

华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年 12 月 31 日

[illegible]

投资回报:1.024%
 按年月复利定期理财财富:
 投资回报:1.0847%

45 资产管理人实施:证券市场及行业走势的简要提示

美国经济复苏力度是否足以支撑楼市企稳,而美国在采取新的财政紧缩政策,将可能实施大幅缩量的货币政策,欧元区经济持续低迷,经济增速未见好转,欧元区货币政策可能再出大招。中国经济方面,近期通胀压力继续回升,通胀压力开始抬头,并已经持续保持持续缩量的货币政策,资金面中宽松,整体流动性将有所收紧,但春节前夕货币市场仍会出现季节性的利率松动。

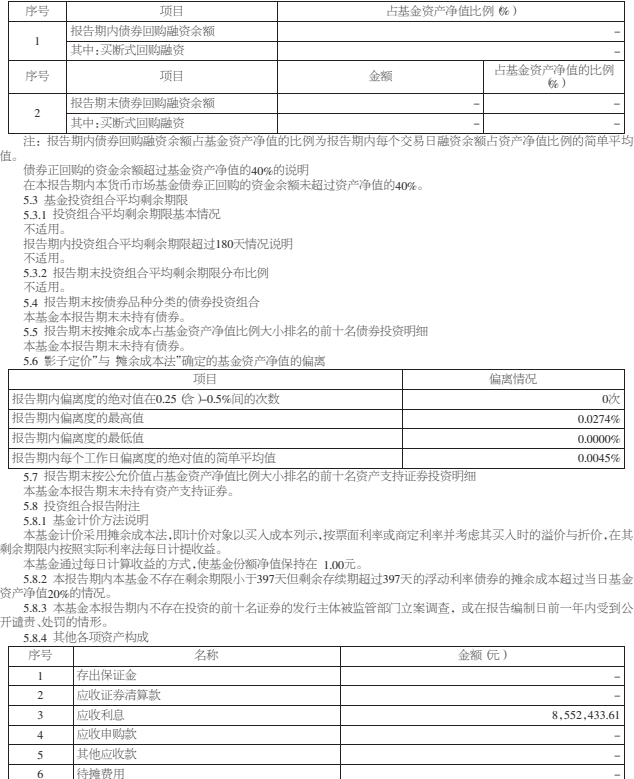
根据上述基本判断,本基金将比较短期融资券、回购和定期存款等各类资产的收益水平,进行合理配置,力争为持有人提供安全高效、有竞争力的理财产品。

65 投资组合报告

51 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	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,551,680,901.35	99.89
4	其他各项资产	8,552,433.61	0.11
5	合计	7,560,233,334.96	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况



7	其他		-
8	合计		8,552,433.61

56 开放式基金份额变动

项目	华安月月鑫定期理财份额A	华安月月鑫定期理财份额B	单位:份
本报告期初基金份额总额	1,410,221,646.54	47,372,400.00	
本报告期基金总申购份额	12,836,038,766.56	2,649,097,196.24	
减:本报告期基金总赎回份额	8,957,358,218.35	462,166,328.82	
本报告期末基金份额总额	5,288,902,164.25	2,364,303,467.82	

57 重要事项目录

1. 华安月月鑫定期理财类证券投资基金基金合同
2. 华安月月鑫定期理财类证券投资基金基金招募说明书
3. 华安月月鑫定期理财类证券投资基金基金托管协议
4. 存续地点
5. 基金管理人和本基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站<http://www.huamc.com.cn>。
6. 销售渠道

投资者可登录基金管理人互联网网站,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
二〇一三年一月二十一日

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	40.48	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
2	30天(含)~60天	59.66	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
3	60天(含)~90天	--	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
4	90天(含)~180天	--	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
5	180天(含)~397天(含)	--	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
	合计	100.14	--

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期末按资产类别持有债券

5.6 报告期末按摊余成本法占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

5.6 影子定价与 摊余成本法 确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)~0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0742%
报告期内偏离度的最低值	0.0013%

报告期内每个工作日结束时的净资产的简单平均值	0.003%
5.7 投资者未按公允价值或基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券信息披露	
本基金本报告期末持有资产支持证券。	
5.8 投资报告附注说明	
5.8.1 基金计价方法说明	
本基金采用四舍五入法,并以人民币元作为记账单位,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率和每日计提利息。	
本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。	
5.8.2 本报告期末本基金基金份额余额为3,997,310.00份,距离存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%。	
5.8.3 本基金本报告期末不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开	

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	313,053.73
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
合计		313,053.73

6	7971	96	开放式基金份额变动	215,055.73
			单位:份	
	项目	华安双月鑫短定期理财券A	华安双月鑫短定期理财券B	
	本报告期初基金份额总额	856,255,594.24	247,043,971.83	
	本报告期基金总申购份额	17,283,161.63		
	减:本报告期基金总赎回份额	584,348,261.53	224,449,441.68	
	本报告期基金拆分变动份额			
	本报告期末基金份额总额	289,190,494.34	22,594,530.15	
7.1	§7 备查文件目录			

1. 《华安双月鑫定期理财债券型证券投资基金基金合同》

2. 《华安双月鑫定期理财债券型证券投资基金招募说明书》

3. 《华安双月鑫定期理财债券型证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

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

7.3 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。

华安基金管理有限公司
二〇一三年一月二十一日

[illegible]

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,551,680,901.35	99.89
4	其他各项资产	8,552,433.61	0.11
5	资产合计	7,560,233,334.96	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况			
序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		--
	其中：买断式回购融资		--
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额		--
	其中：买断式回购融资		--

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例均为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

不适用。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按行业分类的基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

基金本报告期末未持有债券。

5.6 影子定价与公允价值法确定的基金资产净值的偏离

(1) 公允价值法

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0274%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0045%

5.7 货币资金按公允价值计量在资产负债表日余额的前十名资产支持证券投资明细

本基金货币资金余额未投资于资产支持证券。

5.8 投资组合合规性说明

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用公允价值法，即公允价值按买入或卖出列示，按照票面利率或约定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法每日计提收益，使基金份额净值保持在 1.00 元。

5.8.2 本报告期末本基金不存在剩余期限小于397天且剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日公允价值的情况。

5.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	8,552,433.61
4	应收申购款	--
5	其他应收款	--

6	待摊费用		-
7	其他		-
8	合计		8,552,433.61

56 开放式基金份额变动

项目	华安月月鑫定期理财债券A	华安月月鑫定期理财债券B
本报告期初基金份额总额	1,410,221,616.54	77,372,940.00
本报告期基金总申购份额	12,836,038,766.06	2,649,097,196.24
减:本报告期基金总赎回份额	8,957,358,218.35	462,166,528.42
本报告期末基金份额总额	5,288,902,164.25	2,564,303,607.82

57 截至资产负债表日

7.1 备查文件目录

1、你农月鑫短期理财债券型证券投资基金合同

2、你农月鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书

3、你农月鑫短期理财债券型证券投资基金托管协议

7.2 存储地点

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

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站，或在营业时间内在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
二〇一三年二月十一日

序号	平均剩余期限	各期资产占基金资产净值的比例 (%)	各期负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	40.48	--
2	30天（含）—60天 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	59.66	--
3	60天（含）—90天	--	--

	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
4	90天(含)~180天	--	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
5	180天(含)~397天(含)	--	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	--	--
	合计	100.14	--

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%~0.45%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0742%
报告期内偏离度的最低值	0.0013%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0103%

5.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大于8%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。

5.8 投资组合报告附注

3.5.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即以计价对象以买入或买入后的实际利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。

本基金通过每日计算基金份额净值并维持在 1.00 元。

3.5.2 本报告期末基金份额净值在剩余期限小于 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金份额净值 20% 的情况。

3.5.3 本基金本报告期末不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚的情形。

3.5.4 其他资产或资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	-
3	应收利息	313,053.73
4	应收中期款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	313,053.73

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安双月鑫短期理财财富A	华安双月鑫短期理财财富B

本报告期期初基金份额总额	856,255,504.24	247,043,971.83
本报告期基金总申购份额	17,283,161.63	—
减：本报告期基金总赎回份额	584,348,261.53	224,449,441.68
本报告期基金净申购/赎回份额	—	—
本报告期末基金份额总额	289,190,404.34	22,594,530.15

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《平安双月鑫短债定期开放债券投资基金基金合同》

2、《平安双月鑫短债定期开放债券投资基金招募说明书》

3、《平安双月鑫短债定期开放债券投资基金托管协议》

2、在销售点

基金管理人或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.huam.com.cn>。
7.3 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。

华安基金管理有限公司
二〇一三年一月二十一日