华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

【2014】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安中国A股增强指数
基金主代码	040002
前端交易代码	040002
后端交易代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月8日
报告期末基金份额总额	7,945,086,098.94份
投资目标	运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。
投资策略	(1)资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。 (2)股票投资:本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购,股票增发等。 (3)其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。
业绩比较基准	95%×MSCI中国A股指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	234,110,762.33
2.本期利润	699,007,232.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0646
4.期末基金资产净值	4,249,479,310.44
5.期末基金份额净值	0.535

注:1.所述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、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

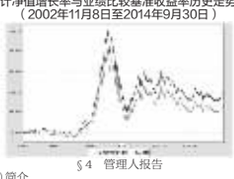
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.35%	0.84%	13.83%	0.83%	-0.48%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2002年11月8日至2014年9月30日)



§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛勇	本基金的基金经理	2010-9-2	-	10年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),10年证券金融从业经历,曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师,2009年7月至2010年8月担任本基金的基金经理助理,2010年6月至2012年12月担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010年9月起同时担任本基金的基金经理。2010年11月起担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2012年6月起同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配,综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报,若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的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、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易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、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同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;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,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1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

三季度经济基本面较差,除新增信贷低于预期外,受地产投资增速下降影响,8月份工业增加值同比增速大幅下降至6.9%,创08年后新低。但市场与基本面表现迥异,市场信心受管理层转型改革的决心与配套政策提振,交投活跃,除海外资金布局低估值蓝筹外,从银证转帐与融资额数据来看,国内增量资金入场特征比较明显,风格偏向于小市值成长主题类个股,定增、并购、技术升级等主题活跃。本基金在报告期内超配成长消费股,低配银行、能源等强周期行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为0.535元,本报告期份额净值增长率为13.35%,同期业绩比较基准增长率为13.83%,截至2014年9月30日,本基金过去30个交易日日均跟踪偏离度为0.14%(按照基金合同和招募说明书规定)。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季末,监管层出台支持改善需求的住房信贷政策,以图扭转全社会对房价与地产市场的悲观预期,并最终防范转型过程中地产市场可能伴生的金融风险,短期有利于地产销售、稳定预期。但从中期看,在高层既定的改革与转型框架下,国内大类资产配置将继续从地产市场向股票市场迁移,资金继续流入股市的可能性较大,我们对A股市场的中长期表现仍持乐观看法,受外围影响短期震幅可能加大,但趋势仍向好,从风格上仍以转型与消费成长为主。作为MSCI中国A股增强型指数基金的管理人,我们将在跟踪指数的前提下,通过适度增强操作,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,023,934,477.62	94.13
	其中:股票	4,023,934,477.62	94.13
2	固定收益投资	61,611,741.31	1.44
	其中:债券	61,611,741.31	1.44
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	167,839,133.12	3.93
7	其他资产	21,598,342.69	0.51
8	合计	4,274,983,694.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	-	-
B	采矿业	1,387,978.90	0.03
C	制造业	158,983,596.69	3.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,295,915.35	0.81
E	建筑业	16,020,600.20	0.38
F	批发和零售业	2,717,743.35	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,820,168.42	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,057,412.75	0.26
J	金融业	2,131,729.65	0.05
K	房地产业	23,143,833.15	0.54
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	6,630,241.05	0.16
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	-	-
	合计	262,189,219.51	6.17

5.2.2 指数投资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	42,638,246.15	1.00
B	采矿业	132,744,955.99	3.12
C	制造业	1,553,359,907.02	36.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,295,720.71	3.33
E	建筑业	178,913,286.85	4.21
F	批发和零售业	268,104,829.38	6.31
G	交通运输、仓储和邮政业	121,436,839.19	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,266,437.79	3.70
J	金融业	912,375,656.76	21.47
K	房地产业	73,266,077.04	1.72
L	租赁和商务服务业	81,902,430.60	1.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	65,928,593.07	1.55
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	11,976,356.98	0.28
S	综合	20,535,920.58	0.48
	合计	3,761,745,258.11	88.52

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600030	中信证券	9,816,008	130,749,226.56	3.08
2	601169	北京银行	13,755,879	110,459,708.37	2.60
3	600511	国药股份	3,961,689	106,767,518.55	2.51
4	601318	中国平安	2,536,889	104,874,991.26	2.47
5	601328	交通银行	19,304,057	82,814,404.53	1.95
6	002385	大北农	5,607,820	77,331,837.80	1.82
7	600875	东方电气	4,514,072	65,454,044.00	1.54
8	600837	海通证券	5,954,649	61,451,977.68	1.45
9	600079	人福医药	2,011,055	55,545,339.10	1.31
10	600138	中青旅	3,374,680	55,479,739.20	1.31

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600422	昆明制药	1,481,916	41,182,445.64	0.97
2	002601	佰利联	1,358,098	31,779,493.20	0.75
3	600612	老凤祥	744,446	22,482,269.20	0.53
4	600509	天富能源	2,252,079	21,349,708.92	0.50
5	000656	金科股份	1,804,736	19,852,096.00	0.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,054,000.00	1.41
	其中:政策性金融债	60,054,000.00	1.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,557,741.31	0.04
8	其他	-	-
9	合计	61,611,741.31	1.45

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140317	14进出17	600,000	60,054,000.00	1.41
2	128002	东华转债	5,497	794,514.39	0.02
3	110024	隧道转债	4,420	580,611.20	0.01
4	128005	齐翔转债	1,553	182,615.72	0.00

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。

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。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,036,297.11
2	应收证券清算款	15,217,223.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,525,318.40
5	应收申购款	2,819,503.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,598,342.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	东华转债	794,514.39	0.02
2	110024	隧道转债	580,611.20	0.01

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	12,757,480,365.46
报告期期间基金总申购份额	1,605,706,754.11
减:报告期期间基金总赎回份额	6,418,101,020.63
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,945,086,098.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》

2、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》

3、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一四年十月二十四日

华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金

【2014】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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安7日鑫短期理财债券
基金主代码	040042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月26日
报告期末基金份额总额	38,334,660.58份
投资目标	在力求本金安全的基础上,追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类固定收益类金融工具的配置比例并进行积极的投资组合管理。在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,力争为投资人创造稳定的收益。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金,高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基金简称	华安7日鑫短期理财债券A / 华安7日鑫短期理财债券B
下属两级基金的交易代码	040042 / 040043
报告期末下属两级基金的份额总额	22,171,020.33份 / 16,163,640.25份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	华安7日鑫短期理财债券A	华安7日鑫短期理财债券B
1.本期已实现收益	201,659.09	149,654.37
2.本期利润	201,659.09	149,654.37
3.期末基金资产净值	22,171,020.33	16,163,640.25

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安7日鑫短期理财债券A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8136%	0.0009%	0.2722%	0.0000%	0.5414%	0.0009%

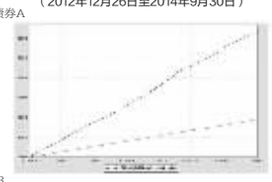
2、华安7日鑫短期理财债券B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8870%	0.0009%	0.2722%	0.0000%	0.6148%	0.0009%

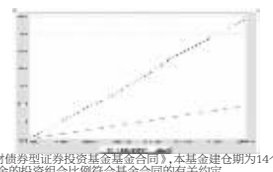
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月26日至2014年9月30日)

1、 华安7日鑫短期理财债券A



2、华安7日鑫短期理财债券B



注:根据《华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为14个交易日。基金管理人已自基金合同生效之日起14个交易日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张晟刚	本基金的基金经理	2013-1-25	2014-8-30	15年	硕士研究生,15年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任本基金及华安日日鑫货币市场基金的基金经理;2013年3月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2013年10月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2013年11月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014年8月从华安基金离职。
孙丽娜	本基金的基金经理	2014-8-30	-	4年	硕士研究生,4年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理。2014年8月起担任本基金及华安汇财通货币市场基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理。
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监。	2014-8-30	-	13年	硕士研究生,13年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在闽发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。 2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任本基金及华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报,若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的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、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易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、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同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;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,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1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

三季度,沪深300指数上涨13.20%,创业板综指上涨16.66%。市场呈现单边走高的趋势,不管是大盘蓝筹股,还是成长股都有相当优秀的表现。主要原因在于:(1)政府对创新和转型的支持力度超出预期,投资者对前景预期乐观。(2)虽然经济数据表现一般,但政府通过不断出台托底政策,为创新和转型赢得了较多的时间。(3)成长股进入收购兼并的活跃期,盈利能力增长得到提升。

本基金在报告期期间,仓位维持在90%以上,配置上坚持以成长股为主。互联网OTO行业、移动互联网、在线教育、在线医疗、医药等行业仍然是我们配置的重点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.831元,本报告期份额净值增长率为14.51%,同期业绩比较基准增长率为13.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济数据低于预期在未来的几个月可能依然是大概率的事件。但我们认为GDP走势对市场影响已弱化,市场参与者的关注点仍然在转型和创新方面。本基金坚定看好政府未来的改革方向,继续对市场后期表现保持乐观。展望后市,我们认为一方面大盘蓝筹股在国有企业所有制改造的推动下走强概率较大,另一方面中小盘成长股在民营企业做大做强的驱动下走强概率同样很大。总之,未来3-6个月是获取绝对收益较好的时机。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,404,290,687.67	89.64
	其中:股票	1,404,290,687.67	89.64
2	固定收益投资	6,219,442.72	0.40
	其中:债券	6,219,442.72	0.40
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	142,218,302.16	9.08
7	其他资产	13,923,713.32	0.89
8	合计	1,566,652,145.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	32,328,411.68	2.10
C	制造业	791,999,815.94	51.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	42,551,682.39	2.76
F	批发和零售业	38,933,918.56	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	189,939,339.78	12.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	53,663,514.96	3.48
L	租赁和商务服务业	62,379,697.64	4.05
M	科学研究和技术服务业	35,370,594.00	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	157,123,712.72	10.19
S	综合	-	-
	合计	1,404,290,687.67	91.11

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	600479	千金药业	4,035,016	68,756,672.64	4.46
2	300071	华谊嘉信	3,721,939	62,379,697.64	4.05
3	300226	上海钢联	1,115,617	58,201,738.89	3.78
4	002437	誉衡药业	2,419,972	57,474,335.00	3.73
5	002133	广宇集团	10,399,906	53,663,514.96	3.48
6	300291	华录百纳	1,346,519	53,591,456.20	3.48
7	300147	香雪制药	2,327,309	52,806,641.21	3.43
8	002572	索菲亚	2,692,104	52,657,554.24	3.42
9	002436	兴森科技	1,760,000	52,624,000.00	3.41
10	002055	得润电子	4,101,839	51,970,300.13	3.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,219,442.72	0.40
8	其他	-	-
9	合计	6,219,442.72	0.40

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128007	通联转债	49,789	6,219,442.72	0.40

5.6 报告期末按公允价值