

信息披露

isrose

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

2017年第三季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

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	1,407,038.06	0.06
B	制造业	108,000,541.12	4.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,418,777.56	0.10
D	建筑业	—	—
E	交通运输业	7,552,489.89	0.30
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	448,240.78	0.02
G	金融业	—	—
H	房地产业	—	—
I	批发和零售业	18,260,276.27	0.73
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,616,362.28	0.06
L	医药制造业	—	—
M	科学研究和技术服务业	43,651,227.00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	321,380.00	0.01
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	106,363.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,776.06	—
S	其他	—	—
合计	—	193,127,506.11	7.73

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	12,428,263.89	0.50
B	制造业	32,360,807.00	1.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,017,124,100.02	40.76
D	建筑业	14,018,184.42	0.56
E	交通运输业	51,162,072.31	2.05
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	40,467,960.00	1.63
G	金融业	66,083,284.21	2.68
H	房地产业	3,680,760.00	0.15
I	批发和零售业	70,366,327.1	2.82
J	金融业	625,164,265.16	24.97
K	房地产业	18,474,270.00	0.74
L	医药制造业	20,263.70	0.00
M	科学研究和技术服务业	113,000.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,679,463.73	0.87
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,033,447.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	32,464,427.70	1.31
S	其他	—	—
合计	—	2,032,364.06	0.11
合计	—	2,107,704,124.44	86.41

本基金管理人：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：二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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约定，于2017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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者有风险，投资需谨慎。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
基金代码	000002
交易代码	000002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	3,104,090,040.02份

投资策略：本基金投资于具有良好流动性的资产，通过量化模型构建投资组合，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准：MSCI中国A股指数收益率×95%+金融同业存款利率。

风险收益特征：本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币型基金。

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

§4 管理人报告

§5 投资组合报告

华安安享灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

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	1,407,038.06	0.06
B	制造业	108,000,541.12	4.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,418,777.56	0.10
D	建筑业	—	—
E	交通运输业	7,552,489.89	0.30
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	448,240.78	0.02
G	金融业	—	—
H	房地产业	—	—
I	批发和零售业	18,260,276.27	0.73
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,616,362.28	0.06
L	医药制造业	—	—
M	科学研究和技术服务业	43,651,227.00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	321,380.00	0.01
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	106,363.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,776.06	—
S	其他	—	—
合计	—	193,127,506.11	7.73

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	12,428,263.89	0.50
B	制造业	32,360,807.00	1.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,017,124,100.02	40.76
D	建筑业	14,018,184.42	0.56
E	交通运输业	51,162,072.31	2.05
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	40,467,960.00	1.63
G	金融业	66,083,284.21	2.68
H	房地产业	3,680,760.00	0.15
I	批发和零售业	70,366,327.1	2.82
J	金融业	625,164,265.16	24.97
K	房地产业	18,474,270.00	0.74
L	医药制造业	20,263.70	0.00
M	科学研究和技术服务业	113,000.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,679,463.73	0.87
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,033,447.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	32,464,427.70	1.31
S	其他	—	—
合计	—	2,032,364.06	0.11
合计	—	2,107,704,124.44	86.41

本基金管理人：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：二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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约定，于2017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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者有风险，投资需谨慎。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安享灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	000002
交易代码	000002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	3,104,090,040.02份

投资策略：本基金投资于具有良好流动性的资产，通过量化模型构建投资组合，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准：MSCI中国A股指数收益率×95%+金融同业存款利率。

风险收益特征：本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币型基金。

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

§4 管理人报告

§5 投资组合报告

华安安信消费服务混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,360,031,790.56	93.69
2	固定收益投资	2,360,031,790.56	93.69
3	贵金属投资	1,256,760.16	0.05
4	金融衍生品投资	1,256,760.16	0.05
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和拆出资金	—	—
7	其他资产	136,366,927.97	5.30
8	合计	2,500,100,100.22	100.00

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	1,407,038.06	0.06
B	制造业	108,000,541.12	4.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,418,777.56	0.10
D	建筑业	—	—
E	交通运输业	7,552,489.89	0.30
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	448,240.78	0.02
G	金融业	—	—
H	房地产业	—	—
I	批发和零售业	18,260,276.27	0.73
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,616,362.28	0.06
L	医药制造业	—	—
M	科学研究和技术服务业	43,651,227.00	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	321,380.00	0.01
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	106,363.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,776.06	—
S	其他	—	—
合计	—	193,127,506.11	7.73

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	12,428,263.89	0.50
B	制造业	32,360,807.00	1.30
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,017,124,100.02	40.76
D	建筑业	14,018,184.42	0.56
E	交通运输业	51,162,072.31	2.05
F	信息、通信、软件和信息技术服务业	40,467,960.00	1.63
G	金融业	66,083,284.21	2.68
H	房地产业	3,680,760.00	0.15
I	批发和零售业	70,366,327.1	2.82
J	金融业	625,164,265.16	24.97
K	房地产业	18,474,270.00	0.74
L	医药制造业	20,263.70	0.00
M	科学研究和技术服务业	113,000.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,679,463.73	0.87
O	交通运输、仓储和邮政业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,033,447.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	32,464,427.70	1.31
S	其他	—	—
合计	—	2,032,364.06	0.11
合计	—	2,107,704,124.44	86.41

本基金管理人：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：二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构均不存在虚假记载、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约定，于2017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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，投资者有风险，投资需谨慎。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安信消费服务混合型证券投资基金
基金代码	000002
交易代码	000002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	3,104,090,040.02份

投资策略：本基金投资于具有良好流动性的资产，通过量化模型构建投资组合，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

业绩比较基准：MSCI中国A股指数收益率×95%+金融同业存款利率。

风险收益特征：本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币型基金。

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

§4 管理人报告

§5 投资组合报告

§1.1 投资组合报告附注

§1.1.1 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。

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

§1.1.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	772,447.86
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	20,240.00
4	应收股利	—
5	其他应收款	20,024,371.11
6	其他	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	21,727,068.97

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	110001	国债逆回购	929,289.00	0.04
2	120013	国债逆回购	346,474.84	0.01

§1.1.4 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.5 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.6 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.7 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.8 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.9 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.10 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.11 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.12 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.13 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.14 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.15 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.16 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.17 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.18 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.19 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.20 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.21 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.22 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.23 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.24 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.25 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.26 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.27 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.28 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.29 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.30 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.31 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.32 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.33 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.34 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.35 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.36 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.37 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.38 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.39 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.40 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.41 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.42 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.43 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.44 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.45 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.46 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.47 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.48 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.49 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.50 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.51 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.52 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.53 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.54 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.55 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.56 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.57 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.58 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.59 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.60 报告期内，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§1.1.61 报告期内，