华安安信消费服务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 1 日起至 9 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	681,752,737.11 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 7 月 1 日-2014 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	25,280,658.92
2.本期利润	70,692,228.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.1003
4.期末基金资产净值	694,448,810.68
5.期末基金份额净值	1.019

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	10.88%	0.89%	9.52%	0.85%	1.36%	0.04%

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 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	2008-2-13	-	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: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。 ()交易所一级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则,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。 ()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。 ()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规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,A 股主板迎来了一波久违的上涨,沪深 300 指数上涨 13.20%,创业板指数上涨 9.7%,中小板指数上涨超过 16%。期间,各类主题轮番表现,周期股、国企改革、土地流转、军工等等均有良好表现。新活力适度提升了二级市场股票和可转债仓位,参与了周期股、国企改革、军工等行业和主题上的机会。

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 1.019 元,本报告期份额净值增长率为 10.88%,同期业绩比较基准增长率为 9.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为市场将逐步进入稳验期,也许稳验期来得会较我们预期的迟,但相信终将会来到。中短期需要稳验的是经济内生性增长动力的修复能力,中长期则需要稳验经济转型的力度,前者决定业绩,后者决定业绩的稳定性或持续性,从而影响估值的区间。基于对中期经济转型不变的预期,我们将继续在跨界行业和公司中去选择品种,同时将关注具有较长产业链,从而有可能成为新支柱产业,如在新能源汽车、军工等行业中积极寻找品种布局。

§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	656,686,908.00	93.40
	其中:股票	656,686,908.00	93.40
2	固定收益投资	21,565,775.00	3.07
	其中:债券	21,565,775.00	3.07
	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	19,869,691.65	2.83
7	其他资产	4,983,053.05	0.71
8	合计	703,105,427.70	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	507,212,472.40	73.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,587,430.00	1.09
E	建筑业	29,655,500.00	4.27
F	批发和零售业	11,882,900.00	1.71
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	95,479,605.60	13.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	4,869,000.00	0.70
S	综合	-	-
	合计	656,686,908.00	94.56

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	002450	康得新	2,180,000	67,841,600.00	9.77
2	002250	联化科技	3,300,000	52,140,000.00	7.51
3	600867	通化东宝	3,390,000	47,358,300.00	6.82
4	600887	伊利股份	1,530,000	39,627,000.00	5.71
5	300017	网宿科技	563,833	31,529,541.36	4.54
6	300146	汤臣倍健	880,000	25,792,800.00	3.71
7	002081	金螳螂	1,330,000	25,762,100.00	3.71
8	002038	双鹭药业	530,000	22,472,000.00	3.24
9	000625	长安汽车	1,580,000	21,646,000.00	3.12
10	002502	骅威股份	1,289,512	21,212,472.40	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	1,589,775.00	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,976,000.00	2.88
	其中:政策性金融债	19,976,000.00	2.88
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	21,565,775.00	3.11

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	19,976,000.00	2.88
2	010213	02国债(3)	16,500	1,589,775.00	0.23

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	219,531.29
2	应收证券清算款	4,494,171.85
3	应收股利	-
4	应收利息	259,497.71
5	应收申购款	9,852.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,983,053.05

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	708,347,229.61
报告期期间基金总申购份额	58,997,803.99
减:报告期期间基金总赎回份额	85,592,296.49
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	681,752,737.11

§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

二〇一四年十月二十四日

华安大国新经济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	华安大国新经济股票
基金主代码	000549
交易代码	000549
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 4 月 14 日
报告期末基金份额总额	50,720,456.46 份
投资目标	本基金重点投资于与大国新经济相关的子行业或企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略,一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。股票投资中,通过对大国新经济相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	90%×中证 800 指数收益率+10%×中国债券总指数收益率
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	17,419,470.14
2.本期利润	19,992,691.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.1348
4.期末基金资产净值	59,450,958.38
5.期末基金份额净值	1.172

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	15.13%	0.80%	14.93%	0.79%	0.20%	0.01%

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

华安大国新经济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

(2014 年 4 月 14 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		
陈逊	本基金的基金经理	2014-4-14	-	13年	上海财经大学 MBA,13 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 月至 2014 年 4 月担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理;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。2014 年 1 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。2014 年 4 月起同时担任本基金的基金经理。
翁启森	本基金的基金经理、基金投资部兼全球投资部高级总监	2014-4-15	-	18年	工业工程学硕士,18 年证券、基金行业从业经历,具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理,台湾中信证券投资总监助理,台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司,任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部总监。2014 年 3 月起同时担任华安安利股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。

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,除因本基金持有的华策影视 (代码 300133)连续停牌时间超过 2 个月,期间基金出现巨额赎回,导致基金持有该股票的比例持续 18 个工作日超过基金净值的 10%以外 (该股票复牌,本基金将在法规规定期间内调整合规),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。 ()交易所一级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则,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。 ()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。 ()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规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,A 股各类指数基本呈现单边上涨行情,且在期末创出年内新高。从行业结构看,3 季度军工和与土地流转相关的农林牧渔涨幅靠前,而大市值传媒和银行表现较弱。市场依然延续偏好主题投资和转型带来边际改善的标的。

本组合在报告期内始终保持高仓位运行,重点配置了互联网相关的计算机软件和传统行业转型类公司,减持了部分与经济波动相关性较高的上游行业和金融行业配置。

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 1.172 元,本报告期份额净值增长率为 15.13%,同期业绩比较基准增长率为 14.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对未来中国资本市场持相对乐观态度,尽管未来经济增速下滑是大概率事件,但通过经济结构调整及相关的制度安排,降低 GDP 增速将换来经济增长的更高质量和良性结构,同时这种结构调整将带来无风险利率趋势性的下降。我们继续看好经济结构调整下的产业升级以及新技术引发新经济模式带来的投资机会。

§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	56,301,715.25	91.00
	其中:股票	56,301,715.25	91.00
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	2,881,483.31	4.66
7	其他资产	2,688,186.21	4.34
8	合计	61,871,384.77	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	29,736,538.70	50.02
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	2,990,806.30	5.03
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	10,699,673.90	18.00
J	金融业	1,566,146.13	2.63
K	房地产业	-	-
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	1,972,013.94	3.32
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	9,336,536.28	15.70
S	综合	-	-
	合计	56,301,715.25	94.70

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	300133	华策影视	320,183	9,336,536.28	15.70
2	002450	康得新	130,068	4,047,716.16	6.81
3	002005	德豪润达	491,501	4,005,733.15	6.74
4	002444	巨星科技	307,318	3,995,134.00	6.72
5	300271	华宇软件	72,980	3,567,262.40	6.00
6	600580	卧龙电气	258,000	2,546,460.00	4.28
7	600571	信雅达	113,500	2,241,625.00	3.77
8	002439	启明星辰	87,410	2,115,322.00	3.56
9	000625	长安汽车	151,000	2,068,700.00	3.48
10	300070	碧水源	65,169	1,972,013.94	3.32

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	97,740.56
2	应收证券清算款	2,116,953.90
3	应收股利	-
4	应收利息	851.16
5	应收申购款	472,640.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,688,186.21

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	300133	华策影视	9,336,536.28	15.70	重大事项停牌
2	002005	德豪润达	4,005,733.15	6.74	重大事项停牌
3	600571	信雅达	2,241,625.00	3.77	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	274,707,064.80
报告期期间基金总申购份额	20,650,681.17
减:报告期期间基金总赎回份额	244,637,289.51
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	50,720,456.46

§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、《华安大国新经济股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安大国新经济股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安大国新经济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

华安新活力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:招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。

基金托管人招商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	华安新活力混合
基金主代码	000590
交易代码	000590
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 4 月 1 日
报告期末基金份额总额	1,235,247,069.05 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,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。
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