华安日日鑫货币市场基金

2019 第一季度 报告

2019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:二〇一九年四月二十日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安日日鑫货币
场内简称	货币ETF
基金主代码	040038
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月26日
报告期末基金份额总额	160,077,565,813.96份
投资目标	为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。
投资策略	本基金将根据市场情况和产品品种的容量,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、协议存款交易对手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	同期七天通知存款利率(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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华安日日鑫货币A / 华安日日鑫货币B / 华安日日鑫货币H
下属分级基金的场内简称	- / - / 货币ETF
下属分级基金的交易代码	040038 / 040039 / 511600
报告期末下属分级基金的份额总额	159,793,514,152.75份 / 145,228,909.78份 / 138,822,751.43份

注:1.自2016年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为“货币ETF”,基金份额净值为100.00元,本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为“华安日日鑫货币A”,基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为“华安日日鑫货币B”,基金份额净值为1.00元。

§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(2019年1月1日-2019年3月31日)		
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
1.本期已实现收益	1,048,596,936.25	1,176,492.42	892,451.22
2.本期利润	1,048,596,936.25	1,176,492.42	892,451.22
3.期末基金资产净值	159,793,514,152.75	145,228,909.78	138,822,751.43

注:1.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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
2.自2016年9月12日起,本基金增设H类份额类别。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1.华安日日鑫货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6537%	0.0006%	0.2663%	0.0000%	0.3874%	0.0006%

2.华安日日鑫货币B:

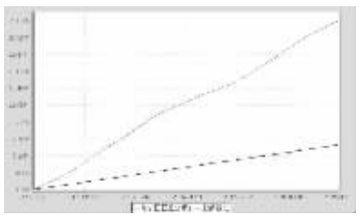
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7131%	0.0006%	0.2663%	0.0000%	0.4468%	0.0006%

3.华安日日鑫货币H:

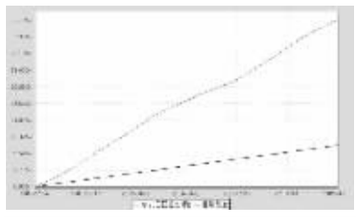
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6428%	0.0006%	0.2663%	0.0000%	0.3765%	0.0006%

注:1.自2016年9月12日起,本基金增设H类份额。
本基金自成立起至2016年6月29日,利润分配是按月结转份额,自2016年8月30日起至今,利润分配是按日结转份额。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
华安日日鑫货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年11月26日至2019年3月31日)

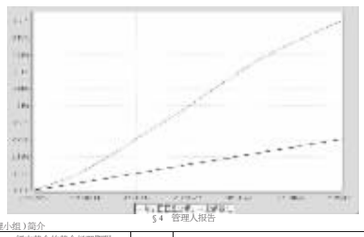
1.华安日日鑫货币A



2.华安日日鑫货币B



3.华安日日鑫货币H



§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		
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格证书,曾任安永华明会计师事务所审计师、2010年3月加入华安基金管理有限公司,先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作,2014年9月起担任基金经理助理,2016年3月起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、本基金的基金经理,2016年11月起,同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理,2017年12月起,同时担任华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
沈翔云	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2016-12-19	-	11年	硕士研究生,11年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理,2016年7月加入华安基金,任指数与量化投资部ETF业务负责人,2016年12月起,担任本基金的基金经理,2017年4月起,担任华安中证沪港深港股通投资价格指数证券投资基金(LOF)的基金经理,2017年10月起,同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2017年12月起,同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理,2018年9月起,同时担任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2018年10月起,同时担任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2018年11月,同时担任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019年1月起,同时担任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2019年3月起,同时担任华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2018-05-31	-	8年	硕士研究生,8年债券、基金行业从业经验,曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人,2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理,2014年8月至2017年7月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理,2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理,2015年2月起担任华安年年益定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任华安添顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理,2016年10月至2018年1月,同时担任华安纯债添益配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月起,同时担任华安年年利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理,2018年5月起,同时担任本基金的基金经理,2018年9月起,同时担任华安成德鑫股票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,使用腾会发言、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,超过授权限的操作需履行严格的审批程序;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/按公平原则进行分配,若不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。(2)交易所一级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则进行分配,若不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。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。(4)交易所二级市场业务,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。(5)银行间市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。(6)银行间市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。(7)银行间市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。
4.3.2 公平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确认反向交易的检查;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,出现同日反向交易或交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0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
中国经济继续面临减速压力,主要是去杠杆下财政金融紧缩效应的滞后体现,中美关系紧张也打击了投资和消费信心。但是,随着去年下半年尤其是四季度政策转向结构性扶持实体经济,以及中美回到谈判轨道上,我们看到今年以来经济出现了明显的企稳的迹象。
本基金在报告期内涨幅不佳,主要是因为作为有到期日的封闭产品,事先建立了比较严格的风控要求,去年这些风控要求有效降低了基金跌幅,但今年也相应限制了基金的上涨节奏。在一季度,我们基本上都是以很低的仓位在积累收益,随着收益的获得逐步放大仓位。
从所投资公司定期的经营情况看,大多数均表现上佳,体现了这些公司优秀的经营管理能力,总体情况令人满意。个别公司受宏观经济下滑、竞争格局恶化以及经营应对措施有所限能影响,业绩有较为显著的下滑,但我也认为这应可能属于短期影响,未来的有望恢复正常。
4.4.2报告期内基金的业绩表现
截至2019年3月31日,本基金A类份额净值为0.9550 元,本报告期份额净值增长率为5.06%;本基金C类份额净值为0.9461 元,本报告期份额净值增长率为4.80%。同期业绩比较基准增长率为13.15%。
4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
中国正在进行深刻的经济和社会转型。
转型是一个新陈代谢,优胜劣汰甚至浴火重生的过程。短期,这必然会有代价,经济增速会受到抑制,但是,短期的困中蕴含着长期的机会;供给侧改革的实质是产业结构的升级,打造出高效、内生、环保、弱发展动的强大实体业;去杠杆的本质是财政金融体系的改革,打造更加稳健有效的资本配置机制;贸易战的本质是中外经济关系重构,推动中国的开放更快、更深入;对房地产实定“房子不炒”、“一城一策”的调控也有助于降低要素成本,减少地产对宏观的干扰。
尽管面临种种转型的困难和冲击,我们看到政府仍在坚定推动改革开放向深水区前进,系统性重构中国的经济和社会管理体制,打造推动中国经济从高速增长向高质增长转型的新机制,为中国经济的长期繁荣奠定基础。
中美谈判此时也正紧锣密鼓,中美共同利益远大于分歧,中美都是有智慧的大国,通过对话和实干消除误解、摒弃对抗,回到竞争性协作的轨道上,这是大概率事件,正如生产力发展的要求不可压抑一样,全球化趋势不可逆转,中美终将在斗争与妥协的大国博弈中,找到大国竞合、顺应历史、解决问题的道路。
尽管我们对于经济和中美关系的中长期趋势保持乐观,尽管我们认为经济正在逐步企稳,但我们也认识到,前路布满挑战,不会一帆风顺,当前,股价已经实现了有力的修复,其所包含的预期已经不低,未来要兑现这些预期,推动股价进一步走高的难度在加大,特别是考虑到中美关系仍有不确定性,世界经济面临一定的减速压力,美国股市日益显得高处不胜寒的情况下,我对未来短期走势的态度从之前积极乐观转为相对中性。如果中美能够迅速达成一个较好的协议,则可能会有一波较为普遍的上涨,但之后能否站稳于住涨幅是一个问题,排除中美协议这个因素,我认为市场进一步系统性上涨的概率不高,要可能转入震荡加剧、结构分化的局面。
本基金将密切跟踪形势变化,继续控制价值投资的理念,坚持投资基本面强健、股票被显著低估的公司,积极管控风险,努力为投资者谋取良好的中长期投资回报。
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	固定收益投资	50,619,726,190.22	29.86
	其中:债券	50,619,726,190.22	29.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	31,002,057,187.66	18.29
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	86,660,604,525.50	51.12
4	其他资产	1,240,748,292.26	0.73
5	合计	169,523,136,195.64	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.57
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	9,324,117,313.82 / 5.82
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。
5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。
5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	22.59	5.82
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	19.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	31.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	13.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	17.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.25	5.82

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
报告期内投资组合无平均剩余存续期超过240天的情况。
5.5 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	2,341,735,820.65	1.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,781,760,487.47	3.61
	其中:政策性金融债	5,781,760,487.47	3.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	42,496,229,882.10	26.55
8	其他	-	-
9	合计	50,619,726,190.22	31.62
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111909059	19浦发银行CD059	20,000,000	1,989,208,553.94	1.24
2	111916067	19上海银行CD067	18,000,000	1,790,076,582.84	1.12
3	111994129	19北京农商银行CD057	15,000,000	1,490,213,588.44	0.93
4	111993398	19浦阳银行CD028	14,500,000	1,429,057,421.54	0.89
5	160420	16农发20	11,200,000	1,121,161,035.14	0.70
6	180407	18农发07	11,000,000	1,101,548,717.98	0.69
7	111897112	18成都银行CD119	10,000,000	995,941,890.20	0.62
8	111918094	19华夏银行CD094	10,000,000	994,526,180.86	0.62
9	111810559	18兴业银行CD559	10,000,000	987,742,090.21	0.62
10	111993793	19重庆农村商行CD033	10,000,000	985,957,460.84	0.62

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0499%
报告期内偏离度的最低值	0.0182%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0351%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
无。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
无。
5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1基金行位方法说明
本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。
本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。
5.9.2本报告期内,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。
5.9.3证券投资资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	200,000,000.00
3	应收利息	1,039,734,030.06
4	应收申购款	1,013,962.20
5	其他应收款	300.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,240,748,292.26

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B	华安日日鑫货币H
本报告期期初基金份额总额	136,221,147,183.80	176,126,684.76	153,070,688.43
报告期基金总申购份额	605,698,653,167.92	41,050,973.96	21,036,050.09
报告期基金总赎回份额	582,126,286,198.97	71,948,748.94	35,283,907.09
报告期基金分拥份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	159,793,514,152.75	145,228,909.78	138,822,751.43

注:1.自2016年9月12日起,本基金新增场内基金份额(H类基金份额)简称为“货币ETF”,基金份额净值为100.00元,本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元;场外基金份额(A类基金份额)简称为“华安日日鑫货币A”,基金份额净值为1.00元;场外基金份额(B类基金份额)简称为“华安日日鑫货币B”,基金份额净值为1.00元。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金及其利润

无。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录
1.《华安日日鑫货币市场基金合同》
2.《华安日日鑫货币市场基金招募说明书》
3.《华安日日鑫货币市场基金托管协议》
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获阅方式
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
二〇一九年四月二十日

华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安睿享定开混合
基金主代码	003339
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	129,049,512.43份
投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金在每个运作周期前确定大类资产初始配比,达到初始配比目标后除证券价格波动等客观因素影响大类资产配比,不做频繁的主动大类资产配置调整。期初以一定比例投资于债券类资产作为安全垫,为总投资组合的本金安全提供保障,同时以有限比例投资于权益类资产而保有对股票市场一定的暴露度,以争取为组合创造超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*30%+中债综合全价指数收益率*70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益风险水平的投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华安睿享定开混合A / 华安睿享定开混合C
下属分级基金的交易代码	003339 / 003340
报告期末下属分级基金的份额总额	114,420,664.80份 / 14,628,847.63份

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	华安睿享定开混合A	华安睿享定开混合C
1.本期已实现收益	6,177,227.23	762,922.84
2.本期利润	8,972,655.65	1,117,093.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0784	0.0764
4.期末基金资产净值	131,935,701.13	16,708,211.33
5.期末基金份额净值	1.1531	1.1421

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),计入费用后实际基金业绩表现将低于所列数字。
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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
1.华安睿享定开混合A:

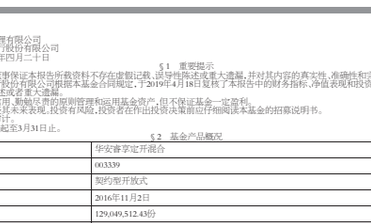
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.36%	0.26%	8.92%	0.45%	-1.62%	-0.19%

2.华安睿享定开混合C:

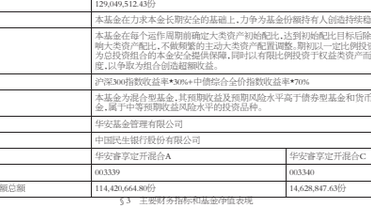
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.16%	0.26%	8.92%	0.45%	-1.76%	-0.19%

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
华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金
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
(2016年11月2日至2019年3月31日)

1. 华安睿享定开混合A:



2. 华安睿享定开混合C:



§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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016-11-02	-	21年	金融学硕士(金融工程方向),21年证券、基金从业经历,曾任长城证券有限责任公司债券研究员、华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008年4月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月起同时担任华安可转换债券型证券投资基金的基金经理,2012年12月至2017年6月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理,2013年4月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理,固定收益部助理总监,2013年8月起担任固定收益部副总监,2013年10月至2017年7月,同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金、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的基金经理,2014年7月至2017年7月,同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理,2015年2月至2017年4月担任华安年年益定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2015年5月起担任固定收益部总监,2015年5月至2017年7月担任华安添顺养老混合型发起式证券投资基金的基金经理,2015年5月起担任华安添利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年9月至2018年9月,担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理,2018年9月起,同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年12月至2017年7月,同时担任华安添惠保本混合型证券投资基金的基金经理,2016年2月至2018年8月,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理,2016年7月至2019年1月,同时担任华安安逸保本混合型发起式证券投资基金的基金经理,2016年11月至2017年12月,同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月起,同时担任本基金的基金经理,2017年2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,2018年2月起,同时担任华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2019年1月起,同时担任华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
胡宜斌	本基金的基金经理	2016-11-02	-	7年	硕士研究生,7年证券、基金行业从业经验,曾任杭州核新同花顺软件有限公司产品经理、长江证券股份有限公司研究员、上投摩根基金管理有限公司研究员,2015年5月加入华安基金,担任基金投资部基金经理助理,2015年11月起担任华安新丰债券型证券投资基金的基金经理,2016年1月至2017年7月,担任华安添惠保本混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月起,同时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,使用腾会发言、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,超过授权限的操作需履行严格的审批程序;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/按公平原则进行分配,若不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。(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。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。(4)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则进行分配,若不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。(5)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。(6)银行间市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配/按公平原则,先到先成的控制原则,通过内部系统Swind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。