华安可转换债券债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
报告期末基金份额总额	352,590,861.88份	
投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种,在控制风险和保持流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。	
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	142,278,699.78份	210,312,162.10份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
1.本期已实现收益	87,117,581.94	119,810,906.84
2.本期利润	35,006,483.83	38,448,328.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.1686	0.1343
4.期末基金资产净值	261,674,517.35	380,422,242.24
5.期末基金份额净值	1.839	1.809

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.华安可转债债券A类:

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	7.92%	3.50%	-3.65%	2.49%	11.57%	1.01%

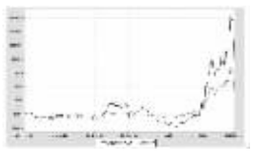
2.华安可转债债券B类:

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	7.81%	3.50%	-3.65%	2.49%	11.46%	1.01%

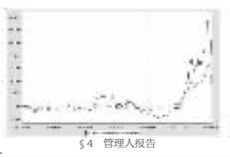
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安可转换债券债券型证券投资基金
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
(2011年6月22日至2015年6月30日)

1. 华安可转债债券A类



2. 华安可转债债券B类



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理,固定收益部总监	2011-6-22	-	17年	金融学硕士(金融工程方向),17年证券、基金从业经历,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。2008年4月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011年4月起同时担任本基金的基金经理。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6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理,固定收益部副总监。2013年8月起担任固定收益部副总监。2013年10月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2014年7月起同时担任华安红财通货币市场基金的基金经理。2015年2月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起担任固定收益部副总监。2015年5月起担任华安新回报灵活配置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、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 公平交易专项说明

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。

基金经理人对宏观、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,美国经济持续温和扩张,制造业PMI连续3个月企稳回升,就业市场回暖趋势较为温和,联储下调了经济增长预期,但年内加息的可能性仍然较大,美元指数继续震荡调整。欧元区经济表现平稳,制造业和服务业PMI均在6月企稳回升,失业率继续小幅改善。国内经济仍然处于寻底过程,制造业和房地产投资增速微幅回升,但投资金额实现新基建投资增速明显下滑,4-5月固定资产投资增速持续下降,消费增速低位平稳,贸易继续呈现衰退式增长。在需求低迷背景下,通胀低位回落,虽有基数效应影响,但目前低通胀压力仍存。货币政策在三季度转向全面宽松,央行2次下调基准利率合计0.5个百分点,1次全面降准1个百分点,另辅以定向降准、增加抵押补充贷款频度等促进经济转型。三季度股票市场冲高回落,季初主题投资盛行,杠杆资金涌入快速推升股指;季末随着监管加强、股市调整,去杠杆资金短互踩踏,股指大幅回落,尽管国家出台多项稳定市场的措施,但股市颓势短期内较难扭转。三季度转债在正股上涨带动下震荡上涨,多只转债在股市剧内完成提前赎回,目前市场上仅存7只转债和23只交换债,6月下旬后转债受正股下跌和估值下降带动大幅调整。本基金在报告期内逐步降低了转债仓位,对持股结构进行了调整。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,华安可转债债券A份额净值为1.839元,B份额净值为1.809元;华安可转债债券A份额净值增长率为7.92%,B份额净值增长率为7.81%,同期业绩比较基准增长率为-3.65%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,美国经济稳健复苏,对于加息美联储态度较为谨慎,预计加息频率会低于市场预期。欧元区经济预期将保持复苏步伐,但"希腊退欧风险"将对欧盟经济的产生冲击。国内经济将呈现低位整固走势,目前来看房地产销售数据一枝独秀,但由于高库存,供求失衡以及行业前景变化,预计房地产投资仍处于强势状态;随着地方债务置换的逐步推进和地方融资条件的放松,后续稳增长政策内涵地执行或将推动基建投资增速轻微反弹。6月27日央行再次降低基准利率并对符合要求的银行进行定向降准,表明货币政策宽松的基调并未发生变化,因此预计三季度资金面仍将保持总体宽松的格局。随着近期股市的大幅调整,市场风险偏好将会有明显下降,转债溢价率过高的现象将会有所修正,随着供给增加,转债市场可投资范围将扩宽。预计股票市场呈现寻底走势,短期再次大幅上扬需要更多的外部变量变化。本基金将保持适中的转债仓位,并利用新券上市,择机调整持仓结构,适度压低股票持仓等待更好地配置时机。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	92,783,532.00	9.18
	其中:股票	92,783,532.00	9.18
2	固定收益投资	805,654,150.60	79.71
	其中:债券	805,654,150.60	79.71
	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	93,156,368.65	9.22
7	其他资产	19,174,835.36	1.90
8	合计	1,010,768,886.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	24,750.00	0.00
C	制造业	37,237,740.00	5.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,720,000.00	1.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,250,000.00	5.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,576,000.00	1.96
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	2,975,042.00	0.46
	合计	92,783,532.00	14.45

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002308	威创股份	1,200,000	37,200,000.00	5.79
2	002268	卫士通	200,000	16,960,000.00	2.64
3	002405	四维图新	300,000	13,140,000.00	2.05
4	600706	曲江文旅	600,000	12,576,000.00	1.96
5	600820	隧道股份	500,000	6,720,000.00	1.05
6	600037	歌华有线	100,000	3,150,000.00	0.49
7	600895	张江高科	102,200	2,975,042.00	0.46
8	300458	全志科技	500	37,740.00	0.01
9	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,140,000.00	6.25
	其中:政策性金融债	40,140,000.00	6.25
4	企业债券	567,415,892.70	88.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	198,098,257.90	30.85
8	其他	-	-
9	合计	805,654,150.60	125.47

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132001	14宝钢EB	1,432,970	264,999,142.10	41.27
2	126018	08江铜债	1,843,400	181,335,258.00	28.24
3	128009	歌尔转债	630,000	100,031,400.00	15.58
4	110030	格力转债	280,000	53,796,400.00	8.38
5	126019	09长虹债	512,380	51,142,777.00	7.96

5.6 报告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。

5.7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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 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。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,253,930.27
2	应收证券清算款	3,343,357.07
3	应收股利	-
4	应收利息	5,316,958.75
5	应收申购款	9,260,589.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,174,835.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	100,031,400.00	15.58
2	110030	格力转债	53,796,400.00	8.38
3	113501	洛钼转债	43,001,901.60	6.70

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002308	威创股份	37,200,000.00	5.79	重大事项停牌
2	002268	卫士通	16,960,000.00	2.64	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
报告期期初基金份额总额	357,623,505.46	560,585,398.27
报告期期间基金总申购份额	137,745,682.21	438,222,829.07
减:报告期期间基金总赎回份额	353,090,487.89	788,496,065.24
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	142,278,699.78	210,312,162.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安可转换债券债券型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

华安纳斯达克100指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安纳斯达克100指数
基金主代码	040046
交易代码	040046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月2日
报告期末基金份额总额	17,879,118.95份
投资目标	本基金为股票指数基金,通过严格的指数化投资策略与风险控制,紧密跟踪标的指数,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,跟踪标的指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。 本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过4%(以美元计价计算)。
业绩比较基准	纳斯达克100价格指数(Nasdaq 100 Price Index)收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,790,350.79
2.本期利润	457,905.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0199
4.期末基金资产净值	23,113,927.26
5.期末基金份额净值	1.293

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

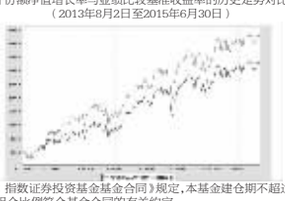
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.70%	0.81%	0.98%	0.82%	-0.28%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安纳斯达克100指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年8月2日至2015年6月30日)



注:根据《华安纳斯达克100 指数证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期不超过6个月。基金管理人在基金合同生效后6个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐宜宜	本基金的基金经理	2013-8-2	-	9年	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),9年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及本基金的基金经理。2013年12月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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,超过授权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;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以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0次,未出现异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年2季度,纳斯达克100指数上涨1.74%,指数成分股表现活跃。特别是互联网和生物医药行业,均创出去十年新高。单季度,苹果股票上涨1.2%,英特尔下跌2.73%。总体来看,纳斯达克100指数延续了过去三年以来的趋势,继续大幅跑赢周期股,小盘股,说明美国经济已经进入科技创新带动的新阶段。从美国宏观数据来看,2015年一季度实际GDP增速减缓,但就业数据向好,房屋新开工面积均高于预期。我们认为,美国经济新的一轮经济增长仍然是科技创新驱动型。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.293元,本报告期份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准增长率为0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计纳斯达克指数基金在2015年将继续保持良好的投资收益。美国经济进一步走强的信号将持续显现,并进一步体现在企业盈利中。从基本面来看,美国科技股估值仍然合理,创新能力和成长性依旧具有全球优势。

作为纳斯达克100指数基金的管理人,我们继续坚持积极将基金组合与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本基金自2015年4月1日至2015年6月30日基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,074,110.04	85.14
	其中:普通股	23,074,110.04	85.14
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,730,591.70	6.39
8	其他各项资产	2,295,618.99	8.47
9	合计	27,100,320.73	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	23,074,110.04	99.83

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
工业	498,753.61	2.16
信息技术	12,750,900.14	55.17
非必需消费品	4,328,576.56	18.73
能源	-	-
保健	3,962,514.57	17.14
公用事业	-	-
必需消费品	1,226,418.72	5.31
电信服务	217,094.86	0.94
材料	85,193.02	0.37
合计	23,069,451.48	99.81

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	4,658.56	0.02
合计	4,658.56	0.02

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 报告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及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克市场	美国	3,400	2,607,114.15	11.28
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克市场	美国	5,100	1,376,568.74	5.96
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克市场	美国	400	1,061,541.05	4.59
4	FACEBOOK INC	Facebook公司	FB US	纳斯达克市场	美国	1,900	996,232.52	4.31
5	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克市场	美国	300	954,656.98	4.13
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克市场	美国	1,000	715,780.29	3.10
7	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克市场	美国	4,000	671,517.82	2.91
8	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	CMCSA US	纳斯达克市场	美国	1,800	661,809.43	2.86
9	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克市场	美国	200	660,317.71	2.86
10	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克市场	美国	3,300	613,618.98	2.65

5.4.2 积极投资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益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	EQUINIX INC	易昆尼克斯公司	EQIX US	纳斯达克市场	美国	3	4,658.56	0.02

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,252,035.41
3	应收股利	10,357.84
4	应收利息	161.96
5	应收申购款	33,063.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,295,618.99

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	26,810,496.69
报告期期间基金总申购份额	1,434,052.08
减:报告期期间基金总赎回份额	10,365,429.82
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	17,879,118.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安纳斯达克100 指数证券投资基金基金合同》

2、《华安纳斯达克100 指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安纳斯达克100 指数证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

华安逆向策略股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示