

**华安保本混合型证券投资基金**  
**2015 年年度报告摘要**  
**2015 年 12 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：二〇一六年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 华安保本混合           |
| 基金主代码      | 000072           |
| 交易代码       | 000072           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2013 年 5 月 14 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     |
| 报告期末基金份额总额 | 267,698,030.20 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。                                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略   | 本基金采用基于 VaR 的风险乘数全程可变的 CPPI 策略（恒定比例组合保险策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款收益率（税后）                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。                                                                                                                                                                                                                              |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人      | 基金托管人        |
|----|------------|--------------|
| 名称 | 华安基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |

|             |      |                      |                      |
|-------------|------|----------------------|----------------------|
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                   | 田青                   |
|             | 联系电话 | 021-38969999         | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099           | 010-67595096         |
| 传真          |      | 021-68863414         | 010-66275853         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn            |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年         | 2014 年         | 2013 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至<br>2013 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|-----------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 133,766,015.04 | 102,693,827.69 | 9,020,944.53                                  |
| 本期利润          | 128,451,720.57 | 143,630,748.53 | -12,853,153.47                                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5376         | 0.2405         | -0.0149                                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 42.55%         | 29.54%         | -1.50%                                        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末        | 2014 年末        | 2013 年末                                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.8189         | 0.2698         | -0.0153                                       |
| 期末基金资产净值      | 486,922,457.37 | 409,996,356.54 | 787,700,125.78                                |
| 期末基金份额净值      | 1.819          | 1.276          | 0.985                                         |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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    | 13.40%   | 0.79%       | 0.65%      | 0.01%         | 12.75% | 0.78% |
| 过去六个月    | 14.40%   | 1.05%       | 1.38%      | 0.01%         | 13.02% | 1.04% |
| 过去一年     | 42.55%   | 0.91%       | 3.15%      | 0.01%         | 39.40% | 0.90% |
| 自基金成立起至今 | 81.90%   | 0.64%       | 10.29%     | 0.01%         | 71.61% | 0.63% |

注：本基金业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）

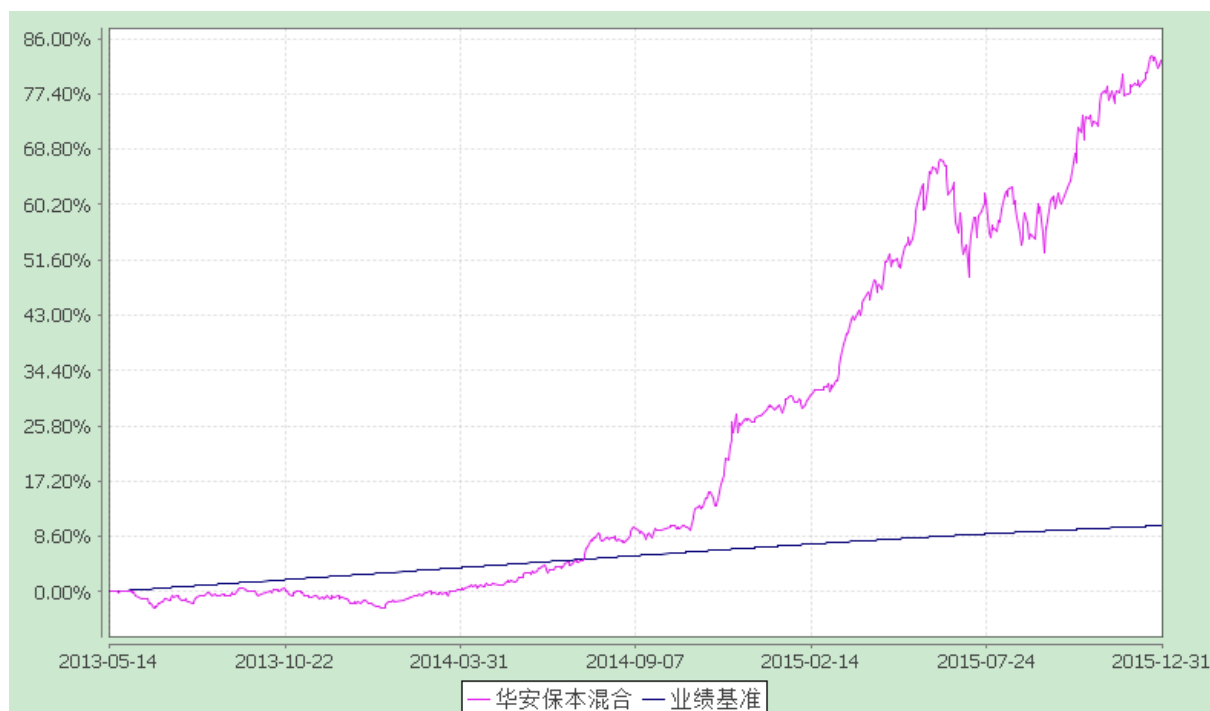
根据本基金合同的有关规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资比例限制为：投资于股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

#### 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

华安保本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的历史走势对比图

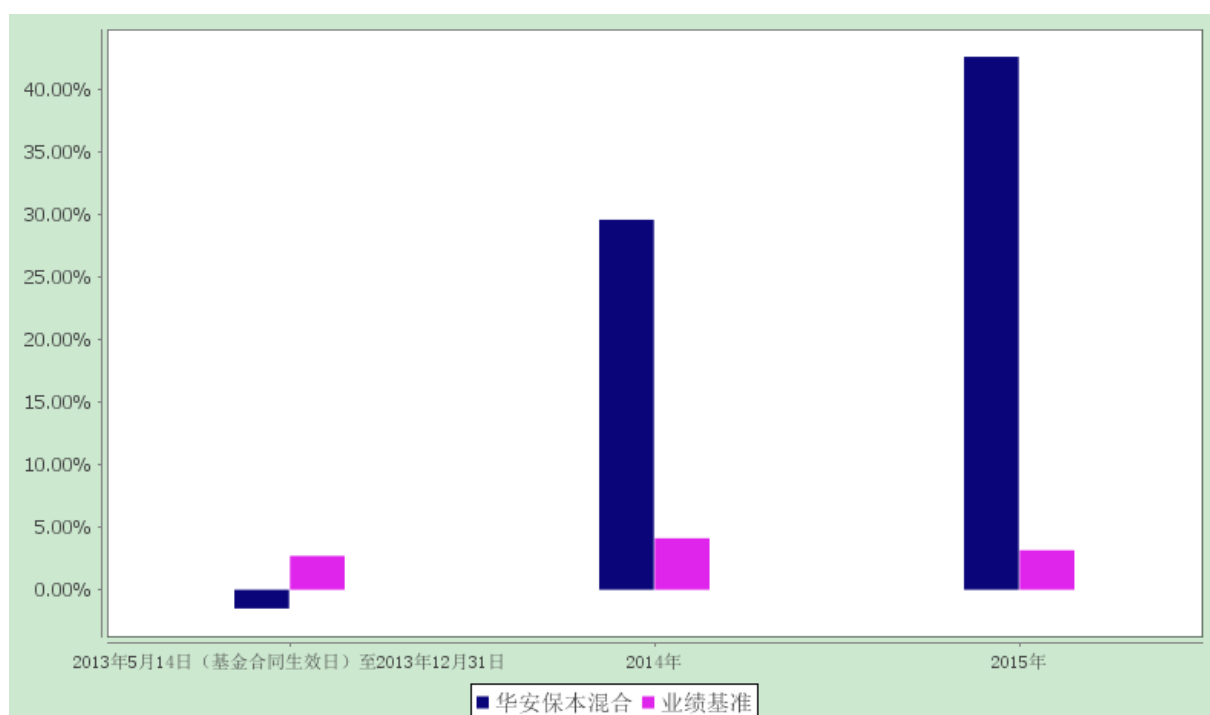
(2013 年 5 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等 71 只开放式基金。管理资产规模达到 1558.45 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----|---------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                     | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 郑可成 | 本基金的基金经理，固定收益部助理总监。 | 2013-05-14      | -    | 14 年   | 硕士研究生，14 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 8 月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月起，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月起，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 吴丰树 | 本基金的基金经理            | 2013-05-14      | -    | 12 年   | 硕士研究生，12 年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员、华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011 年 3 月                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |



|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>份加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月至 2013 年 5 月担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 10 月起同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 2 月起担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1.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。

2.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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安保本混合型证券投资基金基金合同》、《华安保本混合型证券投资基金招募说明书》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、邮件发送、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，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，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，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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 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，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 1 次，未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，未发现异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，全球经济继续分化，美国经济复苏好于预期，美联储启动加息；欧洲经济弱势复苏，量化宽松政策继续；日本经济复苏缓慢，经济持续弱于预期。国内经济持续下滑，经济增速再下台阶，传统产业的产能过剩压力继续加大，工业持续低迷；房地产销售虽有回暖，但地产投资未见起色，基建投资对经济托底有限，经济下行压力依然较大。央行货币政策保持宽松，四次降准、五次降息，基准利率大幅下调 125 个基点，同时，央行通过 SLO、MLF 等工具配合实施，降低了市场对资金面波动的预期，资金利率低位保持稳定。在经济下行、产能过剩背景下，人民币贬值预期持续升温，8.11 汇率改革后，人民币贬值预期进一步上升，随着外汇占款的持续下降，资金流出不断扩大，一定程度制约了货币政策的进一步放松。

在货币供给充裕但融资需求萎缩以及股票市场深度调整的情况下，资金涌向债券市场，债券市场继续呈现牛市特征。一季度央行通过大幅降准以及公开市场引导资金利率不断下行，7 天回购平均下行近 200 个基点，短端债券收益率下行 100 多 BP，资金利率明显下降；二季度地方债置换导致利率债供给大增，收益率以调整上行为主，同时股市大涨分流了部分资金；下半年随着股市大幅下跌，IPO 暂停，打新基金转型债券基金，资本市场风险偏好发生转移，银行理财大规模资金流入债券市场，资产重新配置使得债券收益率大幅下降。随着经济下滑，企业经营压力不断增大，特别是过剩产能行业连年亏损，信用风险大幅上升，刚兑彻底打破，信用违约事件屡见不鲜，信用利差进一步分化，高等级利差进一步大幅压缩，低等级特别是过剩产能行业利差大幅上升。

权益市场上半年在市场各主体加杠杆的背景下，出现了较大涨幅。但在 6 月底趋势逆转，市场出现急速下跌。一直到年底市场维持了宽幅震荡的格局。可转债跟随股市行情，上半年表现出色，下半年经历了深度调整，全年表现为指数下跌。

本基金上半年得益于较高的权益类仓位和较好的行业配置，业绩表现较好。二季度末开始，受权益市场暴跌的影响，业绩产生较大波动。但本基金在下半年把握了债券市场的行情以及权益类在四季度的修复性行情，最终净值取得较大增长，战胜了比较基准。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.819 元，本报告期份额净值增长率为 42.55%，同期业绩比较基准增长率为 3.15%。

## 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 2016 年，全球低增长、低通胀、低利率的环境仍将持续，虽然美联储已启动加息，但市场

已对其后续加息预期开始降低，美元走强可能弱于市场预期，人民币汇率的压力可能会有所缓解。虽然央行货币政策执行报告中指出，货币政策将保持适度原则，货币政策的宽松预期可能有所减弱，但国内经济转型和供给侧改革仍是宏观主基调，化解过剩产能是我国产业结构升级、提升经济运行效率的重要举措，国务院已下发关于煤炭、钢铁等行业过剩产能的指导意见，未来三至五年，经济仍将处于转型阵痛期，经济增长压力较大，债券市场的牛市基础仍在。但随着房地产政策的持续放松以及宽松财政政策的发力，可能会对经济悲观预期有所修正，同时地方债置换规模的扩大可能仍对债券市场产生一定冲击，汇率波动将继续对国内货币政策产生影响，2016 年债券市场的波动可能进一步加剧。在经济下行及去产能背景下，信用风险溢价将继续上升，违约事件可能进一步增多，风险防范将是 2016 年的市场重点。

本基金在 2016 年将继续高等级信用债和无风险利率债的配置，在期限和等级利差均较低的情况下，采用中短久期，中低杠杆的策略，跟随市场变化进行可转债配置。灵活调整股票仓位，自下而上的挖掘主题和行业的机会。我们将秉承稳健、专业的投资理念，优化组合结构，控制风险，勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：总经理助理（分管投资研究）、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师

及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵 敏：研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺 涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理，固定收益部副总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接基金的基金经理，指数投资部总监。

陈 林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## （2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## （3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期不进行收益分配。

**4.8 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说明**

无。

**§5 托管人报告**

**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

**5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 郭杭翔、蒋燕华签字出具了安永华明(2016)审字第 60971571\_B08 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     | -                       | -                        |
| 银行存款     | 35,246,693.44           | 6,840,898.84             |
| 结算备付金    | 1,531,493.29            | 3,101,151.68             |
| 存出保证金    | 147,087.93              | 74,682.69                |
| 交易性金融资产  | 432,747,537.00          | 556,783,168.75           |
| 其中：股票投资  | 123,607,433.20          | 71,212,407.25            |
| 基金投资     | -                       | -                        |
| 债券投资     | 309,140,103.80          | 485,570,761.50           |
| 资产支持证券投资 | -                       | -                        |
| 贵金属投资    | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产 | 5,000,000.00            | -                        |
| 应收证券清算款  | 15,830,256.45           | -                        |
| 应收利息     | 5,269,419.30            | 10,797,641.43            |
| 应收股利     | -                       | -                        |
| 应收申购款    | 3,520,493.72            | 515,314.50               |

|                   |                                 |                                  |
|-------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产           | -                               | -                                |
| 其他资产              | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       | <b>499,292,981.13</b>           | <b>578,112,857.89</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>本期末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| 负 债:              | -                               | -                                |
| 短期借款              | -                               | -                                |
| 交易性金融负债           | -                               | -                                |
| 衍生金融负债            | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款         | 10,000,000.00                   | 149,299,300.05                   |
| 应付证券清算款           | -                               | 699.28                           |
| 应付赎回款             | 903,535.10                      | 17,354,499.39                    |
| 应付管理人报酬           | 458,872.09                      | 455,785.87                       |
| 应付托管费             | 76,478.65                       | 75,964.29                        |
| 应付销售服务费           | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | 570,801.57                      | 363,259.90                       |
| 应交税费              | -                               | -                                |
| 应付利息              | 694.44                          | 116,992.57                       |
| 应付利润              | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           | -                               | -                                |
| 其他负债              | 360,141.91                      | 450,000.00                       |
| <b>负债合计</b>       | <b>12,370,523.76</b>            | <b>168,116,501.35</b>            |
| <b>所有者权益:</b>     | -                               | -                                |
| 实收基金              | 267,698,030.20                  | 321,375,276.07                   |
| 未分配利润             | 219,224,427.17                  | 88,621,080.47                    |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>486,922,457.37</b>           | <b>409,996,356.54</b>            |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>499,292,981.13</b>           | <b>578,112,857.89</b>            |

注: 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.819 元, 基金份额总额 267,698,030.20 份。



## 7.2 利润表

会计主体：华安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>138,789,342.21</b>                     | <b>164,111,931.99</b>                          |
| 1.利息收入                | 17,445,508.37                             | 40,773,637.13                                  |
| 其中：存款利息收入             | 189,601.57                                | 840,482.66                                     |
| 债券利息收入                | 17,255,157.92                             | 39,560,324.32                                  |
| 资产支持证券利息收入            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            | 748.88                                    | 372,830.15                                     |
| 其他利息收入                | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 119,068,863.58                            | 72,890,131.23                                  |
| 其中：股票投资收益             | 106,680,819.30                            | 42,709,143.63                                  |
| 基金投资收益                | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 10,602,165.07                             | 25,984,191.96                                  |
| 资产支持证券投资收益            | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益               | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | 1,785,879.21                              | 4,196,795.64                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -5,314,294.47                             | 40,936,920.84                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7,589,264.73                              | 9,511,242.79                                   |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>10,337,621.64</b>                      | <b>20,481,183.46</b>                           |
| 1. 管理人报酬              | 4,417,046.79                              | 7,543,174.48                                   |
| 2. 托管费                | 736,174.40                                | 1,257,195.76                                   |

|                            |                       |                       |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 2,350,557.37          | 1,240,143.38          |
| 5. 利息支出                    | 2,426,424.42          | 10,008,710.68         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 2,426,424.42          | 10,008,710.68         |
| 6. 其他费用                    | 407,418.66            | 431,959.16            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>128,451,720.57</b> | <b>143,630,748.53</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>128,451,720.57</b> | <b>143,630,748.53</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                 |                 |
|-----------------------------------|----------------------------------------|-----------------|-----------------|
|                                   | 实收基金                                   | 未分配利润           | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 321,375,276.07                         | 88,621,080.47   | 409,996,356.54  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | 128,451,720.57  | 128,451,720.57  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -53,677,245.87                         | 2,151,626.13    | -51,525,619.74  |
| 其中：1.基金申购款                        | 285,084,628.21                         | 175,514,076.83  | 460,598,705.04  |
| 2.基金赎回款                           | -338,761,874.08                        | -173,362,450.70 | -512,124,324.78 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少    | -                                      | -               | -               |

|                                        |                                             |                |                 |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|----------------|-----------------|
| 以“-”号填列)                               |                                             |                |                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 267,698,030.20                              | 219,224,427.17 | 486,922,457.37  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                |                 |
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 799,919,461.90                              | -12,219,336.12 | 787,700,125.78  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                           | 143,630,748.53 | 143,630,748.53  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -478,544,185.83                             | -42,790,331.94 | -521,334,517.77 |
| 其中：1.基金申购款                             | 41,779,440.81                               | 7,819,071.69   | 49,598,512.50   |
| 2.基金赎回款                                | -520,323,626.64                             | -50,609,403.63 | -570,933,030.27 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                           | -              | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 321,375,276.07                              | 88,621,080.47  | 409,996,356.54  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 朱学华, 主管会计工作负责人: 章国富, 会计机构负责人: 陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]218 号文《关于核准华安保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人社会公开募集,基金合同于 2013 年 5 月 14 日生效。首次设立募集为 901,938,256.03 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金以每三年为一个保本周期。本基金的第一个保本周期自基金合同生效日起至三个公历年后的对应日止,如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。保本周期届满时,若符合保本基金存续条件,本基金转入下一保本周期;基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则,确定下一个保本周期的起始时间;第一个保本周期之后各保本周期自基金公告的保本周期起始之日起至三个公历年后对应日止,若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。本基金第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额累计分红金额之和低于认购保本金额,则基金管理人应补足该差额(即“保本赔付差额”),并在保本周期到期日后 20 个工作日内(含第 20 个工作日)将该差额支付给基金份额持有人。其后各保本周期到期日,如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额,由当期有效的基金合同、《保证合同》或《风险买断合同》约定的基金管理人或保本义务人将保本赔付差额支付给基金份额持有人。本基金到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日(含第 5 个工作日)。

在到期操作期间内,本基金接受赎回和转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。如果基金份额持有人在到期操作期间内未选择赎回或转换转出,则基金管理人根据本基金到期存续形式视其默认选择转入下一保本周期或继续持有转型后的“华安稳健回报混合型证券投资基金”基金份额,默认操作日期为到期操作期间的最后一个工作日。

基金管理人有权视业务需要设定过渡期。过渡期指到期操作期间结束日的下一工作日至下一保本周期开始日前一工作日的时间区间,最长不超过 20 个工作日,具体由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。过渡期内,本基金将暂停办理日常赎回和转换转出业务。投资人在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内,投资人转换转入本基金基金份额,视同为过渡期申购。

本基金第一个保本周期的担保人为中国投资担保有限公司,对保本赔付差额的支付提供不可撤销的连带责任保证;本基金第一个保本周期后各保本周期的担保人或保本义务人对外承担保证责任

或保本偿付责任的情况及其为本基金提供的保本保障额度，由基金管理人在当期保本周期开始前公告。保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金转入下一保本周期。保本周期届满时，在满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的前提下，若本基金不符合上述保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为“华安稳健回报混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围等相关内容也将根据本合同约定做相应修改。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对保本资产和风险资产的投资比例进行动态调整。本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金整体业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的

通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构          |
| 上海国际信托有限公司           | 基金管理人的股东              |
| 上海电气(集团)总公司          | 基金管理人的股东              |

|                |          |
|----------------|----------|
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海锦江国际投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 国泰君安投资管理股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,417,046.79                    | 7,543,174.48                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,646,144.41                    | 3,386,484.84                         |

注：在保本周期内，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$



H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 736,174.40                      | 1,257,195.76                         |

注：在保本周期内，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |            |
|-------|-----------------------------|------------|----------------------------------|------------|
|       | 期末余额                        | 当期利息收入     | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 建设银行  | 35,246,693.44               | 159,287.23 | 6,840,898.84                     | 114,083.05 |

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 10,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 123,607,433.20 元,属于第二层次的余额为人民币 309,140,103.80 元,无属于第三层次余额。

于 2014 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 124,665,083.50 元,第二层次的余额为人民币 432,118,085.25 元,无属于第三层次余额。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自 2015 年 3 月 30 日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 123,607,433.20 | 24.76        |
|    | 其中：股票             | 123,607,433.20 | 24.76        |
| 2  | 固定收益投资            | 309,140,103.80 | 61.92        |
|    | 其中：债券             | 309,140,103.80 | 61.92        |
|    | 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          | 5,000,000.00   | 1.00         |
|    | 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      | 36,778,186.73  | 7.37         |
| 7  | 其他各项资产            | 24,767,257.40  | 4.96         |
| 8  | 合计                | 499,292,981.13 | 100.00       |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别     | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -    | -            |
| B  | 采矿业      | -    | -            |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | 61,909,050.00  | 12.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,776,000.00   | 1.39  |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 22,968,000.00  | 4.72  |
| H | 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              | 1,189,383.20   | 0.24  |
| K | 房地产业             | 4,172,000.00   | 0.86  |
| L | 租赁和商务服务业         | 17,793,000.00  | 3.65  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 8,800,000.00   | 1.81  |
| 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        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 123,607,433.20 | 25.39 |

### 8.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产净值<br>比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 002152 | 广电运通 | 1,080,000 | 33,469,200.00 | 6.87             |
| 2  | 601888 | 中国国旅 | 300,000   | 17,793,000.00 | 3.65             |
| 3  | 600436 | 片仔癀  | 215,000   | 14,789,850.00 | 3.04             |
| 4  | 600009 | 上海机场 | 500,000   | 14,760,000.00 | 3.03             |
| 5  | 002033 | 丽江旅游 | 500,000   | 8,800,000.00  | 1.81             |
| 6  | 600518 | 康美药业 | 500,000   | 8,475,000.00  | 1.74             |
| 7  | 600428 | 中远航运 | 800,000   | 8,208,000.00  | 1.69             |
| 8  | 000543 | 皖能电力 | 800,000   | 6,776,000.00  | 1.39             |
| 9  | 000831 | 五矿稀土 | 250,000   | 5,175,000.00  | 1.06             |
| 10 | 001979 | 招商蛇口 | 200,000   | 4,172,000.00  | 0.86             |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|---------------|--------------------|
| 1  | 002152 | 广电运通  | 39,525,367.88 | 9.64               |
| 2  | 600009 | 上海机场  | 37,852,972.24 | 9.23               |
| 3  | 601601 | 中国太保  | 22,611,176.86 | 5.51               |
| 4  | 601888 | 中国国旅  | 21,498,572.91 | 5.24               |
| 5  | 601166 | 兴业银行  | 19,630,508.90 | 4.79               |
| 6  | 601872 | 招商轮船  | 19,554,168.67 | 4.77               |
| 7  | 600570 | 恒生电子  | 18,629,213.98 | 4.54               |
| 8  | 000002 | 万 科 A | 16,649,943.22 | 4.06               |
| 9  | 600896 | 中海海盛  | 16,120,301.00 | 3.93               |
| 10 | 600873 | 梅花生物  | 15,856,519.86 | 3.87               |
| 11 | 600436 | 片仔癀   | 15,720,289.00 | 3.83               |
| 12 | 002353 | 杰瑞股份  | 15,267,790.01 | 3.72               |
| 13 | 300075 | 数字政通  | 15,180,886.17 | 3.70               |
| 14 | 000961 | 中南建设  | 14,557,404.82 | 3.55               |
| 15 | 000726 | 鲁 泰 A | 14,369,396.40 | 3.50               |
| 16 | 601336 | 新华保险  | 14,087,481.56 | 3.44               |
| 17 | 000987 | 广州友谊  | 13,380,014.50 | 3.26               |
| 18 | 300226 | 上海钢联  | 13,364,445.64 | 3.26               |
| 19 | 600657 | 信达地产  | 13,296,862.76 | 3.24               |
| 20 | 601933 | 永辉超市  | 12,993,010.06 | 3.17               |
| 21 | 601231 | 环旭电子  | 12,731,829.70 | 3.11               |
| 22 | 600428 | 中远航运  | 12,636,895.60 | 3.08               |
| 23 | 002458 | 益生股份  | 11,723,398.40 | 2.86               |
| 24 | 600309 | 万华化学  | 11,657,506.65 | 2.84               |
| 25 | 600897 | 厦门空港  | 11,595,798.61 | 2.83               |
| 26 | 600697 | 欧亚集团  | 11,217,394.51 | 2.74               |
| 27 | 600315 | 上海家化  | 10,915,453.79 | 2.66               |
| 28 | 600518 | 康美药业  | 10,428,485.41 | 2.54               |
| 29 | 601169 | 北京银行  | 10,351,339.60 | 2.52               |
| 30 | 600016 | 民生银行  | 9,193,098.90  | 2.24               |
| 31 | 601009 | 南京银行  | 9,030,771.40  | 2.20               |
| 32 | 600019 | 宝钢股份  | 8,974,199.50  | 2.19               |
| 33 | 600109 | 国金证券  | 8,910,789.58  | 2.17               |
| 34 | 600115 | 东方航空  | 8,834,138.50  | 2.15               |
| 35 | 002033 | 丽江旅游  | 8,665,847.36  | 2.11               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 36 | 002349 | 精华制药 | 8,436,845.30 | 2.06 |
| 37 | 002241 | 歌尔声学 | 8,267,644.58 | 2.02 |
| 38 | 600415 | 小商品城 | 8,233,407.00 | 2.01 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|---------------|--------------------|
| 1  | 002152 | 广电运通  | 50,507,554.72 | 12.32              |
| 2  | 600570 | 恒生电子  | 26,244,460.00 | 6.40               |
| 3  | 300075 | 数字政通  | 25,334,986.56 | 6.18               |
| 4  | 600009 | 上海机场  | 24,301,911.17 | 5.93               |
| 5  | 601166 | 兴业银行  | 24,242,437.42 | 5.91               |
| 6  | 000530 | 大冷股份  | 22,025,142.92 | 5.37               |
| 7  | 601872 | 招商轮船  | 20,654,173.04 | 5.04               |
| 8  | 600896 | 中海海盛  | 20,081,192.96 | 4.90               |
| 9  | 000726 | 鲁 泰 A | 18,454,353.00 | 4.50               |
| 10 | 601336 | 新华保险  | 18,310,898.00 | 4.47               |
| 11 | 000961 | 中南建设  | 18,302,195.20 | 4.46               |
| 12 | 600096 | 云天化   | 17,982,535.59 | 4.39               |
| 13 | 601601 | 中国太保  | 16,864,532.01 | 4.11               |
| 14 | 300226 | 上海钢联  | 16,696,234.09 | 4.07               |
| 15 | 000987 | 广州友谊  | 16,101,001.00 | 3.93               |
| 16 | 600873 | 梅花生物  | 15,835,894.00 | 3.86               |
| 17 | 002458 | 益生股份  | 15,423,516.00 | 3.76               |
| 18 | 600657 | 信达地产  | 15,039,962.95 | 3.67               |
| 19 | 000002 | 万 科 A | 14,440,000.00 | 3.52               |
| 20 | 601231 | 环旭电子  | 14,407,303.06 | 3.51               |
| 21 | 000869 | 张 裕 A | 13,861,062.00 | 3.38               |
| 22 | 600697 | 欧亚集团  | 13,439,755.78 | 3.28               |
| 23 | 601933 | 永辉超市  | 12,838,159.74 | 3.13               |
| 24 | 002353 | 杰瑞股份  | 12,639,784.55 | 3.08               |
| 25 | 600897 | 厦门空港  | 11,831,676.60 | 2.89               |
| 26 | 600315 | 上海家化  | 11,827,287.90 | 2.88               |
| 27 | 601169 | 北京银行  | 10,678,498.88 | 2.60               |
| 28 | 600309 | 万华化学  | 10,508,360.36 | 2.56               |
| 29 | 600019 | 宝钢股份  | 10,324,934.20 | 2.52               |
| 30 | 002241 | 歌尔声学  | 10,262,310.00 | 2.50               |
| 31 | 600872 | 中炬高新  | 9,915,012.50  | 2.42               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 32 | 600115 | 东方航空 | 9,812,096.00 | 2.39 |
| 33 | 600418 | 江淮汽车 | 9,746,613.00 | 2.38 |
| 34 | 000568 | 泸州老窖 | 9,695,611.30 | 2.36 |
| 35 | 601009 | 南京银行 | 8,996,030.00 | 2.19 |
| 36 | 002349 | 精华制药 | 8,516,375.00 | 2.08 |
| 37 | 600016 | 民生银行 | 8,513,563.00 | 2.08 |
| 38 | 002299 | 圣农发展 | 8,377,540.48 | 2.04 |
| 39 | 600415 | 小商品城 | 8,324,849.20 | 2.03 |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 742,496,808.11 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 793,986,155.85 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 70,139,000.00  | 14.40        |
|    | 其中：政策性金融债 | 70,139,000.00  | 14.40        |
| 4  | 企业债券      | 126,127,103.80 | 25.90        |
| 5  | 企业短期融资券   | 70,227,000.00  | 14.42        |
| 6  | 中期票据      | 42,647,000.00  | 8.76         |
| 7  | 可转债       | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 309,140,103.80 | 63.49        |



## 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 150215  | 15 国开 15 | 400,000 | 40,052,000.00 | 8.23         |
| 2  | 150211  | 15 国开 11 | 300,000 | 30,087,000.00 | 6.18         |
| 3  | 1380357 | 13 襄建投债  | 200,000 | 21,874,000.00 | 4.49         |
| 4  | 124163  | 13 蓉文旅   | 200,000 | 21,626,000.00 | 4.44         |
| 5  | 124377  | 13 渝碚城   | 200,000 | 21,262,000.00 | 4.37         |

## 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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、处罚的情况。

8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 147,087.93    |
| 2  | 应收证券清算款 | 15,830,256.45 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 5,269,419.30  |
| 5  | 应收申购款   | 3,520,493.72  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 24,767,257.40 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |            |                |            |
|----------|---------------|--------------|------------|----------------|------------|
|          |               | 机构投资者        |            | 个人投资者          |            |
|          |               | 持有份额         | 占总份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 12,288   | 21,785.32     | 4,470,169.65 | 1.67%      | 263,227,860.55 | 98.33%     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 11,083.04 | 0.00%    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2013 年 5 月 14 日)基金份额总额 | 901,938,256.03 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 321,375,276.07 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 285,084,628.21 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 338,761,874.08 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 267,698,030.20 |

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

（1）2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

（2）2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

（3）2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

（1）本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

（2）本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况：60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称             | 交易<br>单元<br>数量 | 股票交易           |                      | 应支付该券商的佣金  |                    | 备注 |
|------------------|----------------|----------------|----------------------|------------|--------------------|----|
|                  |                | 成交金额           | 占当期股<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金         | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 |    |
| 财达证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 中信证券股份<br>有限公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 中信建投证券<br>股份有限公司 | 1              | 134,622,416.72 | 8.77%                | 125,374.06 | 8.95%              | -  |
| 中山证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 中国国际金融<br>有限公司   | 1              | 104,659,791.54 | 6.82%                | 97,237.19  | 6.94%              | -  |
| 招商证券股份<br>有限公司   | 3              | 42,353,639.67  | 2.76%                | 38,683.86  | 2.76%              | -  |
| 长江证券股份<br>有限公司   | 1              | 141,292,578.37 | 9.20%                | 131,384.73 | 9.38%              | -  |
| 长城证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 兴业证券股份<br>有限公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 新时代证券有<br>限责任公司  | 1              | 172,568,313.80 | 11.24%               | 158,138.59 | 11.29%             | -  |
| 湘财证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 西南证券股份<br>有限公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 万联证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 天风证券有限<br>责任公司   | 1              | -              | -                    | -          | -                  | -  |
| 申银万国证券<br>股份有限公司 | 1              | 50,727,053.95  | 3.30%                | 45,168.18  | 3.23%              | -  |
| 上海证券有限<br>责任公司   | 2              | 14,465,094.23  | 0.94%                | 13,174.85  | 0.94%              | -  |
| 瑞银证券有限           | 1              | 124,898,944.93 | 8.14%                | 111,904.08 | 7.99%              | -  |

|              |   |                |        |            |        |   |
|--------------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 责任公司         |   |                |        |            |        |   |
| 齐鲁证券有限公司     | 1 | 57,500.00      | 0.00%  | 50.88      | 0.00%  | - |
| 联讯证券有限责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 华泰证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 华安证券有限责任公司   | 1 | 5,388,303.30   | 0.35%  | 5,018.19   | 0.36%  | - |
| 宏源证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 海通证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 国信证券股份有限公司   | 1 | 10,569,986.96  | 0.69%  | 9,622.76   | 0.69%  | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 217,793,241.63 | 14.19% | 194,845.27 | 13.92% | - |
| 国盛证券有限责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 广州证券有限责任公司   | 2 | 5,062,061.84   | 0.33%  | 4,613.06   | 0.33%  | - |
| 广发证券股份有限公司   | 1 | 251,418,361.00 | 16.38% | 230,471.88 | 16.46% | - |
| 光大证券股份有限公司   | 1 | 220,789,488.63 | 14.38% | 200,561.05 | 14.32% | - |
| 方正证券股份有限公司   | 1 | 38,404,238.89  | 2.50%  | 33,983.80  | 2.43%  | - |
| 东北证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 德邦证券有限责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 财富证券有限责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |

注：1、基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- （1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- （3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2015 年 3 月完成租用上海证券深圳 390811 交易单元

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易         |              | 回购交易           |              | 权证交易 |              |
|--------------|--------------|--------------|----------------|--------------|------|--------------|
|              | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1,242,273.21 | 4.85%        | 124,000,000.00 | 5.68%        | -    | -            |
| 中国国际金融有限公司   | -            | -            | 175,000,000.00 | 8.02%        | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司   | -            | -            | 265,000,000.00 | 12.15%       | -    | -            |
| 长江证券股份有限公司   | 4,790,799.10 | 18.69%       | 186,000,000.00 | 8.53%        | -    | -            |
| 新时代证券有限责任公司  | -            | -            | 489,300,000.00 | 22.43%       | -    | -            |
| 上海证券有限       | -            | -            | 67,000,00      | 3.07%        | -    | -            |

|                  |                   |        |                    |        |   |   |
|------------------|-------------------|--------|--------------------|--------|---|---|
| 责任公司             |                   |        | 0.00               |        |   |   |
| 瑞银证券有限<br>责任公司   | -                 | -      | 64,000,00<br>0.00  | 2.93%  | - | - |
| 齐鲁证券有限<br>公司     | -                 | -      | 28,755,00<br>0.00  | 1.32%  | - | - |
| 华安证券有限<br>责任公司   | -                 | -      | 23,000,00<br>0.00  | 1.05%  | - | - |
| 国信证券股份<br>有限公司   | -                 | -      | 30,000,00<br>0.00  | 1.38%  | - | - |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 18,220,957.0<br>2 | 71.09% | 40,000,00<br>0.00  | 1.83%  | - | - |
| 广发证券股份<br>有限公司   | 1,378,000.00      | 5.38%  | 652,900,0<br>00.00 | 29.93% | - | - |
| 光大证券股份<br>有限公司   | -                 | -      | 26,260,00<br>0.00  | 1.20%  | - | - |
| 方正证券股份<br>有限公司   | -                 | -      | 10,000,00<br>0.00  | 0.46%  | - | - |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日