华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

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	华安新丰利混合
基金主代码	003803
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
报告期末基金份额总额	196,847,227.64份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略,通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置,并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%＋中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华安新丰利混合A / 华安新丰利混合C
下属分级基金的交易代码	003803 / 003804
报告期末下属分级基金的份额总额	261,018.81份 / 196,586,208.83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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	华安新丰利混合A	华安新丰利混合C
1.本期已实现收益	208,352.13	22,244.53
2.本期利润	219,982.18	5,826,310.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101	0.0515
4.期末基金资产净值	773,731.70	205,833,105.06
5.期末基金份额净值	2.9643	1.0470

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

1、华安新丰利混合A:

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	190.59%	14.90%	2.64%	0.31%	187.95%	14.59%

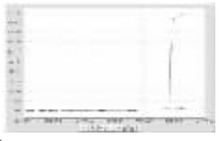
2、华安新丰利混合C:

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	3.20%	0.33%	2.64%	0.31%	0.56%	0.02%

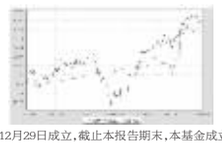
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年12月29日至2017年9月30日)

1. 华安新丰利混合A:



2. 华安新丰利混合C:



注:本基金于2016年12月29日成立,截止本报告期末,本基金成立后基金合同生效未满一年。

§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		
孙丽娜	本基金的基金经理	2016-12-29	-	7年	硕士研究生,7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月至2017年7月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理。2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任华华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年10月起,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任本基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。

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,超过授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。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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,美欧经济仍在复苏,结构上呈现欧强美弱,使得美元指数进一步回落。国内方面,供给侧改革持续推进,工业企业利润大幅改善,杠杆略降。宏观经济走势大体平稳,但三驾马车数据有所走弱。金融杠杆持续去化,"非标转标"继续,M2屡创新低,但信贷增长保持稳定。货币政策中性稳健,央行削峰填谷,流动性紧平衡,资金利率中枢逐步抬升。中美利差大幅走阔,外储持续回升,人民币加速升值。债券市场利率债收益率三季度整体高位震荡,信用债收益率上升,净融资额减少,信用利差较二季度全面走阔。

本基金三季度大幅提高权益仓位,同时保持适度利率债配置比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日, 华安新丰利灵活配置混合A份额净值为2.9643元,C份额净值为1.0470元;华安新丰利灵活配置混合A份额净值增长率为190.59%,C份额净值增长率为3.20%,同期业绩比较基准增长率2.64%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,美联储如期宣布缩表,年内仍存加息可能。欧元区CPI略有抬升,未来低通胀对货币正常化的抑制或将弱化。国内随着地产、基建和外需等方面的贡献逐步放缓,四季度经济将稳中趋降。在国企去杠杆的政策大背景下,大中型企业利润较好的结构性分化或将延续。货币政策中性稳健,相机抉择,实际力度相较于三季度将更为温和,国际收支结构性改善趋势仍将持续,外汇占款进一步修复。债券市场收益率预期将有所回落,收益率曲线依然较平坦。超预期信用风险下降,但在融资环境趋紧、严监管挤泡沫的大环境下,信用风险仍需高度警惕,尤其是对于信用资质较差的民企。转债市场我们仍将关注一级申购机会,存量券精挑细选,关注低吸机会。股票市场关注业绩确定性高、符合政策和产业升级方向的个股。

本基金将继续保持较高的权益仓位和适当的利率债仓位。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

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	191,049,306.40	92.22
	其中:股票	191,049,306.40	92.22
2	固定收益投资	12,041,110.00	5.81
	其中:债券	12,041,110.00	5.81
	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	3,789,281.92	1.83
7	其他各项资产	297,973.24	0.14
8	合计	207,177,671.56	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	508,380.00	0.25
B	采矿业	6,923,121.00	3.35
C	制造业	69,941,182.40	33.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,164,825.00	2.50
E	建筑业	7,640,752.00	3.70
F	批发和零售业	4,326,921.00	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	5,976,236.00	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,344,950.00	3.56
J	金融业	67,063,405.00	32.46
K	房地产业	10,135,515.00	4.91
L	租赁和商务服务业	1,631,998.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,653,178.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	435,456.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	2,028,359.00	0.98
S	综合	275,028.00	0.13
	合计	191,049,306.40	92.47

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

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	601318	中国平安	218,200	11,817,712.00	5.72
2	600519	贵州茅台	9,900	5,124,636.00	2.48
3	600016	民生银行	545,300	4,373,306.00	2.12
4	600036	招商银行	140,200	3,582,110.00	1.73
5	600887	伊利股份	123,200	3,388,000.00	1.64
6	601288	农业银行	879,700	3,360,454.00	1.63
7	600000	浦发银行	255,700	3,290,859.00	1.59
8	601166	兴业银行	181,400	3,136,406.00	1.52
9	000333	美的集团	62,600	2,766,294.00	1.34
10	600837	海通证券	187,000	2,763,860.00	1.34

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	1,999,000.00	0.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,004,000.00	4.84
	其中:政策性金融债	10,004,000.00	4.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	38,110.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,041,110.00	5.83

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	150409	15农发09	100,000	10,004,000.00	4.84
2	019563	17国债09	20,000	1,999,000.00	0.97
3	132012	17巨化EB	370	38,110.00	0.02

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投资。

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型(多头套期保值或空头套期保值),并根据权益类资产投资(或拟投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例;其次,本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择,以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

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 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11投资组合报告附注

5.11.12016年11月28日,海通证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]127号),原因为未按规定审查、了解客户真实身份,被中国证监会责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款;2017年5月23日,海通证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字【2017】59号),原因为公司在融资融券业务开展过程中违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"的规定,被证监会责令改正、给予警告,没收违法所得 509,653.15 元,并处罚款 2,548,265.75 元。本报告期内,本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在本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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92,500.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	205,472.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,973.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安新丰利混合A	华安新丰利混合C
本报告期期初基金份额总额	51,048,442.66	6,752.23
报告期基金总申购份额	281,161.42	196,579,707.60
减:报告期基金总赎回份额	51,068,585.27	251.00
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	261,018.81	196,586,208.83

§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

无

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	-	196,579,516.41	-	196,579,516.41	99.96%
	2	20170701-20170930	50,999,000.00	-	50,999,000.00	-	-
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、《华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

2、《华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

9.2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。

9.3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
二〇一七年十月二十五日

华安新机遇保本混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§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。

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	华安新机遇保本混合
基金主代码	001282
交易代码	001282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月27日
报告期末基金份额总额	1,557,799,347.25份
投资目标	通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略(恒定比例组合保险策略)。基金管理人主要通过数量分析,根据市场的波动来调整和维正安全垫放大倍数(即风险乘数),动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现投资组合的保本增值目标。同时,本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定具体的投资券种选择,权衡寻找各种可能的套利和价值增长机会。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
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
基金保证人	中国投融资担保有限公司

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,946,417.44
2.本期利润	13,844,201.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0081
4.期末基金资产净值	1,598,350,919.02
5.期末基金份额净值	1.026

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。

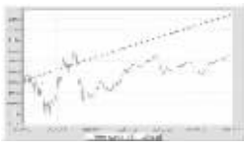
3.2 基金净值表现

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	0.79%	0.10%	0.69%	0.01%	0.10%	0.09%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华安新机遇保本混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年5月27日至2017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		
郑可成	本基金的基金经理、固定收益部助理总监	2015-05-27	-	16年	硕士研究生,16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月在福建闽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月至2017年7月,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纯债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月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年8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。2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015年11月起,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2017年7月,同时担任华安安福保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2017年7月,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。
吴丰树	本基金的基金经理	2015-05-27	-	14年	硕士研究生,14年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员,华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011年3月份加入华安基金管理有限公司,2011年7月至2013年5月担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2012年10月起同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理,2013年2月起担任华安中小盘成长混合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。2015年5月起同时担任本基金的基金经理。
徐宜宜	本基金的基金经理	2013-07-18	-	11年	硕士研究生,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),11年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月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职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任本基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年12月至2016年9月同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安国际龙头(DAX)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。2017年4月起,同时担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)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。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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

2017年三季度现货黄金开盘价1241.7美元/盎司,最高价1362.4美元/盎司,最低价1204美元/盎司,截止9月30日收盘价1282.5美元/盎司,整个季度上涨40.8美元/盎司,涨幅为3.31%。上海黄金交易所上海金开盘价276.4元/克,最高价285.00元/克,最低价268.00元/克,截止9月29日收盘价278.90元/克,整个季度上涨25元/克,涨幅为0.27%。 黄金价格受到如下因素影响:1)受到欧元强势、美国经济数据偏弱以及对美国税改信心不足等影响,美元指数在本季度下跌2.5%,刺激了金价的上涨。 2)朝核问题的发酵,使得全球市场总体避险情绪较浓,利好金价。3)本季度包括油价在内的大宗商品价格上涨较为明显,对金价起到了正面的作用。4)人民币相对于美元升值2.1%,抵消了一部分金价带来的收益,因此以人民币计价的黄金价格跑输以美元计价的黄金价格。 5)九月中旬美联储宣布开始缩表,并大概率确定了12月加息的步骤,对美元币值产生了正面的作用,因此三季度末,金价回落。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为2.7722元,本报告期份额净值增长率为1.54%,同期业绩比较基准增长率为1.59%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响黄金价格的正面因素包括楼市债市资金流出、全球经济的不确定性、特朗普政策的不确定性、全球负利率扩散以及黄金价格本身技术上的反弹。此外,地缘政治的不确定性在全球范围内均有所加强,而金融体系在未来加息的预期下仍然存在的不稳定的因素。这些因素均构成了对黄金作为避险工具的实质性利好。我们预计美元加息黄金价格在2017年全年将保持稳定向上的态势。中长期看,强势美元并不一定意味着黄金价格将在目前的水平下继续下跌,市场已经充分预期12月加息一次,18年加息三次的步骤。未来金价走势取决于美国经济的增长势头。值得注意的是,朝鲜伊朗为代表的地缘政治烽烟又起,导致全球的政治环境动荡,投资者风险偏好下降。建议投资者更加关注避险情绪的提升带来的阶段性机会。

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	600028	中国石化	6,000,000	35,400,000.00	2.21
2	002152	广电运通	4,000,000	31,320,000.00	1.96
3	600428	中远海特	2,600,000	17,420,000.00	1.09
4	601888	中国国旅	500,000	17,245,000.00	1.08
5	300133	华策影视	800,000	8,728,000.00	0.55
6	601952	苏垦农发	500,000	7,365,000.00	0.46
7	300699	光威复材	4,392	314,423.28	0.02
8	601949	中国出版	14,559	141,513.48	0.01
9	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.01
10	603106	恒银金融