华安沪深300指数分级证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年四月二十日

§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。

§2 基金产品概况

基金简称	华安沪深300指数分级
场内简称	沪深300
基金主代码	160407
交易代码	160407
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
报告期末基金份额总额	293,756,710.03份
投资目标	本基金通过被动跟踪标的指数优化投资管理，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	本基金为被动式指数型基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数成分股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化进行调整，以期达到尽量降低组合与标的指数间的跟踪误差的目的。本基金投资于标的指数成分股的资产比例不低于基金资产净值的90%，其余资产投资于债券、现金及其他流动性资产等品种，基金可能因为成分股调整、基金可能不能购买成分股证券或证券停牌、基金可能因为流动性不足等原因导致基金投资组合无法调整基金投资组合，并可能导致不利影响风险；基金可能因为证券市场波动、证券发行人违约、证券停牌、证券退市、证券流动性不足、证券发行人信用状况恶化或证券价格大幅下跌等原因导致基金投资组合发生较大规模的赎回，基金可能因为赎回比例较大导致基金资产规模迅速减少，从而导致基金管理人因可用现金资产不足而被迫以不利价格出售证券，从而给本基金的跟踪带来不利影响；此外，由于证券市场交易时间、证券发行人信用状况恶化或证券价格大幅下跌等因素，基金可能因为证券市场波动、证券发行人信用状况恶化或证券价格大幅下跌等原因导致基金投资组合无法调整基金投资组合，并可能导致不利影响风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)
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，从本基金所投资的股票看，沪安沪深300指数分级股票，沪安沪深300指数分级A股票具有较高的预期收益特征，沪安沪深300指数分级B股票具有较高的风险特征。
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

下属分级基金的基金简称	沪安沪深300指数分级A	沪安沪深300指数分级B	沪安沪深300指数分级
下属分级基金的交易代码	150168	150169	150167
下属分级基金的场内简称	沪深300A	沪深300B	沪深300
报告期末下属分级基金的份额总额	1,380,409.00份	1,380,409.00份	293,944,892.03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 (2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	395,529.08
2.本期利润	41,111,277.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.2060
4.期末基金资产净值	291,256,534.28
5.期末基金份额净值	1.3942

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	份额净值增长率①	份额增长率标准差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	26.94%	1.47%	27.11%	1.48%	-0.20%	-0.01%

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

华安沪深300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

（2012年6月25日至2019年3月31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		
吴刚云	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2017-10-11	-	11年	硕士研究生，MIT证券代码证券从业资格，特许证券投资顾问证券从业资格，2006年7月加入华安基金，投资部与量化投资部副总监，2006年7月-2012年7月期间，担任华安证券投资部研究员，2012年7月-2014年7月期间，担任华安证券投资部研究员兼华安沪深300指数分级基金基金经理，2012年7月-2014年7月期间，担任华安证券投资部研究员兼华安上证180指数分级基金基金经理，2014年7月-2015年7月期间，担任华安证券投资部研究员兼华安上证180指数分级基金基金经理兼华安沪深300指数分级基金基金经理，2015年7月-2016年3月期间，担任华安证券投资部研究员兼华安上证180指数分级基金基金经理兼华安沪深300指数分级基金基金经理兼华安MSCI中国A股指数分级基金基金经理兼华安创业板50指数分级基金基金经理兼华安中证500指数分级基金基金经理兼华安MSCI中国A股指数基金基金经理兼华安创业板50指数基金基金经理兼华安中证500指数基金基金经理兼华安MSCI中国A股指数分级基金基金经理兼华安创业板50指数分级基金基金经理兼华安中证500指数分级