

重要提示

基金管理人承诺基金管理人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。基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年4月1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。投资者有风险，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。本报告财务资料未经审计。本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Rows include 基金名称 (Fund Name), 场内简称 (Listed Name), 基金主代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Report), 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).

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). 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 (End of Period Net Assets), 期末基金份额净值 (End of Period Net Asset Value).

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：封闭期基金交易费用、开放式基金申购赎回费、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 6 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准收益率变动的比较

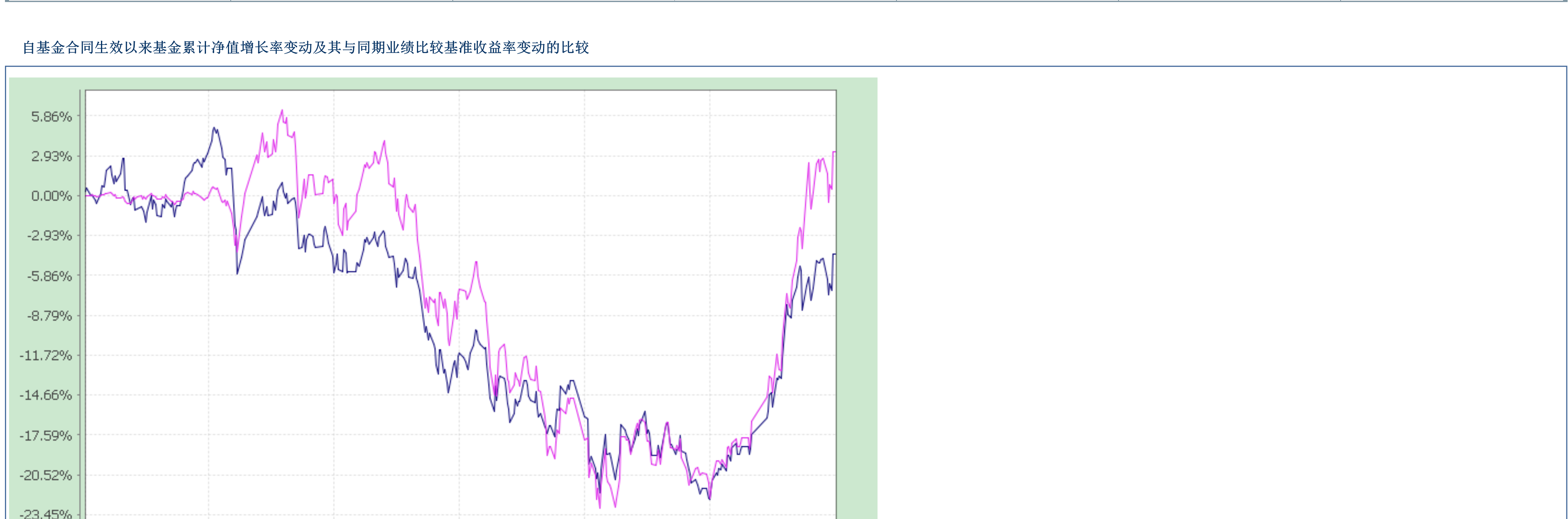


Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Rows include 基金份额持有人户数 (Number of Shareholders), 基金份额持有人户数较期初变化比例 (Change in Number of Shareholders).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 6 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Experience), 说明 (Remarks). Rows include 郑晔 (Zheng Ye).

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《证券基金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合规性情况的说明

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。

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。同时按照包括：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，按照最公允、最透明、最快捷的方式向各投资组合提供研究成果；在投资决策环节，制定并严格执行投资决策流程，以保证各投资组合投资决策的客观和独立。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，超过授权范围的操作需经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行集中交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易前—事前准备：基金经理提交投资指令及交易申请，基金经理提交交易指令及交易申请，基金经理提交交易指令及交易申请。（2）交易时—事中控制：基金经理提交投资指令及交易申请，基金经理提交交易指令及交易申请。（3）交易后—事后监控：基金经理提交交易指令及交易申请，基金经理提交交易指令及交易申请。

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、交易部门共同制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所和银行间市场交易的控制规则，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、专户的回日交易交易的监控与隔日反向交易的检查。风险管理部开发了反向交易分析系统，对相关反向交易指标进行持续监控，并定期对组合的回日交易行为进行了重点分析。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的基金份额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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度贸易摩擦加剧，同时市场流动性趋紧，市场波动反弹，风险偏好回升较快。尽管市场整体估值较低，但是结构上上与宏观经济相关性较强的行业估值不低，预计未来经济将从投资消费和服务转型，从地产高端制造转型，因此市场估值体系需要再平衡。本基金将坚持长期和消费股，特别是符合产业和消费升级趋势的行业。行业配置包括：5g产业链、云计算产业链、生物科技产业链、新能源汽车产业链等。

报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月31日，本基金份额净值为1.019元。本报告期份额净值增长率为29.67%，同期业绩比较基准增长率为23.86%。

报告期末基金份额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 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets). Rows include 权益类投资 (Equity Investment), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 贵金属投资 (Precious Metals Investment), 金融衍生品投资 (Financial Derivatives Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 银行存款和结算备付金合计 (Total Bank Deposits and Settlement Funds), 其他资产 (Other Assets), 合计 (Total).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Rows include 农、林、牧、渔业 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, and Fishing), 采矿业 (Mining), 制造业 (Manufacturing), 电力、热力、燃气及水生产和供应业 (Electricity, Heat, Gas, and Water Supply), 建筑业 (Construction), 批发和零售业 (Wholesale and Retail Trade), 交通运输、仓储和邮政业 (Transportation, Storage, and Postal Services), 住宿和餐饮业 (Accommodation and Food Services), 信息技术、软件和信息技术服务业 (Information Technology, Software, and Information Technology Services), 金融业 (Finance), 房地产业 (Real Estate), 租赁和商务服务业 (Leasing and Business Services), 科学研究和技术服务业 (Science, Research, and Technology Services), 水利、环境和公共设施管理业 (Water Resources, Environment, and Public Facilities Management), 居民服务、修理和其他服务业 (Residential Services, Repairs, and Other Services), 教育 (Education), 卫生和社会工作 (Health and Social Work), 文化、体育和娱乐业 (Culture, Sports, and Entertainment), 综合 (General), 合计 (Total).

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 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Rows include 200928 (亿阳转债), 000661 (长安高新), 002127 (尚品酒店), 002938 (鼎泰新材), 000739 (普洛药业), 600845 (宝信软件), 300751 (迈为股份), 600619 (贵州茅台), 002180 (神思电子), 603871 (聚友国际).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Rows include 国家债券 (Government Bonds), 央行票据 (Central Bank Bills), 金融债券 (Financial Bonds), 企业债券 (Corporate Bonds), 企业短期融资券 (Corporate Short-Term Financing Notes), 中期票据 (Medium-Term Notes), 可转换 (可交换)债 (Convertible (Convertible) Bonds), 同业存单 (Interbank Deposits), 其他 (Other), 合计 (Total).

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 5 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousands of Yuan), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Rows include 128058 (招商转债).

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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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持有权证投资。

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 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description). Rows include 公允价值变动总额合计 (元) (Total Fair Value Change in Yuan), 股指期货投资本期收益 (元) (Futures Investment Income in Yuan), 股指期货投资本期公允价值变动 (元) (Futures Investment Fair Value Change in Yuan).

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，若选择投资于流动性好、交易活跃的投资期合约。本基金在衍生品投资过程中，首先将基于对证券市场总体趋势的判断和组合中收益的构成和投资目标以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产（或基金）的总体特征和风险收益特征确定股指期货的投资比例。其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和定价水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

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 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description). Rows include 公允价值变动总额合计 (元) (Total Fair Value Change in Yuan), 国债期货投资本期收益 (元) (Treasury Futures Investment Income in Yuan), 国债期货投资本期公允价值变动 (元) (Treasury Futures Investment Fair Value Change in Yuan).

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况

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 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan). Rows include 存出保证金 (Outstanding Margin), 应收证券清算款 (Receivable Settlements), 应收股利 (Receivable Dividends), 应收利息 (Receivable Interest), 其他应收款 (Other Receivables), 待摊费用 (Prepaid 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

无。

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持有存在流通受限情况的股票。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity). Rows include 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Report), 报告期间基金份额申购份额 (Shares Subscribed During Report Period), 减：报告期间基金份额赎回份额 (Shares Redeemed During Report Period), 报告期间基金份额拆入拆出份额 (Shares Transferred In/Out During Report Period), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Report).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Rows include 报告期末管理人持有的本基金份额 (Fund Shares Held by Manager at End of Report), 报告期间买入/申购总份额 (Total Shares Bought/Subscription During Report Period), 报告期间卖出/赎回总份额 (Total Shares Sold/Redemption During Report Period), 报告期末管理人持有的本基金份额 (Fund Shares Held by Manager at End of Report), 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%) (Percentage of Total Shares Held by Manager).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Mode), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Shares), 交易金额 (元) (Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate). Rows include 合计 (Total).

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 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), 基金管理人人员 (Fund Manager's Staff), 基金管理人股东 (Shareholders of Fund Manager), 其他 (Other), 合计 (Total).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 7 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 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding 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

备查文件目录

- 1. 《华安幸福生活混合型证券投资基金合同》
2. 《华安幸福生活混合型证券投资基金招募说明书》
3. 《华安幸福生活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http://www.huainan.com.cn。

查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网查询，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。