

华安新丝路主题股票型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十九日

1.1 重要提示及目录

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告中不存在虚假记载、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月25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、投资组合比例等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证投资收益最低。

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。

本报告期内自2015年4月30日至6月30日止。

基金基本情况	基金简介
基金名称: 华安新丝路主题股票型证券投资基金	基金代码: 001104
基金简称: 华安新丝路	基金简称: 001104
基金运作方式: 契约型开放式	基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2015年4月9日	基金合同生效日: 2015年4月9日
基金管理人: 华安基金管理有限公司	基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 中国银行股份有限公司	基金托管人: 中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额: 6,536,627,907.10份	报告期末基金份额总额: 6,536,627,907.10份
基金资产净值: 不定期	基金资产净值: 不定期
投资目标: 本基金重点投资于与丝绸之路经济带相关的子行业龙头公司,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。	投资目标: 本基金重点投资于与丝绸之路经济带相关的子行业龙头公司,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。
投资策略: 本基金采取相对稳定的资产配置策略,影响环境下保持适度超配比例,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。本基金采取定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、行业景气度、市场估值等因素进行跟踪研究,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。本基金采取定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、行业景气度、市场估值等因素进行跟踪研究,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。	投资策略: 本基金采取相对稳定的资产配置策略,影响环境下保持适度超配比例,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。本基金采取定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、行业景气度、市场估值等因素进行跟踪研究,在严格控制风险的前提下,力争实现长期投资资本增值和资产的长期稳健增值。
业绩比较基准: 90%×中证1000指数收益率+10%×中国债券综合收益利率	业绩比较基准: 90%×中证1000指数收益率+10%×中国债券综合收益利率
风险收益特征: 本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益要高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险收益品种。	风险收益特征: 本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益要高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险收益品种。

基金管理人及基金托管人	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
法定代表人	王长林	王长林
联系电话	021-38969900	010-66494896
电子邮箱	qinshun@huawen.com.cn	ts@bankofchina.com
客户服务电话	4008880009	95566
网址	021-68893414	010-66494842

主要会计数据和财务指标	主要财务指标和基金净值表现
1.1.1 期间业绩指标	截至2015年6月30日
本期3个月收益率	189.360,52445%
本期1个月收益率	229.438,96669%
成立以来基金份额净值增长率	0.02%
1.1.2 业绩比较基准	2.70%
1.1.3 业绩比较基准	0.0254%
期末基金份额净值	6.714,396,3437
期末基金份额净值	1.027

注:1.本基金于2015年4月9日成立,以下数据统计区间为2015年4月9日至2015年6月30日。
2.2.2 基金合同生效以来,本基金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

日期	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	①-②	③-④
过去一个月	1.28%	2.06%	-0.67%	2.81%
过去三个月	2.70%	1.33%	6.22%	2.18%
至今	1.23%	0.0254%	1.21%	-0.52%

注:1.本基金于2015年4月9日成立,以下数据统计区间为2015年4月9日至2015年6月30日。
2.2.2 基金合同生效以来,本基金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

项目	本期
一、收入	266,510,78874
1.利息收入	14,309,44627
其中:存款利息收入	7,016,99767
债券利息收入	-
公允价值变动损益	177,268,4427
其他业务收入	2,922,68669
其他利得和损失	-
2.公允价值变动损益	206,869,16741
3.其他业务收入	177,132,73607
4.其他利得和损失	-
二、费用	37,471,76226
1.管理人报酬	28,693,38381
2.托管费	4,482,22069
3.销售服务费	5,988,728334
4.其他费用	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	127,445246
三、利润总额(亏损总额)“=1-2”	229,438,96669
减:所得税费用	-
净利润(净亏损)“=3-4”	229,438,96669

注:1.本基金于2015年4月9日成立,因此无上年度末数据。
2.报告期末自2015年6月30日,基金份额净值1.027元,基金份额总额6,536,627,907.10份。
3.2.2 基金合同生效以来,本基金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

项目	本期
一、期初所有者权益(基金净值)	7,822,760,56956
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-229,438,96669
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(含申购和赎回)	-1,286,132,66246
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(现金红利)	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,536,627,90710

注:本基金2015年4月9日成立,因此无上年度可比期间数据。
报告期末持有基金份额的基金份额持有人户数、基金份额数量情况表:
基金持有人户数(户数)及基金份额数量
基金持有人户数(户数)及基金份额数量
基金持有人户数(户数)及基金份额数量

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
4.8 报告期内基金利润分配情况的说明
4.9 报告期内基金利润分配情况的说明

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况的说明
5.2 报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在华安新丝路主题股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的投资过程中,严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了托管人的义务。

6.1 资产负债表
6.2 利润表
6.3 所有者权益变动表

资产	期末
货币资金	2,527,794,93309
结算备付金	70,326,86247
交易性金融资产	4,511,207,11596
其中:股票投资	4,511,207,11596
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
买入返售金融资产	-
其他金融资产	-
应收款项	54,752,09848
预付款项	688,05647
应收股利	-
应收利息	3,300,23689
递延所得税资产	-
其他资产	3,298,79604
资产总计	7,181,806,39338

负债	期末
短期借款	-
交易性金融负债	-
应付短期融资款	38,273,26846
应付账款	411,969,01530
应付管理人报酬	10,469,46222
应付托管费	1,674,98227
应付销售服务费	-
应付利息	4,815,07922
应付股利	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	620,196330
负债合计	467,409,60601
所有者权益	6,536,627,90710
实收基金	6,536,627,90710
未分配利润	-
所有者权益合计	6,536,627,90710

注:1.本基金于2015年4月9日成立,因此无上年度末数据。
2.报告期末自2015年6月30日,基金份额净值1.027元,基金份额总额6,536,627,907.10份。
3.2.2 基金合同生效以来,本基金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

项目	本期
一、收入	266,510,78874
1.利息收入	14,309,44627
其中:存款利息收入	7,016,99767
债券利息收入	-
公允价值变动损益	177,268,4427
其他业务收入	2,922,68669
其他利得和损失	-
2.公允价值变动损益	206,869,16741
3.其他业务收入	177,132,73607
4.其他利得和损失	-
二、费用	37,471,76226
1.管理人报酬	28,693,38381
2.托管费	4,482,22069
3.销售服务费	5,988,728334
4.其他费用	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	127,445246
三、利润总额(亏损总额)“=1-2”	229,438,96669
减:所得税费用	-
净利润(净亏损)“=3-4”	229,438,96669

注:本基金2015年4月9日成立,因此无上年度末数据。
报告期末持有基金份额的基金份额持有人户数、基金份额数量情况表:
基金持有人户数(户数)及基金份额数量
基金持有人户数(户数)及基金份额数量
基金持有人户数(户数)及基金份额数量

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将申购款中对应公允价值部分确认为权证投资成本,按实际支付的申购款扣除申购费用后的余额扣除权证投资成本后的余额确认为股票成本;上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)中(3)中相关原则进行计算;
(3)权证公允价值按照公允价值确定,本基金主要依据上市日的公允价值确定。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.7 套期保值
6.4.4.8 公允价值计量

6.4.4.9 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.10 套期保值
6.4.4.11 公允价值计量

6.4.4.12 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.13 套期保值
6.4.4.14 公允价值计量

6.4.4.15 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.16 套期保值
6.4.4.17 公允价值计量

6.4.4.18 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.19 套期保值
6.4.4.20 公允价值计量

6.4.4.21 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.22 套期保值
6.4.4.23 公允价值计量

6.4.4.24 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.25 套期保值
6.4.4.26 公允价值计量

6.4.4.27 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.28 套期保值
6.4.4.29 公允价值计量

6.4.4.30 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.31 套期保值
6.4.4.32 公允价值计量

6.4.4.33 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.34 套期保值
6.4.4.35 公允价值计量

6.4.4.36 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.37 套期保值
6.4.4.38 公允价值计量

6.4.4.39 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.40 套期保值
6.4.4.41 公允价值计量

6.4.4.42 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.43 套期保值
6.4.4.44 公允价值计量

6.4.4.45 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.46 套期保值
6.4.4.47 公允价值计量

6.4.4.48 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.49 套期保值
6.4.4.50 公允价值计量

6.4.4.51 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.52 套期保值
6.4.4.53 公允价值计量

6.4.4.54 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.55 套期保值
6.4.4.56 公允价值计量

6.4.4.57 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.58 套期保值
6.4.4.59 公允价值计量

6.4.4.60 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.61 套期保值
6.4.4.62 公允价值计量

6.4.4.63 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.64 套期保值
6.4.4.65 公允价值计量

6.4.4.66 金融资产和金融负债的抵销
6.4.4.67 套期保值
6.4.4.68 公允价值计量

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	000036	招商银行	16,500,000	306,880,000.00	4.60
2	001939	建设银行	37,289,220	295,046,492.77	4.37
3	000081	中信银行	7,880,543	228,046,270.84	3.37
4	000029	中国银行	6,671,027	221,174,172.10	3.21
5	001668	中国中铁	23,000,923	191,137,610.83	2.83
6	000069	华商银行	13,889,900	180,430,818.62	2.69
7	000009	天富能源	12,600,000	177,262,000.00	2.64
8	600045	海康光电	8,851,121	176,086,164.46	2.64
9	000066	宝硕股份	6,163,269	169,086,019.83	2.53
10	601117	中国中化	7,620,387	167,289,416.00	2.49

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应查阅刊登在www.huawen.com.cn网站的半年度报告正文。
7.4 报告期内基金投资组合的重大变动
7.4.1 买入卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	318,726,270.00	4.76
2	601939	建设银行	263,016,048.38	3.92
3	000261	中国工业	253,443,991.24	3.77
4	601228	交通银行	228,322,027.24	3.40
5	000029	中国银行	194,000,136.00	2.89
6	000045	海康光电	193,585,589.29	2.88
7	000028	精工	191,129,921.23	2.85
8	601117	中国中化	187,418,310.12	2.79
9	000029	中国银行	182,988,004.11	2.73
10	601668	中国中铁	171,430,391.17	2.60
11	601818	光大银行	177,931,546.15	2.65
12	000077	天沃股份	176,733,844.66	2.63
13	600046	宝硕股份	173,396,922.81	2.59
14	600009	天富能源	171,675,071.10	2.56
15	000029	中国银行	168,420,348.68	2.51
16	002302	雅化集团	168,689,212.66	2.49
17	601179	中国中冶	156,800,114.70	2.30
18	600049	中金黄金	154,486,963.53	2.28
19</				