# 华安日日鑫货币市场基金

## 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**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:二〇一三年四月十九日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4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1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华安日日鑫货币 | |
| 基金主代码 | 040038 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年11月26日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 220,981,717.83份 | |
| 投资目标 | 为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。 | |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率(税后) | |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华安日日鑫货币A | 华安日日鑫货币B |
| 下属两级基金的交易代码 | 040038 | 040039 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 174,738,262.87份 | 46,243,454.96份 |

### §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

| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) | |
|---|---|---|
| | 华安日日鑫货币A | 华安日日鑫货币B |
| 1.本期已实现收益 | 2,045,450.97 | 971,598.77 |
| 2.本期利润 | 2,045,450.97 | 971,598.77 |
| 3.期末基金资产净值 | 174,738,262.87 | 46,243,454.96 |

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 华安日日鑫货币A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.9031% | 0.0055% | 0.2663% | 0.0000% | 0.6368% | 0.0055% |

2. 华安日日鑫货币B

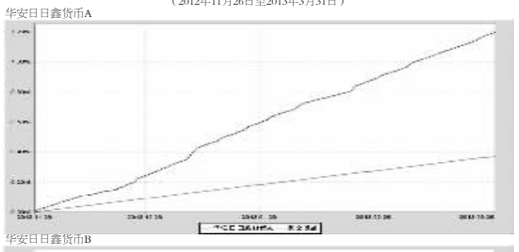
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.9629% | 0.0055% | 0.2663% | 0.0000% | 0.6966% | 0.0055% |

注:本基金收益分配按月结转份额。

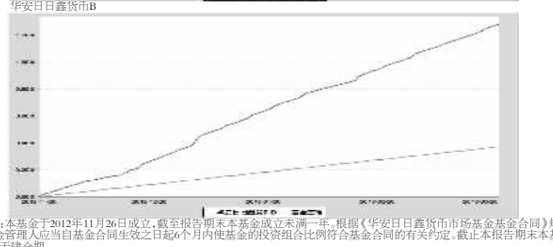
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年11月26日至2013年3月31日)

1、 华安日日鑫货币A



2、 华安日日鑫货币B



注:本基金于2012年11月26日成立,截至报告期末本基金成立未满一年。根据《华安日日鑫货币市场基金基金合同》规定,基金管理人应当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。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

### §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 | | |
| 郑可成 | 本基金的基金经理 | 2012-11-26 | - | 11年 | 硕士研究生,11年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在闽发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。<br>2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月起同时担任本基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 张晟刚 | 本基金的基金经理 | 2013-1-25 | - | 14年 | 硕士研究生,14年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任本基金及华安日日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理;2013年3月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |

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有关法律法规及《华安日日鑫货币市场基金基金合同》、《华安日日鑫货币市场基金招募说明书》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市交易的投资品种、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以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0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

在一季度,美国维持量化宽松政策,就业和房地产走出谷底,美股刷新历史新高;日本推出超级量化宽松政策,日元大幅贬值,日股强势回升;欧洲方面,继续陷入财政紧缩泥潭,结构性问题难以解决,经济低迷。整体看,国际经济温和复苏,货币环境仍极度宽松,有利于我国外需和外汇占款回升;但美元走强带来了人民币被动升值压力;石油、铜等大宗商品价格持续回落,BDI指数低位徘徊,也显示国际上对于全球增长并不乐观。

国内方面,宏观增长数据低于预期,工业品价格、发电量等指标持续回落,高端消费受到政策打压,经济增长动力弱于预期;两会前后,出台了房地产调控"国五条"、银监会理财规范性文件等,加上去年底以来多部委的一系列规范和限制地方融资平台、城投债政策,显示政府对于社会融资的规范清理力度坚决,短期内将影响社会资金供应,打压经济复苏预期,同时降低低评级信用债的资质。

1月份,央行推出了短期流动性管理工具,丰富了公开市场操作工具,同期稳定了市场对于资金利率预期。央行通过公开市场更加灵活的正逆回购,调节了市场流动性,确保了在春节前和月末的资金平稳。主要资金供给方银行的超储率较高,外汇占款流入增加,机构配置需求强烈,推动了债券市场的行情。短期融资券收益率较去年末大幅下行50-60点,货币市场平稳度过春节和季末考验,短期资金利率水平较往年同期更低,波动更为平稳,有利于机构杠杆操作。

本报告期内,日日鑫基金在确保流动性的前提下,增加了债券配置,并加大高频交易,从波段中积极赚取利差;同时,利用月末资金面紧张,增加定存了配置,锁定了较高的收益率。通过积极管理,保持了组合的较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安日日鑫短期理财债券A:

投资回报:0.9031% 比较基准:0.2663%

华安日日鑫短期理财债券B:

投资回报:0.9629% 比较基准:0.2663%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年二季度,需要关注几个变量:日元贬值是否会引发亚洲和新兴市场货币竞争性贬值,影响我国出口和热钱流入;国内二季度的经济增长,是否会比一季度有改观。一季度因为两会和政府换届,各项政府工程开工推迟,随着政府人事更迭完毕,投资力度加大,有望提升经济;在一季度经济疲弱的情况下,财政和货币政策是否会有进一步刺激措施出台;银行理财规范整顿之后,社会融资渠道能否畅通,信用债券发行量是否大幅上升。

我们认为,经济仍将受政策的支持,有望维持温和复苏态势,全年呈现V型走势。整体来看,通胀仍然不是问题。因此,对债券市场维持谨慎乐观。利率债存在短期交易性机会,信用债仍有配置价值,理财投资非标债权受限之后,会增加债券的需求。随着未来资金利率降低,将增加短期限信用品种的配置,但需警惕个别行业和企业的资质风险。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 固定收益投资 | 80,097,786.38 | 33.19 |
| | 其中:债券 | 80,097,786.38 | 33.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 30,000,165.00 | 12.43 |
| | 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 | 125,966,661.97 | 52.20 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,245,437.38 | 2.17 |
| 5 | 合计 | 241,310,050.73 | 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 | | 6.68 |
| | 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 | 19,399,850.90 | 8.78 |
| | 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

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 70 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 35 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过90天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过90天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 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 | 48.86 | 8.78 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 30.79 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 9.07 | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 9.05 | - |
| | 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) | 18.13 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 106.83 | 8.78 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,034,761.36 | 9.07 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,034,761.36 | 9.07 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,063,025.02 | 27.18 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 80,097,786.38 | 36.25 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 20,034,761.36 | 9.07 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130211 | 13国开11 | 200,000 | 20,034,761.36 | 9.07 |
| 2 | 011318002 | 13铁物资SCP002 | 200,000 | 20,021,652.18 | 9.06 |
| 3 | 071303003 | 13中信CP003 | 200,000 | 19,996,490.43 | 9.05 |
| 4 | 041360005 | 13鲁商CP001 | 100,000 | 10,044,487.80 | 4.55 |
| 5 | 041360014 | 13青国信CP001 | 100,000 | 10,000,394.61 | 4.53 |

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 | 0.0576% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0023% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0326% |

5.7 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

5.8.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。

5.8.2 本报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%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、处罚的情形。

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 | 1,129,528.72 |
| 4 | 应收申购款 | 4,115,908.66 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,245,437.38 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 华安日日鑫货币A | 华安日日鑫货币B |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 233,423,867.75 | 60,474,951.84 |
| 本报告期基金总申购份额 | 594,714,704.93 | 342,984,770.07 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 653,400,309.81 | 357,216,266.95 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 174,738,262.87 | 46,243,454.96 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安日日鑫货币市场基金基金合同》

2、《华安日日鑫货币市场基金基金招募说明书》

3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》

7.2 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。

7.3 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**
**二〇一三年四月十九日**

# 华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金

## 2013 第一季度 报告

2013年3月31日

**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:二〇一三年四月十九日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4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1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华安7日鑫短期理财债券 | |
| 基金主代码 | 040042 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年12月26日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 426,550,899.89份 | |
| 投资目标 | 在力求本金安全的基础上,追求稳健的当期收益。 | |
| 投资策略 | 本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类固定收益类金融工具的配置比例并进行积极的投资组合管理。在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,力争为投资人创造稳定的收益。 | |
| 业绩比较基准 | 人民币七天通知存款利率(税后) | |
| 风险收益特征 | 本基金为短期理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金,高于货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华安7日鑫短期理财债券A | 华安7日鑫短期理财债券B |
| 下属两级基金的交易代码 | 040042 | 040043 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 200,160,040.98份 | 226,390,858.91份 |

### §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

| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) | |
|---|---|---|
| | 华安7日鑫短期理财债券A | 华安7日鑫短期理财债券B |
| 1.本期已实现收益 | 4,468,706.67 | 2,587,648.88 |
| 2.本期利润 | 4,468,706.67 | 2,587,648.88 |
| 3.期末基金资产净值 | 200,160,040.98 | 226,390,858.91 |

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 华安7日鑫短期理财债券A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.8610% | 0.0033% | 0.2663% | 0.0000% | 0.5947% | 0.0033% |

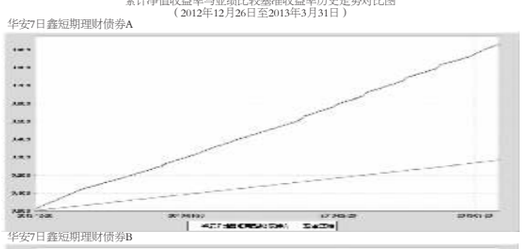
2. 华安7日鑫短期理财债券B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.9344% | 0.0033% | 0.2663% | 0.0000% | 0.6681% | 0.0033% |

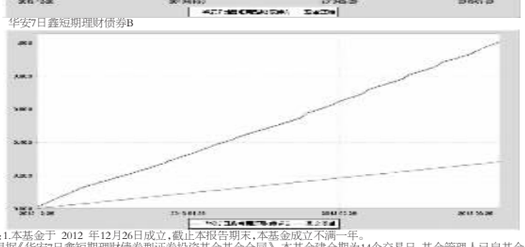
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月26日至2013年3月31日)

1、 华安7日鑫短期理财债券A



2、 华安7日鑫短期理财债券B



注:1.本基金于 2012 年12月26日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为14个交易日。基金管理人已自基金合同生效之日起14个交易日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### §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 | | |
| 黄勤 | 本基金的基金经理,固定收益部总监 | 2012-12-26 | - | 12年 | 经济学硕士,持有基金从业人员资格证书,16年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004年8月加入华安基金管理公司,曾任固定收益部债券投资经理,2007年5月起担任华安现金富利基金的基金经理,2009年4月至2012年10月担任华安强化收益债券型基金的基金经理。2011年12月起同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2012年12月起同时担任本基金的基金经理。 |
| 张晟刚 | 本基金的基金经理 | 2013-1-25 | - | 14年 | 硕士研究生,14年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任本基金及华安日日鑫货币市场基金的基金经理;2013年3月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |

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有关法律法规及《华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》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市交易的投资品种、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以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0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

一季度,全球主要经济体持续货币宽松,尤其日本以前所未有的力度加入量化宽松的行列。国内经济延续去年四季度以来的复苏态势,但企业再库存力度弱于预期,制造业投资增速下滑。通胀温和,热钱加速流入,央行货币政策转为中性。春节后了加大公开市场货币回收力度。在此背景下,债券市场走出了一波"快牛"行情,特别是短端、信用品种,收益率呈现快速下行趋势。这轮行情主要推动力是充裕的流动性和一级市场供给阶段性稀缺。年初资金面的宽松程度略超出市场预期,春节时点对流动性的冲击也明显弱于往年,只有2月末出现了一次比较明显的波动;一级市场供给稀缺,推动了一级半市场的火爆格局。信用债市场走势特征包括:信用债好于利率债;低评级债券好于高评级债券;高评级中短久期好于中长久期。同时可转债市场在股市上涨的推动下,指数自低点上涨超过10%。

华安信用增强债券基金受到成立开户的干扰,在季度初采用了大量的定期存款作为配置,错过了年初信用产品的最佳配置时机,并且出于对春节、季度末节资金面以及未来供给大幅上升的担忧,采用了较为中性的杠杆水平,并且采用了较为保守的久期配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为1.014元,本报告期份额净值增长率为 1.3%,同期业绩比较基准增长率为1.2%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年二季度,外围经济数据仍不乐观。国内宏观经济将保持"弱复苏"态势,通胀保持相对低位。影子银行的清理以及各地方"新国五条"实施细则或将影响基建和地产投资未来的增速。央行温和的正回笼规模相对市场异常宽裕的流动性仍然影响有限,市场对二季度CPI预期依然处于可以接受水平。二季度存在IPO重启预期。所以债券市场依然将发挥避风港作用。在此背景下,我们对债券市场仍然持较乐观态度,预期收益率曲线将呈现陡峭化。中短期信用品种在绝对收益方面将有较好表现,利率产品存在波段性机会。股票市场的反弹仍有持续性,行情将在不同板块和主题中出现分化。我们仍将坚持票息为主的债券配置策略,根据央行的货币政策力度及时调节杠杆和久期,关注可转债和利率产品的波段性机会。在新股IPO重启后,将会在深入个股研究的基础上,积极参与。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。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 固定收益投资 | 160,191,043.73 | 32.44 |
| | 其中:债券 | 160,191,043.73 | 32.44 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 100,000,270.00 | 20.25 |
| | 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 | 230,509,680.90 | 46.68 |
| 4 | 其他各项资产 | 3,090,046.78 | 0.63 |
| 5 | 合计 | 493,791,041.41 | 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 | | 7.03 |
| | 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 | 66,699,646.65 | 15.64 |
| | 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

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 88 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 112 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 1 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过127天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 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 | 65.76 | 15.64 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 14.07 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 7.05 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 4.70 | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 4.69 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 23.47 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 115.04 | 15.64 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,056,536.48 | 4.70 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,056,536.48 | 4.70 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 140,134,507.25 | 32.85 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 160,191,043.73 | 37.55 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 20,056,536.48 | 4.70 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 100236 | 10国开36 | 200,000 | 20,056,536.48 | 4.70 |
| 2 | 041354015 | 13粤电航运CP001 | 200,000 | 20,030,333.16 | 4.70 |
| 3 | 011351001 | 13中船SCP001 | 200,000 | 20,023,087.47 | 4.69 |
| 4 | 011218005 | 12铁物资SCP005 | 200,000 | 20,021,286.21 | 4.69 |
| 5 | 041352001 | 13南方水泥CP001 | 100,000 | 10,052,662.24 | 2.36 |
| 6 | 041358019 | 13北方水泥CP001 | 100,000 | 10,014,501.77 | 2.35 |
| 7 | 041351010 | 13华电股CP001 | 100,000 | 10,000,805.58 | 2.34 |
| 8 | 041361012 | 13中电投CP001 | 100,000 | 10,000,805.58 | 2.34 |
| 9 |