华安季付驱动量化策略混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-20

重要提示

基金管理人的董事会及董事会成员保证所载资料的不虚假、不存在误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19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，但不能保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期内2019年1月1日至3月31日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	华安季付驱动量化策略混合
场内简称	-
基金主代码	002179
基金运作方式	契约型开放式
成立日期	2018-12-14
报告期末基金份额总额	38,935,065.32 份
投资目标	本基金严格控制投资的风险的前提下，利用公开信息，通过量化方法，发现可持续上涨公司组成本基金的产生真正影响因素变化，对冲市场系统性风险，力争为投资者获取长期稳健的收益。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过对基金资产的配置，控制投资组合工具之间的风险敞口，并在当期市场行情出现明显变动或者基金资产的实际组合情况，未来出现明显变动的情况下，本基金将视情况调整资产配置比例。本基金将根据宏观经济、证券市场行业景气度、证券市场流动性、市场情绪等因素，通过定性研究，确定大类资产配置比例，并在该大类资产配置比例范围内，根据市场情况，在基金合同约定的投资比例范围内，本基金主要根据市场估值变化情况调整股票投资比例，在股票投资组合比例，对定量与定性相结合的方法选择最有长期增值潜力的股票，并在该大类资产配置比例范围内，根据市场情况，在基金合同约定的投资比例范围内，本基金主要根据市场估值变化情况调整股票投资比例，在股票投资组合比例，对定量与定性相结合的方法选择最有长期增值潜力的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×85%
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	中国农业银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01 至 2019-03-31）
本期已实现利润	-5,989,324.12
本期利润	-11,848,188.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1842
期末基金资产净值	32,987,065.30
期末基金份额净值	0.847

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：认购费或赎回费等）。计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现利润是本期利润减去、加变动数、公允价值变动损益、投资收益差额后的金额。本期利润为本期已实现利润加上本期公允价值变动损益。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-26.92 %	1.48 %	-22.32 %	1.10 %	-4.59 %	0.38 %

自基金合同生效以来基金净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-01至2019-03-31）
其他指标	报告期（2019-03-31）

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨磊成	本基金的基金经理，指数与量化投资部部总监	2018-12-19	-	9年	硕士研究生，9年基金从业资格证书，具有基金从业资格证书，2010年应届毕业进入华安基金，历任量化投资数据管理岗数据管理师，指数投资岗，指数投资部副总监，现任指数与量化投资部部总监，2015年加深CFA指数证券投资基金（CIP）的基金研究，2015年3月取得CFA证书，2018年12月取得证券从业资格证书，2018年1月担任本基金的基金经理，2017年1月起，同时担任华安稳健双利债券型证券投资基金，2017年12月起，同时担任华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理，2019年1月起，同时担任本基金的基金经理，2017年1月起，同时担任华安稳健双利债券型证券投资基金，华安量化多因子股票型证券投资基金的基金经理，2017年12月起，同时担任华安沪深300量化增强型指数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以合同生效日计算，特别注意日期为，证券从业的年之最或从业资格证书证券从业年限按照中国证券业协会的规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，经核查相关报告期内的投资，本报告期内，管理人在投资决策时，合理合法，不存在违法违规或未履行职责公允对待投资组合。

公平交易专项说明

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》，组织机构建立、审批流程、投资管理严格控制公平交易的管理程序、利润核算、交易执行等方面全面确立了公平交易管理体系。具体措施如下：研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究意见、投资建议过程中，按照适当方法，发证券时，并在证券池内管理或有等级之间或确保各类投资组合的投资可以公平获得信息获取机会，在投资决策时，公司各投资组合的投资决策程序是独立的，投资决策时，公司各投资组合的投资决策程序是独立的，投资决策时，投资经理根据各投资组合投资目标、投资范围、投资限制以投资组合资产的实际情况，独立做出投资决策，投资经理根据投资组合的实际情况，独立做出投资决策，投资经理根据投资组合的实际情况，独立做出投资决策，投资经理根据投资组合