

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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:二〇一五年十月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员在所披露文件上不存在虚假记载、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、及时性承担个别法律责任。

基金托管人和代销机构在所披露文件上不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金销售人员在以诚实信用、勤勉尽责的原则履行基金销售职责时，不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华安国企改革主题灵活配置混合

基金代码:001445

交易代码:001446

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2015年6月20日

报告期末基金份额总额:1,361,461,471.42份

投资目标:本基金主要投资于国民经济基础行业中的上市公司的股票，同时根据宏观经济形势变化，适时调整投资组合，通过精选个股，力争实现超越业绩基准的投资回报。

投资策略:本基金将结合代表指数未来表现、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2015年9月30日止。

§ 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 -39,206,622.97

2.本期利润 -166,458,197.89

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1065

4.期末基金资产净值 1,171,403,370.10

5.期末基金份额净值 0.897

注:1.所列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、红利再投费、基金转换费等),计算费用后实际盈亏要低于所列数字。

2.本报告期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除非相关费用后的余额,本期期初为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.21 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -13.30% 3.10% -13.96% 1.71% 0.66% 1.39%

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

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2015年6月20日至2015年9月30日)

3.23 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -13.30% 3.10% -13.96% 1.71% 0.66% 1.39%

注:本基金于2015年6月29日成立,2015年12月20日建仓期截止。

§ 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 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨明 本基金的基金经理、投资总监 2015-6-29 - 15年 中央财经大学硕士研究生,15年金融行业经验,曾任研究员、交易员及基金经理助理,2004年10月加入华安基金管理有限公司,曾先后任研究发展部研究员、项目经理,现任研究发展部总监,2013年6月起担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任本基金的基金经理。

苏炳添 本基金的基金经理、全球宏观策略总监 2015-6-29 - 11年 博士,上海交通大学金融学硕士,华安基金管理有限公司高级研究员,2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后任研究发展部研究员、项目经理,2010年9月起担任华安港股精选基金经理,2011年6月同时担任华安大中华区定期配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任本基金的基金经理。

王璐 本基金的基金经理 2015-7-17 - 13年 博士,中国科学院工业工程专业毕业,曾在上海市浦东新区企业咨询公司工作,2008年进入华安基金管理有限公司,历任研究员、交易员及基金经理助理,2010年5月加入华安基金,曾任华安大中华区定期配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年7月起担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任本基金的基金经理。

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》的规定。

4.2 公司基本情况的说明

4.3 公司内部交易的说明

4.4 报告期内基金的利润分配情况

4.5 报告期内的费用情况

4.6 报告期内的收入情况

4.7 报告期内的现金流量情况

4.8 报告期内的关联交易情况

4.9 报告期内的市场价格情况

4.10 报告期内的基金投资策略和运作分析

4.11 报告期内基金的估值政策和程序

4.12 报告期内基金的会计政策

4.13 报告期内基金的税收政策

4.14 报告期内基金的费用情况

4.15 报告期内对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.16 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.17 管理人对基金未来业绩的展望

4.18 管理人对基金投资组合的分析

4.19 管理人对基金业绩的评价

4.20 管理人对基金投资策略和运作分析

4.21 管理人对宏观经济的简要分析

4.22 管理人对证券市场的简要分析

4.23 管理人对行业发展的简要分析

4.24 管理人对风格的简要分析

4.25 管理人对估值方法的简要分析

4.26 管理人对流动性管理的简要分析

4.27 管理人对投资组合的分析

4.28 管理人对基金业绩的评价

4.29 管理人对基金投资策略和运作分析

4.30 管理人对宏观经济的简要分析

4.31 管理人对证券市场的简要分析

4.32 管理人对行业发展的简要分析

4.33 管理人对风格的简要分析

4.34 管理人对估值方法的简要分析

4.35 管理人对流动性管理的简要分析

4.36 管理人对投资组合的分析

4.37 管理人对基金业绩的评价

4.38 管理人对基金投资策略和运作分析

4.39 管理人对宏观经济的简要分析

4.40 管理人对证券市场的简要分析

4.41 管理人对行业发展的简要分析

4.42 管理人对风格的简要分析

4.43 管理人对估值方法的简要分析

4.44 管理人对流动性管理的简要分析

4.45 管理人对投资组合的分析

4.46 管理人对基金业绩的评价

4.47 管理人对基金投资策略和运作分析

4.48 管理人对宏观经济的简要分析

4.49 管理人对证券市场的简要分析

4.50 管理人对行业发展的简要分析

4.51 管理人对风格的简要分析

4.52 管理人对估值方法的简要分析

4.53 管理人对流动性管理的简要分析

4.54 管理人对投资组合的分析

4.55 管理人对基金业绩的评价

4.56 管理人对基金投资策略和运作分析

4.57 管理人对宏观经济的简要分析

4.58 管理人对证券市场的简要分析

4.59 管理人对行业发展的简要分析

4.60 管理人对风格的简要分析

4.61 管理人对估值方法的简要分析

4.62 管理人对流动性管理的简要分析

4.63 管理人对投资组合的分析

4.64 管理人对基金业绩的评价

4.65 管理人对基金投资策略和运作分析

4.66 管理人对宏观经济的简要分析

4.67 管理人对证券市场的简要分析

4.68 管理人对行业发展的简要分析

4.69 管理人对风格的简要分析

4.70 管理人对估值方法的简要分析

4.71 管理人对流动性管理的简要分析

4.72 管理人对投资组合的分析

4.73 管理人对基金业绩的评价

4.74 管理人对基金投资策略和运作分析

4.75 管理人对宏观经济的简要分析

4.76 管理人对证券市场的简要分析

4.77 管理人对行业发展的简要分析

4.78 管理人对风格的简要分析

4.79 管理人对估值方法的简要分析

4.80 管理人对流动性管理的简要分析

4.81 管理人对投资组合的分析

4.82 管理人对基金业绩的评价

4.83 管理人对基金投资策略和运作分析

4.84 管理人对宏观经济的简要分析

4.85 管理人对证券市场的简要分析

4.86 管理人对行业发展的简要分析

4.87 管理人对风格的简要分析

4.88 管理人对估值方法的简要分析

4.89 管理人对流动性管理的简要分析

4.90 管理人对投资组合的分析

4.91 管理人对基金业绩的评价

4.92 管理人对基金投资策略和运作分析

4.93 管理人对宏观经济的简要分析

4.94 管理人对证券市场的简要分析

4.95 管理人对行业发展的简要分析

4.96 管理人对风格的简要分析

4.97 管理人对估值方法的简要分析

4.98 管理人对流动性管理的简要分析

4.99 管理人对投资组合的分析

4.10 管理人对基金业绩的评价