

## 华安逆向策略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

基金份额持有人的基金份额及基金管理人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、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2015年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称	华安逆向策略混合型证券投资基金
基金代码	040035
交易代码	040035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月16日
报告期末基金份额总额	284,175,311.37份
投资目标	本基金将通过价值低估的投资，在严格控制风险的前提下，力争实现基金份额的长期稳健增值。
投资策略	在大类资产配置方面，本基金将使用定量与定性结合的研究方法对宏观经济、政策环境、资金面和市场情绪等进行综合分析，从而影响市场的投资偏好进行研究和预测，进而调整资产配置比例。本基金将通过深入研究行业基本面，配置股票等资产类别，分析和比较股票、债券等市场不同金融工具的风险收益特征，通过资产配置比例的动态调整，动态化地调整投资组合，力争把握高性价比的行业配置机会，进而为投资者创造良好的投资回报。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中债企业债收益率
风险收益特征	本基金属中型基金，基金的风险与预期收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 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	-104,888,679.09
2.本期利润	-116,567,932.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0380
4.期末基金资产净值	526,607,391.94
5.期末基金份额净值	1.860

注:1)本基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费);不包括持有人赎回时产生的费用(例如:赎回费);不包括持有人申购或赎回后基金净值的变动所导致的费用。

2)本期已实现收益指基金收入减去总费用后的余额,其中包含持有人在本报告期内均匀持有的部分。

3)本期利润为本期已实现收益加上本期期间利息收入,扣除相关费用后的余额,本期利润同时反映了本基金本期利润的实现情况。

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其同行业业绩基准收益的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业績比較基准收益 业績比較基准標準差 ③ ④ ⑤ ⑥

过去三个月 -8.64% 3.90% -22.45% 2.68% 13.81% 1.22%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩基准收益的比较

注:上图显示了本基金成立以来每万份基金单位净值的累计增长情况,并将其与同期业绩基准收益的历史走势进行对比。

(2012年8月16日至2015年9月30日)

图示:华安逆向策略混合型证券投资基金

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
谢颖	本基金的基金经理	2015-6-18	-	7年。 谢颖女士,硕士研究生,具有10年证券从业经验,历任华安基金管理有限公司研究员,担任基金经理助理,现任基金经理。谢颖女士具有丰富的行业研究经验,擅长宏观研究,尤其擅长周期行业研究,并善于挖掘行业景气度变化带来的投资机会。

注:在此处的任职日期和在任日期均指公司作出决定之日起,即以公告日为准。证券从业的含义是指从行业协会从事从业人员资格管理工作的机构处取得从业资格。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵守法律法规情况的说明

本基金报告期内,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的规定,认真履行诚信义务,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据《公开募集证券投资基金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”,将公平交易机制贯穿于基金的产研、销售、投资、评价等各个环节,并定期对公平交易情况进行评估,确保公平交易制度的有效执行。

4.4 公平交易制度的执行情况

根据《公开募集证券投资基金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”,将公平交易机制贯穿于基金的产研、销售、投资、评价等各个环节,并定期对公平交易情况进行评估,确保公平交易制度的有效执行。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

根据《公开募集证券投资基金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”,将公平交易机制贯穿于基金的产研、销售、投资、评价等各个环节,并定期对公平交易情况进行评估,确保公平交易制度的有效执行。

4.6 对报告期内基金投资策略的说明

根据《公开募集证券投资基金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”,将公平交易机制贯穿于基金的产研、销售、投资、评价等各个环节,并定期对公平交易情况进行评估,确保公平交易制度的有效执行。

4.7 报告期内基金的估值政策和程序

根据《公开募集证券投资基金估值指引(试行)》,公司制定了“华安基金管理有限公司估值政策”,并定期对估值政策和程序进行评估,确保估值政策和程序的合理性。

4.8 对报告期内基金收益分配政策和执行情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,公司制定了“华安基金管理有限公司收益分配政策”,并定期对收益分配政策和执行情况进行评估,确保收益分配政策的合理性。

4.9 报告期内管理人支付给基金销售机构的报酬情况

根据《公开募集证券投资基金销售支付报酬管理规定》,公司制定了“华安基金管理有限公司支付给基金销售机构的报酬政策”,并定期对支付给基金销售机构的报酬政策和执行情况进行评估,确保支付给基金销售机构的报酬政策的合理性。

4.10 报告期内发生的基金销售费用情况

根据《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》,公司制定了“华安基金管理有限公司基金销售费用政策”,并定期对基金销售费用政策和执行情况进行评估,确保基金销售费用政策的合理性。

4.11 报告期内发生的税收调整情况

根据《公开募集证券投资基金税收政策》,公司制定了“华安基金管理有限公司基金税收政策”,并定期对基金税收政策和执行情况进行评估,确保基金税收政策的合理性。

4.12 报告期内费用的计提、支付和归属情况

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,公司制定了“华安基金管理有限公司费用计提、支付和归属政策”,并定期对费用计提、支付和归属政策和执行情况进行评估,确保费用计提、支付和归属政策的合理性。

4.13 报告期内发生的内部控制制度的建立和执行情况

根据《公开募集证券投资基金内部控制制度》,公司制定了“华安基金管理有限公司内部控制制度”,并定期对内部控制制度和执行情况进行评估,确保内部控制制度和执行的合理性。

4.14 报告期内基金的会计政策、审计报告

根据《公开募集证券投资基金会计核算办法》,公司制定了“华安基金管理有限公司会计核算办法”,并定期对会计核算办法和执行情况进行评估,确保会计核算办法的合理性。

4.15 报告期内基金的审计情况

根据《公开募集证券投资基金审计办法》,公司制定了“华安基金管理有限公司基金审计办法”,并定期对基金审计办法和执行情况进行评估,确保基金审计办法的合理性。

4.16 报告期内基金的年度报告

根据《公开募集证券投资基金年度报告》,公司制定了“华安基金管理有限公司年度报告办法”,并定期对年度报告办法和执行情况进行评估,确保年度报告办法的合理性。

4.17 报告期内基金的季度报告

根据《公开募集证券投资基金季度报告》,公司制定了“华安基金管理有限公司季度报告办法”,并定期对季度报告办法和执行情况进行评估,确保季度报告办法的合理性。

4.18 报告期内基金的半年报

根据《公开募集证券投资基金半年报》,公司制定了“华安基金管理有限公司半年报办法”,并定期对半年报办法和执行情况进行评估,确保半年报办法的合理性。

4.19 报告期内基金的年报

根据《公开募集证券投资基金年度报告》,公司制定了“华安基金管理有限公司年报办法”,并定期对年报办法和执行情况进行评估,确保年报办法的合理性。

4.20 报告期内基金的临时公告

根据《公开募集证券投资基金临时公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司临时公告办法”,并定期对临时公告办法和执行情况进行评估,确保临时公告办法的合理性。

4.21 报告期内基金的澄清公告

根据《公开募集证券投资基金澄清公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司澄清公告办法”,并定期对澄清公告办法和执行情况进行评估,确保澄清公告办法的合理性。

4.22 报告期内基金的权益登记公告

根据《公开募集证券投资基金权益登记公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司权益登记公告办法”,并定期对权益登记公告办法和执行情况进行评估,确保权益登记公告办法的合理性。

4.23 报告期内基金的红利发放公告

根据《公开募集证券投资基金分红发放公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司分红发放公告办法”,并定期对分红发放公告办法和执行情况进行评估,确保分红发放公告办法的合理性。

4.24 报告期内基金的巨额赎回公告

根据《公开募集证券投资基金巨额赎回公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司巨额赎回公告办法”,并定期对巨额赎回公告办法和执行情况进行评估,确保巨额赎回公告办法的合理性。

4.25 报告期内基金的暂停赎回公告

根据《公开募集证券投资基金暂停赎回公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司暂停赎回公告办法”,并定期对暂停赎回公告办法和执行情况进行评估,确保暂停赎回公告办法的合理性。

4.26 报告期内基金的巨额申购公告

根据《公开募集证券投资基金巨额申购公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司巨额申购公告办法”,并定期对巨额申购公告办法和执行情况进行评估,确保巨额申购公告办法的合理性。

4.27 报告期内基金的定期定额投资业务公告

根据《公开募集证券投资基金定期定额投资业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司定期定额投资业务公告办法”,并定期对定期定额投资业务公告办法和执行情况进行评估,确保定期定额投资业务公告办法的合理性。

4.28 报告期内基金的转换业务公告

根据《公开募集证券投资基金转换业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司转换业务公告办法”,并定期对转换业务公告办法和执行情况进行评估,确保转换业务公告办法的合理性。

4.29 报告期内基金的开放申购、赎回业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放申购、赎回业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放申购、赎回业务公告办法”,并定期对开放申购、赎回业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放申购、赎回业务公告办法的合理性。

4.30 报告期内基金的开放定期定额投资业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额投资业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额投资业务公告办法”,并定期对开放定期定额投资业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额投资业务公告办法的合理性。

4.31 报告期内基金的开放转换业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放转换业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放转换业务公告办法”,并定期对开放转换业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放转换业务公告办法的合理性。

4.32 报告期内基金的开放定期定额转换业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额转换业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额转换业务公告办法”,并定期对开放定期定额转换业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额转换业务公告办法的合理性。

4.33 报告期内基金的开放定期定额申购业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额申购业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额申购业务公告办法”,并定期对开放定期定额申购业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额申购业务公告办法的合理性。

4.34 报告期内基金的开放定期定额赎回业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额赎回业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额赎回业务公告办法”,并定期对开放定期定额赎回业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额赎回业务公告办法的合理性。

4.35 报告期内基金的开放定期定额转换申购业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额转换申购业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额转换申购业务公告办法”,并定期对开放定期定额转换申购业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额转换申购业务公告办法的合理性。

4.36 报告期内基金的开放定期定额转换赎回业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额转换赎回业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额转换赎回业务公告办法”,并定期对开放定期定额转换赎回业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额转换赎回业务公告办法的合理性。

4.37 报告期内基金的开放定期定额转换份额增加业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额转换份额增加业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额转换份额增加业务公告办法”,并定期对开放定期定额转换份额增加业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额转换份额增加业务公告办法的合理性。

4.38 报告期内基金的开放定期定额转换份额减少业务公告

根据《公开募集证券投资基金开放定期定额转换份额减少业务公告》,公司制定了“华安基金管理有限公司开放定期定额转换份额减少业务公告办法”,并定期对开放定期定额转换份额减少业务公告办法和执行情况进行评估,确保开放定期定额转换份额