

华安动态灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告

2019-03-31
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：2019-04-20

重要提示

基金管理人承诺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。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes: 基金名称 (华安动态灵活配置混合), 场内简称 (H0015), 基金代码 (H0015), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2009-12-22), 期末基金份额总额 (127,423,313.92), 投资目标 (通过股票、债券等金融资产...), 投资策略 (本基金主要运用资产配置的方法...), 业绩比较基准 (80%×沪深300指数收益率+20%×中国国债总回报收益率), 风险收益特征 (本基金是一只混合型基金...), 基金管理人 (华安基金管理有限公司), 基金托管人 (中国工商银行股份有限公司)

主要财务指标

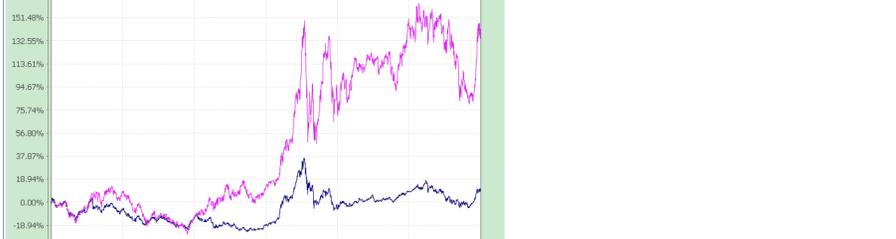
Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes: 本期已实现收益 (7,782,229.41), 本期利润 (49,674,971.84), 加权平均基金份额本期利润 (0.3823), 期末基金资产净值 (199,148,435.29), 期末基金份额净值 (1.565)

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... 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... 扣除相关费用后的余额。

基金净值表现

Table with columns: 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. Includes: 过去三个月 (32.85%, 1.69%, 17.24%, 0.92%, 15.61%, 0.77%)

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



其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 报告期 (2019-03-31). Includes: 基金份额持有人数量 (1,565), 基金资产净值 (199,148,435.29)

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes: 曹璋 (基金经理), 任职日期: 2015-06-16, 证券从业年限: 11年

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。

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运作基金资产，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。

公平交易专项说明

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》，明确封闭式基金、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体系。
异常交易行为的专项说明
报告期内未发现异常交易行为。

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》，公司构建了智能风控系统，对异常交易行为进行实时监控。报告期内未发现异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，A股市场大幅上涨，一季度上证综指、深成指分别上涨23.05%、36.48%，沪深300、创业板指分别上涨28.62%、33.03%。市场呈现普涨格局，从行业表现来看，电子、计算机、非银金融、食品饮料和电子等行业涨幅超过10%。在银行、电力及公用事业、医药、有色金属等行业涨幅在5%以内。具成长性板块来看，工业大麻表现超预期，跨境电商、白酒等板块涨幅均超过了60%。本基金在二季度整体保持较高仓位运行，基金个股较多集中在高科技成长板块，导致基金份额净值表现较前阶段比较积极。

报告期内基金的业绩表现

截至2019年03月31日，本基金份额净值为1.565元，本报告期份额净值增长率为22.85%，同期业绩比较基准增长率为17.24%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观判断：1季度宏观经济数据全面向好，但市场对此已有充分预期，结合两会政府工作报告精神，我们倾向于认为19年逆周期政策调控的力度会显著加大，无论是货币政策还是财政政策，边际变化的趋势非常明确，以稳健“稳增长、稳就业、稳金融、稳外贸、稳投资、稳预期”的目标以期待实现。从结构上看，小微企业和民营企业可能会成为本轮政策调控的主要受益对象。

报告期末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份额持有人数少于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes: 权益类投资 (198,755,029.77), 固定收益投资 (28,365,812.75), 贵金属投资 (0), 金融衍生品投资 (0), 买入返售金融资产 (0), 银行存款和结算备付金合计 (11,811,927.69), 其他资产 (4,290,547.27), 合计 (203,736,317.48)

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes: A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及生产供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息技术、软件和信息技术服务业, J 金融业, K 房地产业, 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 (198,755,029.77)

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

Table with columns: 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 (%). Includes: 1 600845 同仁堂, 2 603636 顺威股份, 3 300882 附新科技, 4 300115 长盛精密, 5 600997 露天矿, 6 300259 海松智尊, 7 603225 博众文化, 8 602271 北方华创, 9 600585 海螺水泥, 10 603019 华科博龙

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes: 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债 (可交换债), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计 (28,365,812.75)

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

Table with columns: 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 (%). Includes: 1 123002 国债转债, 2 113517 博众转债, 3 123010 博众转债, 4 113509 顺威转债, 5 128019 久谦转债

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

注：本基金本报告期末未有资产支持证券投资。

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

注：本基金本报告期末未有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未有权证投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes: 公允价值变动总额合计 (元), 股指期货投资本期收益 (元), 股指期货投资本期公允价值变动 (元)

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明. Includes: 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元)

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
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。

申明基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元). Includes: 1 存出保证金 (112,667.99), 2 应收证券清算款 (4,010,812.13), 3 应收股利, 4 应收利息, 5 其他应收款, 6 其他, 7 其他, 8 其他, 9 合计 (4,290,547.27)

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券简称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes: 1 123002 国债转债, 2 113517 博众转债, 3 123010 博众转债, 4 113509 顺威转债, 5 128019 久谦转债

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未有存在流通受限情况的股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量. Includes: 报告期期初基金份额总额 (127,423,313.92), 报告期期间基金总申购份额 (15,164,461.88), 报告期期间基金总赎回份额 (15,383,147.03), 报告期期间基金净申购份额 (33,108,295.01), 报告期期末基金份额总额 (127,423,313.92)

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目, 基金份额. Includes: 报告期末持有本基金基金份额, 报告期末持有本基金基金份额占基金总份额比例 (%)

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes: 合计

报告期末发起式基金发起人资金持有份额情况

Table with columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes: 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金从业人员, 基金管理人股东, 其他, 合计

报告期末前十名投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with columns: 机构投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 申购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比. Includes: 机构, 个人

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
2、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
3、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

存放地点

基金管理人和本基金托管人的办公场所，并登录于基金管理人互联网网站http://www.huaman.com.cn。

查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。