华安安信消费服务股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十九日

§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2014年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安信消费股票
基金主代码	519002
交易代码	519002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月23日
报告期末基金份额总额	708,347,229.61份
投资目标	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险,确保基金资产的安全,并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金为成长型基金,本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%,其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的20-50%,股票资产的比例控制在45-80%,现金比例根据运作情况调整。在股票资产中,70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。 本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好,在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势,财务状况良好,能保持较高的业绩增长,预期收入或利润增长率不低于同期GDP增长率的上市公司股票。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-9,927,115.81
2.本期利润	21,463,389.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0278
4.期末基金资产净值	651,061,556.03
5.期末基金份额净值	0.919

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.本基金已于2013年6月24日对原安信证券投资基金退市时的基金份额进行了折算,基金折算比例为1:1.016880461。

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

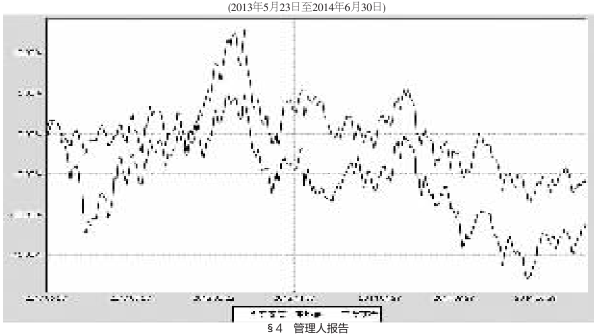
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.49%	1.04%	0.03%	0.92%	3.46%	0.12%

3.2.2 自基金转型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

华安安信消费服务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

(2013年5月23日至2014年6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		
陈俏宇	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2008-2-13	-	18年	工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,18年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理,2007年3月至2008年2月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理,2008年2月起担任本基金的基金经理,2008年10月起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。2011年4月起同时担任华安升级主题股票型证券投资基金的基金经理。2014年4月起兼任基金投资部副总监。

注:1.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。

2.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

报告期内沪深300指数微升0.88%,同期上证50指数上涨1.13%,中证500上涨2.20%,创业板指数则上涨5.79%,而本基金比较基准选取的中证消费服务领先指数涨幅仅为0.03%。虽然指数间的差异较之前有所收敛,但从行业分类指数的表现来看,分化仍相当明显,其中军工、电子和半导体,以及有色金属等行业整体表现良好,而交运、食品饮料、商贸和房地产等行业则出现了调整。应该说二季度的市场表现与一季度并无本质差异,受制于经济层面和流动性的约束,市场在显示其纠结特征的同时,板块和个股的表现则显现出活跃性。投资者在业绩预期和估值要求上,对新兴行业表现出相当的宽容度,而对传统行业,即使是其中的稳定增长型公司则表现出更具体更严苛的要求。

本基金对宏观和中观经济的保守观点并未做调整,应该说此判断与实际情况较为吻合,但基于对市场估值取向的反思,认为组合整体风格过于防守,因此报告期内主要从提高组合进攻性方面进行调整。在具体操作方面,进一步降低了对部分盈利模式难以理解和把控的公司的配置比重,集中增加了通信和信息服务等轻资产类型公司的比重,整体效果较理想。尽管报告期内仍有重点持仓品种的黑天鹅事件再度发生,以及部分品种的估值未获得市场认同,但整体组合绩效较理想,超越了同期的业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为0.919元,本报告期份额净值增长率为3.49%,同期业绩比较基准增长率为0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金下一阶段的操作思路仍将延续我们对成长股的选择。尽管我们也注意到在底线思维下,政策正在逐步释放微刺激的信号,我们也相信政策的累积效应在某一时点会产生效果,但是由于我们对经济转型的大格局没有进行调整,所以我们相信这一次会有所不同,也必然要有所不同。我们认为对更健康的有机增长方式追求的意志力会决定微刺激的效果将以更缓慢,持续和深远的方式显现,经济有托底,但真正能使中国经济摆脱政策依赖路径,建立起核心竞争力的产业,才更能获得市场的认同。基于对市场估值偏好的理解与反思,我们将继续坚守部分稳定增长类品种,同时在更多的行业内寻找传统业务保持相对稳定,且在新领域中具有自我挑战和开拓精神,能快速建立起先发优势,同时盈利模式具有一定壁垒的优秀公司进行投资。

§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	602,968,996.39	91.91
	其中:股票	602,968,996.39	91.91
2	固定收益投资	21,556,350.00	3.29
	其中:债券	21,556,350.00	3.29
	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	30,515,943.34	4.65
7	其他资产	983,718.55	0.15
8	合计	656,025,008.28	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	431,817,646.95	66.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,143,759.80	1.25
E	建筑业	3,141,990.72	0.48
F	批发和零售业	10,646,400.00	1.64
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	89,529,913.80	13.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,760,095.08	2.88
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	21,975,190.04	3.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	18,954,000.00	2.91
	合计	602,968,996.39	92.61

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	600867	通化东宝	4,300,000	56,029,000.00	8.61
2	002250	联化科技	3,870,000	54,954,000.00	8.44
3	002450	康得新	2,390,000	54,372,500.00	8.35
4	300146	汤臣倍健	1,680,000	41,412,000.00	6.36
5	300273	和佳股份	1,250,000	38,375,000.00	5.89
6	600887	伊利股份	1,130,000	37,425,600.00	5.75
7	300017	网宿科技	460,000	29,348,000.00	4.51
8	002038	双鹭药业	637,000	28,391,090.00	4.36
9	002065	东华软件	1,050,000	21,126,000.00	3.24
10	600256	广汇能源	2,700,000	18,954,000.00	2.91

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	1,582,350.00	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,974,000.00	3.07
	其中:政策性金融债	19,974,000.00	3.07
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	21,556,350.00	3.31

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	140437	14农发37	200,000	19,974,000.00	3.07
2	010213	02国债⒀	16,500	1,582,350.00	0.24

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 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	270,664.62
2	应收证券清算款	649,776.22
3	应收股利	-
4	应收利息	63,277.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	983,718.55

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无流通受限股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	805,093,611.68
报告期基金总申购份额	2,544,153.57
减:报告期基金总赎回份额	99,290,535.64
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	708,347,229.61

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	29,020,212.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	29,020,212.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.1

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、《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安安信消费服务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
二〇一四年七月十九日

华安宝利配置证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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: 二〇一四年七月十九日

§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7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2014年4月1日起至6月30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	2,393,549,962.85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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	25,223,281.78
2.本期利润	110,612,358.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0452
4.期末基金资产净值	2,669,534,645.49
5.期末基金份额净值	1.115

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

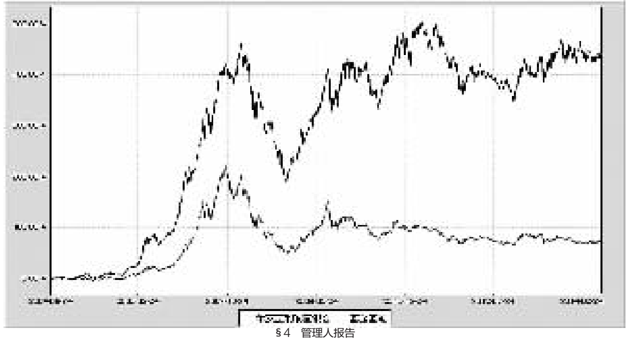
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.21%	0.58%	2.54%	0.38%	1.67%	0.20%

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6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		
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。2014年4月起,同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:1.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。

2.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

二季度以来,A股主板市场窄幅波动,沪深300指数仅上涨0.88%,其区间波动也在10个百分点以内,在如此窄幅的波动区间内,大市值股票普遍表现不佳。

相对而言,创业板在此段时间内先跌后涨,一些个股表现亮丽,尤其在5月中旬之后,市场主题投资活跃。我们于一季度末判断市场难以有大的起色,因此在二季度中,宝利在仓位方面变化不大,依然以较低的仓位运作,而在行业与个股方面,组合降低了在地产和金融方面的配置比例,略微增加了TMT行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.115元,本报告期份额净值增长率为 4.21%,同期业绩比较基准增长率为2.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年1季度,国内GDP获得了7.4%的增长,超过市场预期,但与以前的高增长相比,已经有大幅回落,而工业增加值一直在9%以下,企业盈利受压,因此,在二季度,我们看到了一系列的刺激政策出台,如定向降准,调整贷存比计算因子等,使得银行的放款能力增加,加上资金利率的下移,资金较为充裕,市场信心提升,以创业板为代表的中小市值公司股价表现良好。

虽然从经济的中长期角度来讲,目前的微刺激政策将使得有限的资源更加集中在国有低效部门,并不利于国内经济的转型,但相对稳定的经济增长环境有利于股市局部表现,预期代表未来经济的行业能够持续有所表现,我们在后续投资中将加大对这些行业的配置。

§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	1,689,936,755.37	60.23
	其中:股票	1,689,936,755.37	60.23
2	固定收益投资	600,152,465.49	21.39
	其中:债券	580,826,547.68	20.70
	资产支持证券	19,325,917.81	0.69
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	344,481,467.22	12.28
	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	163,443,337.18	5.82
7	其他资产	8,007,948.60	0.29
8	合计	2,806,021,973.86	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	11,060,000.00	0.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,055,993,422.02	39.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,252,311.90	1.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	109,851,733.28	4.12
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	175,508,090.12	6.57
J	金融业	18,090,000.00	0.68
K	房地产业	60,736,000.00	2.28
L	租赁和商务服务业	46,827,000.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	37,696,000.00	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	4,690,000.00	0.18
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	128,232,198.05	4.80
S	综合	-	-
	合计	1,689,936,755.37	63.30

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	002250	联化科技	10,603,494	150,569,614.80	5.64
2	600518	康美药业	8,850,000	132,307,500.00	4.96
3	002063	远光软件	4,537,178	92,785,290.10	3.48
4	600089	特变电工	9,452,858	80,254,764.42	3.01
5	600079	人福医药	2,490,000	74,326,500.00	2.78
6	600312	平高电气	5,300,000	73,882,000.00	2.77
7	002450	康得新	2,930,000	66,657,500.00	2.50
8	300309	吉艾科技	3,300,000	66,429,000.00	2.49
9	002415	海康威视	3,748,200	63,494,508.00	2.38
10	600153	建发股份	11,007,930	59,993,218.50	2.25

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	5,069,232.00	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,285,000.00	6.38
	其中:政策性金融债	170,285,000.00	6.38
4	企业债券	156,543,482.90	5.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	248,928,832.78	9.32
8	其他	-	-
9	合计	580,826,547.68	21.76

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	150,195,000.00	5.63
2	113001	中行转债	1,000,000	101,790,000.00	3.81
3	113003	重工转债	812,360	92,251,601.60	3.46
4	110015	石化转债	400,000	43,188,000.00	1.62
5	088039	08兵器装备债	300,000	30,300,000.00	1.14

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	0.72

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	707,264.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,538,390.46
5	应收申购款	762,293.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,007,948.60

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	101,790,000.00	3.81
2	113003	重工转债	92,251,601.60	3.46
3	110015	石化转债	43,188,000.00	1.62
4	110017	中海转债	4,682,000.00	0.18
5	128001	泰尔转债	3,806,943.48	0.14
6	125887	中鼎转债	1,876,105.90	0.07
7	113005	平安转债	1,334,181.80	0.05

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,467,294,182.83
报告期基金总申购份额	90,152,161.99
减:报告期基金总赎回份额	163,896,381.97
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,393,549,962.85

§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
二〇一四年七月十九日

华安保本混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十九日

§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2014年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安保本混合
基金主代码	000072
交易代码	000072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月14日
报告期末基金份额总额	618,150,981.97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)。基金管理人通过数量分析,根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数(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,积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准: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。
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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	13,835,813.63
2.本期利润	24,584,470.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0368
4.期末基金资产净值	642,695,905.08
5.期末基金份额净值	1.040

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

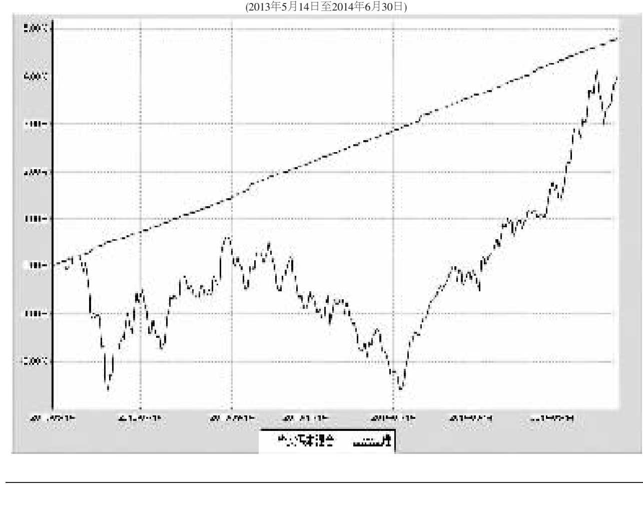
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.69%	0.21%	1.02%	0.01%	2.67%	0.20%

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

华安保本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

(2013年5月14日至2014年6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	2013-5-14	-	12年	硕士研究生,12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月在福建儒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月起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增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任本基金的基金经理。
吴丰树	本基金的基金经理	2013-5-14	-	11年	硕士研究生,11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股票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股票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股票型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任本基金的基金经理。
张晟刚	本基金的基金经理	2013-5-24	-	15年	硕士研究生,15年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金及华安日日鑫货币市场基金的基金经理;2013年3月起同时担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任本基金的基金经理。2013年10月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2013年11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。

注:1.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。

2.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

回顾上半年,一季度经济增速下行至7.4%,其中房地产是增长面临的最大下行风险。二季度以来,政府在保持定力的基础上,陆续出台约17项微刺激稳增长措施。随着政策的落实和显效,6月基本面出现边际改善的迹象(发电量、制造业PMI反弹),经济短期内企稳。年初以来央行货币政策态度转为"总量稳定,结构优化",通过定向降准和国开行再贷款支持"三农"和小微,并且尽量熨平资金面的季节性波动。

货币市场利率的全面回落,银行间的隔夜和7天回购利率中枢继续下移,接近去年一季度末的利率低点,6月底在银行体系流动性充裕的情况下安然度过。5月,五部委联合发布127号文,配合此前的99号文,标志着监管升级重拳治理影子银行和非标资产。债市在"宽货币"和"严监管"的双重驱动下继续演绎牛市行情。中长端利率大幅走低,10年金融债收益今年以来首度降至5.0%以下。信用债市场,中高等级的短融和有政府信用背书的城投债依然是市场的交投热点,利率中枢较一季度下移70BPS和50BPS。

股市方面,大盘低位震荡。保增长和宽货币为大盘托底,但地产下行、结构性问题和改革效果的不确定性,影响了投资者的风险偏好。蓝筹股的配置价值突出,底部逐渐显现投资价值,中小市值板块分化严重。

本报告期内,适度降低债券投资比例,增加了权益类和转债的投资。信用债方面,坚持高票息策略;权益方面,关注金融地产的价值修复性机会。通过审慎和积极的管理,在控制风险的基础上,积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.040元,本报告期份额净值增长率为 3.69%,同期业绩比较基准增长率为1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,宏观经济增速下行压力仍然较大。定向刺激下,基建投资抵御房地产周期的下滑效果有限,出口在全球经济新常态下亦难以全面发力。通胀短期将不构成压力。

但另一方面,保增长政策将为短期经济托底。央行着力化解货币堆积,引导银行增加信贷支持实体经济。定向刺激、基建投资、结构性减税将推动短期内经济反弹。大额CD推出,长远看将提升银行的负债成本。财税体制改革深化,地方债发行规模增加,都将带来利率债收益率上行压力。还需要关注IPO带来的资金扰动,流动性有可能将结构性和阶段性失衡。债市短期内将面临反复,需警惕基本面和配置力量边际上的变化。股市将出现修复性的反弹行情。

操作方面,我们将继续关注权益类资产的配置和交易性机会,由于收益率大幅走低,短期经济下行空间被封杀,蓝筹股的投资价值有修复机会。债市曲线较平坦,关注短期限品种的投资机会。在控制组合风险的基础上,为投资者积极赚取高收益。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

§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	131,955,279.93	13.37
	其中:股票	131,955,279.93	13.37
2	固定收益投资	811,862,349.50	82.25
	其中:债券	811,862,349.50	82.25
	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	4,604,600.38	0.47
7	其他资产	38,685,808.28	3.92
8	合计	987,108,038.09	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	8,435,744.80	1.31
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	-	-
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	-	-
J	金融业	56,702,685.28	8.82
K	房地产业	50,102,951.46	7.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,713,898.39	2.60
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	131,955,279.93	20.53

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	000002	万 科A	6,058,398	50,102,951.46	7.80
2	601166	兴业银行	3,300,000	33,099,000.00	5.15
3	601318	中国平安	599,992	23,603,685.28	3.67
4	000069	华侨城A	3,563,731	16,713,898.39	2.60
5	000530	大冷股份	500,000	4,905,000.00	0.76
6	600703	三安光电	150,000	3,514,500.00	0.55
7	603006	联明股份	1,136	16,244.80	0.00

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,008,000.00	6.23
	其中:政策性金融债	40,008,000.00	6.23
4	企业债券	271,758,613.90	42.28
5	企业短期融资券	141,308,000.00	21.99
6	中期票据	276,726,000.00	43.06
7	可转债	82,061,735.60	12.77
8	其他	-	-
9	合计	811,862,349.50	126.32

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	122033	09富力债	792,000	79,643,520.00	12.39
2	1382255	13云城投MTN2	600,000	59,106,000.00	9.20
3	112060	12金风01	553,990	55,869,891.50	8.69
4	113005	平安转债	430,000	45,932,600.00	7.15
5	101359007	13粤发电MTN001	450,000	45,513,000.00	7.08

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

本基金本报告期没有投资贵金属。

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

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),并根据风险资产投资(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,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。此外,基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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	88,608.50
2	应收证券清算款	16,858,297.25
3	应收股利	-
4	应收利息	21,726,733.80
5	应收申购款	12,168.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,685,808.28

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	113005	平安转债	45,932,600.00	7.15
2	113002	工行转债	20,431,790.00	3.18
3	110018	国电转债	15,524,593.60	2.42
4	110015	石化转债	172,752.00	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	714,214,062.46
报告期基金总申购份额	2,603,746.08
减:报告期基金总赎回份额	98,666,826.57
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	618,150,981.97

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安保本混合型型证券投资基金基金合同》

2、《华安保本混合型型证券投资基金招募说明书》

3、《华安保本混合型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
二〇一四年七月十九日