华安创新证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

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: 二〇一四年四月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安创新混合
基金主代码	040001
前端交易代码	040001
后端交易代码	041001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年9月21日
报告期末基金份额总额	7,575,746,676.10份
投资目标	基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。
投资策略	本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。 这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。 高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。 传统产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。 本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相当竞争优势等。 本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,如国债和现金,从而保持基金资产良好的流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	无
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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	140,278,553.23
2.本期利润	-35,399,276.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0046
4.期末基金资产净值	4,630,685,299.59
5.期末基金份额净值	0.611

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。

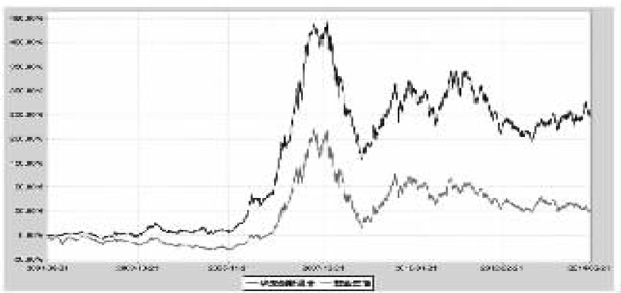
3.2 基金净值表现

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	-0.94%	1.12%	-4.90%	0.88%	3.96%	0.24%

3.2.2 自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

华安创新证券投资基金
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
(2001年9月21日至2014年3月31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		
李冠宇	本基金的基金经理	2013-10-29	-	6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月起担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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。2013年10月起同时担任本基金的基金经理,2013年11月起同时担任华安生态优先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。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3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

一季度,沪深300指数下跌7.59%,创业板指数上涨1.79%。市场波动剧烈,尤其是创业板在2月份创出新高之后,3月下旬出现急跌的情况。目前来看,市场风格由偏好成长转向偏好蓝筹价值股。我们认为风格转向的主要原因包括:(1)以创业板为首的成长股在经历了一年多的大幅上涨之后,存在一定程度的高估。因此需要通过调整来化解股价上的压力。(2)经济持续走弱,政府对房地产政策有所松动,导致部分投资者认为传统行业存在一定的投资机会。(3)部分传统行业出现高分红的情况,对部分投资者产生吸引力。

本基金在报告期期间,仓位维持在70-75%之间,配置上一直坚持成长股配置。在3月中旬适当减持部分上涨过快的股票,同时提升了医药行业的配置比重,但是创业板的下跌,超出了预期,对净值的负面影响较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为0.611元,本报告期份额净值增长率为 -0.94%,同期业绩比较基准增长率为-4.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

成长股在经历了3月的下跌之后,逐渐回归合理价值,但是离显著低估还有很远的距离。未来可能还有一定的下跌空间,之后可能又会迎来一轮新的机会。而传统行业3月底的上涨我们认为是一次反弹。房地产限购政策放开,并不能有效刺激需求,我们判断整体的的住房消费能力已基本接近极限。

基于上述判断,我们将坚守成长,等待该板块调整结束后,继续增加成长股的配置。

§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	3,253,248,661.02	69.97
	其中:股票	3,253,248,661.02	69.97
2	固定收益投资	998,277,160.00	21.47
	其中:债券	998,277,160.00	21.47
	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	166,132,849.20	3.57
	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	207,182,343.09	4.46
7	其他资产	24,592,898.73	0.53
8	合计	4,649,433,912.04	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	17,258,966.35	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,203,897,852.78	47.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,039,117.02	0.78
F	批发和零售业	108,263,602.52	2.34
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	378,362,468.62	8.17
J	金融业	90,825,950.68	1.96
K	房地产业	115,069,726.53	2.48
L	租赁和商务服务业	263,683,312.40	5.69
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	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	39,847,664.12	0.86
S	综合	-	-
	合计	3,253,248,661.02	70.25

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	3,091,365	154,568,250.00	3.34
2	002022	科华生物	6,845,719	152,591,076.51	3.30
3	000423	东阿阿胶	4,007,796	136,665,843.60	2.95
4	600557	康缘药业	4,263,253	129,986,583.97	2.81
5	600594	益佰制药	2,911,340	119,219,373.00	2.57
6	600804	鹏博士	8,375,060	114,068,317.20	2.46
7	002063	远光软件	5,189,302	110,532,132.60	2.39
8	600252	中恒集团	7,800,469	100,080,017.27	2.16
9	600175	美都控股	16,231,271	99,335,378.52	2.15
10	300115	长盈精密	2,874,815	95,156,376.50	2.05

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	208,800,160.00	4.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	789,477,000.00	17.05
	其中:政策性金融债	789,477,000.00	17.05
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	998,277,160.00	21.56

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	130236	13国开36	1,400,000	139,846,000.00	3.02
2	130007	13附息国债07	1,000,000	100,000,000.00	2.16
3	070227	07国开27	800,000	80,072,000.00	1.73
4	130227	13国开27	800,000	79,880,000.00	1.73
5	130326	13进出26	800,000	79,584,000.00	1.72

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。

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。

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投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,989,196.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,404,325.62
5	应收申购款	199,376.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,592,898.73

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

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	002063	远光软件	110,532,132.60	2.39	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,789,975,888.01
报告期基金总申购份额	74,437,993.78
减:报告期基金总赎回份额	288,667,205.69
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,575,746,676.10

§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

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、《华安创新证券投资基金基金合同》
2、《华安创新证券投资基金招募说明书》
3、《华安创新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
二〇一四年四月二十二日

华安策略优选股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

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: 二〇一四年四月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安策略优选股票
基金主代码	040008
前端交易代码	040008
后端交易代码	041008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月2日
报告期末基金份额总额	12,508,803,184.80份
投资目标	以优选股票为主,配合多种投资策略,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	① 资产配置策略 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,并利用公司研究开发的数量模型工具,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,确定合适的资产配置比例。 ② 股票投资策略 本基金的股票投资策略将采用"自下而上"和"自上而下"相结合的方法,通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以"自下而上"的优选成长策略为主,辅以"自上而下"的主题优选策略、逆势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的中长期稳定增值。 ③ 债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。 ④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	173,319,836.33
2.本期利润	-511,829,216.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0402
4.期末基金资产净值	7,462,687,709.71
5.期末基金份额净值	0.5966

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。

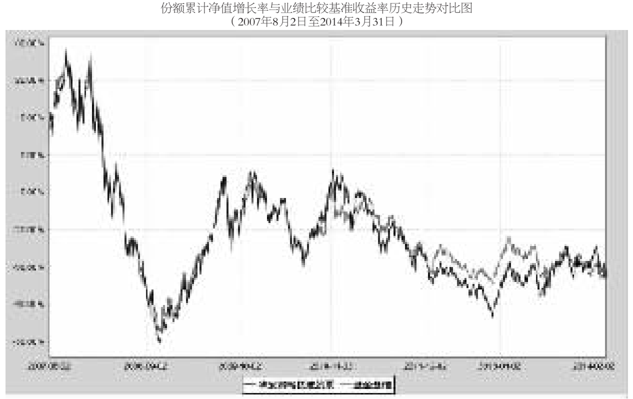
3.2 基金净值表现

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	-6.43%	1.42%	-4.01%	0.94%	-2.42%	0.48%

3.2.2 自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

华安策略优选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
(2007年8月2日至2014年3月31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		
杨明	本基金的基金经理、投资研究部总监	2013-6-5	-	13年	中央财经大学硕士研究生,13年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004年10月加入华安基金管理有限公司,任研究发展部研究员。现任投资研究部总监。2013年6月起担任本基金的基金经理。

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3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

一季度,宏观经济走弱,出口、投资和消费增速全面回落,通胀走低,M2和社融增速下行。外汇占款增加、国内流动性改善,人民币兑美元汇率一改单边升值走势,双边波动加剧。本季度A股市场走势震荡,分化依旧。从年初到2月中旬,在沪深300指数继续萎靡的同时,创业板表现优异,指数上涨超过20%。但从2月下旬之后,大小指数均表现不佳,创业板的跌幅更是超过主板市场。

本基金在报告期内仓位基本保持稳定,适当提高了持股集中度。择机减持了部分高估值的创业板股票,增加了价值股的持仓,向前期大幅回落且具有较好成长前景的制造类公司进行倾斜。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为0.5966元,本报告期份额净值增长率为 -6.43%,同期业绩比较基准增长率为-4.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为二季度受基数效应以及保增长政策的影响,宏观经济将有所改善,体制改革、结构调整仍然是带来变化的主线。综合考虑经济、盈利、估值等因素,适应于整个经济转型的大方向,我们认为市场将继续呈现结构性行情。本基金将继续按照体制改革、经济转型的大逻辑,结合各个行业、公司的具体情况,以及估值水平、安全边际,关注业绩与估值相匹配的蓝筹股投资机会。

§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	6,645,706,938.42	88.71
	其中:股票	6,645,706,938.42	88.71
2	固定收益投资	399,744,000.00	5.34
	其中:债券	399,744,000.00	5.34
	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	91,850,337.78	1.23
	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	285,992,962.19	3.82
7	其他资产	68,201,583.28	0.91
8	合计	7,491,495,821.67	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	503.00	0.00
C	制造业	5,163,283,421.60	69.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,461,090.51	0.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,517,439.68	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	10,104,550.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	274,083,329.31	3.67
J	金融业	97,471,645.50	1.31
K	房地产业	633,024,682.26	8.48
L	租赁和商务服务业	267,450,667.87	3.58
M	科学研究和技术服务业	82,254,291.79	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	44,174,871.00	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,639,125.90	0.25
R	文化、体育和娱乐业	240,156.00	0.00
S	综合	1,164.00	0.00
	合计	6,645,706,938.42	89.05

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	600352	浙江龙盛	22,129,430	359,824,531.80	4.82
2	000625	长安汽车	36,894,329	353,078,728.53	4.73
3	600089	特变电工	35,147,945	316,682,984.45	4.24
4	600585	海螺水泥	17,841,268	291,526,319.12	3.91
5	000002	万 科A	34,812,340	281,631,830.60	3.77
6	600703	三安光电	11,257,973	256,118,885.75	3.43
7	600309	万华化学	13,869,531	242,300,706.57	3.25
8	600597	光明乳业	13,924,841	233,380,335.16	3.13
9	600196	复星医药	11,384,589	228,033,317.67	3.06
10	600151	航天机电	30,337,416	227,833,994.16	3.05

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	20,000,000.00	0.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	379,744,000.00	5.09
	其中:政策性金融债	379,744,000.00	5.09
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	399,744,000.00	5.36

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	070406	07农发06	2,200,000	219,824,000.00	2.95
2	130218	13国开18	600,000	60,000,000.00	0.80
3	110406	11农发06	500,000	50,005,000.00	0.67
4	130311	13进出11	500,000	49,915,000.00	0.67
5	130007	13附息国债07	200,000	20,000,000.00	0.27

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。

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。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有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	2,427,418.19
2	应收证券清算款	52,956,490.57
3	应收股利	-
4	应收利息	12,627,048.44
5	应收申购款	190,626.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,201,583.28

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本期末本基金未持有可转换债券。

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

报告期期初基金份额总额	12,924,349,951.17
报告期基金总申购份额	19,578,647.05
减:报告期基金总赎回份额	435,125,413.42
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	12,508,803,184.80

§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

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、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》
2、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》
3、《华安策略优选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
二〇一四年四月二十二日

华安宝利配置证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

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: 二〇一四年四月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安宝利配置混合
基金主代码	040004
前端交易代码	040004
后端交易代码	041004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年8月24日
报告期末基金份额总额	2,467,294,182.83份
投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。
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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	134,518,338.41
2.本期利润	-101,537,089.37
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0370
4.期末基金资产净值	2,640,239,751.63
5.期末基金份额净值	1.070

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。

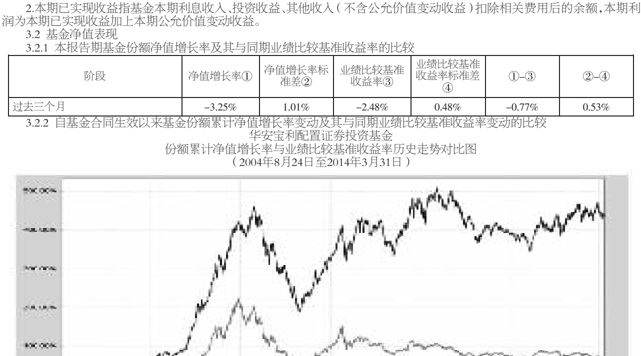
3.2 基金净值表现

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	-3.25%	1.01%	-2.48%	0.48%	-0.77%	0.53%

3.2.2 自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

华安宝利配置证券投资基金
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
(2004年8月24日至2014年3月31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		
陆从珍	本基金的基金经理	2010-4-21	-	13年	经济学硕士,13年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员;京华山一证券上海公司高级研究员;中企东方资产管理公司高级研究员;东方证券研究部资深研究员等职。2008年3月加入华安基金管理公司,任研究发展部高级研究员,2009年5月16日起至2010年4月21日担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理,2010年4月起担任本基金的基金经理。2012年8月起同时担任华安逆向策略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。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3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

2014年一季度的A股市场走势震荡,分化依旧。从年初到2月中旬,在沪深300指数继续萎靡的同时,创业板表现优异,指数上涨超过20%。但从2月下旬之后,大小指数均表现不佳,创业板的跌幅更是超过主板市场。

一季度,华安宝利配置在仓位上较为保守,一直在70%以下;在行业配置上,阶段性增加了对金融地产等低估值行业的配置比例;在个股方面,在成长股上涨的过程中对其进行了一定的减持。总体而言,宝利保持了一个比较均衡的配置,但年初至2月中旬的成长股行情超过了基金经理的预期,使得基金净值在此期间表现落后,但在随后的回调行情中,基金的相对表现则有所上升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为1.070元,本报告期份额净值增长率为 -3.25%,同期业绩比较基准增长率为-2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2014年,国内经济增长依然不容乐观,从已经公布的经济数据分析2014年一季度的GDP增速有所回落,这造成A股市场重心下移。基于对经济增速下滑的判断,A股投资者在年初延续了2013年的投资策略,依然将重点聚焦于成长股,无奈企业利润的增速无法跟上高企的估值,导致后期股价的大幅回调。

2014年,中国经济面临一系列的问题,如地方政府债务、巨量信托资产到期兑付、实体资金利率依然高企等等问题,增长与转型的压力同时存在。两会期间,中央确定了今年GDP7.5%的增长目标,以目前来看,存在一定的困难,因此我们判断后期存在放松的可能,这将有利于传统行业中有竞争力的公司。但以我们所处的经济增长阶段而言,传统周期行业能够提供的只是阶段性的行情,而长期的投资机会还是在于成长和新兴产业。我们将努力在合适的价格上对这类公司进行投资,同时,我们也看好制度变革带来的相关投资机会。

§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	1,750,087,275.06	65.96
	其中:股票	1,750,087,275.06	65.96
2	固定收益投资	684,758,730.62	25.81
	其中:债券	665,432,812.81	25.08
	资产支持证券	19,325,917.81	0.73
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	64,500,429.15	2.43
	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	141,412,526.75	5.33
7	其他资产	12,645,192.70	0.48
8	合计	2,653,404,154.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	1,010,966,839.16	38.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,978,668.85	1.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	83,954,000.00	3.18
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	226,022,775.14	8.56
J	金融业	62,190,000.00	2.36
K	房地产业	107,063,000.00	4.06
L	租赁和商务服务业	53,592,000.00	2.03
M	科学研究和技术服务业	36,090,000.00	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	127,229,991.91	4.82
S	综合	-	-
	合计	1,750,087,275.06	66.29

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	600518	康美药业	8,500,000	137,700,000.00	5.22
2	002250	联化科技	7,068,996	130,281,596.28	4.93
3	002063	远光软件	4,537,178	96,641,891.40	3.66
4	600048	保利地产	11,300,000	85,993,000.00	3.26
5	300002	神州泰岳	3,200,000	75,040,000.00	2.84
6	002415	海康威视	3,990,000	69,625,500.00	2.64
7	600079	人福医药	2,490,000	68,375,400.00	2.59
8	600312	平高电气	5,300,000	66,992,000.00	2.54
9	300309	吉艾科技	3,300,000	65,340,000.00	2.47
10	600594	益佰制药	1,430,000	58,558,500.00	2.22

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	5,009,386.90	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,643,000.00	10.25
	其中:政策性金融债	270,643,000.00	10.25
4	企业债券	154,926,580.10	5.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	234,853,845.81	8.90
8	其他	-	-
9	合计	665,432,812.81	25.20

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	090411	09农发11	1,500,000	150,735,000.00	5.71
2	113001	中行转债	1,000,000	97,930,000.00	3.71
3	113003	重工转债	812,360	85,021,597.60	3.22
4	120409	12农发09	800,000	79,880,000.00	3.03
5	110015	石化转债	400,000	40,948,000.00	1.55

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119031	澜沧江3	200,000	19,325,917.81	0.73

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。

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。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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 本基金投资国债期货的投资政策

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	733,387.79
2	应收证券清算款	1,678,297.20
3	应收股利	-
4	应收利息	9,092,732.84
5	应收申购款	1,140,774.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,645,192.70

5.11.4 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	113001	中行转债	97,930,000.00	3.71
2	113003	重工转债	85,021,597.60	3.22
3	110015	石化转债	40,948,000.00	1.55
4	110017	中海转债	4,567,500.00	0.17
5	128001	泰尔转债	3,547,452.96	0.13
6	125887	中鼎转债	1,604,658.75	0.06

5.11.5 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	002063	远光软件	96,641,891.40	3.66	公告重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,070,593,877.73
报告期基金总申购份额	58,878,109.95
减:报告期基金总赎回份额	662,177,804.85
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,467,294,182.83

§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

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、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
3、《华安宝利配置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
二〇一四年四月二十二日