华安升级主题混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月22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
报告期末基金份额总额	174,319,163.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业,分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略。即:采取"自上而下"的方式选择行业,挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业龙头股。 根据上述"自上而下"策略选择行业的基础上,采取"自下而上"的方法,运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张娴	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	261,928,135.53	161,625,666.71	204,392,685.95
本期利润	239,137,788.99	34,733,583.32	291,953,061.67
加权平均基金份额本期利润	0.9869	0.0704	0.2609
本期基金份额净值增长率	53.22%	8.54%	21.75%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.7134	0.1177	-0.0227
期末基金资产净值	298,683,345.44	315,401,135.98	739,900,404.61
期末基金份额净值	1.713	1.118	1.030

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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3个月	38.59%	2.49%	13.66%	1.34%	24.93%	1.11%
过去6个月	-4.36%	3.7%	-12.53%	2.14%	8.17%	1.61%
过去一年	53.22%	3.19%	5.37%	1.99%	47.85%	1.16%
过去三年	102.48%	2.11%	39.58%	1.43%	62.90%	0.68%
自基金成立起至今	71.30%	1.82%	11.59%	1.30%	59.71%	0.52%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

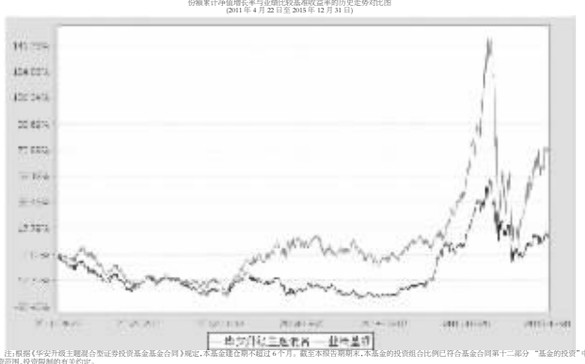
根据基金合同的规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括A股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具和国产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例固用为60%-95%,其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业股票的资产合计不低于股票投资的80%;债券、权证、现金、货币市场工具和国产支持证券占基金资产的比例固用为5-40%,其中权证投资占基金资产净值的比例固用为0-3%;现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

华安升级主题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的历史走势对比图

(2011年4月22日至2015年12月31日)

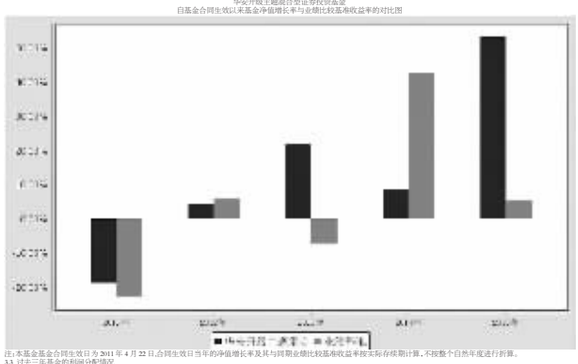


注:根据《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》规定,本基金建立不超过6个月,截至本报告期期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分"基金的投资"中投资范围、投资限制的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安升级主题混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金基金合同生效日为2011年4月22日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至2015年12月31日,公司旗下共管华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安安心债券混合、华安策略优选混合、华安证券分级债券混合、华安稳定收益债券、华安混合收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、华安上证龙头企业ETF联接、华安升级主题混合、华安稳健收益债券、华安可转债、华安保证300指数LOF、华安利投边力混合、华安四季红债券、华安鸿禧精选股票、华安上证中小平均股票、华安稳享石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安保证保证债券、华安安信消费混合、华安纯债达定100指数、华安黄金ETF、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化增强、华安平衡证券、华安主题优选混合、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、华安新动力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财富通货币、华安平安的基金经理、国泰君安证券(DAX)ETF联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新价值主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新信息灵活配置混合、华安中证金融证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安品牌齐老混合发起式、华安创业板50指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安丰盈保本混合等71只开放式基金。管理资产规模达到1558.45亿元人民币。

4.1.2 基金经理(基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈炳宇	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2011-04-22	2015-06-18	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所工作。2003年加入华安基金管理有限公司,历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证券投资基金投资经理。2007年3月至2008年2月担任安顺证券投资基金、华安证券投资基金、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月起同时担任本基金的基金经理。2012年9月起兼任基金投资部总监。2013年6月离开华安基金。
蒋蓉	本基金的基金经理	2015-06-16	—	8年	硕士,8年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员,华安兴业基金管理有限公司研究员,2011年4月加入华安基金管理有限公司,担任投资研究部行业分析师、基金经理。2015年4月起担任本基金、华安动态灵活配置混合型证券投资基金、华安安信消费混合型证券投资基金、华安安心收益债券基金的基金经理。2015年11月起,同时担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	—	8年	硕士,8年基金行业从业经历,曾任银河基金管理有限公司研究员,国联安基金基金经理。2015年5月加入华安基金管理有限公司,2015年9月起同时担任本基金及华安安信消费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,而以公告为准。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有关法律法规及《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》、《华安升级主题混合型证券投资基金招募说明书》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和策略的执行

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、特定客户资产管理的各类投资组合投资决策、投资授权、投资指令的下达、投资交易、交易执行等方面全面纳入公平交易管理中,控制隐藏风险的环节,在投资研究组合、投资决策委员会、基金经理、交易部门等方面设置防火墙,分别在投资研究、决策、授权、指令下达、交易执行、事后监控等环节实现信息隔离、权责分离、业务分离、监督分离的原则,并在公司内部实现投资研究、决策、授权、指令下达、交易执行、事后监控等环节的有效隔离。公司在投资研究、决策、授权、指令下达、交易执行、事后监控等环节设置了一系列的风控指标,并在公司内部实现了有效的隔离。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的投资决策委员会、投资决策委员会成员、投资经理、交易部门、风控部门等人员均未发生变动。

4.3.2 异常交易的专项说明

2015年A股波澜壮阔,上半年牛市上涨,以互联网金融为龙头的创新池潮涌登入股市市场,引领市场上涨,新兴产业公司出于产业布局的需求,传统行业公司出于转型的目的积极在资本市场运作,在股价的作用下加上杠杆资金放入后,市场在年内大幅上涨,市场在年内大幅上涨,市场在年内大幅上涨