

华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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;风险管理根据市场公允性的第三方意见(如:中债债的债券估值),定期对投资组合持仓与交易对手之报价交易的交易价格公允性进行审查,对不同类型投资组合面临交易日的反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、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,并定期对组合间同向反向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除货币基金以外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超过该证券当日成交量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
6月份以后,整个市场的流动性端有所改善,加之整个经济基本面比预期的要好得多,特别是供给端压力大大改善了,周期行业的盈利状况,在这些因素的推动下,整个市场的可投资性大幅增加。本基金注重采用自上而下的选股策略,在关注周期行业改善的信号后,我们提高了周期行业的配置比例,同时新能源行业在成长趋势信号下进一步明线,组合中也增加了配置。从结果来看,效果还可以。接下来我们会保持持续跟踪并动态修正对投资标的判断从而对持仓进行调整。由于未来一段时间,企业盈利分化严重,利率高位维稳,流动性保持紧平衡状态,市场更多会呈现结构性行情,因此,我们会更多自上而下而上的选股策略,积极挖掘基本面和业绩表现优异的品种。尤其看好如果存在估值被市场误读而出现错杀带来的投资机会,努力为客户创造更好的投资回报。

4.4.2报告期内基金的投资表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为0.9720元,本报告期份额净值增长率为5.77%,同期业绩比较基准增长率为2.31%。

4.5管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
从短期静态的视角看,宏观经济基本面逐步企稳,流动性进入偏紧区间,汇率调整也依然还没完全达到均衡水平,外部风险依然存在,无风险收益率逐步上移。未来一段时间只要不出现超预期风险因素,市场依然存在一定的结构性机会,特别是一些具有时代特征的高质量优质成长股和政策受益标的。因此在操作上,我们将继续以稳健和主动为主,把握投资机会。4.6报告期内基金持有人人数或基金资产净值披露说明
本基金报告期内不存在基金持有人人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,017,389,227.37	77.48
2	其中:股票	1,017,389,227.37	77.48
3	固定收益投资	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	其他金融资产投资	29,990,188.41	2.17
8	其他投资	9,614,180.04	0.73
9	合计	1,131,413,495.82	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	-	66,750,000.00	2.78
B 采矿业	-	126,216,300.00	6.88
C 制造业	-	1,045,222,242.00	93.27
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	9,569,003.44	0.47
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	66,735,35.46	3.27
G 交通运输、仓储和邮政业	-	129,138,571.81	6.33
H 信息传输、软件和信息技术服务业	-	75,267,700.00	4.78
I 金融业	-	22,220,000.00	1.43
J 房地产业	-	58,152,000.00	2.86
L 租赁和商务服务业	-	187,718,000.00	9.21
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 教育	-	-	-
P 公共卫生和社会工作	-	50,844,205.99	2.40
R 文化、体育和娱乐业	-	34,476,000.00	1.80
S 综合	-	4,120,000.00	0.20
合计	-	1,832,787,061.41	89.00

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	002088	长丰科技	4,200,000	144,858,000.00	7.11
2	000152	广晟有色	18,000,000	146,540,000.00	6.91
3	000028	中国石化	16,000,000	107,200,000.00	5.26
4	000061	安泰集团	10,000,000	101,300,000.00	4.94
5	600028	中国石化	10,000,000	88,500,000.00	4.38
6	000037	恒顺投资	1,800,000	77,320,000.00	3.79
7	000006	云天化	7,000,000	66,225,000.00	3.26
8	000026	广开集团	1,000,000	58,200,000.00	2.80
9	000012	招商银行	6,000,000	87,000,000.00	4.25
10	000053	深赛格	4,000,000	46,000,000.00	2.23

5.4 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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	资产支持证券	-	-
3	金融债券	69,080,000.00	2.94
4	企业债券	69,080,000.00	2.94
5	公司债	-	-
6	可转债(可交换债)	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	其他	69,080,000.00	2.94
10	合计	69,080,000.00	2.94

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 本基金投资股指期货的投资政策

5.13 本基金资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 报告期末前十名债券中存在流通受限情况的说明

5.17 报告期末前十名资产支持证券投资明细

5.18 报告期末前十名权证投资明细

5.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.20 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.21 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.22 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

5.23 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

5.24 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股票投资明细

5.25 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

5.26 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

5.27 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股票投资明细

5.28 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

5.29 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股票投资明细

5.30 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股票投资明细

5.31 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股票投资明细

5.32 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股票投资明细

5.33 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股票投资明细

5.34 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股票投资明细

5.35 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股票投资明细

5.36 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股票投资明细

5.37 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股票投资明细

5.38 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股票投资明细

5.39 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股票投资明细

5.40 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股票投资明细

5.41 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股票投资明细

5.42 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股票投资明细

5.43 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股票投资明细

5.44 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股票投资明细

5.45 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股票投资明细

5.46 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股票投资明细

5.47 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股票投资明细

5.48 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股票投资明细

5.49 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股票投资明细

5.50 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股票投资明细

5.51 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股票投资明细

5.52 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股票投资明细

5.53 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股票投资明细

5.54 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股票投资明细

5.55 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股票投资明细

5.56 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股票投资明细

5.57 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股票投资明细

5.58 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股票投资明细

5.59 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股票投资明细

5.60 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股票投资明细

5.61 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股票投资明细

5.62 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股票投资明细

5.63 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股票投资明细

5.64 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股票投资明细

5.65 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股票投资明细

5.66 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股票投资明细

5.67 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股票投资明细

5.68 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股票投资明细

5.69 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股票投资明细

5.70 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股票投资明细

5.71 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股票投资明细

5.72 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股票投资明细

5.73 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股票投资明细

5.74 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股票投资明细

5.75 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股票投资明细

5.76 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股票投资明细

5.77 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股票投资明细

5.78 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股票投资明细

5.79 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股票投资明细

5.80 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股票投资明细

5.81 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股票投资明细

5.82 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股票投资明细

5.83 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股票投资明细

5.84 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股票投资明细

5.85 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股票投资明细

5.86 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股票投资明细

5.87 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股票投资明细

5.88 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股票投资明细

5.89 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股票投资明细

5.90 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股票投资明细

5.91 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股票投资明细

5.92 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股票投资明细

5.93 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股票投资明细

5.94 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股票投资明细

5.95 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股票投资明细

5.96 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股票投资明细

5.97 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股票投资明细

5.98 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股票投资明细

5.99 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股票投资明细

5.100 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股票投资明细

5.101 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股票投资明细

5.102 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股票投资明细

5.103 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股票投资明细

5.104 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股票投资明细

5.105 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股票投资明细

5.106 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股票投资明细

5.107 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股票投资明细

5.108 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股票投资明细

5.109 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股票投资明细

5.110 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股票投资明细

5.111 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股票投资明细

5.112 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股票投资明细

5.113 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股票投资明细

5.114 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股票投资明细

5.115 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股票投资明细

5.116 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股票投资明细

5.117 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股票投资明细

5.118 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股票投资明细

5.119 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股票投资明细

5.120 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股票投资明细

5.121 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股票投资明细

5.122 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股票投资明细

5.123 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股票投资明细

5.124 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股票投资明细

5.125 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股票投资明细

5.126 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股票投资明细

5.127 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股票投资明细

5.128 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股票投资明细

5.129 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股票投资明细

5.130 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股票投资明细

5.131 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股票投资明细

5.132 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股票投资明细

5.133 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股票投资明细

5.134 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股票投资明细

5.135 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股票投资明细

5.136 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股票投资明细

5.137 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股票投资明细

5.138 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股票投资明细

5.139 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股票投资明细

5.140 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股票投资明细

5.141 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股票投资明细

5.142 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股票投资明细

5.143 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股票投资明细

5.144 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股票投资明细

5.145 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股票投资明细