华安保本混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

§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2016年4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2016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	272,625,034.48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),动态调整基金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,确定具体的投资品种选择,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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	785,270.89
2.本期利润	-11,495,071.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0422
4.期末基金资产净值	484,523,039.25
5.期末基金份额净值	1.777

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

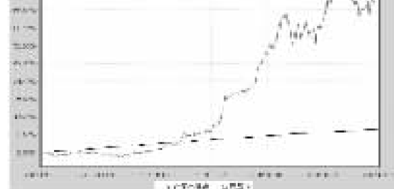
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.31%	1.00%	0.62%	0.01%	-2.93%	0.99%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

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2016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		
吴丰树	本基金的基金经理	2013-05-14	-	13	硕士研究生,13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混合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混合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混合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。2015年5月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监	2013-05-14	-	14	硕士研究生,14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。2014年8月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年3月起同时担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015年11月起,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安康保本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,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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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 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

2016年一季度,美联储加息预期的下降,汇率的阶段性企稳,降低了资金外流的压力。另一方面央行货币政策以中性为主,宽松预期不断减弱。在经济和通胀预期回升后,带动利率债期限利差上升,债券市场以震荡为主。一季度过剩产能行业信用债市场由于配置需求旺盛走势与利率债背离,信用利差进一步被压缩。权益市场在年初暴跌后,随着估值下降和汇率层面的稳定,开始出现结构性反弹行情。

本基金一季度债券方面以信用债为主要配置,逐渐缩短久期,保持合理的杠杆。权益方面受市场影响出现较大波动,但通过主动操作在反弹中取得较好回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.777元,本报告期份额净值增长率为 -2.31%,同期业绩比较基准增长率为0.62%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,预期经济将在政策的支持下持续复苏,通胀预期在二季度仍以上行为主,经济基本面对债市不利。预计二季度债券市场仍以震荡为主。随着违约事件的不断增加,中低等级特别是过剩产能行业的信用债面临较大的调整压力。权益市场预期保持震荡,但结构性行情将会持续演绎。

本基金将继续保持高等级信用债的配置,在资金利率稳定的情况下,适当增加杠杆操杆。结合权益市场的波动,自下而上的选择标的波段操作。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	178,838,491.80	35.90
	其中:股票	178,838,491.80	35.90
2	固定收益投资	298,129,334.40	59.85
	其中:债券	298,129,334.40	59.85
	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	9,054,493.60	1.82
7	其他各项资产	12,087,837.95	2.43
8	合计	498,110,157.75	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	8,628,000.00	1.78
C	制造业	103,794,300.00	21.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,650,000.00	1.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,510,000.00	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	30,082,200.00	6.21
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	1,123,991.80	0.23
K	房地产业	15,050,000.00	3.11
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	178,838,491.80	36.91

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	002152	广电运通	1,100,000	26,268,000.00	5.42
2	600428	中远航运	2,800,000	18,648,000.00	3.85
3	001979	招商蛇口	1,000,000	15,050,000.00	3.11
4	002308	威创股份	800,000	13,944,000.00	2.88
5	600009	上海机场	380,000	11,434,200.00	2.36
6	000911	南宁糖业	660,000	10,975,800.00	2.27
7	600612	老凤祥	250,000	10,167,500.00	2.10
8	002353	杰瑞股份	550,000	9,674,500.00	2.00
9	600219	南山铝业	1,200,000	8,328,000.00	1.72
10	000055	方大集团	550,000	7,738,500.00	1.60

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	70,044,000.00	14.46
	其中:政策性金融债	70,044,000.00	14.46
4	企业债券	125,340,334.40	25.87
5	企业短期融资券	60,142,000.00	12.41
6	中期票据	42,603,000.00	8.79
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	298,129,334.40	61.53

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	150215	15国开15	400,000	40,020,000.00	8.26
2	150211	15国开11	300,000	30,024,000.00	6.20
3	1380357	13襄建投债	200,000	22,000,000.00	4.54
4	124163	13蓉文旅	200,000	21,476,000.00	4.43
5	124377	13渝碚城	200,000	21,228,000.00	4.38

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投资。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	173,538.67
2	应收证券清算款	4,700,346.70
3	应收股利	-
4	应收利息	5,998,934.20
5	应收申购款	1,215,018.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,087,837.95

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	002353	杰瑞股份	9,674,500.00	2.00	筹划重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	267,698,030.20
报告期基金总申购份额	45,956,839.46
减:报告期基金总赎回份额	41,029,835.18
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	272,625,034.48

§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、《华安保本混合型证券投资基金基金合同》
2、《华安保本混合型证券投资基金招募说明书》
3、《华安保本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
二〇一六年四月二十日

华安宝利配置证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:二〇一六年四月二十日

§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2016年4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2016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	
交易代码	040004(前端)	041004(后端)
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	2,229,795,271.32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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-221,169,572.03
2.本期利润	-404,913,759.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1949
4.期末基金资产净值	2,406,826,276.73
5.期末基金份额净值	1.079

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

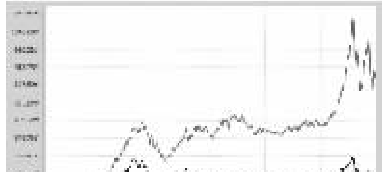
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.85%	2.98%	-4.57%	1.03%	-12.28%	1.95%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

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2016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		
刘伟亭	本基金的基金经理	2015-09-25	-	10	硕士研究生,10年证券、基金从业经验,曾任长江巴黎百富勤证券有限公司助理经理、国海富兰克林基金基金经理。2015年6月加入华安基金管理有限公司,2015年9月起担任本基金及华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
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,公司总经理助理	2015-06-16	-	19	工业工程学硕士,19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月起同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月起同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任华安智联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任本基金、华安生态优先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,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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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 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

一季度市场总体波动较大。由于经济总体继续处于探底阶段,年初在人民币小幅贬值、熔断制度实施、流动性边际改善较小、减持解禁开始等负面因素影响下风险偏好大幅下降导致市场发生大幅下挫,本基金由于仓位偏高加之弹性品种占比较大,在这波下跌中,净值回撤受损较大。在这个过程中本基金通过下调仓位及调整持仓结构,降低风险容忍度,逐步扭转了下滑的势头。进入3月份后,美国明确了暂停加息,国内暂停了注册制和战略新兴板等缓解市场恐慌情绪的措施,加之经济出现复苏苗头,市场逐步企稳反弹。随着市场热点逐步增加,投资可操作性也在增加,本基金也逐步提高仓位并调入超跌的优良品种,从更多维的视角去选择投资标的,努力为投资人创造更好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.079元,本报告期份额净值增长率为-16.85%,同期业绩比较基准增长率为-4.57%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于年初至今市场出现了较大幅度的调整,风险也得到一定程度的释放,这对于追求稳健收益的投资者来说,机会正变得越来越大,越来越多的新兴产业优秀公司估值开始逐步进入可投资区间。虽然从短期静态的视角看,宏观经济基本面还没完全企稳,仍将在底部调整一段时间,汇率调整也依然还没完全达到均衡水平,无风险收益率的下降空间相比去年也较小,但我们也要看到过去一段时间的市场大幅下跌正是反映了这些风险因素,未来一段时间只要不出现超预期的风险因素,市场将逐步进入具有投资价值的结构性机会阶段,特别是一些具有时代特征的优质成长股和政策受益标的。因此在操作上,本基金将依据市场阶段特征和主要矛盾,提高投资的灵活性。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	1,899,960,130.93	77.43
	其中:股票	1,899,960,130.93	77.43
2	固定收益投资	282,809,261.10	11.53
	其中:债券	277,787,261.10	11.32
	资产支持证券	5,022,000.00	0.20
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,000,145.00	2.04
	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	192,075,964.64	7.83
7	其他各项资产	28,915,534.32	1.18
8	合计	2,453,761,035.99	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	960,660,774.64	39.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	82,063,588.96	3.41
F	批发和零售业	88,815,695.18	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	94,900,885.44	3.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,286,281.13	5.29
J	金融业	62,343,141.12	2.59
K	房地产业	39,644,388.00	1.65
L	租赁和商务服务业	47,999,358.40	1.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	66,644,172.64	2.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	48,016,764.54	2.00
Q	卫生和社会工作	3,602,570.16	0.15
R	文化、体育和娱乐业	277,982,510.72	11.55
S	综合	-	-
	合计	1,899,960,130.93	78.94

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	002699	美盛文化	4,586,782	165,582,830.20	6.88
2	600271	航天信息	1,660,900	96,697,598.00	4.02
3	002072	凯瑞德	4,042,257	95,882,336.04	3.98
4	002245	澳洋顺昌	11,324,688	94,900,885.44	3.94
5	002325	洪涛股份	6,625,796	82,027,354.48	3.41
6	600136	道博股份	1,196,747	72,235,648.92	3.00
7	600749	西藏旅游	3,297,584	66,644,172.64	2.77
8	002329	皇氏集团	3,921,919	65,613,704.87	2.73
9	600109	国金证券	4,320,384	62,343,141.12	2.59
10	600305	恒顺醋业	2,981,779	61,394,829.61	2.55

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	2,175,200.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,963,000.00	8.31
	其中:政策性金融债	199,963,000.00	8.31
4	企业债券	59,501,605.80	2.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	16,147,455.30	0.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	277,787,261.10	11.54

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	160204	16国开04	900,000	89,910,000.00	3.74
2	160401	16农发01	500,000	50,020,000.00	2.08
3	150419	15农发19	300,000	30,027,000.00	1.25
4	150311	15进出11	300,000	30,006,000.00	1.25
5	122952	09赣州债	150,000	15,078,000.00	0.63

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	5,022,000.00	0.21

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投资。

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 本期国债期货投资政策

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期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本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,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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,168,282.94
2	应收证券清算款	22,120,626.69
3	应收股利	-
4	应收利息	3,513,481.05
5	应收申购款	1,113,143.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,915,534.32

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	110031	航信转债	167,493.60	0.01

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	600271	航天信息	96,697,598.00	4.02	重大资产重组
2	600749	西藏旅游	66,644,172.64	2.77	重大资产重组
3	002072	凯瑞德	95,882,336.04	3.98	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,171,351,204.30
报告期基金总申购份额	3,529,441,142.31
减:报告期基金总赎回份额	2,470,997,075.29
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,229,795,271.32

§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
二〇一六年四月二十日

华安安信消费服务混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

§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2016年4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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安信消费混合
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	270,015,373.56份
投资目标	本基金重点投资于消费服务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。
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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-35,578,659.09
2.本期利润	-64,213,767.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2374
4.期末基金资产净值	387,353,479.43
5.期末基金份额净值	1.435

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

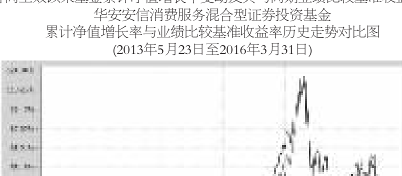
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.17%	3.68%	-13.60%	2.40%	-0.57%	1.28%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华安安信消费服务混合型证券投资基金

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2016年3月31日)



注:根据《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	8	硕士,8年基金行业从业经验,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升级主题混合型证券投资基金的基金经理。
蒋璆	本基金的基金经理	2015-06-16	-	8	硕士,8年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宝兴业基金管理有限公司研究员。2011年6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、基金经理助理。2015年6月起担任本基金、华安动态灵活配置混合型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理;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。

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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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 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

一季度市场在大幅下挫后缓步上扬,大盘下跌15.12%,创业板那下跌17.53%。个股分化较大,估值合理或者基本面强劲的个股超额收益较大。由于去年年底仓位较高,一月份组合整体跌幅较大。在市场风险阶段性释放后,组合围绕消费升级和服务升级,结合估值水平重点配置了传媒、新能源汽车等行业,取得了较好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年03月31日,本基金份额净值为1.435元,本报告期份额净值增长率为-14.17%,同期业绩比较基准增长率为-13.60%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,经济增长预期较过去半年有所改善,但物价预期值得关注。过去半年,一线城市和部分二线城市房地产销售明显回暖,基建投资的稳增长作用开始显现,由此带动的产业链景气度应有所提升。随着消费和服务领域升级的深化,部分新兴产业持续快速增长。这些积极的因素可能在二季度逐步得到验证。另一方面,部分一线城市房价快速上涨、以猪肉为代表的农产品价格上涨可能推升市场对物价的担忧。不同于此前几轮物价上涨逻辑, 本轮部分品种物价上涨更多是阶段性供给短缺而不完全是全面需求扩张推动。对货币政策的约束效果不一定呈现简单的线性对应关系。

一季度市场的下跌释放了部分个股风险。长期看,创新和改革是经济持续增长的重要动力。消费升级和服务升级是我们始终关注的重点。在经济增长预期回升的背景下,我们也会关注部分行业可能出现的景气超预期回升。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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	355,195,679.58	88.31
	其中:股票	355,195,679.58	88.31
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	32,981,421.64	8.20
7	其他各项资产	14,019,224.81	3.49
8	合计	402,196,326.03	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	7,380,758.00	1.91
B	采矿业	4,047,662.10	1.04
C	制造业	226,879,431.00	58.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,671,643.44	0.69
E	建筑业	21,936,664.94	5.66
F	批发和零售业	13,608,693.48	3.51
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	8,223,648.00	2.12
J	金融业	21,615,079.08	5.58
K	房地产业	21,046,019.82	5.43
L	租赁和商务服务业	22,487,017.72	5.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,299,062.00	1.37
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	355,195,679.58	91.70

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	002445	中南重工	1,304,368	25,956,923.20	6.70
2	002325	洪涛股份	1,769,017	21,900,430.46	5.65
3	002612	朗姿股份	293,777	18,158,356.37	4.69
4	300063	天龙集团	497,572	15,927,279.72	4.11
5	300242	明家联合	441,137	13,701,715.22	3.54
6	002511	中顺洁柔	1,098,665	13,623,446.00	3.52
7	600061	国投安信	675,900	12,943,485.00	3.34
8	600303	曙光股份	1,004,137	12,923,243.19	3.34
9	002508	老板电器	267,857	12,318,743.43	3.18
10	002709	天赐材料	146,292	12,288,528.00	3.17

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投资。

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投资。

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投资。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	528,907.67
2	应收证券清算款	13,390,767.93
3	应收股利	-
4	应收利息	9,373.27
5	应收申购款	90,175.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,019,224.81

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	002709	天赐材料	12,288,528.00	3.17	重大事项停牌
2	002612	朗姿股份	18,158,356.37	4.69	重大事项停牌
3	300063	天龙集团	15,927,279.72	4.11	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	270,815,646.31
报告期基金总申购份额	5,772,471.06
减:报告期基金总赎回份额	6,572,743.81
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	270,015,373.56

§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、《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》
2、《华安安信消费服务混合型证券投资基金招募说明书》
3、《华安安信消费服务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
二〇一六年四月二十日