

华安逆向策略混合型证券投资基金
2016 年半年度报告摘要
2016 年 6 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：二〇一六年八月二十六日

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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安逆向策略混合
基金主代码	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 8 月 16 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
报告期末基金份额总额	1,271,191,752.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于价值被低估的股票，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。
投资策略	在大类资产配置方面，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。 在股票投资方面，本基金将采用基于投资者情绪的逆向择时策略、基于估值回复的进行行业配置策略、基于逆向思维进行个股精选策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	洪渊
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
----------------------	------------------

基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层；北京市西城区复兴门内大街 55 号
-------------	---

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	10,971,269.47
本期利润	36,850,957.53
加权平均基金份额本期利润	0.0354
本期基金份额净值增长率	-6.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	1.5440
期末基金资产净值	3,300,196,309.40
期末基金份额净值	2.596

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：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
过去一个月	7.67%	1.56%	-0.31%	0.79%	7.98%	0.77%
过去三个月	10.85%	1.53%	-1.74%	0.81%	12.59%	0.72%
过去六个月	-6.18%	2.35%	-12.46%	1.47%	6.28%	0.88%
过去一年	27.50%	2.77%	-22.94%	1.84%	50.44%	0.93%
过去三年	227.46%	1.98%	35.74%	1.47%	191.72%	0.51%
自基金合同生效起至今	268.72%	1.81%	29.13%	1.40%	239.59%	0.41%

注：本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$

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（包括中期票据）、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：持有的股票资产占基金资产的 60%—95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%—40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券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

华安逆向策略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
(2012 年 8 月 16 日至 2016 年 6 月 30 日)



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 2016 年 6 月 30 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、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 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		
崔莹	基金经理	2015-06-18	-	7 年	硕士，7 年从业经历。曾任齐鲁证券有限责任公司项目经理、太平洋保险集团总部资产负债匹配专员、中国中投证券行业分析师。2014 年 3 月加入华安基金管理有限公司，担任投资研究部行业分析师，基金经理助理。2015 年 6 月起同时担任本基金、华安智能装备主题

					股票型证券投资基金、华安媒体互联网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合规守信情况的说明

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 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

投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、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 1 次，未出现异常交易。

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

上半年 A 股市场整体走势先抑后扬，一季度市场跌幅较大，随后市场出现结构性行情，成交量集中在新能源汽车、OLED、半导体等板块，这些板块带动大盘全面反弹。上半年沪深 300 指数下跌 15.5%、中证 500 指数下跌 19.6%、创业板综指下跌 13.9%。报告期内，本基金依照技术升级和消费升级的配置思路，一直维持中性偏高仓位运作，虽然大类资产配置效果不佳，但得益于行业和个股选择方面产生了较好的正向超额贡献，使得本基金上半年的净值表现跑赢了业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.596 元，本报告期份额净值增长率为-6.18%，同期业绩比较基准增长率为-12.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

历史上来看，房地产的短周期一般 3-4 年，本轮地产销售回升始于 2014 年下半年，至今已接近 2 年，从信贷政策、房地产政策和购房者情绪来看，房地产很有可能进入 1 年左右的短周期调整。2014 年至 2015 年，国内货币政策处在较长时间的宽松周期，央行连续降准降息，个人住房贷款利

率由 7% 下降到接近 4.5%，购房成本大幅下降，在很大程度上推升了 2014 年年中至今的房地产反弹。未来一段时间货币政策由宽松重回稳健，除非经济出现快速下滑，否则房贷利率再次下行的概率很低。2014 年上半年开始，除一线部分城市外，全国各地逐步放开限购，但 2016 年上半年随着一线城市房价快速上涨，房地产调控政策已经拐头，3 月底上海和深圳陆续出台了更为严厉的地产政策。

英国脱欧公投结果大超市场预期，给资本市场带来了很大的冲击，其背后所代表的政治变化是值得深思的。自次贷危机以来，全球经济情况没有太大的起色，需要货币政策的持续稳定，一旦刺激政策稍有退出，经济又重回弱势，世界各主要经济体均没有找到新的经济增长点，由此带来了政治上的很多问题。

2016 年表现最好的资产非大宗商品莫属，这种剧烈反弹必将给国内通胀带来较大影响，影响货币进一步宽松，因此下半年投资重点仍然是成长股。回溯历史，从 15 年的互联网金融到 16 年至今的新能源汽车，A 股每年行情都存在主线，下半年看好新能源汽车、泛人工智能、教育、储能、电子化学品等领域的投资机会。

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：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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高级总监，总经理助理，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，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，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高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、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、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理,指数投资部高级总监。

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

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 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

本报告期内，本基金托管人在对华安逆向策略混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华安逆向策略混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安逆向策略混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安逆向策略混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安逆向策略混合型证券投资基金 2016 年上半年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安逆向策略混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	426,287,258.58	462,428,385.72
结算备付金	17,891,373.22	9,103,209.69
存出保证金	2,438,952.81	1,071,332.22
交易性金融资产	2,834,981,900.69	1,504,377,322.52
其中：股票投资	2,834,981,900.69	1,504,377,322.52
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	113,038,141.00	-
应收利息	84,876.97	64,147.40
应收股利	-	-
应收申购款	21,895,556.15	47,156,170.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,416,618,059.42	2,024,200,568.49
负债和所有者权益	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
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	-	-
应付证券清算款	8,954,248.76	76,281,780.94
应付赎回款	89,455,535.28	15,751,276.00
应付管理人报酬	3,752,507.72	1,499,116.48
应付托管费	625,417.95	249,852.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	13,124,960.35	5,576,675.24
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	509,079.96	355,364.08
负债合计	116,421,750.02	99,714,065.49
所有者权益：	-	-
实收基金	1,271,191,752.75	695,578,157.14
未分配利润	2,029,004,556.65	1,228,908,345.86
所有者权益合计	3,300,196,309.40	1,924,486,503.00
负债和所有者权益总计	3,416,618,059.42	2,024,200,568.49

6.2 利润表

会计主体：华安逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	93,074,059.14	128,736,521.66
1.利息收入	1,966,630.16	138,814.18
其中：存款利息收入	1,966,630.16	138,814.18
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	62,273,756.18	154,239,288.22
其中：股票投资收益	56,902,809.49	153,270,888.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	5,370,946.69	968,400.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	25,879,688.06	-26,286,099.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,953,984.74	644,519.08
减：二、费用	56,223,101.61	5,909,719.28
1. 管理人报酬	17,962,899.70	2,142,356.28
2. 托管费	2,993,816.59	357,059.33
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	35,082,831.52	3,254,255.72
5. 利息支出	-	-

其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	183,553.80	156,047.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	36,850,957.53	122,826,802.38
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	36,850,957.53	122,826,802.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	695,578,157.14	1,228,908,345.86	1,924,486,503.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,850,957.53	36,850,957.53
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）	575,613,595.61	763,245,253.26	1,338,858,848.87
其中：1.基金申购款	1,585,809,885.94	2,119,385,781.99	3,705,195,667.93
2.基金赎回款	-1,010,196,290.33	-1,356,140,528.73	-2,366,336,819.06
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）	1,271,191,752.75	2,029,004,556.65	3,300,196,309.40
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	235,649,231.61	83,073,856.09	318,723,087.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	122,826,802.38	122,826,802.38
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）	-144,497,423.31	-111,476,558.68	-255,973,981.99
其中：1.基金申购款	148,175,223.55	129,569,429.36	277,744,652.91
2.基金赎回款	-292,672,646.86	-241,045,988.04	-533,718,634.90

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）	91,151,808.30	94,424,099.79	185,575,908.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安逆向策略混合型证券投资基金(原名为华安逆向策略股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)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[2012]703号《关于核准华安逆向策略股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安逆向策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 232,305,855.89 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 303 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安逆向策略股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 232,412,630.24 份基金份额，其中认购资金利息折合 106,774.35 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安逆向策略股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安逆向策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安逆向策略混合型证券投资基金基金合同》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(包括中期票据)、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。本基金持有的股票资产占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2016 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安逆向策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,962,899.70	2,142,356.28
其中：支付销售机构的客户维护费	5,504,038.88	291,821.47

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,993,816.59	357,059.33

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	7,372,600.12	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,372,600.12	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.58%	-

6.4.8.4.2 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

无。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	426,287,258.58	1,805,673.67	32,504,246.32	123,696.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类型				总额	总额	
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	15,341.00	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000975	银泰资源	2016-04-19	筹划重大事项	14.39	-	-	574,473.00	7,774,446.96	8,266,666.47	-
002452	长高集团	2016-06-14	筹划重大事项	13.04	2016-07-12	10.82	224,100.00	2,689,146.00	2,922,264.00	-
300427	红相电力	2016-06-13	筹划重大事项	21.89	-	-	824,257.00	16,561,026.89	18,042,985.73	-
600203	福日电子	2016-06-30	筹划重大事项	13.80	2016-07-01	13.25	7,069,652.00	83,758,402.87	97,561,197.60	-
600330	天通股份	2016-05-23	筹划重大事项	15.90	-	-	4,544,930.00	57,765,259.91	72,264,387.00	-
600358	国旅联合	2016-04-05	筹划重大事项	13.50	2016-08-05	12.57	977,900.00	13,524,193.00	13,201,650.00	-
600475	华光股份	2016-05-18	筹划重大事项	16.29	-	-	1,852,897.00	27,118,536.14	30,183,692.13	-
600556	慧球科技	2016-01-19	筹划重大事项	16.19	2016-07-07	14.22	3,157,589.00	83,022,205.72	51,121,365.91	-
601611	中国核建	2016-06-30	股票异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	37,059.00	128,594.73	775,274.28	-
603703	盛洋科技	2016-06-20	筹划重大事项	30.73	-	-	483,200.00	14,609,026.94	14,848,736.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告**7.1 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	2,834,981,900.69	82.98
	其中：股票	2,834,981,900.69	82.98
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	444,178,631.80	13.00
7	其他各项资产	137,457,526.93	4.02
8	合计	3,416,618,059.42	100.00

7.2 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	8,266,666.47	0.25

C	制造业	2,141,779,127.26	64.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	163,471,009.03	4.95
F	批发和零售业	227,046,321.34	6.88
G	交通运输、仓储和邮政业	32,580,972.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,445,222.09	4.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	110,118,023.68	3.34
L	租赁和商务服务业	13,201,650.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	52,782.72	0.00
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	2,834,981,900.69	85.90

7.3 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	占基金资产净值比例(%)
1	000821	京山轻机	9,084,050	160,060,961.00	4.85
2	600198	大唐电信	5,788,376	115,072,914.88	3.49
3	002133	广宇集团	17,099,072	110,118,023.68	3.34
4	002537	海立美达	3,529,832	107,306,892.80	3.25
5	300449	汉邦高科	1,853,811	105,926,760.54	3.21
6	600203	福日电子	7,069,652	97,561,197.60	2.96
7	000889	茂业通信	8,894,611	96,506,529.35	2.92
8	002539	新都化工	6,174,683	94,410,903.07	2.86
9	002659	中泰桥梁	5,154,987	93,099,065.22	2.82
10	000700	模塑科技	8,633,746	87,459,846.98	2.65

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 (%)
1	002537	海立美达	195,965,457.98	10.18
2	600198	大唐电信	185,765,611.53	9.65
3	000889	茂业通信	185,237,922.00	9.63
4	600869	智慧能源	158,585,900.17	8.24
5	002048	宁波华翔	158,557,789.36	8.24
6	002464	金利科技	152,450,916.98	7.92
7	300031	宝通科技	150,782,372.65	7.83
8	000821	京山轻机	149,254,322.88	7.76
9	300115	长盈精密	143,813,259.25	7.47
10	000601	韶能股份	138,470,760.49	7.20
11	300449	汉邦高科	137,167,556.62	7.13
12	000971	高升控股	136,559,193.33	7.10
13	000606	*ST 易桥	136,314,228.32	7.08
14	600303	曙光股份	135,519,281.07	7.04
15	600096	云天化	135,243,105.23	7.03
16	300231	银信科技	125,039,898.35	6.50
17	002070	众和股份	122,513,160.70	6.37
18	002133	广宇集团	119,126,996.51	6.19
19	600203	福日电子	116,986,700.09	6.08
20	002196	方正电机	116,071,120.72	6.03
21	600076	康欣新材	115,131,704.72	5.98
22	002045	国光电器	114,897,925.06	5.97
23	300017	网宿科技	113,380,105.25	5.89
24	600366	宁波韵升	108,646,408.78	5.65
25	002325	洪涛股份	106,357,262.19	5.53
26	000700	模塑科技	105,326,540.53	5.47
27	002659	中泰桥梁	102,076,303.14	5.30
28	300207	欣旺达	101,438,070.70	5.27
29	300041	回天新材	100,245,772.14	5.21
30	600667	太极实业	99,068,861.70	5.15
31	002539	新都化工	98,224,829.54	5.10
32	002341	新纶科技	97,874,284.40	5.09
33	600330	天通股份	97,573,025.69	5.07
34	002159	三特索道	97,491,830.23	5.07
35	600114	东睦股份	95,956,584.46	4.99
36	600831	广电网络	91,166,720.22	4.74

37	002139	拓邦股份	87,291,434.94	4.54
38	300097	智云股份	84,545,683.11	4.39
39	002733	雄韬股份	82,396,859.85	4.28
40	300369	绿盟科技	81,985,580.71	4.26
41	002456	欧菲光	81,306,906.75	4.22
42	300198	纳川股份	80,103,903.25	4.16
43	300130	新国都	78,918,811.85	4.10
44	600485	信威集团	77,711,691.05	4.04
45	603729	龙韵股份	77,549,460.98	4.03
46	000831	*ST 五稀	77,512,295.81	4.03
47	002410	广联达	77,439,906.39	4.02
48	000599	青岛双星	77,092,319.92	4.01
49	300012	华测检测	76,697,303.73	3.99
50	002452	长高集团	76,461,574.48	3.97
51	601208	东材科技	74,967,396.21	3.90
52	601789	宁波建工	72,536,674.53	3.77
53	002366	台海核电	72,493,019.38	3.77
54	002224	三力士	71,648,603.94	3.72
55	000887	中鼎股份	70,981,672.49	3.69
56	300494	盛天网络	70,073,380.58	3.64
57	002409	雅克科技	69,902,980.23	3.63
58	600973	宝胜股份	67,802,513.83	3.52
59	002247	帝龙新材	67,775,575.43	3.52
60	300440	运达科技	67,773,342.67	3.52
61	601058	赛轮金宇	67,607,693.56	3.51
62	300325	德威新材	66,734,590.27	3.47
63	002104	恒宝股份	66,420,846.95	3.45
64	600273	嘉化能源	66,184,376.36	3.44
65	600803	新奥股份	65,796,814.85	3.42
66	300269	联建光电	65,605,849.47	3.41
67	002535	林州重机	64,919,043.65	3.37
68	300035	中科电气	62,523,594.93	3.25
69	300360	炬华科技	62,449,303.82	3.24
70	600641	万业企业	62,058,808.21	3.22
71	600525	长园集团	62,032,263.03	3.22
72	600219	南山铝业	61,326,098.80	3.19
73	000970	中科三环	60,458,820.54	3.14
74	600382	广东明珠	59,461,066.64	3.09
75	300183	东软载波	59,376,936.11	3.09
76	603869	北部湾旅	59,021,699.09	3.07
77	300322	硕贝德	57,845,063.51	3.01
78	002418	康盛股份	57,829,313.91	3.00
79	600257	大湖股份	57,335,022.59	2.98
80	002323	雅百特	57,237,906.59	2.97

81	300054	鼎龙股份	56,165,417.68	2.92
82	002730	电光科技	55,842,175.42	2.90
83	000795	英洛华	55,066,726.48	2.86
84	002428	云南锗业	55,048,719.63	2.86
85	002426	胜利精密	54,815,975.30	2.85
86	600459	贵研铂业	54,069,531.12	2.81
87	600727	鲁北化工	53,328,214.59	2.77
88	600077	宋都股份	52,574,785.98	2.73
89	300336	新文化	52,538,831.43	2.73
90	300011	鼎汉技术	52,361,727.16	2.72
91	600647	同达创业	51,336,823.29	2.67
92	002090	金智科技	51,029,626.29	2.65
93	600486	扬农化工	49,490,259.47	2.57
94	002358	森源电气	49,209,310.95	2.56
95	601799	星宇股份	48,951,913.74	2.54
96	300458	全志科技	48,634,258.47	2.53
97	002152	广电运通	48,583,008.43	2.52
98	600759	洲际油气	48,345,981.61	2.51
99	300306	远方光电	48,076,636.47	2.50
100	002097	山河智能	48,021,574.66	2.50
101	600192	长城电工	46,356,695.91	2.41
102	002694	顾地科技	46,305,997.93	2.41
103	002328	新朋股份	45,754,559.83	2.38
104	002050	三花股份	45,043,196.25	2.34
105	000404	华意压缩	43,438,583.77	2.26
106	600688	上海石化	43,092,104.48	2.24
107	603377	东方时尚	42,851,263.96	2.23
108	002006	精功科技	42,582,714.83	2.21
109	002439	启明星辰	42,575,235.63	2.21
110	000697	炼石有色	41,609,559.70	2.16
111	600699	均胜电子	40,910,226.19	2.13
112	601028	玉龙股份	39,566,244.24	2.06
113	600885	宏发股份	39,289,153.12	2.04
114	002268	卫士通	39,191,681.58	2.04
115	600056	中国医药	38,681,986.02	2.01
116	002305	南国置业	38,664,311.94	2.01
117	000758	中色股份	38,624,963.67	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。

7.4.2 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 (%)
1	600869	智慧能源	200,607,684.05	10.42
2	000601	韶能股份	189,216,091.78	9.83
3	002048	宁波华翔	171,793,762.65	8.93
4	002070	众和股份	165,836,171.12	8.62
5	002464	金利科技	165,471,550.03	8.60
6	300031	宝通科技	161,379,725.23	8.39
7	600096	云天化	143,142,367.22	7.44
8	600303	曙光股份	140,951,485.01	7.32
9	300231	银信科技	134,638,192.89	7.00
10	002045	国光电器	130,879,475.76	6.80
11	000971	高升控股	128,230,752.20	6.66
12	600076	康欣新材	123,624,470.83	6.42
13	002196	方正电机	119,080,236.68	6.19
14	002159	三特索道	118,271,995.92	6.15
15	300017	网宿科技	112,902,321.96	5.87
16	600366	宁波韵升	112,801,396.49	5.86
17	002323	雅百特	108,390,911.48	5.63
18	002537	海立美达	104,657,242.34	5.44
19	300207	欣旺达	104,507,897.72	5.43
20	002341	新纶科技	101,078,388.50	5.25
21	600198	大唐电信	100,274,417.00	5.21
22	600831	广电网络	97,677,045.80	5.08
23	300097	智云股份	94,058,936.49	4.89
24	002456	欧菲光	92,778,389.85	4.82
25	300198	纳川股份	92,506,283.43	4.81
26	000889	茂业通信	91,490,008.57	4.75
27	000606	*ST 易桥	87,177,845.70	4.53
28	002139	拓邦股份	86,368,149.28	4.49
29	002452	长高集团	84,395,262.67	4.39
30	300035	中科电气	84,187,449.15	4.37
31	300115	长盈精密	82,825,696.97	4.30
32	002152	广电运通	81,559,244.27	4.24
33	300130	新国都	80,660,528.39	4.19
34	002477	雏鹰农牧	78,453,676.77	4.08
35	600485	信威集团	78,209,006.37	4.06
36	300012	华测检测	77,274,341.28	4.02
37	002410	广联达	76,951,751.34	4.00
38	601789	宁波建工	74,895,873.59	3.89
39	000831	*ST 五稀	73,089,183.79	3.80
40	300494	盛天网络	73,052,414.07	3.80
41	000887	中鼎股份	72,383,496.04	3.76
42	002467	二六三	71,579,014.12	3.72

43	603729	龙韵股份	71,137,216.57	3.70
44	002366	台海核电	70,421,139.31	3.66
45	300440	运达科技	69,203,796.20	3.60
46	600382	广东明珠	68,611,964.28	3.57
47	600257	大湖股份	68,271,004.16	3.55
48	600973	宝胜股份	67,916,620.98	3.53
49	000599	青岛双星	67,721,497.41	3.52
50	300458	全志科技	66,796,379.72	3.47
51	600641	万业企业	66,793,348.55	3.47
52	300183	东软载波	65,479,493.58	3.40
53	600273	嘉化能源	65,181,638.45	3.39
54	002104	恒宝股份	64,211,751.99	3.34
55	601058	赛轮金宇	63,048,095.62	3.28
56	600647	同达创业	62,902,199.03	3.27
57	603869	北部湾旅	62,885,089.16	3.27
58	002224	三力士	62,788,315.36	3.26
59	600525	长园集团	62,445,360.92	3.24
60	600561	江西长运	62,108,769.22	3.23
61	600459	贵研铂业	61,870,206.76	3.21
62	600114	东睦股份	61,626,442.28	3.20
63	600219	南山铝业	61,619,878.54	3.20
64	000970	中科三环	60,242,444.96	3.13
65	600225	天津松江	59,987,786.68	3.12
66	002730	电光科技	57,624,249.85	2.99
67	300054	鼎龙股份	57,306,692.73	2.98
68	300306	远方光电	56,746,592.99	2.95
69	002247	帝龙新材	56,168,282.01	2.92
70	600192	长城电工	55,898,614.31	2.90
71	002426	胜利精密	55,458,239.12	2.88
72	600520	*ST 中发	54,285,808.70	2.82
73	300011	鼎汉技术	53,302,538.69	2.77
74	000795	英洛华	52,395,904.63	2.72
75	600727	鲁北化工	52,345,471.60	2.72
76	300336	新文化	51,814,771.14	2.69
77	002050	三花股份	51,671,236.90	2.68
78	000607	华媒控股	50,070,237.65	2.60
79	002428	云南锗业	49,703,147.72	2.58
80	300360	炬华科技	49,660,533.92	2.58
81	601799	星宇股份	49,217,897.58	2.56
82	600203	福日电子	48,700,032.37	2.53
83	600486	扬农化工	48,447,157.53	2.52
84	002358	森源电气	48,044,337.72	2.50
85	300384	三联虹普	47,607,236.46	2.47
86	000586	汇源通信	47,174,639.61	2.45

87	600699	均胜电子	46,888,848.35	2.44
88	600077	宋都股份	46,347,686.20	2.41
89	600667	太极实业	46,052,632.65	2.39
90	002097	山河智能	45,347,007.94	2.36
91	600759	洲际油气	44,595,393.03	2.32
92	601028	玉龙股份	43,314,942.21	2.25
93	000967	盈峰环境	43,275,895.73	2.25
94	300449	汉邦高科	43,146,242.27	2.24
95	600885	宏发股份	42,781,210.71	2.22
96	603377	东方时尚	42,390,138.11	2.20
97	600688	上海石化	41,675,003.51	2.17
98	600392	盛和资源	41,131,488.71	2.14
99	000404	华意压缩	41,039,374.21	2.13
100	000680	山推股份	40,954,694.06	2.13
101	600330	天通股份	40,065,163.58	2.08
102	600563	法拉电子	39,982,475.51	2.08
103	600075	新疆天业	39,856,207.19	2.07
104	603023	威帝股份	39,639,812.52	2.06
105	002328	新朋股份	39,386,201.74	2.05
106	002587	奥拓电子	39,329,475.71	2.04
107	000702	正虹科技	39,059,625.53	2.03
108	000758	中色股份	38,863,144.82	2.02
109	000697	炼石有色	38,732,031.06	2.01
110	600071	凤凰光学	38,671,067.37	2.01
111	600056	中国医药	38,493,197.36	2.00

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,475,409,693.61
卖出股票的收入（成交）总额	11,227,587,612.99

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。

7.5 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。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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。

7.8 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投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。在风险可控的前提下，本基金本着审慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,438,952.81
2	应收证券清算款	113,038,141.00
3	应收股利	-
4	应收利息	84,876.97
5	应收申购款	21,895,556.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,457,526.93

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	600203	福日电子	97,561,197.60	2.96	筹划重大事 项停牌

8 基金份额持有人信息

8.1 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 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 比例	持有份额	占总份额 比例
114,698	11,082.95	440,453,773.56	34.65%	830,737,979.19	65.35%

8.2 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	1,329,585.96	0.10%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0-10 万之间；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 8 月 16 日）基金份额总额	232,412,630.24
本报告期期初基金份额总额	695,578,157.14
本报告期基金总申购份额	1,585,809,885.94
减：本报告期基金总赎回份额	1,010,196,290.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,271,191,752.75

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
广发华福	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	5,169,041,519.14	21.81%	4,710,556.46	21.65%	-
中金公司	1	4,598,955,004.12	19.40%	4,283,002.18	19.69%	-
中泰证券	2	3,610,701,287.50	15.23%	3,290,434.04	15.13%	-
招商证券	1	2,647,477,274.91	11.17%	2,412,648.64	11.09%	-
华泰证券	1	1,655,593,869.07	6.99%	1,508,743.89	6.94%	-
广发证券	1	1,580,829,695.58	6.67%	1,440,612.50	6.62%	-
国泰君安	1	700,236,896.71	2.95%	638,126.04	2.93%	-
上海证券	2	666,063,414.41	2.81%	620,304.12	2.85%	-
国金证券	2	626,534,339.20	2.64%	570,960.60	2.62%	-
华创证券	1	610,602,342.99	2.58%	568,649.58	2.61%	-
兴业证券	1	577,524,753.36	2.44%	537,844.75	2.47%	-
银河证券	1	565,646,410.33	2.39%	526,785.86	2.42%	-

国信证券	1	455,073,249.35	1.92%	423,808.75	1.95%	-
信达证券	1	156,175,739.24	0.66%	145,446.69	0.67%	-
中信证券	1	80,436,151.38	0.34%	74,911.94	0.34%	-
西藏同信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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：

2016 年 4 月完成租用托管在工商银行西藏同信证券交易单元 395395。

10.7.2 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
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西藏同信证券	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日