

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

[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:交通银行股份有限公司
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监事会对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的规定，于2014年10月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:华安安顺灵活配置-型基金

基金代码:519909

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2014年5月12日

报告期末基金份额总额:2,831,156,271.71份

投资目标:本基金采取对冲策略的投资模式，在股票型基金的基础上，通过量化模型识别出具有高收益潜力的股票并进行买入操作，同时通过卖出股指期货等对冲工具，降低股票仓位，从而在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的回报率和资产的长期稳健增长。

投资策略:本基金采取对冲策略的投资模式，在股票型基金的基础上，通过量化模型识别出具有高收益潜力的股票并进行买入操作，同时通过卖出股指期货等对冲工具，降低股票仓位，从而在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的回报率和资产的长期稳健增长。

风险收益特征:本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和净值表现

单位:人民币元

1.本期已实现收益 140,366,126.84

2.本期利润 360,515,990.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0707

4.期末基金份额净值 3,221,351,365.51

5.期末总资产净值 1,138

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,红利再投费,基金转换费等),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。
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,本期利润同上。
3.基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

3.1 主要财务指标

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

1.本期已实现收益 140,366,126.84

2.本期利润 360,515,990.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0707

4.期末基金份额净值 3,221,351,365.51

5.期末总资产净值 1,138

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,红利再投费,基金转换费等),计算费用后实际收益水平将低于所列数字。
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,本期利润同上。
3.基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

3.2 基金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

3.2.1 本报告期内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

3.2.2 自基金转型以来基金份额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

3.2.3 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势对比图

(2014年5月12日至2014年9月30日)

注:1.本基金转型日期为2014年5月12日,截至报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。
6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

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间 证券从业年限 说明

尚志民 本基金的基金经理,基金经理助理,基金经理,基金经理助理 2003-9-18 - 17年

注:本基金的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告为准。证券从业的年限从证券从业协会《证券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合规性情况的说明

本基金报告期内,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、招募说明书等有关文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和谨慎运作基金资产,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的承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正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印制公平交易制度的书面文件中,明确公平交易原则,规范投资研究、交易执行、风险管理、绩效评估等环节,确保公平交易制度的严格执行。同时严格按照投资决策委员会、投资总监、投资组合经理、投资研究部、交易部等部门和人员的职责分工,明确相应的公平交易行为规范,确保公平交易制度的执行效果。

4.3.2 平公正交易执行的情况

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4 报告期内基金的业绩表现

4.4.1 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.2 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.3 报告期内基金的业绩表现

4.4.4 报告期内基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.5 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.6 报告期内基金的业绩表现

4.4.7 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.8 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.9 报告期内基金的业绩表现

4.4.10 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.11 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.12 报告期内基金的业绩表现

4.4.13 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.14 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.15 报告期内基金的业绩表现

4.4.16 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.17 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.18 报告期内基金的业绩表现

4.4.19 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.20 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.21 报告期内基金的业绩表现

4.4.22 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.23 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.24 报告期内基金的业绩表现

4.4.25 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.26 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.27 报告期内基金的业绩表现

4.4.28 报告期内本基金的净值增长率和运作情况

报告期内,本基金净值上涨3.20%,而同期上证指数上涨9.26%,中证500涨幅则达到25.25%,

市场风格继续偏向小盘股。7月末以来市场的上涨,主力主要集中在科技类的题材以及一些周期类品种上,而创业板指数表现相对疲弱。

4.4.29 报告期内基金的资产配置

本基金报告期内,基金管理人严格按照《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等部门基金投资、交易执行等部门按月反

映投资决策委员会对基金的公平交易情况进行分析,对不同时间尺度内投资组合之间的交易行为进行监控,定期向公司总经理办公会汇报,对异常交易行为进行重点监控。本报告期内,除所有投资组合外,不存在投资组合之间发生不公平交易的情况。

4.4.30 报告期内基金的业绩表现

4.4.31 报告期内本基金的净值增长率和运作情况