

华安新机遇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：中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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、净值信息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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。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。
本报告自2019年3月31日起至3月31日止。

Table with 2 columns: 项目 (Items) and 数值 (Values). Includes Fund Name, Code, Strategy, and Investment Objective.

主要财务指标

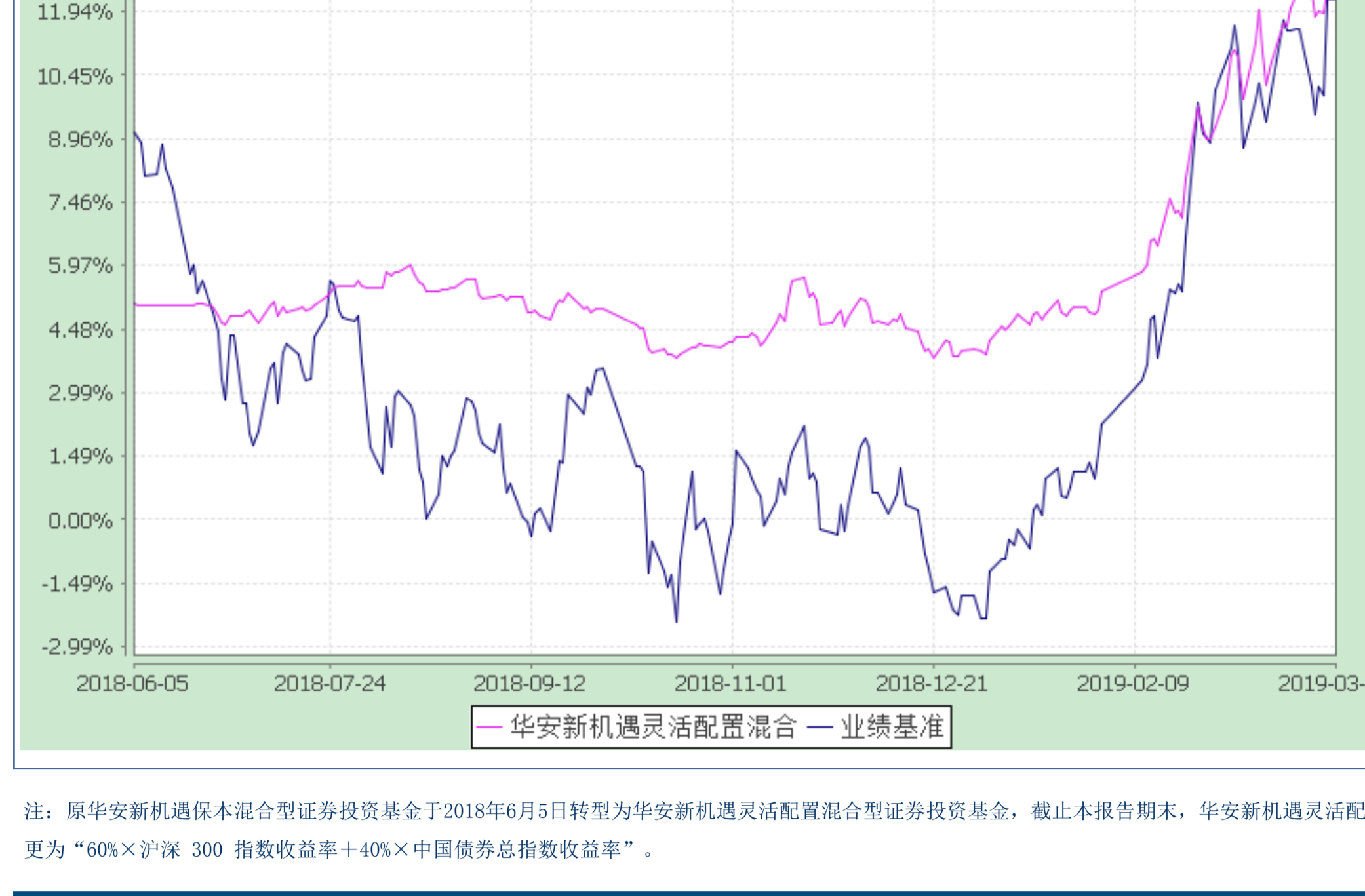
Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31). Shows metrics like Net Income and Net Assets.

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 6 columns: 阶段 (Period), 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, 业绩比较基准收益标准差④, ①-③, ②-④. Includes 3-month performance data.

自基金份额成立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



注：华安新机遇保本混合型证券投资基金于2018年6月5日转型为华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金。截止本报告期末，华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金成立未满一年。本基金于2018年6月5日起，整体业绩比较基准由“三年期银行定期存款收益率（税后）* 2 变更为“60%*沪深300指数收益率+40%*中国债券总指数收益率”。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-01 to 2019-03-31). Lists metrics like Average Daily Net Assets.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 6 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理年限 (Experience), 证券从业年限 (Securities Experience), 说明 (Remarks). Lists managers like 何可成 and 程露.

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公历日期为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员管理暂行办法》的相关规定。

报告期内基金管理人承诺遵守的情况

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。

公平交易专项说明

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制度，严格防范利益冲突。

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运营、交易等部门对异常交易进行了筛查，未发现异常交易。同时，系统对异常交易进行了实时监控，未发现异常交易。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，宏观经济保持温和复苏态势，全球风险资产呈现普涨上涨。国内宏观经济保持稳健态势，货币政策保持稳健中性，央行通过多种措施支持信用扩张。同时，由于人民币汇率升值预期，在风险偏好上有所提升，债券收益率继续出现回落，信用利差收窄。权益市场则与全球市场同步走强，并且表现出超预期的上涨。

本基金结合市场环境，继续保持了较谨慎的仓位，权益方面保持了灵活的仓位，取得了正收益。

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1.1259元，本报告期份额净值增长率为8.18%，同期业绩比较基准增长率为7.61%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济增长仍有可能持续。对中国而言，未有贸易风险和全球需求的不确定性，内需总需求不足带来的潜在风险在降低。宏观经济仍具有一定的下行压力，在经济数据持续改善之前，财政和货币政策保持温和发力，为稳定经济增长提供助力。货币政策的稳健性提供助力，人民币和中小企业的融资环境均有改善。债券市场在风险偏好提升、进入加息周期、未来预期进入加息周期。

本基金将在获得确定性收益的基础上，继续保持对长期利率和权益仓位波段操作，同时积极参与可转债；本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

报告期末基金持有人户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户数或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 项目 (Items). Lists various asset categories like Equity, Fixed Income, etc.

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), 占基金资产净值比例 (%). Lists various industry categories like IT, Healthcare, etc.

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 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%). Lists top 10 stocks held.

报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%). Lists various bond types held.

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), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%). Lists top 5 bonds held.

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投资情况说明

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) (Quantity), 合约价值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk). Shows empty data.

注：无。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据股指期货的特性，以避险为目的，适度参与股指期货交易。本基金在股指期货交易中的首要目标是规避市场波动和利率风险。本基金在股指期货交易中的首要目标是规避市场波动和利率风险。本基金在股指期货交易中的首要目标是规避市场波动和利率风险。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

本期国债期货投资政策

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) (Quantity), 合约价值 (元) (Contract Value), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk). Shows empty data.

注：本基金本报告期末没有国债期货。

本期国债期货投资政策

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发生被监管部门立案调查，也没有在报告期内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中是否存在基金合同规定备选库之外的股票
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库之外的股票。

Table with 2 columns: 序号 (Serial Number) and 金额 (元) (Amount). Lists various assets like Cash, Receivables, etc.

报告期末未持有的处于转股期的可转换债券明细
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 流通受限部分的公允价值 (元) (Fair Value of Restricted Portion), 占基金资产净值比例 (%), 流通受限情况说明 (Restriction Description). Shows empty data.

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Items) and 数量 (Quantity). Shows fund assets and liabilities.

基金管理人持有本基金基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 (Items) and 基金份额 (Shares). Shows fund manager's shareholding.

注：无。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额 (份) (Transaction Amount), 交易金额 (元) (Transaction Amount), 运用频率 (Application Frequency).

注：无。

报告期末按基金发起设立持有基金份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Items), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

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 4 columns: 投资者类别 (Investor Type), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的期间 (Period), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Current Shares), 份额占比 (Percentage).

影响投资决策的其他重要信息

各文件目录
1、《华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金合同》
2、《华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
3、《华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

存放地点
基金管理人及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.huanan.com.cn。

查阅方式
投资者可登录基金管理人互联网网站，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。