

# 华安创新证券投资基金

## 2011 年第 3 季度报告

2011 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：二〇一一年十月二十四日

## § 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 2011 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 2011 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安创新混合
基金主代码	040001
前端交易代码	040001
后端交易代码	041001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年9月21日
报告期末基金份额总额	9,887,664,036.91份
投资目标	基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。

投资策略	<p>本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。</p> <p>这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。</p> <p>高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。</p> <p>传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。</p> <p>本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。</p> <p>本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。</p>
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	无
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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-144,529,683.58
2.本期利润	-848,962,343.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0853
4.期末基金资产净值	6,319,223,761.43
5.期末基金份额净值	0.639

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	-11.86%	1.01%	-11.29%	0.99%	-0.57%	0.02%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华安创新证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2001 年 9 月 21 日至 2011 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		
汪光成	本基金的基金经理	2009-3-27	-	9年	管理学博士，持有基金从业资格证书，9年证券、基金行业从业经历，2002年1月加入华安基金管理有限公司后，曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月至2009年3月担任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，2009年3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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照本基金的基金合同规定，本基金的投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

无

## 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，市场经历了 7 月中上旬的短暂反弹后重入跌势。此前市场普遍预期，政策将逐渐放松，但 7 月加息、8 月调整存款准备金缴存范围，打击了投资者的政策放松预期；而市场认为三季度物价可能下滑的预期，也被 7、8 月份 CPI 继续上升无情打破；而且，由于资金紧张，企业对经济前景愈来愈谨慎；而欧债危机的继续恶化、美国国债评级被下调等诸多不利因素则使得投资者预期雪上加霜，A 股市场悲观气氛越来越浓厚。

本报告期内，本基金重点配置于化工、汽车、能源、技术类新兴产业等。组合特征上，以低市盈率和成长性比较明确的股票为主。在操作上，由于对前述因素估计不足，在下跌过程中股票组合仓位下降力度不大，而是基于从中期角度进行组合调整，但在这种单边下跌的悲观氛围中，这种操作上的努力显得很无助和无效。当前市场的估值水平已经很低了，未来市场的转变可能源于政策上的微调，虽然我们无法预计市场的底到底在哪里，但在“寒冬”中，我们也想通过勤勉努力以减少“冻伤面积”，并期待“春天”来临的时候，尽量弥补投资者在“寒冬”中所忍受的痛苦和损失。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.639 元，本报告期份额净值增长率为-11.86%，同期业绩比较基准增长率为-11.29%。

## §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	3,998,658,138.00	63.12
	其中：股票	3,998,658,138.00	63.12
2	固定收益投资	1,445,352,187.70	22.81
	其中：债券	1,445,352,187.70	22.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-

4	买入返售金融资产	299,980,769.97	4.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	566,176,926.41	8.94
6	其他各项资产	25,171,465.20	0.40
7	合计	6,335,339,487.28	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	采掘业	334,965,597.68	5.30
C	制造业	3,035,675,753.77	48.04
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	154,318,175.68	2.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,209,536.00	0.15
C4	石油、化学、塑胶、塑料	687,475,356.66	10.88
C5	电子	103,356,672.00	1.64
C6	金属、非金属	657,053,592.58	10.40
C7	机械、设备、仪表	1,150,041,448.30	18.20
C8	医药、生物制品	274,220,972.55	4.34
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产	-	-



	和供应业		
E	建筑业	45,068,341.74	0.71
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	345,988,881.71	5.48
H	批发和零售贸易	127,906,109.10	2.02
I	金融、保险业	74,340,000.00	1.18
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	31,757,454.00	0.50
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,956,000.00	0.05
	合计	3,998,658,138.00	63.28

### 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	000422	湖北宣化	14,309,982	275,610,253.32	4.36
2	600741	华域汽车	20,828,736	213,702,831.36	3.38
3	601088	中国神华	8,034,826	203,602,490.84	3.22
4	600426	华鲁恒升	20,809,510	192,696,062.60	3.05
5	000581	威孚高科	4,998,796	163,060,725.52	2.58
6	000012	南玻A	11,216,291	158,598,354.74	2.51
7	002152	广电运通	5,683,416	158,283,135.60	2.50
8	000063	中兴通讯	7,821,099	147,818,771.10	2.34
9	002001	新和成	6,606,064	144,342,498.40	2.28
10	600104	上海汽车	8,800,000	140,624,000.00	2.23

**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	560,237,640.40	8.87
2	央行票据	77,256,000.00	1.22
3	金融债券	660,707,000.00	10.46
	其中：政策性金融债	660,707,000.00	10.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,005,000.00	0.32
6	中期票据	-	-
7	可转债	127,146,547.30	2.01
8	其他	-	-
9	合计	1,445,352,187.70	22.87

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110011	11付息国债11	3,700,000	368,372,000.00	5.83
2	080222	08国开22	1,500,000	149,550,000.00	2.37
3	070227	07国开27	1,200,000	121,908,000.00	1.93
4	080216	08国开16	1,000,000	101,660,000.00	1.61
5	110009	11付息国债09	600,000	59,796,000.00	0.95

**5.6 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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

### 5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,497,396.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,741,649.83
5	应收申购款	932,418.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,171,465.20

### 5.8.4 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	110015	石化转债	47,426,043.70	0.75
2	113001	中行转债	44,632,414.80	0.71
3	113002	工行转债	33,318,488.80	0.53
4	110016	川投转债	1,769,600.00	0.03

### 5.8.5 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不存在流通受限的股票。

## § 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	10,052,796,499.86
本报告期基金总申购份额	31,073,514.96
减：本报告期基金总赎回份额	196,205,977.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,887,664,036.91

## § 7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- 1、《华安创新证券投资基金基金合同》
- 2、《华安创新证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安创新证券投资基金托管协议》

### 7.2 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>。

### 7.3 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

二〇一一年十月二十四日

