

华安核心优选混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月三十日
1.1 重要提示
1.1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。

4.3.3 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》,公司合规稽核部按品种间基金投资、交易部门制定了公募基金、专户投资策略,同时进行了资产配置的优化,获得了较好的相对收益。

业绩评价:中德证券会计师事务所有限公司普华永道中天签字(2008)第149号验资报告予以确认,经中国证监会备案。(《华安核心优选混合型证券投资基金合同》于2008年10月22日正式生效,基金自生效日的基金净值总额为813.446,720.66份基金份额,其中认购基金份额813,745.41份基金份额。)

(b) 持续在以公允价值计量的金融工具
(1) 各层次金融工具公允价值
于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融资产按公允价值计量的金融资产中属于第一层次的金额为1,148,611,701.55元,属于第二层次的金额为70,654,245.80元,属于第三层次的金额为2017年12月31日;第一层次1127,015,325.14元,第二层次65,844.91元,无第三层次。

8.0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。
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item, Value. Section: 2.2 基金产品说明

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现分析
2018年市场全年呈现大幅震荡下行的态势。沪深300指数下跌25.3%,创业板指下跌28.65%。

7.4.2 会计政策的编制基础
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〉》、中国证券业协会发布的行业会计准则及实务操作指南(“行业会计准则”)和中国证券投资基金业协会(以下简称“中国证券投资基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安核心优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4所列示的中国证监会、中国证监会发布的有关基金及公开募集证券投资基金活动的法律法规及其他规范性文件的要求编制。

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.12 期末本基金持有的公允价值计量属性归类

2.3 基金管理人及基金托管人
2.3.1 基金管理人基本情况
2.3.2 基金托管人基本情况

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现分析
截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.3701元,本报告期份额净值增长率为-11.43%,同期业绩比较基准收益率为-18.47%。

7.4.5 会计政策的变更
7.4.5.1 会计政策的变更
7.4.5.2 会计估计的变更

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.2 自基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

4.4 基金管理人及其基金经理的情况
4.4.1 基金管理人及其基金经理的情况
4.4.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.3 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

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.2 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.1 资产负债表
7.1.1 资产负债表
7.1.2 资产负债表

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.2 利润表
7.2.1 利润表
7.2.2 利润表

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
7.3.1 所有者权益(基金净值)变动表
7.3.2 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.4 关联方关系及其交易
7.4.1 关联方关系
7.4.2 关联交易

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.4.3 关联方交易
7.4.3.1 关联方交易
7.4.3.2 关联方交易

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.4.4 关联方交易
7.4.4.1 关联方交易
7.4.4.2 关联方交易

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 3.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

7.4.5 关联方交易
7.4.5.1 关联方交易
7.4.5.2 关联方交易

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 8.4 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债券投资明细

Table with 4 columns: Item, Amount, Unit, Amount. Section: 9.3 期末基金份额持有人的从业机构持有本基金的情况