

华安创新证券投资基金 2013 年第 3 季度报告

2013 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：二〇一三年十月二十四日

§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 2013 年 10 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 2013 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	8,099,517,911.50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	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>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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	135,409,568.21
2.本期利润	471,418,607.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0565

4.期末基金资产净值	5,206,448,016.14
5.期末基金份额净值	0.643

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

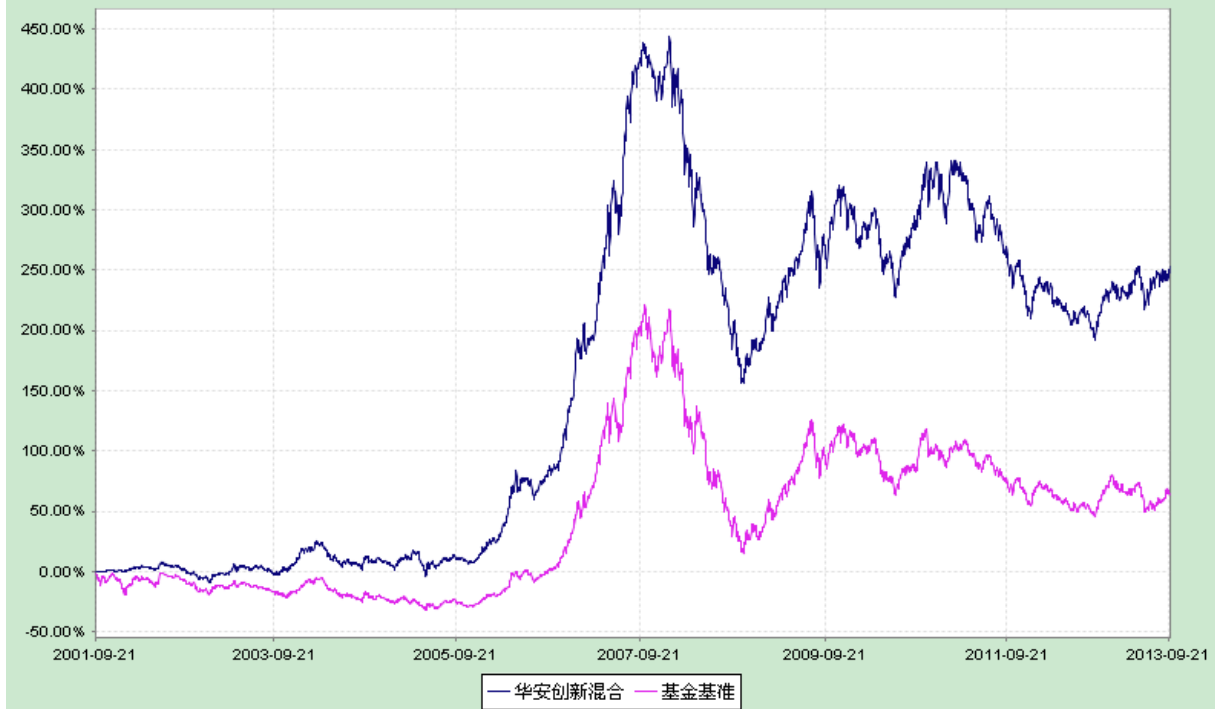
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.54%	1.04%	8.13%	1.04%	1.41%	0.00%

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

华安创新证券投资基金

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

（2001 年 9 月 21 日至 2013 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、基金投资部副总监	2009-3-27	-	11年	管理学博士，持有基金从业资格，11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。2011年12月起同

					时担任华安科技动力股票型证券投资基金的基金经理。2013年3月起同时担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。 2012年6月起担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合规守信情况的说明

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。

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 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

2013 年 3 季度, 沪深 300 指数上涨 9.47%, 结束了年初以来连续两个季度的下跌。从公布的经济数据看, 稳增长政策初见成效, 3 季度工业生产增速以及投资、消费、出口等宏观数据继续好转, 月度 PMI 也持续回暖。再加上一些利好政策的刺激, 投资者情

绪趋于乐观，市场呈现非常活跃的态势。从行业和板块的表现看，市场仍然延续了上半年的风格，非周期行业表现好于周期行业，新兴产业表现强于传统产业，中小市值股票表现强于大市值股票。

在组合操作方面，3 季度仍然重点持有医药、电子、化工和家电行业，并增加了传媒和一些周期类行业的配置，但对一些主题类投资参与不多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.643 元，本报告期份额净值增长率为 9.54%，同期业绩比较基准增长率为 8.13%。

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 4 季度，我们认为经济仍然处于缓慢复苏过程中，但面临的不确定性依然较多。在经济转型背景下，中上游行业盈利面临的压力仍然比较大，景气好转力度有限，但在供应端受到压缩的一些细分行业会存在机会。而以中小盘股票为代表的成长板块，仍然代表着未来的转型方向，在大幅度上涨以后，估值面临压力，需要仔细甄别其成长性。在操作上，将重点寻找一些业绩确定较强的行业和个股进行配置，适度保持组合行业配置和仓位的灵活性。

§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	3,374,747,980.52	62.22
	其中：股票	3,374,747,980.52	62.22
2	固定收益投资	1,332,116,912.40	24.56
	其中：债券	1,332,116,912.40	24.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	300,000,350.00	5.53

	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	213,745,221.73	3.94
6	其他各项资产	203,646,857.55	3.75
7	合计	5,424,257,322.20	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	2,811,630,932.66	54.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	90,812,414.88	1.74
F	批发和零售业	44,988,027.48	0.86
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	97,660,000.00	1.88
L	租赁和商务服务业	207,231,941.60	3.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	122,424,663.90	2.35
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	3,374,747,980.52	64.82

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	600309	万华化学	10,000,000	162,500,000.00	3.12
2	600276	恒瑞医药	4,205,774	152,964,000.38	2.94
3	600079	人福医药	4,606,009	149,418,931.96	2.87
4	600703	三安光电	6,805,628	138,086,192.12	2.65
5	300058	蓝色光标	2,008,000	134,536,000.00	2.58
6	600690	青岛海尔	10,085,323	134,336,502.36	2.58
7	601231	环旭电子	6,008,696	132,311,485.92	2.54
8	600252	中恒集团	8,800,469	131,567,011.55	2.53
9	300070	碧水源	3,007,977	122,424,663.90	2.35
10	002450	康得新	5,003,603	119,986,399.94	2.30

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	427,755,600.00	8.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	617,054,000.00	11.85
	其中：政策性金融债	617,054,000.00	11.85
4	企业债券	78,992.10	0.00
5	企业短期融资券	59,892,000.00	1.15
6	中期票据	80,233,000.00	1.54
7	可转债	147,103,320.30	2.83
8	其他	-	-
9	合计	1,332,116,912.40	25.59

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	130007	13付息国债07	2,800,000	278,852,000.00	5.36
2	070227	07国开27	1,200,000	120,468,000.00	2.31
3	130218	13国开18	1,200,000	119,196,000.00	2.29
4	080216	08国开16	1,000,000	100,640,000.00	1.93
5	080218	08国开18	600,000	59,898,000.00	1.15

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 600252中恒集团因重大事项（合同）履行过程中风险提示不及时、不充分，遭到

上海证券交易所公开谴责。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,154,129.31
2	应收证券清算款	182,466,660.43
3	应收股利	-
4	应收利息	18,957,627.50
5	应收申购款	68,440.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,646,857.55

5.10.4 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	55,069,977.30	1.06
2	113001	中行转债	51,067,315.60	0.98
3	113002	工行转债	38,433,627.40	0.74
4	110016	川投转债	2,532,400.00	0.05

5.10.5 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	600690	青岛海尔	134,336,502.36	2.58	重大事项停牌

§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	8,699,391,308.97
本报告期基金总申购份额	15,918,591.58
减：本报告期基金总赎回份额	615,791,989.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,099,517,911.50

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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》

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
二〇一三年十月二十四日