

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、误导性陈述或者重大遗漏，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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险，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。
本报告财务数据未经审计。
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: 基金简称 (华安行业轮动混合), 场内简称 (HAXY), 基金主代码 (040016), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2010-05-11), 报告期末基金份额总额 (143,979,729.42), 投资目标 (本基金注重把握行业轮动规律,力求通过行业轮动配置,对具备行业龙头企业和具有估值优势、成长潜力的股票进行重点投资...), 投资策略 (本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法进行资产配置...), 业绩比较基准 (80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率), 风险收益特征 (本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种), 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).

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 (28,216,212.63), 本期利润 (64,744,009.40), 加权平均基金份额本期利润 (0.4280), 期末基金资产净值 (229,918,333.29), 期末基金份额净值 (1.5969).

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

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 (净值增长率 36.96%, 净值增长率标准差 1.39%, 业绩比较基准收益率 22.93%, 业绩比较基准收益率标准差 1.21%, ①-③ 14.03%, ②-④ 0.15%).



其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes: 其他指标 (空), 报告期 (2019-03-31).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业资格, 说明. Includes: 陈斌 (基金经理, 任职日期 2018-06-11, 10年), 钱晓刚 (基金经理, 任职日期 2018-11-12, 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,证券从业的含义参照行业协会《证券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》,得到切实执行。报告期内,基金管理人严格执行公平交易管理制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

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、交易部门对报告期内公募基金、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。同时加强了公募基金、专户的同日反向交易的监控与同日反向交易的检查;风险管理部开发了反向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对同向交易的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,由现同日反向交易或较少的单位交易量超过该证券当日成交量的一定比例,未发现异常交易。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度上证指数上涨23.9%,创业板指上涨33%,行业层面,农业、计算机、食品饮料、银行、电子涨幅较大,银行、电力及公用事业、煤炭、石油石化、汽车等涨幅落后。一季度白马、成长风格均有较好的表现,一季度华安行业轮动上涨38.96%。

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1.5969元,本报告期内份额净值增长率为36.96%,同期业绩比较基准增长率为22.93%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度社融数据出现大幅回升,通胀维持在相对较低水平,人民币汇率回升。从历史看,社融企稳回升后,经济在后续几个季度企稳回升的概率较大。从一些早期行业看,春节后景气度较去年年初明显回升。由于去年经济增速降低时社会库存水平相对历史不算太高,因此本轮社融回升传导的时间可能比过去更短。同时,非洲猪瘟对通胀的压力可能在二季度逐步显现,相对宽松的货币政策可能受到一定的掣肘。改革层面,去年下半年以来一系列改革持续推进,一些长期的风险点在化解。未来一段时间,我们既可能看到经济企稳回升,也可能在不太远的时点看到一些科技产业的瓶颈。2019年是播种的一年,华安行业轮动将继续着力新兴行业和消费升级,注重行业的景气轮动,争取为投资者创造良好收益。

报告期内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, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes: 权益类投资 (183,114,664.63), 固定收益投资 (137,690.00), 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他资产 (459,321.30), 合计 (234,532,127.50).

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、燃气及水生产和供应业, 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 信息传输、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 批发零售、修理和其他服务业, P 教育, Q 卫生和社工作, R 文化、体育和娱乐业, S 综合, 合计 (193,114,664.63).

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: 002475 汉鼎宇佑, 000568 泸州老窖, 601888 中国国旅, 300128 锦兴能源, 002282 亿嘉和, 603966 亿嘉和, 600547 山东黄金, 300383 北环新网, 002821 凯莱英, 000333 美的集团.

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: 国家债券, 央行票据, 金融债券, 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 合计 (137,690.00).

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: 110054 浦发转债, 128861 启明转债.

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

报告期末本基金没有股指期货持仓和损益明细。

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).

注: 本基金本报告期没有股指期货持仓。

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

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 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).

注: 本基金本报告期没有国债期货持仓。

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
本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有在被监管部门立案调查,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, 项目, 名称, 金额(元), 单位: 人民币元. Includes: 1 应收证券利息 (74,421.98), 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计 (459,321.30).

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: 本基金本报告期末未持有处于流通受限情况的股票。

Table with columns: 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. Includes: 1 002282 金风科技 (1,240,736.70, 0.54% 非公开发行股票).

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量, 单位: 份. Includes: 报告期初基金份额总额 (155,224,517.32), 报告期申购基金份额 (11,829,419.74), 报告期赎回基金份额 (23,074,207.64), 报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (143,979,729.42).

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, 单位: 份. Includes: 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期末买入/申购总份额, 报告期末卖出/赎回总份额, 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期末管理人持有的基金份额占基金总份额比例(O).

注: 无。

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, 交易数量(份), 交易金额(元), 适用费率. Includes: 合计.

注: 无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

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, 基金管理人基金经理, 基金管理人股东, 其他, 合计.

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 columns: 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: 个人.

影响投资决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1.《华安行业轮动混合型证券投资基金基金合同》
2.《华安行业轮动混合型证券投资基金招募说明书》及其更新招募说明书
3.《华安行业轮动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住所, 并登录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。