

信息披露 disclosure

华安消费服务混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

风险管理根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对投资组合组合与交易所对手之间议价的交易的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、交易部门制定了公募基金基金，专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间市场的同向反向交易控制规则，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跟踪，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 一季度市场呈现普涨格局。从一季度板块表现来看，农林牧渔、计算机、电子元器件、非银金融及食品饮料表现较好；银行、公用事业、建筑、汽车、钢铁表现较弱。 华安消费服务基金2019年收益率为40.99%，同期上证综指上涨23.93%，创业板综指上涨33.43%，组合的机会更多来自板块配置和个股的择时。板块配置上增加了消费和服务行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至2019年3月31日，本基金份额净值为1.589元，本报告期份额净值增长率为40.99%，同期业绩比较基准增长率为32.40%。 2018年下半年宏观经济从“紧货币”转向“宽货币”。进入2019年，信贷端开始出现好转，我们也可以在1、2月的社融数据中得到印证。同时由于去年下半年产业对经济悲观，导致产业经历了一波去库存的拐点，进入2019年，在政策的正面影响下，企业信心得到一部分修复，叠加土地端好转，我们可以看到一些企业补库存的情况，经济数据也会反映好转的预期。与此同时，中美贸易摩擦带来一定程度的颠簸，因此我们对上半年股票市场走势，在配置上，我们依然会选择符合未来产业方向及自身产业已完成调整并确定性向上的行业和个股，努力为投资者创造良好的回报。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明 本基金报告期内不存在基金资产净值低于200人或基金资产净值低于5000万元的情况。

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)	占基金资产净值比例(%)	
1	权益投资	310,349,011.63	91.30	
1.1	其中:股票	310,349,011.63	91.30	
2	债权投资	—	—	
2.1	其中:国债	—	—	
3	贵金属投资	—	—	
4	金融衍生品投资	—	—	
5	买入返售金融资产	—	—	
6	其他资产	26,082,771.62	7.38	
7	其他负债	5,670,330.60	1.62	
8	合计	349,102,113.87	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	26,816,467.88	7.68
B	制造业	—	—
C	金融业	215,477,736.07	62.86
D	电力、热力、燃气及生产供应业	6,119,820.00	1.72
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	6,721,056.00	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	10,122,680.00	2.88
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,860,476.68	4.51
J	房地产业	18,106,667.68	5.17
K	租赁和商务服务业	31,860,520.40	9.13
L	综合	1,656,000.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	2,966,240.00	0.86
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	1,654,002.00	0.48
合计		310,349,011.63	92.57

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 无

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	002527	亿阳科技	971,790	15,828,800.00	4.48
2	300688	国瓷材料	358,700	13,629,420.00	3.89
3	002707	众拓股份	267,960	13,058,380.00	3.70
4	000656	中航光电	137,300	13,043,500.00	3.70
5	600360	华谊集团	800,600	12,426,612.00	3.51
6	600199	金茂股份	115,300	11,368,067.00	3.23
7	600745	华信国际	626,500	10,162,400.00	2.87
8	002714	苏州银行	162,900	10,276,500.00	2.87
9	000668	华信国际	126,100	6,528,880.00	1.84
10	000646	华信国际	256,061	6,474,384.04	1.84

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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十名债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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投资。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,747,850.00	0.49
B	制造业	771,426,943.57	94.06
C	金融业	—	—
D	电力、热力、燃气及生产供应业	8,180,000.00	0.60
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	52,284,272.00	3.80
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,723,143.00	0.48
J	房地产业	138,345,000.00	0.41
K	租赁和商务服务业	62,342,000.00	0.43
L	综合	—	—
M	科学研究和技术服务业	69,023,480.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	26,060.00	0.00
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	10,785,233.66	0.78
S	综合	—	—
合计		1,097,692,267.28	76.76

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	300626	亿阳科技	1,098,262	18,910,548.00	7.70
2	000661	长春高新	238,232	74,566,191.68	6.42
3	002127	长春高新	6,028,263	65,003,170.00	5.40
4	000739	普洛药业	5,036,560	63,123,547.20	5.21
5	600466	中国石化的子公司	1,829,113	60,296,409.00	4.99
6	002588	国瓷材料	170,500	60,003,170.00	4.93
7	300761	应流股份	328,276	56,386,376.12	4.67
8	603180	华信国际	1,690,912	52,389,012.00	4.31
9	603771	华信国际	1,031,248	52,284,272.00	4.31
10	005176	华信国际	1,839,160	51,680,000.00	4.27

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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 本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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投资。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,747,850.00	0.49
B	制造业	771,426,943.57	94.06
C	金融业	—	—
D	电力、热力、燃气及生产供应业	8,180,000.00	0.60
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	52,284,272.00	3.80
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,723,143.00	0.48
J	房地产业	138,345,000.00	0.41
K	租赁和商务服务业	62,342,000.00	0.43
L	综合	—	—
M	科学研究和技术服务业	69,023,480.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	26,060.00	0.00
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	10,785,233.66	0.78
S	综合	—	—
合计		1,097,692,267.28	76.76

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	300626	亿阳科技	1,098,262	18,910,548.00	7.70
2	000661	长春高新	238,232	74,566,191.68	6.42
3	002127	长春高新	6,028,263	65,003,170.00	5.40
4	000739	普洛药业	5,036,560	63,123,547.20	5.21
5	600466	中国石化的子公司	1,829,113	60,296,409.00	4.99
6	002588	国瓷材料	170,500	60,003,170.00	4.93
7	300761	应流股份	328,276	56,386,376.12	4.67
8	603180	华信国际	1,690,912	52,389,012.00	4.31
9	603771	华信国际	1,031,248	52,284,272.00	4.31
10	005176	华信国际	1,839,160	51,680,000.00	4.27

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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 本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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投资。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,747,850.00	0.49
B	制造业	771,426,943.57	94.06
C	金融业	—	—
D	电力、热力、燃气及生产供应业	8,180,000.00	0.60
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	52,284,272.00	3.80
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,723,143.00	0.48
J	房地产业	138,345,000.00	0.41
K	租赁和商务服务业	62,342,000.00	0.43
L	综合	—	—
M	科学研究和技术服务业	69,023,480.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	26,060.00	0.00
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	10,785,233.66	0.78
S	综合	—	—
合计		1,097,692,267.28	76.76

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	300626	亿阳科技	59,377	227,679.76	0.02
2	603686	上海机场	17,700	227,679.76	0.01
3	603686	上海机场	1,235	82,474.27	0.01
4	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
5	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
6	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
7	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
8	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
9	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
10	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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 本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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投资。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,747,850.00	0.49
B	制造业	771,426,943.57	94.06
C	金融业	—	—
D	电力、热力、燃气及生产供应业	8,180,000.00	0.60
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	52,284,272.00	3.80
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,723,143.00	0.48
J	房地产业	138,345,000.00	0.41
K	租赁和商务服务业	62,342,000.00	0.43
L	综合	—	—
M	科学研究和技术服务业	69,023,480.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	26,060.00	0.00
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	10,785,233.66	0.78
S	综合	—	—
合计		1,097,692,267.28	76.76

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	300626	亿阳科技	59,377	227,679.76	0.02
2	603686	上海机场	17,700	227,679.76	0.01
3	603686	上海机场	1,235	82,474.27	0.01
4	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
5	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
6	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
7	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
8	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
9	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01
10	300762	华信国际	1,412	74,831.88	0.01

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券投资。

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 本基金本报告期末未持有债券投资。

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投资。

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投资。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,747,850.00	0.49
B	制造业	771,426,943.57	