华安媒体互联网混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

§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2016年4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安媒体互联网混合
基金主代码	001071
交易代码	001071
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月15日
报告期末基金份额总额	1,953,503,166.50份
投资目标	本基金重点投资于与媒体与互联网相关的子行业或企业,在严格控制风险的前提下,力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金为主题投资型混合基金,将主要运用战略资产配置的方法来确定投资组合中的资产类别和权重,辅以战术资产配置来动态优化投资组合中各类资产的配置比例。在具体投资品种选择方面,本基金将综合运用定量分析和定性分析手段,精选出具有内在价值和成长潜力的媒体互联网类股票来构建权益类投资组合。在研究分析宏观经济和利率趋势等因素的基础上,选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率+50%×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

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	23,855,586.54
2.本期利润	-123,126,723.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0699
4.期末基金资产净值	2,067,633,043.11
5.期末基金份额净值	1.058

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

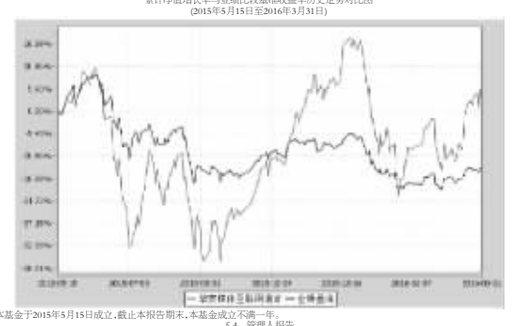
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.32%	3.39%	-7.42%	1.32%	-0.90%	2.07%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华安媒体互联网混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年5月15日至2016年3月31日)



注:本基金于2015年5月15日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

§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		
胡宜斌	本基金的基金经理	2015-11-26	-	4	硕士研究生,4年证券、基金行业从业经验。曾任杭州核新同花顺股份有限公司产品经理、长江证券股份有限公司研究员、上投摩根基金管理有限公司研究员,2015年5月加入华安基金,担任基金投资部基金经理助理。2015年11月起担任本基金的基金经理。2016年1月起担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。
崔	本基金的基金经理	2015-06-18	-	7	硕士,7年从业经历。曾任齐鲁证券有限责任公司项目经理、太平洋保险集团总部资产负债匹配专员、中国中投证券行业分析师。2014年3月加入华安基金管理有限公司,担任投资研究部行业分析师,基金经理助理。2015年6月起同时担任本基金、华安逆向策略混合型证券投资基金、华安智能装备主题股票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,则以公告日为准。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swind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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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、不同投资组合间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1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报告期内基金的业绩表现

截止2016年3月31日,本基金份额净值为1.058元,本报告期份额净值增长率为-8.32%,同期业绩比较基准增长率为-7.42%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	1,757,062,408.22	83.88
	其中:股票	1,757,062,408.22	83.88
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	315,964,302.83	15.08
7	其他各项资产	21,702,534.64	1.04
8	合计	2,094,729,245.69	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	114,020.85	0.01
C	制造业	936,222,781.57	45.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
F	批发和零售业	132,143,988.48	6.39
G	交通运输、仓储和邮政业	80,292,743.74	3.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,875,313.90	8.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	174,074,233.08	8.42
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	133,210,958.66	6.44
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	11,800,236.84	0.57
S	综合	118,291,896.62	5.72
	合计	1,757,062,408.22	84.98

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	002329	皇氏集团	8,354,564	139,771,855.72	6.76
2	600603	*ST兴业	9,531,982	118,291,896.62	5.72
3	300365	恒华科技	3,343,606	117,694,931.20	5.69
4	600158	中体产业	4,969,663	101,679,304.98	4.92
5	002072	凯瑞德	3,934,844	93,334,499.68	4.51
6	600136	道博股份	1,545,643	93,295,011.48	4.51
7	002587	奥拓电子	5,575,770	89,156,562.30	4.31
8	603869	北部湾旅	2,690,902	84,817,231.04	4.10
9	300306	远方光电	4,018,922	82,789,793.20	4.00
10	002245	澳洋顺昌	9,581,473	80,292,743.74	3.88

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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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股票投资明细

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型(多头套期保值或空头套期保值),并根据风险资产投资(或短投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例;其次,本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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的,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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,210,098.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,488.26
5	应收申购款	19,416,948.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,702,534.64

5.11.4报告期未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。

5.11.5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	002072	凯瑞德	93,334,499.68	4.51	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,643,604,389.71
报告期基金总申购份额	766,993,796.30
减:报告期基金总赎回份额	457,095,019.51
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,953,503,166.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	17,705,862.83
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	17,705,862.83
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.91

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1、《华安媒体互联网混合型证券投资基金基金合同》

2、《华安媒体互联网混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华安媒体互联网混合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
二〇一六年四月二十日

华安纳斯达克100指数证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:二〇一六年四月二十日

§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2016年4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安纳斯达克100指数
基金主代码	040046
交易代码	040046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月2日
报告期末基金份额总额	20,865,378.82份
投资目标	本基金为股票指数基金,通过严格的指数化投资策略与风险控制,紧密跟踪标的指数,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,跟踪标的指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。 本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过4%(以美元计价计算)。
业绩比较基准	纳斯达克100价格指数 Nasdaq 100 Price Index)收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-43,140.39
2.本期利润	-399,359.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0222
4.期末基金资产净值	28,586,828.48
5.期末基金份额净值	1.370

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

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	-3.25%	1.24%	-2.87%	1.43%	-0.38%	-0.19%

3.2.2 自基金合同生效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

华安纳斯达克100指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年8月2日至2016年3月31日)

注:根据《华安纳斯达克100 指数证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期不超过6个月。基金管理人在基金合同生效后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		
徐宜宜	本基金的基金经理	2013-08-02	-	9	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),9年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格,曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及本基金的基金经理。2013年12月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年7月起同时担任华安沪深300指数证券投资基金的基金经理。2015年2月起担任华安新丰混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年9月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月起,同时担任华安证券保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安安华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,则以公告日为准。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swind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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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、不同投资组合间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1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报告期内基金的业绩表现

纳斯达克指数1季度表现平稳,以美元计价单季度下跌2.06%。值得注意的是该指数单季度振幅高达12%,最低跌至3819点,最终收在了4483.66点。我们认为纳斯达克100指数的巨幅波动源于多个因素。首先是对美国货币政策的担忧到缓解,其次是对新兴市场经济的担忧到缓解。美元指数由强转弱也对以出口为主力的科技股的走势产生了积极的影响。即便如此,纳斯达克100指数在全球范围内仍然是强光的投资标的。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.370元,本报告期份额净值增长率为-3.25%,同期业绩比较基准增长率为-2.87%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计以成长股和高市盈率为代表的纳斯达克100指数经过一季度的调整,未来走势会比较稳健向上。全球仍然处在新一轮科技创新的浪潮,科技股轻资产、现金流充裕,相信在短暂回调之后,领跑市场的长期趋势没有改变。而纳斯达克100指数的成分股是科技股中的翘楚,估值并不存在显著泡沫,未来表现依然值得期待。

作为纳斯达克100指数基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内基金持有人数不低于200人;基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	26,660,596.69	88.32
	其中:普通股	26,660,596.69	88.32
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,115,886.78	10.32
8	其他各项资产	410,929.31	1.36
9	合计	30,187,412.78	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	26,660,596.69	93.26
合计	26,660,596.69	93.26

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
工业	615,435.76	2.15
电信服务	153,145.62	0.54
信息技术	15,636,620.88	54.70
非必需消费品	5,355,116.98	18.73
能源	-	-
保健	3,117,567.76	10.91
公用事业	-	-
必需消费品	1,782,709.69	6.24
材料	-	-
合计	26,660,596.69	93.26

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克市场	美国	5,100.00	3,591,451.56	12.56
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克市场	美国	7,400.00	2,640,705.36	9.24
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克市场	美国	400.00	1,534,250.71	5.37
4	FACEBOOK INC	Facebook公司	FB US	纳斯达克市场	美国	1,900.00	1,400,723.55	4.9
5	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克市场	美国	200.00	985,849.90	3.45
6	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克市场	美国	200.00	962,654.19	3.37
7	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克市场	美国	4,800.00	882,961.75	3.09
8	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克市场	美国	4,200.00	877,883.24	3.07
9	GILEAD SCIENCES INC	Gilead 科学	GILD US	纳斯达克市场	美国	1,400.00	830,936.16	2.91
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克市场	美国	1,700.00	670,905.16	2.35

5.4.2 积极投资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益投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	192,397.35
3	应收股利	10,510.76
4	应收利息	491.69
5	应收申购款	207,529.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	410,929.31

5.10.4报告期未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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	15,101,920.70
报告期基金总申购份额	8,149,327.10
减:报告期基金总赎回份额	2,385,868.98
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	20,865,378.82

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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、《华安纳斯达克100 指数证券投资基金基金合同》

2、《华安纳斯达克100 指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安纳斯达克100 指数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
二〇一六年四月二十日

华安可转换债券债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安可转换债券	
基金主代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
报告期末基金份额总额	291,231,808.82份	
投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种,在控制风险和保持流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。	
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	106,852,045.16份	184,379,763.66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(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
1.本期已实现收益	-12,253,724.10	-18,980,899.79
2.本期利润	-34,381,783.17	-59,711,800.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3159	-0.3431
4.期末基金资产净值	134,746,086.74	228,044,955.34
5.期末基金份额净值	1.261	1.237

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