <li>1上本期公允价值变动收</li> <li>3.2 基金净值表现</li> <li>3.2.1本报告期基金份</li> </ol>	益。			动收益)扣除相关费	用后的余额。本期利	润为本期已实现收
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	0-3	2-4
过去三个月	-16.39%	3.05%	-16.22%	2.82%	-0.17%	0.23%
3.2.2自基金合同生效	以来基金累计净值	华安深证: 累计净值增长率与	同期业绩比较基准的 900指数证券投资基金 业绩比较基准收益。 9月2日至2016年3月	企(LOF) 率历史走势对比图		



\$1.2	10.4	任本基金的基金	2位理期限	证券从业年期	设即
READ	47.95	任职日期	高任日期	RESPONSE THE	15091
孙晨进	本基金的基金 经理	2015-03-20	-	5	硕士研究生、5年基金行业从业经验,具有基金资格证书。2010年识届毕业进入华安基金、先尼斯技技资部数量分析师、投资经理、基金经理 2015年3月起担任本基金及华安中证高分允批 强型证券投资基金的基金经理。
许之商	本基金的基金 经理,指数均 量化投资事业 总部高级总监	2011-09-02	-	12	理時等上12年底多。在於人在於此《內側下 如此上個別。如下少年的中山上十分的下 如此上個別。如此上個別。 完成。如此上個別。如此上個別 以此一個別。如此上個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以此一個別 以上一一個別 以上一一個別 以上一一一個別 以上一一個別 以上一個別 以上一個別 以上一一個別 以一一個 以一一個 以一一個 以一一個 以一一個 以一一個 以一一個 以一一一一一一一 以一一一一 以一一一 以一一 以

代天物問題中日上35年 (內值 复新年生物研究。 4.4.2 民前 新述 25.4 大龙 26.6 保育 22.9 元本任告期份额净值增长率为 -16.39%,同期业绩比较基本增长率为-16.22%。 4.4.2 民前 15.4 太龙 26.6 保育 22.9 元本任告期份额净值增长率为 -16.39%,同期业绩比较基本增长率为-16.22%。 4.5 现在 4.5 元本 25.4 元本 25.4

云。 300指数基金的管理人,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 46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。

序号	項目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	29,025,831.03	94.6
	其中:股票	29,025,831.03	94.6
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	买人返售金融资产	-	
	其中: 买新式回购的买人返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	1,619,246.96	5.2
7	其他各项资产	8,623.19	0.0
8	合计	30,653,701.18	100.00

代码	行业类别	公允价值 (元 )	占基金资产净值比例 66)
A	农,林、牧,渔业	_	
В	采矿业	_	
C	制造业	1,693,838.03	5.6
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	-	
Н	住宿和餐饮业	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	
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	-	
0	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	-	
S	综合	-	
	台计	1,693,838.03	5.6
5.2.2指数报	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.村	*.牧、渔业	351,615.0	5
B ##*	Ψ.	456.630.8	8

代码		行业类别		1	公允价值(元)	占基金资产净值比例 66)
A	农、林、牧、渔业				351,615.06	1.1
В	采矿业			456,630.88	1.5	
C	制造业			14,796,340.77	49.0	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	SIŁ			484,792.23	1.6
E	建筑业				424,648.30	1.4
F	批发和零售业				738,718.34	2.4
G	交通运输、仓储和邮政业				34,305.18	0.1
Н	住宿和餐饮业				-	
I	信息传输、软件和信息技术服务。	lk			3,301,707.59	10.9
J	金融业				2,364,879.32	7.8
K	房地产业				2,330,277.75	7.3
L	租赁和商务服务业				591,613.52	1.5
M	科学研究和技术服务业		-			
N	水利、环境和公共设施管理业				1.6	
0	居民服务、修理和其他服务业		5条、餘理和其他服务业		-	
P	統領					
Q	卫生和社会工作	E和社会工作 123,584.		0.4		
R	文化、体育和娱乐业				710,520.19	2.3
S	综合				122,732.47	0.4
	合计				27,331,993.00	90.5
5.3.1其	告期末按公允价值占基金资 月末指数投资按公允价值占	基金资产净值比例大小排		十名股票投资明		
序号		股票名称	_	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A		57,388	1,079,468.28	3.5
2	000651	格力电器		30,924	594,359.28	1.9
3	000001	平安银行		44,365	472,043.60	1.5
4	000333	美的集团		14,949	461,176.65	1.5
				167,974	428,333.70	1.4
5	000725	京东方A		107,974	428,333.70	I.A

平磁速中球区可求不必寻用顺野灯灯。 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 本基金本报任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新

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 3.7 放在则本在公元的但正点面至以下呼阻比例不分率户的加五右面至属成为吗。 本基金本格尼斯未按与有股金值。 5.8报告期未按全允价值上基金营产等值上例大小排序的前五名权证股领明细 本基金本格尼斯未按持有实证股份。 5.9 报告期末本基金投资的股指期货之易情况以明 5.91 报告期末本基金投资的股指期货与各职超益明细 本基金本格尼斯及有效股份和货货。 5.92 本基金按负债及有货股份的股份 5.92 本基金按负债

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

3111年金建設資金。 3111年金建設資金。 第26年2年3月2日日本 2015年3月2日日本 2015年30月2日日本 2015年30月2日日本 2015年3月2日日本 2015年3月2日日本 2015年3月2日日本 2015年3月2日日本 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3月2日 2015年3日 20

	210页前「石取示平,个行任10页」周田高並宣 5项资产构成	· 问观· 上 哲2位权· 示牛· 之7年70权· 示。
序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	1,595.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	354.41
5	应收申购款	6,673.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	台计	8,623.19

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序码	股票代码	股票名称	流通受联部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	波通受取情况边明
PS	86991099	放卵石杯	REMISERENDS HIS 25 TO DISH (TO)	出版证据(广/中国(10万年)	SEEDELSCHICH OF DOUBLE
1	000651	格力电器	594,359.28	1.97	重大事項停納
5.11.5.2期末积	吸投资前五名股票中存	存在流通受限情况的说	明		
序号	股票代码	股票名称	流通受联部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002048	宁波华翔	52,826.40	0.18	重大事項停納
		中银纹业	1.641.011.63	5.44	重大事項停制

		单位:
本报告期期初基金份额总额		24,080,120.41
报告期基金总申购份额		2,099,169.15
减。报告期基金总赎回份额		1,619,223.58
报告期基金拆分支动份额		-
本报告期期末基金份额总额		24,560,065.98
	§ 7 基金管理人运用固有资	· F金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份額变动情况

自由森

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好

边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为1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

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

8.1 备查文件目录

6.1 亩 又 1 日 3 1、《华安深证300证券指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》 2、《华安深证300证券指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 3、《华安深证300证券指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》

THOUSE 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.hua

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

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。

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 本表以由自己生产的企产中面层态的收益。 原体各投资值全交易未被的客观性化单位之往,同时严格社内设立接受人发现含氮、投资的含氮等各及投资量之块投权规则,提及自会理 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,时间使先、比例分配、综合平衡的控制规则、实现同一时间下这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 中的工工。1000次的一个1000次的相比,1000次的企业的企业,是由于1000次的企业。1000次的工程,1000次的工程,2000次的工程,

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 

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。佛参。则即等投品品库在20年2年,20年20年,20年20

截至2016年3月31日,本基金份额争值为1.523元,本报告期份额争值增长率为-21.94%,同期业绩比较基准增长率为-12.28%。

由于年初至今市场出现了较大幅度的调整,风险也得到一定程度的释放,这对于追求稳健收益的投资者来说,机会正变得越来越大,越来越多的

## 华安升级主题混合型证券投资基金

### 2016 第一季度 报告

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

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2016年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和股资组合报告等内 基金注的人平圆建设银行成价有限公司根据库基金管即规定。于2016年4月15日复核,本报台中的财务指标、 环止复核内容不存在整假之载、误导性练达或者置大遗漏。 基金管理人采取出。域实任用。勤勉尽所的原则管理张远用基金资产,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展设用书

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止

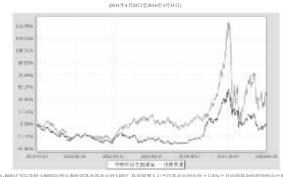
4-18/T301D7010-1-1/11/H3/T20/12/H1T0	
	§ 2 基金产品概况
基金简称	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	185,809,087.64(5)
投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级,消费升级和技术升级的行业,分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在 严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
经价额略	本基金模果用 包上每下"与 包下面上""结合合的主动投资管理顺畅。即,采取 包上布下"的方式选择行业。把棚井校 穿下每中代表化分泌及聚场的方式或主题。 根据上述 包上而下"简格选择行业的基础上,采取 包下而上"的方法。运用基本部分析如实地调研相结合的研 安方法选择行业
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
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离于债券型基金和货币市场基金、低于投票型基金、属于证: 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

	単位:人氏巾兀
主要财务指标	报告期 (2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-23,667,737.95
2.本期利间	-42,771,239.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2366
4.期末基金资产净值	271,507,584.52
5.期末基金份额净值	1.461
金转换费等),计人费用后实际收益水平要低于所列数字。	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

加上本期公允价值变动收益

3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期基金份额的

受以来基金累计净值增长率变动及共与同期业值比较基准收益率变动的比较 华安开级主题混合型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:根据《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基 金合同的有关规定。截至本报告期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分 "基金的投资"中投资范围、投资限制等有关约定 § 4 管理人报告

\$1.25	10.6			证券从业年限	1989	
XDEI	401.70	任职日期	高任日期	BLDD DUBLITHK	1091	
体收删	本基金的基金 经理	2015-09-07	-	8	硕士,8年基金行业从业经验,曾任银河基金管理有限公司研究员,国联安基金基金经理。2015年5月加入华安基金管理有限公司,2015年9月起同时担任本基金及平安安倍消费服务混合型证券投资基金的基金经理。	
89	本基金的基金 经理	2015-06-16	-	8	即士。每年从总经历,曾任即参哲安证券有报公司诉 受损。年实决金基金管理构成公司,担任投资研究组、2014年 有到加人年安基金管理特况公司,担任投资研究组行, 业分析制、基金管理均和公司,担任投资研究组行, 年安动态观点配置混合党理步校资基金、年安安信 消费服务混合证券投资基金经理。2015年 11月起、即时担任年安新乐享保本混合型证券投资基金 基金的基金管理。2015年	
注:此处的	任职日期和离	任日期均指公司作出决定	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	

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台同、招募设用书等有关基金法律文件的规定,本着该求信用。 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。

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 你我中国出血是又让多好权高能宣称这个过去了关助的批准审点人。公司制定了《生产品管理者科技之机公子之为智能和能见人为对抗人态法。 "我吃太龙鱼,特定实下的产业理组合及比较的货租合金件。在新兴分析,我的发展、交易执行等力高企能的人公平之务管理中,起制精整信息,在研发 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,使用颜金发言。发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各 类投资租合经理可以公平享有信息就取出金。在投资环节。公司各投资租合金额理租份股租的风格和投资策略。就定并严格执行交易决策和 民保证名投资品仓分为规律的客户租金。但实现在,公司各投资租合企业要将投资租仓金额等各投资,就完全工作成实现和,股份租合金 理在授权范围内自主决策,因过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节、公司实行递船公平交易机制,确保各投资组合字有公平的 交易执行机会。(1) 交易所三级市场业务,通常价格位先,到间提出。比例分记、综合平确的控制规则,采取用一时间下达出各分投资租合企交易封 1. 公司第一次,公司第一次市场企业。为通价格位先、到间提出。比例分记、综合平确的控制规则,采取用一时间下达出各分投资租合企交易时, 1. 公司第一次,公司第一次市场企业,以股份人企业的企业。 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 机上的2分平医、(2) 交易所一级市场业务。投资团恰全地按高速超过在扩展少年报、港平交易邮及政策团首会及对分处估计用表。占有业务从公司总 处于行程与中华、网络实际中华的成以价格优先、比较的处原则挂行分配。并举备量记才无法会理扩估的份允。且以公司名义获得,粮贷套额了 在台模监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务道商指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind牌,发 市均价需求和结果、截到信息公开、老是多个投资组合进行一级市场损失,则各投货组合经票则以各投资组合名义和维中交易而下达投资部门。文 局风以赴进行投标、以商保中签定结果与投资组合侵收率的一一一对应。 罗中签量让力不进合建进行比例分配。且以公司名义实核等,则投资部了在风控 部门跨监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估还有、公司风险管理部公公通准下的各投货组合使费地增加参市场上市交易的投资 品种,进行场外的企工产技化影响中。 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; 个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

。例如文的印格公元巴拉丁拜京。4个问取收组台临近文房日即同时交购的交购的机机交的扩充进行分析。 - 年报告期内、公司公平交易制度总 行前皮良好 - 年报告期内、公司公平交易制度总体执行情况良好 4.3.2 第帝交易行为的专项原明 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x

-季度市场在大幅下挫后缓步上扬、大盘下跌15.12%,创业板那下跌17.53%。个股分化较大,估值合理或者基本面强劲的个股超额收益较大。本 基金由于去年年底仓位较高,一月份组合整体跌幅较大。在市场风险阶段性释放后本基金围绕经济转型升级,结合估值水平重点配置了传媒、新能

\*\*4-24(7四)\*\*16年2月22年3月21日,本基金份额等值为1.461元,未报告期份额等值增长率为-14.71%。同期业绩比较基准增长率为-10.94% 4-5管理人对宏观经济、证券市场及行业生势的简要展望

限显一等度。是分析优别期於过去平年有所改善。但初时期期他特天正。过去平年,一线城市和北沙一级城市郑州"相时"起即晚。战难民党的 的增长作用开始显现。由此带动的产业建聚气度应该有所提升。随着转型升级的深化。部分新兴产业持续快速增长。这些积极的国家市伍二季度 逐步得到验证。另一方面。那分一线城市房价快速上涨,以辖内支付类的农产品价格上涨可能推升市场对物的的组批、不同于土质几轮给价上涨逻辑。本轮部分品种物价上涨更多是阶段性保给短缺而不完全是全面需求扩张推动。对货币政策的块效果不一定呈现简单的核性对应关系。

---季度市场的下跌释放了部分个股风险。长期看,创新和改革是经济持续增长的重要动力。经济增长方式转型升级是我们关注的重点。在经济

增长预期回升的背景下,我们也会关注部分行业可能出现的超预期的景气回升。 4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说用

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知

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投资。

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顺益明细 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

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 本期国债期货投资政策

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 5.10.3 本期国债期货投资评价

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,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚

	序号	名称	金額(元)
Г	1	存出保证金	261,27
Г	2	应收证券清算款	11,637,66
Г	3	应收股利	
Г	4	应收利息	6,12
Г	5	应收申购款	356,28
Г	6	其他应收款	
Г	7	待推费用	
Г	8	其他	
Г	9	台计	12,261,33
	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处于转股期的可转换债券

H-19	股票代码	股票名标	流通受限部分	1922:900HM(70)	占基金资产净值比例(%)	池原学税額の設別
1	002612	朗姿较份	12,438,829.83		4.58	重大事项停牌
2	300063	天龙集团	10,387,116.96	3.83		重大资产重组停牌
			§ 6 开放式基金	份額变动		
						单位:
本报告期期初基金份	<b>新总额</b>					174,319,163.98
报告期基金总申购依	riii					41,071,279.96
域。报告期基金总赎	回份額					29,581,356.30
报告期基金拆分支过	份額					_

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 备查文件目录 1、《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》 2、《华安升级主题混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华安升级主题混合型证券投资基金托管协议》

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.cr

二〇一六年四月二十日

#### 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

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

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2016年4月15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。

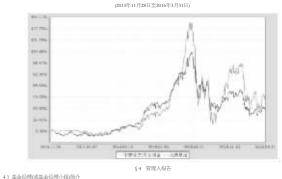
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险、投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止

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

上本期公允价值变动收益。 3.2 基金净值表现

> 华安生态优先混合型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



# 华安生态优先混合型证券投资基金

# 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

次然还没完全达到均衡水平,无风险收益率的下降空间相比去年也较小,但我们也要看到过去一段时间的市场大幅下跌正是反映了这些风险因素 来来一段时间只要不出现超预期的风险因素,市场将逐步进入具有投资价值的结构 标的。因此在操作上,本基金将依据市场阶段特征和主要矛盾,提高投资的灵活性。 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

新兴产业优秀公司估值开始逐步进入可投资区间。虽然从短期静态的视角看,宏观经济基本面还没完全企稳,仍将在底部调整一段时间,汇率调整也

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业				-	
E	建筑业				9,570,318.78	
F	批发和零售业				-	
G	交通运输、仓储和邮政业				-	
Н	住宿和餐饮业	住宿和餐饮业			-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业				16,327,666.29	1
J	金雕业	金鵬业			-	
K	房地产业					
L	租赁和商务服务业	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				9,273,296.28	
0	居民服务、修理和其他服务业				-	
P	教育	教育			-	
Q	卫生和社会工作				-	
R	文化、体育和娱乐业				20,292,299.08	1-
S	综合	综合			-	
	合计				126,246,350.53	8
3 报	告期末按公允价值占基金的	资产净值比例大小排序的前十	-名1	及票投资明细		
代码	· 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	002699	美盛文化		250,496	9,042,905.6	0
2	002072	凯瑞德		363,700	8,626,964.0	0
3	002587	奥拓电子		367,153	5,870,776.4	7
4	300133	华策影視	212,800		5,660,480.0	0
5	002325 洪海股份		452,757 5,605,131:		6	
6	600749	四藏旅游	276,70		5,592,107.0	0
7	600136	道牌股份		92,593	5,588,913.4	8
8	000558	000558 莱茵体育		274,800 5,160,744.0		0
9	9 300034 银矿汽油		219,397	4,896,941.0	4	
10	300285	国党材料		137,300	4,477,353.0	0

面因素影响下风险偏好大幅下降导致市场发生大幅下摇。本基金由于仓位偏高加之弹性品种占比较大,在这被下跌中,净值回撤受损较大。在这个过程中本基金通过下调仓位及调整持仓结构,降低风险容忍度,逐步扭转了下滑的势头。进入3月份后,美国阴确了暂停加息,国内暂停了往册制和战略 新兴板等缓解市场恐慌情绪的措施,加之经济出现复苏苗头,市场逐步企稳反弹。随着市场热点逐步增加,投资可操作性也在增加,本基金也逐步提

> 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

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投资。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资股指期货。 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

直或空头套期保值),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

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责,处罚的

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

1、《华安生态优先混合型证券投资基金基金合同》 2、《华安生态优先混合型证券投资基金招募说明书

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

二〇一六年四月二十日