华安核心优选股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014 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: 二〇一四年十月二十四日

§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 2014 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 2014 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	126,573,039.78 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

主要财务指标	报告期 (2014 年 7 月 1 日-2014 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,701,454.28
2.本期利润	13,076,778.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0929
4.期末基金资产净值	133,787,221.40
5.期末基金份额净值	1.0570

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	9.80%	0.67%	10.78%	0.71%	-0.98%	-0.04%

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

华安核心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

(2008 年 10 月 22 日至 2014 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		
陈俏宇	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2008-10-22	-	19年	工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,19 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股票型证券投资基金的基金经理助理,2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任安顺证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2008 年 2 月起担任安信证券投资基金的基金经理,2008 年 10 月起同时担任本基金的基金经理。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。
杨鑫鑫	本基金的基金经理	2013-6-5	-	6年	硕士研究生,具有基金从业资格,6 年基金行业从业资格。2008 年 7 月应届进入华安基金管理有限公司,先后担任研究发展部行业研究员、基金投资部基金经理助理。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,超过授权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

三季度市场出现全面上涨,沪深 300 指数涨幅达到 13.2%,中小板综指涨幅超过 20%,市场风格继续偏向小盘股。细分来看,大盘股主要涨幅在 7 月份已经完成,8、9 月份以横盘震荡为主,相反 8、9 月份成了小盘股表现活跃的主要阶段。由于对宏观经济的整体判断没有发生改变,组合在报告期内维持了中性偏低的仓位,持仓结构继续偏向于沪深 300 风格,对主题投资与并购重组参与很少,因此导致三季度组合净值最终小幅跑输基准,相比同行则落后较多。对政策风向与市场情绪把握欠缺需要进行反思。

结构方面,报告期内组合配置适当回归均衡,减持了前期配置较重的汽车建材等周期类行业,对零售、旅游、医药等消费类行业进行了一定幅度增持。在 TMT 领域,由于积的估值水平始终保持高位,并且盈利水平也没有超出预期的表现,组合在这类板块维持低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 9 月 30 日,本基金份额净值为 1.057 元,本报告期份额净值增长率为 9.80%,同期业绩比较基准增长率为 10.78%。

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,三季度工业企业利润状况下行态势已经比较显著,预计将逐步影响到多数后周期、弱周期行业,改革重于增长也已经成为政策领域共识。基于此,组合在整体投资上将维持此前的策略,同时在合适的时机提升参与主题投资的灵活性。此外,在弱势宏观背景下加强对个股基本面的深入研判是需要一以贯之的重点工作。

§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	100,711,244.00	74.08
	其中:股票	100,711,244.00	74.08
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	34,760,748.41	25.57
7	其他资产	476,897.11	0.35
8	合计	135,948,889.52	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	3,284,760.00	2.46
B	采矿业	4,293,000.00	3.21
C	制造业	55,160,461.00	41.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,073.00	0.03
E	建筑业	2,628,000.00	1.96
F	批发和零售业	6,682,500.00	4.99
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	6,658,800.00	4.98
J	金融业	15,879,870.00	11.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,959,200.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,041,100.00	2.27
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	87,480.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	100,711,244.00	75.28

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	600050	中国联通	1,860,000	6,658,800.00	4.98
2	600036	招商银行	639,000	6,639,210.00	4.96
3	000060	中金岭南	690,000	5,285,400.00	3.95
4	300145	南方泵业	252,000	5,284,440.00	3.95
5	000528	柳 工	720,000	5,126,400.00	3.83
6	601318	中国平安	123,000	5,084,820.00	3.80
7	000501	鄂武商 A	327,000	4,492,980.00	3.36
8	002283	天润曲轴	531,000	4,343,580.00	3.25
9	600028	中国石化	810,000	4,293,000.00	3.21
10	600085	同仁堂	225,000	4,261,500.00	3.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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	38,986.00
2	应收证券清算款	324,476.79
3	应收股利	-
4	应收利息	5,640.63
5	应收申购款	107,793.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	476,897.11

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在流通受限的情况。

本基金本报告期末前十名股票中不在在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	168,319,519.19
报告期期间基金总申购份额	28,077,724.20
减:报告期期间基金总赎回份额	69,824,203.61
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	126,573,039.78

§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	47,409,679.75
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	47,409,679.75
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00%

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2014-07-09	-20,000,000.00	-19,288,000.00	0.00%
2	赎回	2014-07-24	-14,000,000.00	-13,998,600.00	0.00%
3	赎回	2014-07-29	-13,409,679.75	-13,726,148.19	0.00%
合计			-47,409,679.75	-47,012,748.19	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安核心优选股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安核心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
二〇一四年十月二十四日

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年十月二十四日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安顺灵活配置-转型后
基金主代码	519909
交易代码	519909
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 5 月 12 日
报告期末基金份额总额	2,831,156,271.71 份
投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置,并结合对个股、个券的精选策略,以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	本基金业绩比较基准:50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的预期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	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 7 月 1 日-2014 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	140,366,126.84
2.本期利润	360,515,990.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.1077
4.期末基金资产净值	3,221,351,365.51
5.期末基金份额净值	1.138

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	10.92%	0.78%	8.58%	0.45%	2.34%	0.33%

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

华安安顺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

(2014 年 5 月 12 日至 2014 年 9 月 30 日)

注:1.本基金转型日期为 2014 年 5 月 12 日,截止报告期末,本基金转型后基金合同生效未满一年。

2.根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定,基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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	2003-9-18	-	17年	工商管理硕士,17 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、现任公司副总经理、首席投资官。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 月至今担任本基金的基金经理,2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 2 月起担任华安基金副总经理兼首席投资官。

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

报告期间沪深 300 指数上涨 13.20%,同期上证 50 指数上涨 9.26%,中证 500 涨幅则达到 25.25%,市场风格继续偏向小盘股。7 月未以来市场的上涨,动力主要来自市场对经济企稳的预期以及对于沪港通等政策效果的憧憬。

报告期内,本基金认为经济仍面临一定下行压力,同时,在就业可控前提下,政策仍重更于中长期制度建设,对经济“是托不是举”;但金融尾部风险的趋弱以及各类资产价值的比价变化,都有利于市场大环境的向好,这为自下而上的选股模式创造了较好的外部环境;本基金给终保持相对权极的仓位,操作上主要增加了建筑、传媒、工业机械等行业的配置,降低了保险、化工、银行等行业的配置,在转开放式基金运行后取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 9 月 30 日,本基金份额净值为 1.138 元,本报告期份额净值增长率为 10.92%,同期业绩比较基准增长率为 8.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于对中国改革创新和经济转型的信心,我们仍对未来一阶段市场保持乐观。相当一批具有核心竞争力的企业在积极转型及拥抱新经济,这是我们选股方向之一;同时,13 亿的人口基数以及最大规模的中产阶级基础,促使我们较乐观看待着重于内需方向的企业。此外,我们也将积极关注符合政策支持方向,并有可能成为新支柱产业的行业,如新能源汽车、军工等。

§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	3,009,093,267.59	88.22
	其中:股票	3,009,093,267.59	88.22
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	346,542,363.87	10.16
7	其他资产	55,273,367.13	1.62
8	合计	3,410,908,998.59	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	1,332,905,306.93	41.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	698,000.00	0.02
E	建筑业	405,813,427.18	12.60
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	492,715,200.00	15.30
J	金融业	413,400.00	0.01
K	房地产业	369,883,144.40	11.48
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	185,051,121.88	5.74
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	221,613,667.20	6.88
S	综合	-	-
	合计	3,009,093,267.59	93.41

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	002375	亚厦股份	13,119,916	283,783,783.08	8.81
2	300002	神州泰岳	19,990,000	280,659,600.00	8.71
3	002450	康得新	7,770,000	241,802,400.00	7.51
4	002415	海康威视	11,660,000	224,688,200.00	6.97
5	300133	华策影视	7,599,920	221,613,667.20	6.88
6	600770	综艺股份	20,000,000	211,800,000.00	6.57
7	002001	新 和 成	13,330,000	201,016,400.00	6.24
8	002241	歌尔声学	7,113,959	195,989,570.45	6.08
9	002285	世联行	16,699,909	193,718,944.40	6.01
10	000002	万 科 A	19,190,000	176,164,200.00	5.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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	1,396,896.58
2	应收证券清算款	52,726,844.08
3	应收股利	-
4	应收利息	65,193.65
5	应收申购款	1,084,432.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,273,367.13

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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中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	300002	神州泰岳	280,659,600.00	8.71	重大事项停牌
2	300133	华策影视	221,613,667.20	6.88	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	3,748,357,091.15
报告期期间基金总申购份额	581,534,778.66
减:报告期期间基金总赎回份额	1,498,735,598.10
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,831,156,271.71

§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	24,325,003.00
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	24,325,003.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.86%

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、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》

2、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华安安顺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
二〇一四年十月二十四日

华安汇财通货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014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: 二〇一四年十月二十四日

§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 2014 年 10 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 7 月 17 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安汇财通货币
基金主代码	000709
交易代码	000709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 7 月 17 日
报告期末基金份额总额	200,594,620.62 份
投资目标	在力求本金安全、确保资产流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对于的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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

###