

华安大中华升级股票型证券投资基金2019年第1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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告期为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). Rows include: 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Fund Assets at Reporting End), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian), 境外资产托管人 (Overseas Asset Custodian).

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Rows include: 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Period Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金资产净值 (Net Asset Value at Reporting End), 期末基金份额净值 (Net Asset Value per Share at Reporting End).

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。

基金净值表现

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

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Std Dev), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Return Std Dev), ①-③ (Difference), ②-④ (Difference). Rows include: 过去三个月 (Last 3 Months).

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



基金经理（或基金经理小组）简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Rows include: 陈自森 (Chen Zisen), 苏苏涵 (Su Suhuan).

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。

境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

Table with columns: 姓名 (Name), 在境外投资顾问所任职务 (Position at Overseas Advisor), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Row: 无 (None).

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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约定，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，不存在违法违规及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》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理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，使用联合会议、发送邮件、登录在研究管理信息系统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险和投资策略，制定并严格执行投资决策流程，以确保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，公司实行严格执行公平交易机制，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、综合平衡的原则进行控制，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。若中签量超过法律法规进行比例分配，且以公司名义获得，则投资组合在集中交易部监督指导下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵照指令时间优先原则，先到先报的控制原则，通过内部共同的view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。若中签量超过法律法规进行比例分配，且以公司名义获得，则投资组合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属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：中债的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间以询价交易的价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的反向交易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。

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》，公司定期跟踪稽核部门基金投资、交易部门对涉及公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间市场的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的自动控制，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，对相关同向交易数据进行持续监控，并定期将同向交易分析进行了重点分析。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较少的单边交易量超过该证券当日成交量的3%或5次，未出现异常交易。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金持有人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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Rows include: 权益投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 金融衍生品投资 (Financial Derivatives Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 货币市场工具 (Money Market Instruments), 银行存款和结算备付金合计 (Total Bank Deposits and Settlement Funds), 其他各项资产 (Other Assets), 合计 (Total).

报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

Table with columns: 国家（地区） (Country/Region), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include: 中国香港 (Hong Kong), 中国台湾 (Taiwan).

报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include: 信息技术 (Information Technology), 工业 (Industry), 非必需消费品 (Non-essential Consumer Goods), 保健 (Healthcare), 金融 (Finance), 材料 (Materials), 通讯服务 (Communication Services), 公用事业 (Utilities), 能源 (Energy), 房地产 (Real Estate), 必需消费品 (Essential Consumer Goods), 合计 (Total).

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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 (Serial Number), 公司名称(英文) (Company Name in English), 公司名称(中文) (Company Name in Chinese), 证券代码 (Securities Code), 所在证券市场 (Market), 所属国家(地区) (Country/Region), 数量(股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Rows include: LARGAN PRECISION CO LTD, TAIKAY SEMICONDUCTOR MANFAC, XINJIANG GOLDMIND SCIMATE-H, TENCENT HOLDINGS LTD, CHINA MERCHANTS BANK-H, SUNNY OPTICAL TECH, CHINA TRADITIONAL CHINESE ME, ZHIZHOU CRIC TIMES ELECTRI-H, FLEXUM INTERCONNECT INC, CHINA EDUCATION GROUP HOLDEN.

报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Row: 无 (None).

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 衍生品类别 (Derivative Category), 衍生品名称 (Derivative Name), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Row: 1 权证 (Warrant), 金风科技股票权证 (Warrant of Goldwind Technology).

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基金投资明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 基金名称 (Fund Name), 基金类型 (Fund Type), 运作方式 (Operation Mode), 管理人 (Manager), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Row: 无 (None).

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。

基金投资的前十名股票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 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan). Rows include: 存出保证金 (Margin Deposited), 应收证券清算款 (Receivable Securities Settlements), 应收股利 (Receivable Dividends), 应收利息 (Receivable Interest), 其他应收款 (Other Receivables), 特殊费用 (Special Expenses), 其他 (Other), 合计 (Total).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (Quantity). Rows include: 报告期期初基金份额总额 (Total Fund Assets at Reporting Start), 报告期期间基金总申购份额 (Total Fund Assets Purchased during Reporting Period), 减：报告期期间基金总赎回份额 (Total Fund Assets Redeemed during Reporting Period), 报告期期间基金净申购份额 (Net Fund Assets Purchased during Reporting Period), 报告期末基金份额总额 (Total Fund Assets at Reporting End).

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 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Transaction Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 运用费率 (Application Fee Rate). Row: 合计 (Total).

报告期末发起式基金发起资金持有份情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Initiated Shares). Rows include: 基金管理人固有资金 (Fund Manager's Own Funds), 基金管理人高级管理人员 (Senior Management of Fund Manager), 基金管理人从业人员 (Employees of Fund Manager), 基金管理人股东 (Shareholders of Fund Manager), 其他 (Other), 合计 (Total).

报告期内前—投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Share Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Shares Purchased), 赎回份额 (Shares Redeemed), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Share Proportion). Rows include: 机构 (Institution), 个人 (Individual).

影响投资者决策的其他重要信息

无 (None).

备查文件目录

- 1、《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》
2、《华安大中华升级股票型证券投资基金招募说明书》
3、《华安大中华升级股票型证券投资基金托管协议》

存放地点

基金管理人的办公场所和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网网站http://www.huanan.com.cn。

查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站查阅，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。