

华安安信消费服务股票型证券投资基金 （原安信证券投资基金转型）2013 年第 2 季度报告

2013 年 6 月 30 日

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：二〇一三年七月十九日

§ 1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 7 月 16 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代表其未来表现。投资有风险，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 华安安信消费服务股票型证券投资基金

基金简称：	华安安信消费股票
交易代码：	519002
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2013 年 5 月 23 日
报告期末基金份额总额：	2,946,180,618.29
投资目标：	本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会、实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略：	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对消费服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。

业绩比较基准:	中证消费服务领先指数收益率
风险收益特征:	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，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:	中国工商银行股份有限公司

2.2 原安信证券投资基金

基金简称:	华安安信封闭
交易代码:	500003
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1998 年 6 月 22 日
报告期末基金份额总额:	2,000,000,000
投资目标:	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险，确保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略:	本基金为成长型基金，本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 45-80%，现金比例根据运作情况调整。在股票资产中，70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。 本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 增长率的上市公司股票。
业绩比较基准:	无
风险收益特征:	无
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

项目	2013 年第 2 季度报告
----	----------------

	转型后（2013年5月23日-2013年6月30日）	转型前（2013年4月01日-2013年5月22日）
1. 本期已实现收益	25,369,605.88	16,437,895.52
2. 本期利润	-844,675.53	33,269,189.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0004	0.0166
4. 期末基金资产净值	2,997,596,886.81	2,085,987,601.95
5. 期末基金份额净值	1.017	1.0430

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。

3.本基金已于2013年6月24日对原安信证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为1:1.016880461。

3.2 基金净值表现

3.2.1 华安安信消费服务股票型证券投资基金

3.2.1.1 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

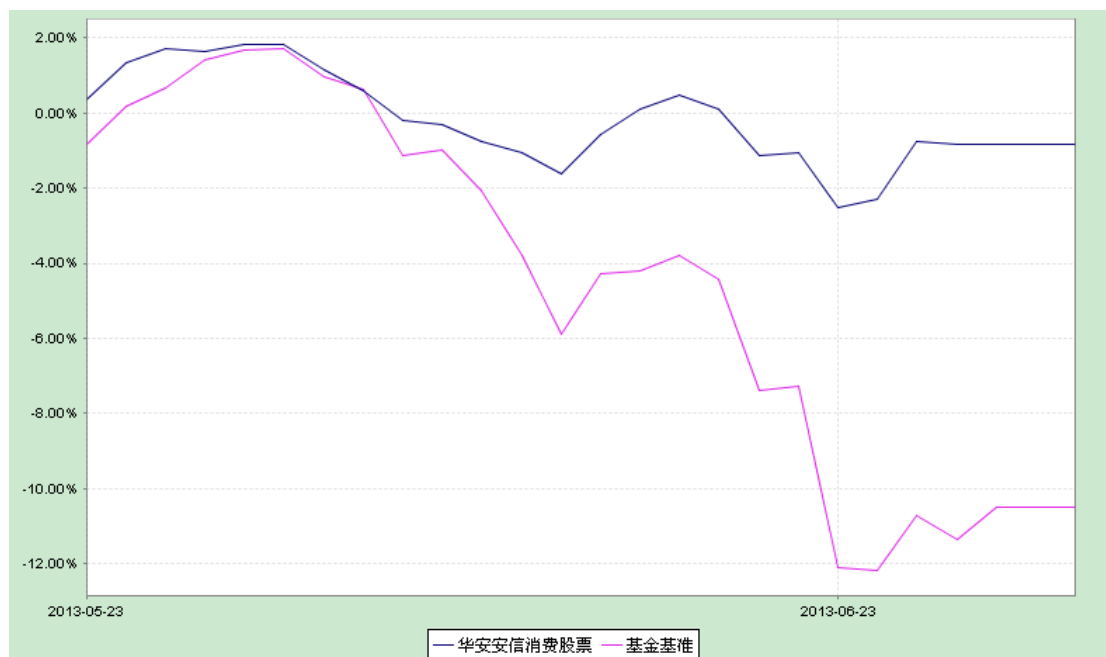
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2013.5.23-2013.6.30	-0.85%	0.69%	-10.49%	1.52%	9.64%	-0.83%

3.2.1.2 自基金转型以来基金累计份额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

华安安信消费服务股票型证券投资基金

转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年5月23日至2013年6月30日）



注：1、本基金转型日期为 2013 年 5 月 23 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、根据《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.2 安信证券投资基金

3.2.2.1 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

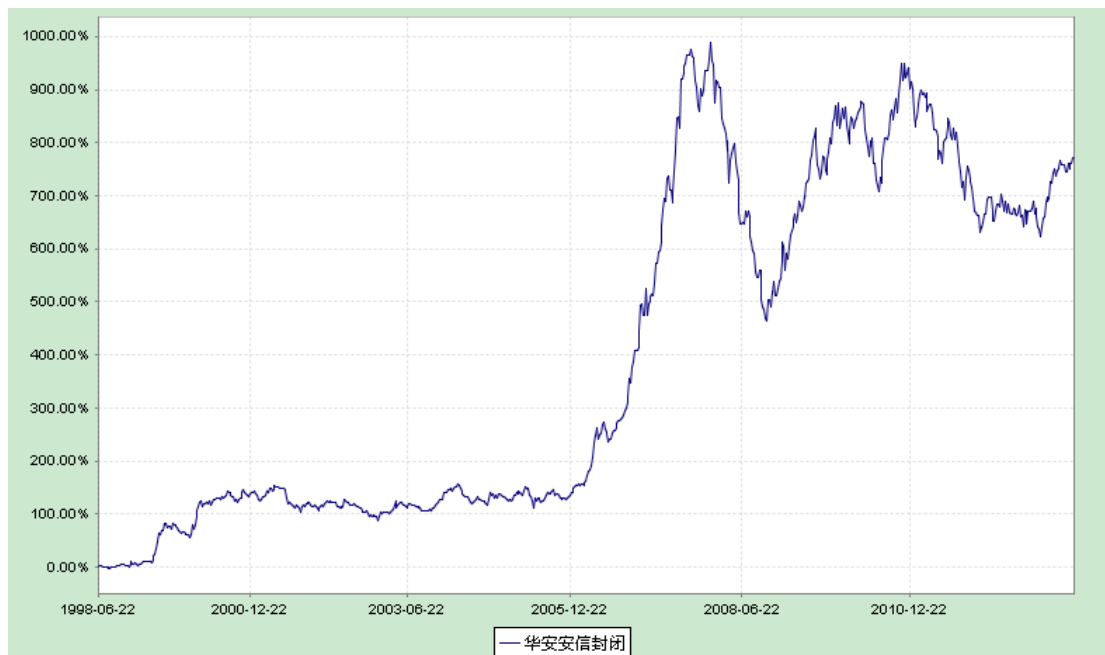
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2013.4.1-2013.5.22	1.62%	1.19%	-	-	-	-

3.2.2.2 自基金转型以来基金份额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

安信证券投资基金

转型前累计净值增长率历史走势图

（1998 年 6 月 22 日至 2013 年 5 月 22 日）



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈俏宇	本基金的基金经理、投资研究部副总监	2008-2-13	—	17 年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，17 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理，2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理，2008 年 2 月起担任本基金的基金经理，2008 年 10 月起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基

					金经理。2011年4月起同时担任华安升级主题股票型证券投资基金的基金经理。2012年9月起兼任投资研究部副总监。
--	--	--	--	--	--

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。

4.2 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。控制措施包括：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，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中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格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证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，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，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、综合平衡的控制原则，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，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 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。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、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：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机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。

4.3.2 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、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。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，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向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中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 2 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度前半阶段的市场平静期终于在六月被打破。我们认为与其说是流动性

预期制约了市场，不如说是在一系列低于预期的经济数据面前，投资者越来越意识到对经济增长速率保持盲目乐观不切实际，同时对过往增长方式的反思以及对经济转型的决心和憧憬，令资源更积极更有效地配置在有良好发展前景的弱周期行业内，尤其是其中在完全市场化竞争中脱颖而出的优势企业中。报告期内沪深300指数下跌11.8%，同期中证500下跌6.13%，中小板指数下跌3.42%，创业板指数则上涨16.76%，也折射出结构性的市场风格。而从行业板块来看，信息服务、电子和医药等行业依然延续了强势，采掘、有色金属和金融服务等行业依然表现疲弱。

本基金报告期内在基金持有人的支持下，顺利完成了封闭式基金的转型工作，转型后的新基金将重点投资于消费服务相关的子行业或公司。报告期内我们对经济转型背景下如何进行真正的防御性投资进行了进一步的反思，对部分出于低估值而非竞争力提升的配置型品种进行了减持，而将有限的仓位集中于能受益于新经济发展，在发展中逐步形成较难超越的核心竞争力的品种中，其中稳定增长类的医药、大众消费和定制加工类，以及新材料公司成为主要投资方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为1.017元，本报告期份额净值增长率为-0.85%，同期业绩比较基准增长率为-10.49%。

§5 投资组合报告

5.1 华安安信消费服务股票型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2013年5月23日-2013年6月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,005,398,824.32	33.03
	其中：股票	1,005,398,824.32	33.03
2	固定收益投资	424,962,445.00	13.96
	其中：债券	424,962,445.00	13.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,522,321,009.60	50.01
	其中：买断式回购的买入返	-	-

	售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	32,199,498.78	1.06
6	其他各项资产	59,009,809.88	1.94
7	合计	3,043,891,587.58	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	803,539,846.47	26.81
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	29,670,980.25	0.99
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	25,402,500.00	0.85
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	27,589,107.60	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,526,790.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	108,669,600.00	3.63
	合计	1,005,398,824.32	33.54

5.1.3 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

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（%）
1	002450	康得新	6,100,000	170,678,000.00	5.69
2	002250	联化科技	5,717,793	114,298,682.07	3.81
3	600256	广汇能源	8,385,000	108,669,600.00	3.63
4	600867	通化东宝	6,136,875	91,378,068.75	3.05
5	002038	双鹭药业	1,500,243	87,914,239.80	2.93
6	600887	伊利股份	1,680,000	52,550,400.00	1.75
7	002241	歌尔声学	1,339,369	48,605,701.01	1.62
8	300146	汤臣倍健	1,000,269	44,001,833.31	1.47
9	000963	华东医药	733,465	29,228,580.25	0.98
10	600594	益佰制药	907,623	28,054,626.93	0.94

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	262,750,445.00	8.77
2	央行票据	69,902,000.00	2.33
3	金融债券	92,310,000.00	3.08
	其中：政策性金融债	92,310,000.00	3.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	424,962,445.00	14.18

5.1.5 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

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（%）
1	120019	12 付息国债 19	1,200,000	119,568,000.00	3.99
2	130002	13 付息国债 02	700,000	69,643,000.00	2.32
3	080216	08 国开 16	600,000	62,370,000.00	2.08
4	1001060	10 央票 60	600,000	59,934,000.00	2.00
5	010308	03 国债(8)	520,700	52,017,930.00	1.74

5.1.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.1.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.1.9 投资组合报告附注

5.1.9.1 报告期内，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。

5.1.9.2 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。

5.1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	29,609.63
2	应收证券清算款	47,622,441.98
3	应收股利	-
4	应收利息	11,357,758.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,009,809.88

5.1.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.2 原安信证券投资基金投资组合报告

（报告期：2013 年 4 月 01 日-2013 年 5 月 22 日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	764,573,264.14	36.54
	其中：股票	764,573,264.14	36.54
2	固定收益投资	466,965,635.00	22.32
	其中：债券	466,965,635.00	22.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	470,000,000.00	22.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	270,440,457.43	12.93

6	其他各项资产	120,300,644.25	5.75
7	合计	2,092,280,000.82	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,120,000.00	0.72
C	制造业	568,568,444.14	27.26
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	3,577,800.00	0.17
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	92,799,520.00	4.45
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	84,507,500.00	4.05
	合计	764,573,264.14	36.65

5.2.3 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

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（%）
1	002450	康得新	6,200,000	166,656,000.00	7.99
2	600256	广汇能源	4,390,000	84,507,500.00	4.05
3	002250	联化科技	3,735,845	83,271,985.05	3.99
4	600867	通化东宝	4,655,729	75,003,794.19	3.60
5	600016	民生银行	5,608,000	59,669,120.00	2.86
6	002038	双鹭药业	755,202	50,288,901.18	2.41
7	600887	伊利股份	1,300,000	36,972,000.00	1.77
8	600594	益佰制药	807,623	23,154,551.41	1.11
9	300146	汤臣倍健	434,847	22,090,227.60	1.06
10	601166	兴业银行	1,000,000	18,730,000.00	0.90

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	263,838,635.00	12.65
2	央行票据	69,960,000.00	3.35
3	金融债券	92,847,000.00	4.45
	其中：政策性金融债	92,847,000.00	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,320,000.00	1.93
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	466,965,635.00	22.39

5.2.5 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

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（%）
1	120019	12 付息国债 19	1,200,000	120,060,000.00	5.76
2	130002	13 付息国债 02	700,000	69,972,000.00	3.35
3	080216	08 国开 16	600,000	62,778,000.00	3.01
4	1001060	10 央票 60	600,000	59,970,000.00	2.87
5	010308	03 国债(8)	520,700	52,226,210.00	2.50

5.2.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.2.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.2.9 投资组合报告附注

5.2.9.1 报告期内，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。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	395,926.95
2	应收证券清算款	110,087,048.80
3	应收股利	-
4	应收利息	9,817,668.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,300,644.25

5.2.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资原封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	28,538,470.00
报告期初至转型前买入总份额	-
报告期初至转型前卖出总份额	-
转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额	28,538,470.00
转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	1.43

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

合同生效日基金份额总额	2,000,000,000.00
合同生效日至报告期末基金总申购份额	912,453,957.29

合同生效日至报告期末卖出总份额	-
合同生效日至报告期末拆分份额	33,726,661.00
报告期期末基金份额总额	2,946,180,618.29

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安信消费服务股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《安信证券投资基金基金合同》
- 5、《安信证券投资基金招募说明书》
- 6、《安信证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，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。

华安基金管理有限公司

二〇一三年七月十九日