

华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

姓名	职务	在本基金的基金经理期间	基金经理年限	证券从业年限	说明
魏斌	基金经理	2018-09-10	-	8年	硕士研究生,毕业于南开大学,曾任招商基金研究员、基金经理,2018年9月加入华安基金担任基金经理,现任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。2019年1月1日起兼任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。2019年1月1日起兼任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。

姓名	职务	在本基金的基金经理期间	基金经理年限	证券从业年限	说明
苏云杰	基金经理	2018-10-31	-	14年	硕士研究生,毕业于南开大学,曾任招商基金研究员、基金经理,2018年10月加入华安基金担任基金经理,现任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。2019年1月1日起兼任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。

过小仓位进行增持比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公开市场询价、交易跟踪、分析与评估环节,当风险管理部对公募基金下的投资组合组合内证券上市交易的流动性、分析并评估市场环境,进行场外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,不同投资组合同日临近交易日的反向交易等,并定期或不定期对组合的持仓进行了重点分析。本报告期内,除除少数与交易对手之间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反向交易的价格公允性进行审查,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、专户并行的股票、债券、回购等投资组合在交易所及银行间市场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,风险管理部开发了反向交易分析系统,对相关同日反向交易进行持续跟踪,并定期对组合的持仓进行了重点分析。本报告期内,除除少数与交易对手之间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反向交易的价格公允性进行审查,本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

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	01299	腾讯控股	101,200	6,798,072.40	16.21
2	00709	腾讯控股	21,200	1,564,288.00	3.87
3	00005	中国银行	162,800	9,612,020.77	23.69
4	00041	中国平安	103,500	3,154,094.00	7.72
5	00388	香港交易所	10,500	1,404,261.11	3.41
6	00882	中国海洋石油	154,000	1,161,420.06	2.87
7	00001	招商局	22,500	1,161,397.77	2.87
8	00002	万科A	12,000	1,287,001.11	3.16
9	01113	长安汽车	21,500	1,287,288.46	3.16

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股权投资	64,078,286.30	95.98
2	债权投资	64,078,286.30	95.98
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,589,243.69	5.57
7	其他资产	180,288.00	0.28
8	负债	96,896,899.77	100.00

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股权投资	44,543,628.77	67.84
2	债权投资	44,543,628.77	67.84
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	180,288.00	0.28
7	其他资产	62,000.00	0.10
8	负债	62,000.00	0.10

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	211,099.41	0.47
B	医药、生物制品	1,338,201.18	3.28
C	制造业	3,156,020.04	7.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,266,222.00	49.20
E	建筑业	1,226,946.00	2.97
F	信息技术业	1,283,505.04	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,487,732.00	3.57
H	批发和零售业	29,469,000.00	71.85
I	综合类	1,892,322.77	4.59
J	金融业	14,171,319.00	34.56
K	房地产业	21,111,948.04	50.75
L	租赁和商务服务业	506,007.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,010.00	0.11
O	国防军工	556,111.00	1.34
P	教育	44,171,319.00	98.20

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	医药、生物制品	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,784,000.00	61.86
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	综合类	-	-
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	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	62,000.00	0.14
R	合计	71,784,000.00	61.86

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

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	00001	招商局	22,500	1,161,397.77	2.87
2	00002	万科A	12,000	1,287,001.11	3.16
3	00003	招商银行	10,000	1,287,001.11	3.16
4	00004	浦发银行	10,000	1,287,001.11	3.16
5	00005	中国银行	10,000	1,287,001.11	3.16
6	00006	工商银行	10,000	1,287,001.11	3.16
7	00007	建设银行	10,000	1,287,001.11	3.16
8	00008	中信银行	10,000	1,287,001.11	3.16
9	00009	民生银行	10,000	1,287,001.11	3.16
10	00010	华夏银行	10,000	1,287,001.11	3.16

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股权投资	247,424,310.22	23.28
2	债权投资	309,238,000.00	28.94
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	209,288,000.00	19.53
7	其他资产	611,097,447.78	57.25
8	负债	6,028,232.34	0.57
9	合计	1,698,282,334.00	100.00

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

姓名	职务	在本基金的基金经理期间	基金经理年限	证券从业年限	说明
魏斌	基金经理	2018-09-10	-	8年	硕士研究生,毕业于南开大学,曾任招商基金研究员、基金经理,2018年9月加入华安基金担任基金经理,现任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。2019年1月1日起兼任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。

姓名	职务	在本基金的基金经理期间	基金经理年限	证券从业年限	说明
苏云杰	基金经理	2018-10-31	-	14年	硕士研究生,毕业于南开大学,曾任招商基金研究员、基金经理,2018年10月加入华安基金担任基金经理,现任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。2019年1月1日起兼任华安基金基金经理,负责华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金投资管理工作。

过小仓位进行增持比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公开市场询价、交易跟踪、分析与评估环节,当风险管理部对公募基金下的投资组合组合内证券上市交易的流动性、分析并评估市场环境,进行场外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,不同投资组合同日临近交易日的反向交易等,并定期或不定期对组合的持仓进行了重点分析。本报告期内,除除少数与交易对手之间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反向交易的价格公允性进行审查,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、专户并行的股票、债券、回购等投资组合在交易所及银行间市场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,风险管理部开发了反向交易分析系统,对相关同日反向交易进行持续跟踪,并定期对组合的持仓进行了重点分析。本报告期内,除除少数与交易对手之间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反向交易的价格公允性进行审查,本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

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	01299	腾讯控股	101,200	6,798,072.40	16.21
2	00709	腾讯控股	21,200	1,564,288.00	3.87
3	00005	中国银行	162,800	9,612,020.77	23.69
4	00041	中国平安	103,500	3,154,094.00	7.72
5	00388	香港交易所	10,500	1,404,261.11	3.41
6	00882	中国海洋石油	154,000	1,161,420.06	2.87
7	00001	招商局	22,500	1,161,397.77	2.87
8	00002	万科A	12,000	1,287,001.11	3.16
9	01113	长安汽车	21,500	1,287,288.46	3.16

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股权投资	64,078,286.30	95.98
2	债权投资	64,078,286.30	95.98
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,589,243.69	5.57
7	其他资产	180,288.00	0.28
8	负债	96,896,899.77	100.00

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股权投资	44,543,628.77	67.84
2	债权投资	44,543,628.77	67.84
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	180,288.00	0.28
7	其他资产	62,000.00	0.10
8	负债	62,000.00	0.10

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	211,099.41	0.47
B	医药、生物制品	1,338,201.18	3.28
C	制造业	3,156,020.04	7.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,266,222.00	49.20
E	建筑业	1,226,946.00	2.97
F	信息技术业	1,283,505.04	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,487,732.00	3.57
H	批发和零售业	29,469,000.00	71.85
I	综合类	1,892,322.77	4.59
J	金融业	14,171,319.00	34.56
K	房地产业	21,111,948.04	50.75
L	租赁和商务服务业	506,007.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,010.00	0.11
O	国防军工	556,111.00	1.34
P	教育	44,171,319.00	98.20

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	医药、生物制品	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,784,000.00	61.86
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	综合类	-	-
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	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	62,000.00	0.14
R	合计	71,784,000.00	61.86

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2019年一季度,经济呈现企稳态势,1-2月的固定资产投资受益于地方政府专项债发行提速,同比增长1.3%。3月份的新增PMI制造业 PMI回升至50.1个百分点,显示经济企稳回升,1-2月社会消费品零售总额同比增长10.4%,消费市场保持韧性。海外方面,美国贸易政策趋紧,欧改宣布后双向长期再融资操作,汇率资产的压力较大。

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	00001	招商局	22,500	1,161,397.77	2.87
2	0000				