华安动态灵活配置混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月15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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安动态灵活配置混合
基金主代码	040015
交易代码	040015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月22日
报告期末基金份额总额	404,542,067.79份
投资目标	通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置,在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力求为投资者获取超额回报。
投资策略	本基金将主要运用战略资产配置的方法来确定投资组合中的资产类别和权重,辅以战术资产配置来动态优化投资组合中各类资产的配置比例。在具体投资品种选择方面,本基金将综合运用定量分析和定性分析手段,精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在研究分析宏观经济和利率趋势等因素的基础上,选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	18,401,749.48
2.本期利润	82,069,939.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.1793
4.期末基金资产净值	459,721,669.17
5.期末基金份额净值	1.136

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

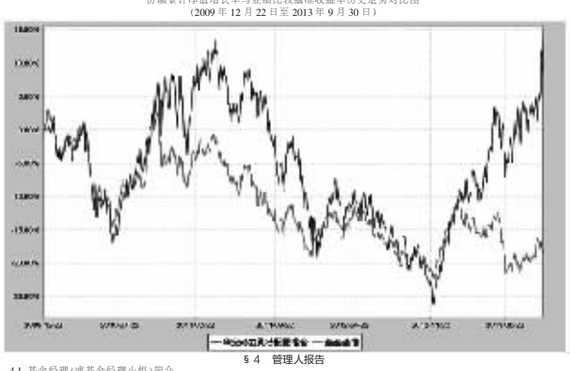
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.33%	1.50%	4.61%	0.86%	14.72%	0.64%

3.2.2 目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

华安动态灵活配置混合型证券投资基金

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

(2009年12月22日至2013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		
陈逊	本基金的基金经理	2013-3-2	-	11年	上海财经大学MBA,11年证券、基金行业从业经验,历任大鹏证券研究所、世纪证券研究所、平安证券研究所研究员、高级研究员,2008年3月加入华安基金管理有限公司,先后在投资研究部和基金投资部担任高级研究员及基金经理助理职务,2012年5月起担任华安安利股票型证券投资基金的基金经理;2013年3月起担任本基金的基金经理。
李冠宇	本基金的基金经理	2013-4-8	-	5年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾在中山证券、海通证券担任研究员,2010年3月加入华安基金管理有限公司。先后担任研究发展部研究员、基金投资部基金经理助理,2013年4月起担任本基金的基金经理,2013年4月起同时担任华安科技动力股票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 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。(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0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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	351,862,566.17	75.85
	其中:股票	351,862,566.17	75.85
2	固定收益投资	71,525,455.50	15.42
	其中:债券	71,525,455.50	15.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,150.00	4.31
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	14,520,404.07	3.13
6	其他各项资产	5,972,862.77	1.29
7	合计	463,881,438.51	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	142,401,835.38	30.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,874,000.00	1.28
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	51,837,350.00	11.28
J	金融业	4,780,000.00	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	93,638,238.56	20.37
M	科学研究和技术服务业	12,480,399.36	2.71
N	水利、环境和公共设施管理业	19,040,537.35	4.14
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	21,810,205.52	4.74
S	综合	-	-
	合计	351,862,566.17	76.54

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	300058	蓝色光标	625,000	41,875,000.00	9.11
2	300071	华谊嘉信	741,992	29,813,238.56	6.49
3	002400	省广股份	500,000	21,950,000.00	4.77
4	600637	百视通	400,000	20,940,000.00	4.55
5	002241	歌尔声学	440,000	18,603,200.00	4.05
6	300027	华谊兄弟	200,054	15,580,205.52	3.39
7	600252	中恒集团	1,000,000	14,950,000.00	3.25
8	300070	碧水源	360,023	14,652,936.10	3.19
9	002501	利源铝业	1,000,000	12,650,000.00	2.75
10	300332	天壕节能	1,000,032	12,480,399.36	2.71

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	19,958,000.00	4.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,612,996.70	0.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	48,954,458.80	10.65
8	其他	-	-
9	合计	71,525,455.50	15.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110018	国电转债	262,580	28,584,458.80	6.22
2	130002	13附息国债02	200,000	19,958,000.00	4.34
3	110023	民生转债	100,000	10,581,000.00	2.30
4	110015	石化转债	100,000	9,789,000.00	2.13
5	122939	09吉安债	24,630	2,612,996.70	0.57

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	360,766.55
2	应收证券清算款	2,046,715.16
3	应收股利	-
4	应收利息	665,308.08
5	应收申购款	2,900,072.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,972,862.77

5.10.4 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	110018	国电转债	28,584,458.80	6.22
2	110023	民生转债	10,581,000.00	2.30
3	110015	石化转债	9,789,000.00	2.13

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002400	省广股份	21,950,000.00	4.77	重大事项停牌
2	300332	天壕节能	12,480,399.36	2.71	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	487,164,283.73
本报告期基金总申购份额	17,772,668.72
减:本报告期基金总赎回份额	100,394,884.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	404,542,067.79

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	赎回	2013-09-06	-20,938,953.00	0.0000

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

2.《华安动态灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

3.《华安动态灵活配置混合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
二〇一三年十月二十四日

华安宏利股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月18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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安宏利股票
基金主代码	040005
前端交易代码	040005
后端交易代码	041005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月6日
报告期末基金份额总额	2,522,163,744.96份
投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益,以及分红所带来的红利收益,实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=中信标普300指数收益率×90%+同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的稳定增值。
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

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	174,760,305.07
2.本期利润	589,880,022.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.2281
4.期末基金资产净值	5,895,039,498.35
5.期末基金份额净值	2.3373

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

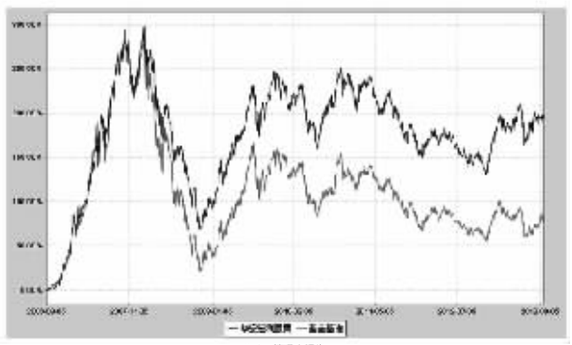
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.60%	1.24%	9.64%	1.25%	0.96%	-0.01%

3.2.2 目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

华安宏利股票型证券投资基金

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

(2006年9月6日至2013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		
尚志民	本基金的基金经理、首席投资官、副总经理	2006-9-6	-	16年	工商管理硕士,16年证券、基金从业经验,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员、现任公司首席投资官、副总经理。1999年6月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理,2000年7月至2001年9月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理,2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理,2006年9月起同时担任本基金的基金经理,2012年2月起担任华安基金副总监理兼首席投资官。
陈逊	本基金的基金经理	2012-5-30	-	11年	上海财经大学MBA,11年证券、基金行业从业经验,历任大鹏证券研究所、世纪证券研究所、平安证券研究所研究员、高级研究员,2008年3月加入华安基金管理有限公司,先后在投资研究部和基金投资部担任高级研究员及基金经理助理职务,2012年5月起担任本基金的基金经理;2013年3月起担任华安动态灵活配置混合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 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0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

三季度市场整体出现回升格局,其中沪深300指数上涨近10%。市场结构层面,除8月份以外,代表成长性风格的中小板创业板优势依然明显,涨幅显著领先主板。本基金报告期内维持积极仓位,以相对稳定的中期持股的策略进行结构调整,整体表现好于基准,但比同行仍相对落后,主要缘于对市场风格判断的失误导致成长股配置比例相对较低。

结构方面,组合三季度主要减持了地产行业,增加了耐用消费品以及部分金融行业,产生一定正面贡献。对部分传统周期行业的尝试性配置目前为止效果不明显,需要继续研究判断。对医药科技板块的低配则产生了明显的负向贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.9416元,本报告期份额净值增长率为11.72%,同期业绩比较基准增长率为7.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前时点来看,宏观经济以及政策层面保持了偏积极的发展态势,短期内市场机会继续大于风险的可能性较高。市场风格方面,高估值板块有强者恒强的可能,但把握难度显著加大。因此,本基金计划在短期投资策略上更加关注安全边际,争取在控制风险的同时尽可能获取理想的收益回报。

§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	152,638,523.60	88.30
	其中:股票	152,638,523.60	88.30
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	19,442,859.97	11.25
6	其他各项资产	774,786.01	0.45
7	合计	172,856,169.58	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	4,536,000.00	2.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	90,640,273.60	52.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,237,600.00	4.21
F	批发和零售业	4,985,400.00	2.90
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	6,166,400.00	3.59
J	金融业	29,201,250.00	16.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,027,600.00	1.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,844,000.00	3.98
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	152,638,523.60	88.80

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	600196	复星医药	32,188,808	447,102,543.12	7.58
2	002250	联化科技	15,859,990	381,115,559.70	6.47
3	002001	新 和 成	15,000,000	327,300,000.00	5.55
4	600016	民生银行	30,770,000	294,161,200.00	4.99
5	600718	东软集团	22,505,409	289,869,667.92	4.92
6	600309	万华化学	16,999,990	276,249,837.50	4.69
7	601318	中国平安	7,699,833	274,884,038.10	4.66
8	002310	东方园林	6,900,187	215,768,847.49	3.66
9	600352	浙江龙盛	16,299,927	199,674,105.75	3.39
10	002376	新北洋	15,855,015	193,114,082.70	3.28

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	162,368,500.00	2.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,171,000.00	2.53
	其中:政策性金融债	149,171,000.00	2.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	311,539,500.00	5.28

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	130007	13附息国债07	1,100,000	109,549,000.00	1.86
2	130236	13国开36	700,000	69,909,000.00	1.19
3	090211	09国开11	700,000	69,307,000.00	1.18
4	080026	08国债26	400,000	39,836,000.00	0.68
5	130002	13附息国债02	100,000	9,979,000.00	0.17

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的中国平安(601318)因子公司平安证券有限责任公司在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中存在违规行为,平安证券有限责任公司被中国证监会处以人民币5,110万元的罚款,并暂停其保荐机构资格3个月,报告期内,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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,166,255.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,668,861.35
5	应收申购款	562,161.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,397,278.63

5.10.4 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。

5.10.5 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

本报告期期初基金份额总额	2,702,998,561.62
本报告期基金总申购份额	46,765,244.39
减:本报告期基金总赎回份额	227,600,061.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,522,163,744.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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.《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》

2.《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》

3.《华安宏利股票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
二〇一三年十月二十四日

华安核心优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月18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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安核心股票
基金主代码	040011
前端交易代码	040011
后端交易代码	041011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月22日
报告期末基金份额总额	182,545,927.55份
投资目标	本基金采取"核心-卫星"股票投资策略,通过"核心"资产-沪深300指数成份股的投资力求获取股票市场整体增长的收益,通过"卫星"资产-非沪深300指数成份股的投资力求获取超额收益。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=80%×沪深300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
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

§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