华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安双月鑫短期理财债券
基金主代码	040033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月14日
报告期末基金份额总额	154,057,681.70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	本基金采用“组作期滚动”的方式运作,在运作期内,本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下,采用持有到期策略构建投资组合,基本保持大类品种配置的比例恒定。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金,属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金。
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

下属两级基金的基金简称	华安双月鑫短期理财债券A	华安双月鑫短期理财债券B
下属两级基金的交易代码	040033	040034
报告期末下属两级基金的份额总额	144,054,081.7份	10,003,600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7月1日-2013年9月30日)	
	华安双月鑫短期理财债券A	华安双月鑫短期理财债券B
1.本期已实现收益	2,174,853.90	188,937.67
2.本期利润	2,174,853.90	188,937.67
3.期末基金资产净值	144,054,081.70	10,003,600.00

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,由于短期理财债券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. 华安双月鑫短期理财债券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	1.8343%	0.0058%	-	-	-	-

2. 华安双月鑫短期理财债券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	1.8951%	0.0058%	-	-	-	-

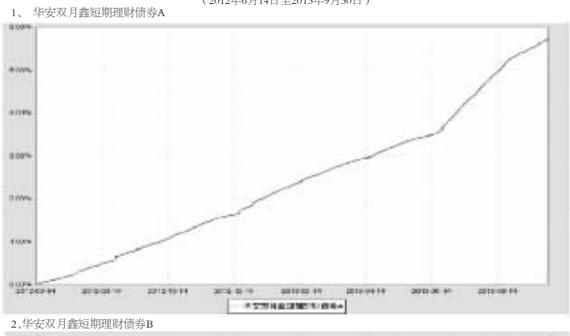
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金

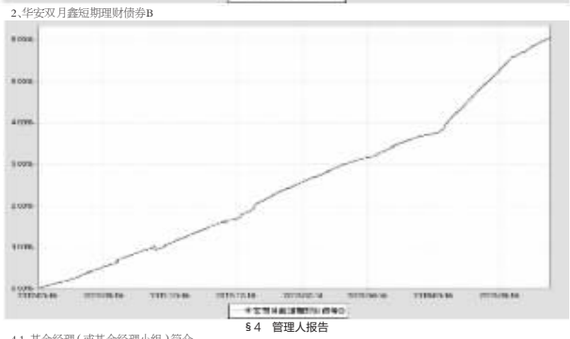
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月14日至2013年9月30日)

1、华安双月鑫短期理财债券A



2、华安双月鑫短期理财债券B



§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		
杨柳	本基金的基金经理	2012-6-14	-	11年	金融学硕士,11年保险、基金从业经历。曾先后在平安保险资产营运中心、太平人寿投资部从事流动性管理及债券交易工作。2005年8月加入华安基金管理有限公司,任集中交易部高级交易员。2009年12月至2012年11月担任华安现金富利投资基金的基金经理助理。2012年5月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金及华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2012年6月起同时担任本基金的基金经理。2012月11月起同时担任华安现金富利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《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,投资组合经理被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.wind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

美联储9月18日宣布维持现行的货币宽松政策不变,QE暂缓退出缓解了国际流动性紧张的预期,提高了市场的风险偏好,有利于新兴市场资金流入。三季度美国经济复苏力度不达预期,美国房地产市场回暖步伐放缓,就业数据低于预期,个人收入增长疲弱;欧洲区部分经济景气指标如PMI有所回升;日本继续量化宽松;新兴市场暂摆脱汇率贬值和股市下跌,但结构性调整可能延续较长时间。

国内方面,三季度宏观经济一扫低迷,企稳回升态势明显。在国内外需求扩张、基建投资加速、企业补库存等因素支撑下,各项经济指标反弹。PMI指数大幅回升,预示未来企业投资加速。房地产和基建投资仍然保持高位运行。消费和外需均有起色。在目前就业充分和通胀压力的形势下,政策淡化托底,基调由保增长转向调结构和促改革,对经济的下滑容忍度提高之后,出台宽松政策的预期减弱。

三季度国内流动性状况总体好转,8月份社会融资增速反弹,外汇占款流出趋势扭转。央行保持“中性偏紧”基调,公开市场操作“放短锁长”,续发了3年央票4000亿元,与6月份SLF量相当,维持了短期资金面稳定的同时锁定中长期流动性,防止经济和通胀失控。在央行政策安态和6月“钱荒”余悸的影响下,金融机构主动调整资产负债结构,压缩同业业务,进行债券去杠杆行为,提高了超储备付,月末和季末的流动性较为平稳。

三季度债券市场经历了较大幅度的调整。因货币市场利率居高不下,利率市场化下成本抬升,银行和保险等配置机构减缓了国债和金融债的配置节奏,一级市场带动二级收益率大幅上升,收益率曲线大幅平坦化上移。标杆10年国债收益率在9月13日上升到4.14%,触及两年来的顶峰。信用产品方面,成交量依然低迷,发行量急剧缩水。短融收益率走高,达到历史3/4高位,高评级表现优于中低评级。中票和企业债收益率跟随利率债上升,但信用利差维持在低位。

本报告期内,双月鑫利用月末资金市场利率较高的机会,进行了回购和定存的交易,积极赚取高收益。通过审慎和积极的管理,回避了金融市场的风险,保持了组合的较高收益和良好的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安双月鑫短期理财债券A:

投资回报:1.8343%

华安双月鑫短期理财债券B:

投资回报:1.8951%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际方面,美国因债务上限问题将延迟QE退出时间窗口。欧美温和复苏,有利于中国四季度出口趋势向好。我国领导人对于增长和债务问题有信心的表态,缓解了外界担忧,国内经济表现稳健,人民币NDF市场保持强势,外汇占款增长继续恢复,缓解了外部流动性压力。

国内方面,经济反弹动力不强,通胀压力上升,但预计不会出现意外的表现。经济面的稳定使得焦点让位于政策面,关注18届三中全会指引未来改革方向。四季度货币政策基调保持中性偏紧。预计通胀压力增加、房产市场较热、社融再次反弹,政策面难以出现放松;金融市场处于利率市场化的大背景下,上海自贸区的获批又将金融改革进程推进了一大步,资金成本还将确定性上升,推动银行、保险者配置主力追求更高收益。因此,四季度利率债券市场没有系统性机会,收益率中枢可能继续抬高。对流动性需要谨慎把握,做好风险防范。

操作方面,四季度我们将继续关注基金的流动性,捕捉月末时点资金利率高的机会,续做回购和定存;争取在控制风险的基础上,获得较好收益。

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	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	45,000,387.50	29.03
	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	109,226,830.01	70.46
4	其他各项资产	788,225.22	0.51
5	合计	155,015,442.73	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	-
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	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	28
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
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60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60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	100.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	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	100.11	-

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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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	788,225.22
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	788,225.22

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安双月鑫短期理财债券A	华安双月鑫短期理财债券B
本报告期期初基金份额总额	111,397,603.29	10,003,600.00
本报告期基金总申购份额	99,062,578.83	-
减:本报告期基金总赎回份额	66,406,100.42	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	144,054,081.70	10,003,600.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安双月鑫短期理财债券型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
二〇一三年十月二十四日

华安安心收益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安心收益债券
基金主代码	040036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月7日
报告期末基金份额总额	333,566,711.74份
投资目标	在有效控制流动性和风险的前提下,力争持续稳定地实现超越比较基准的当期收益。
投资策略	本基金以“组作期滚动”的方式投资运作。在每个运作期内采用“华安避险增值机制”,动态调整基础资产和风险资产的配置比例,定期锁定投资收益,控制基金资产净值的波动幅度,实现基金资产的长期稳定增值。同时,本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会,以确定风险资产在非信用类固定收益品种(国债、央行票据等)、信用类固定收益品种和权益类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的品种,其预期的风险和预期收益水平低于股票基金和混合基金,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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	华安安心收益债券A类	华安安心收益债券B类
下属两级基金的交易代码	040036	040037
报告期末下属两级基金的份额总额	176,834,199.32份	156,732,512.42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7月1日-2013年9月30日)	
	华安安心收益债券A类	华安安心收益债券B类
1.本期已实现收益	4,855,263.11	4,482,901.14
2.本期利润	13,388,661.63	12,365,935.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0639	0.0623
4.期末基金资产净值	196,279,994.77	174,196,108.93
5.期末基金份额净值	1.110	1.111

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1.华安安心收益债券A类:

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
过去三个月	6.53%	0.42%	1.07%	0.00%	5.46%	0.42%

2.华安安心收益债券B类:

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
过去三个月	6.52%	0.41%	1.07%	0.00%	5.45%	0.41%

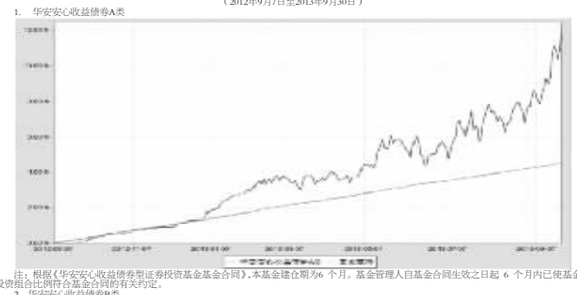
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安心收益债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

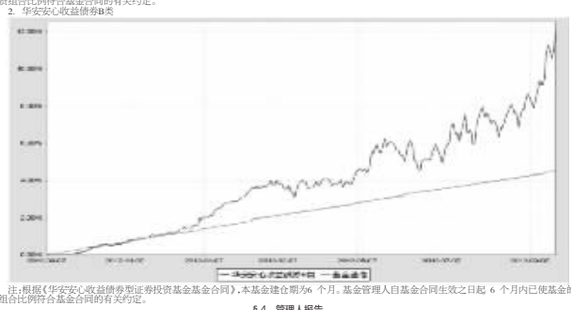
(2012年9月7日至2013年9月30日)

1. 华安安心收益债券A类



注:根据《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》,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个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2. 华安安心收益债券B类



注:根据《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》,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个月内已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		
郑可成	本基金的基金经理	2012-9-7	-	12年	硕士研究生,12年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在国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。 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月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2012年11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。2013年5月起同时担任华安保本混合型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 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,投资组合经理被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.wind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

基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年四季度,美国QE退出延后,对全球资本市场形成一定支撑。国内宏观经济将保持“弱复苏”态势,通胀有所上行。十八届三中全会的召开,将在制度层面释放红利,引导市场正面预期。债券市场在深度调整后,信用产品静态收益已经具备一定的吸引力,预期市场收益率将在高位徘徊。在此背景下,我们将债券市场仍然持谨慎乐观态度,四季度将会是布局固定收益市场的较好时期。可转债市场仍存在波段性机会。权益类市场方面经济转型仍然是主线,代表新兴产业方向的的行业仍然是资金追逐的方向。在固定收益方面我们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,规避久期风险,关注利率产品的波段性机会。对可转债本基金将仍然采用他对收益的思路,目下而上的参与投资。在股票方面,本基金将继续在公司投研成果的基础上,结合债券基金的特点,自下而上进行绝对收益投资。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	权益投资	71,027,309.18	11.81
	其中:股票	71,027,309.18	11.81
2	固定收益投资	495,596,628.20	82.39
	其中:债券	485,596,628.20	80.73
	资产支持证券	10,000,000.00	1.66
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	9,814,078.88	1.63
6	其他各项资产	25,069,155.32	4.17
7	合计	601,507,171.58	100.00

5.2 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	20,306,420.28	5.48
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	24,346,888.90	6.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	21,701,200.00	5.86
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	4,672,800.00	1.26
S	综合	-	-
	合计	71,027,309.18	19.17

5.3 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	300071	华谊嘉信	340,000	13,661,200.00	3.69
2	002148	北纬通信	130,000	8,710,000.00	2.35
3	300058	蓝色光标	120,000	8,040,000.00	2.17
4	300104	乐视网	200,000	6,368,000.00	1.72
5	002064	华峰氨纶	608,100	6,245,187.00	1.69
6	300027	华谊兄弟	60,000	4,672,800.00	1.26
7	600637	百视通	82,974	4,343,688.90	1.17
8	300032	金龙机电	240,000	4,111,200.00	1.11
9	002292	奥飞动漫	140,058	3,944,033.28	1.06
10	300253	卫宁软件	60,000	3,514,200.00	0.95

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	公允价值(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	19,838,000.00	5.35
	其中:政策性金融债	19,838,000.00	5.35
4	企业债券	265,958,628.20	71.79
5	企业短期融资券	100,654,000.00	27.17
6	中期票据	99,146,000.00	26.76
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	485,596,628.20	131.07

5.5 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	1282298	12忠旺MTN2	400,000	39,516,000.00	10.67
2	122538	12裕城乡	300,000	30,306,000.00	8.18
3	1282429	12广汇MTN2	300,000	29,955,000.00	8.09
4	122944	09和城投	240,000	24,782,400.00	6.69
5	122672	12西城投	200,000	21,300,000.00	5.75

5.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119025	侨城03	100,000	10,000,000.00	2.70

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	264,741.02
2	应收证券清算款	10,193,599.45
3	应收股利	-
4	应收利息	13,934,418.70
5	应收申购款	676,396.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,069,155.32

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
1	300104	乐视网	6,368,000.00	1.72	重大事项停牌
2	002292	奥飞动漫	3,944,033.28	1.06	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安安心收益债券A类	华安安心收益债券B类
本报告期期初基金份额总额	229,474,617.48	228,381,840.44
本报告期基金总申购份额	8,395,708.90	11,218,479.69
减:本报告期基金总赎回份额	61,036,127.06	82,867,807.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	176,834,199.32	156,732,512.42

§7 基金管理人运