华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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：二〇一三年一月二十一日

§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1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安季季鑫短期理财债券	
基金主代码	040030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月23日	
报告期末基金份额总额	278,699,567.32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“运作期滚动”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。集中申购期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。	
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	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
下属两级基金的交易代码	040030	040031
报告期末下属两级基金的份额总额	273,699,567.32份	5,000,000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

基金简称	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
1.本期已实现收益	4,795,298.98	51,105.50
2.本期利润	4,795,298.98	51,105.50
3.期末基金资产净值	273,699,567.32	5,000,000.00

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.华安季季鑫短期理财债券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	0.9541%	0.0163%	-	-	-	-

2.华安季季鑫短期理财债券B

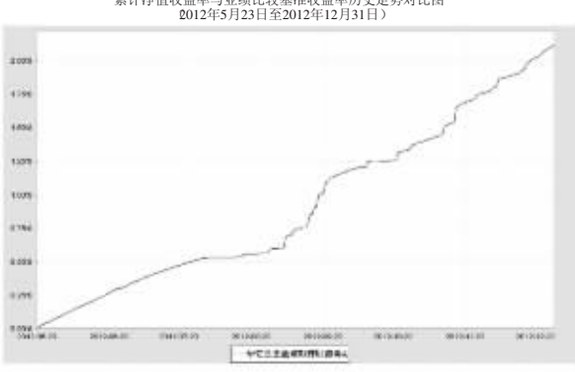
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0227%	0.0163%	-	-	-	-

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

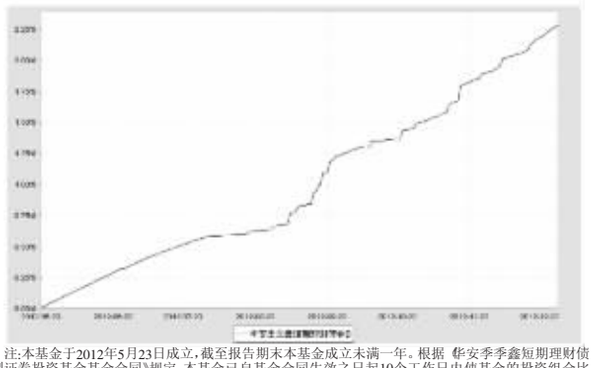
华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

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5月23日至2012年12月31日）



华安季季鑫短期理财债券



注：本基金于2012年5月23日成立，截至报告期末本基金成立未满一年。根据《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金已自基金合同生效之日起10个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

§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		
杨柳	本基金的基金经理	2012-5-23	-	10年	金融学硕士，10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本基金的基金经理，2012年6月起同时担任华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。

注：1.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。

2.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《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《华安季季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

美国经济持续缓慢增长，两党达成的财政悬崖协议延迟了困境到来的时间，但并未根本解决；欧元区方面，问题国家的资本外流已经放缓，但经济尚未走出衰退。中国经济方面，出口反弹和实际消费支出的强劲增长带动GDP强劲反弹，通胀温和回升，外汇占款大幅下滑，广义货币增长显著走弱。央行继续通过公开市场操作向市场注入流动性。本季度期内资金面整体较为宽松，货币市场利率稳中有降。年末货币市场利率出现季节性波动，但是由于央行持续的逆回购投放、商业银行提前筹备跨节资金以及银行理财规模增速放缓等原因，利率波动幅度弱于往年。

在上述环境下，本基金抓住有利时机，积极操作，在月末货币市场利率脉冲走高时开展定存业务，提高组合的收益性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安季季鑫短期理财债券A：

投资回报：0.9541%

华安季季鑫短期理财债券B：

投资回报：1.0227%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济方面，经济复苏仍将是缓慢而疲弱的，预期美国在采取新的财政紧缩的同时，将可能实施大幅宽松的货币政策。欧元区信贷持续低迷，经济增长难见好转，欧元区债务危机依然可能再次出现。中国经济方面，预期宏观经济增速略有回升，通胀水平维持低位。央行将继续保持稳健的货币政策，资金面稳中略松，整体流动性将有所改善，但是春节前货币市场仍会出现季节性的利率波动。

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、有竞争力的理财品种。

§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	-	-
	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	276,089,065.29	98.61
4	其他各项资产	3,885,383.05	1.39
5	合计	279,974,448.34	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		7.58
	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

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	0.1856%
报告期内偏离度的最低值	0.0183%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0836%

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	138,392.87
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	203,313.54
4	应收申购款	3,543,676.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,885,383.05

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
本报告期期初基金份额总额	490,973,442.60	5,000,000.00
本报告期基金总申购份额	35,269,441.30	-
减：本报告期基金总赎回份额	252,543,316.58	-
本报告期期末基金份额总额	273,699,567.32	5,000,000.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安季季鑫短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。

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
二〇一三年一月二十一日

华安科技动力股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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：二〇一三年一月二十一日

§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1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安科技动力股票
基金主代码	040025
交易代码	040025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	58,050,276.07份
投资目标	本基金重点投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，关注其科技创新或技术突破后产生的增长动能，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择中以产业链价值结构为主要判别基准，选取以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，同时从市场广度、技术深度、产业宽度和政策强度等方面寻找选取财务状况良好、盈利能力较强且资产质量较好的公司并作为重点投资对象。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
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	中国建设银行股份有限公司

§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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,832,139.97
2.本期利润	1,045,713.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0176
4.期末基金资产净值	57,503,860.13
5.期末基金份额净值	0.991

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

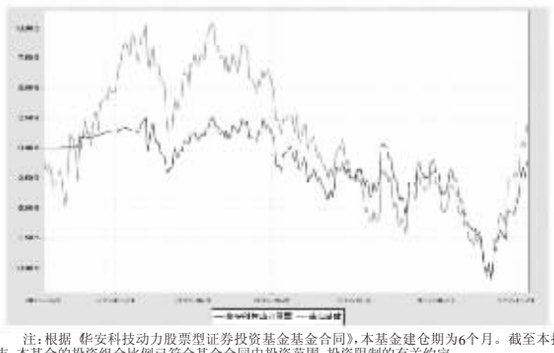
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	0.83%	6.49%	1.04%	-4.43%	-0.21%

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

华安科技动力股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年12月20日至2012年12月31日）



注：根据《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为6个月。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

§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		
汪光成	本基金的基金经理	2011-12-20	-	10年	管理学博士，持有基金从业资格证书，10年证券、基金行业从业经历，2002年1月加入华安基金管理有限公司后，曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月至2009年3月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，2009年3月起担任华安创新证券投资基金的基金经理。2011年12月起担任本基金的基金经理。2012年6月起担任基金投资部副总监。

注：1.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。

2.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有关法律法规及《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》、《华安科技动力股票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

第四季度，规模以上工业企业的单月利润连续3个月实现同比增长，经济增速放缓的趋势出现一定反转。此外，随着十八大的顺利召开，前期对政策预期的不确定性也得到较大缓解，市场整体需求回暖。12月份，市场在强周期权重板块的带动下取得了较大幅度的快速上涨。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.049元，本报告期内，华安沪深300指数分级份额净值增长率为8.59%，同期业绩比较基准增长率为9.53%，基金净值表现落后比较基准0.94%，主要原因是报告期间基金出现较大申购赎回。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，国内经济继续维持稳步复苏的态势，上市企业利润也保持了持续反弹。政策层面，一方面严格控制地方财政金融风险，一方面继续推进金融改革开放。尽管大盘蓝筹股在2012年年底出现了较快上涨，对前期的持续下跌做出了一定的修复，但目前的估值水平仍然处于历史低位。2013年，随着国内国外经济形势的进一步好转，以及政策方向的进一步确定，我们对市场看法相对积极。

本基金在操作上仍将坚持被动投资的原则，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。

§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	39,012,212.11	64.81
	其中：股票	39,012,212.11	64.81
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	20,600,291.19	34.22
6	其他各项资产	581,979.65	0.97
7	合计	60,194,482.95	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	采掘业	2,364,600.00	4.11
C	制造业	24,105,740.11	41.92
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,708,490.72	6.45
C5	电子	4,842,794.56	8.42
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	13,309,654.83	23.15
C8	医药、生物制品	2,244,800.00	3.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,098,000.00	1.91
F	交通运输、仓储业	1,014,000.00	1.76
G	信息技术业	6,313,072.00	10.98
H	批发和零售贸易	2,484,800.00	4.32
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,632,000.00	2.84
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	39,012,212.11	67.84

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	000651	格力电器	134,888	3,439,644.00	5.98
2	600050	中国联通	700,000	2,450,000.00	4.26
3	601231	环旭电子	201,959	2,391,194.56	4.16
4	600309	烟台万华	150,000	2,341,500.00	4.07
5	002649	博彦科技	124,800	1,983,072.00	3.45
6	300083	劲胜股份	150,000	1,812,000.00	3.15
7	002658	雪迪龙	74,800	1,709,180.00	2.97
8	300332	天壕节能	170,000	1,632,000.00	2.84
9	002013	中航精机	140,917	1,602,226.29	2.79
10	600741	华域汽车	140,000	1,565,200.00	2.72

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。

5.6 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。

5.7 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 投资组合报告附注

5.8.1 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。

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

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,762.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,028.93
5	应收申购款	523,188.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	581,979.65

5.8.4 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可转换债券。

5.8.5 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在流通受限的情况。

§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	58,806,604.91
本报告期基金总申购份额	16,949,042.35
减：本报告期基金总赎回份额	17,705,371.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,050,276.07

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安科技动力股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安科技动力股票型证券投资基金托管协议》

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
二〇一三年一月二十一日

华安沪深300指数分级证券投资基金

【2012】第四季度报告

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：二〇一三年一月二十一日

§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1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安沪深300指数分级
基金主代码	160417
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
报告期末基金份额总额	124,614,553.20份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)
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。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。
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
下属三级基金的基金简称	华安沪深300指数分级A / 华安沪深300指数分级B / 华安沪深300指数分级
下属三级基金的交易代码	150104 / 150105 / 160417
报告期末下属三级基金的份额总额	36,955,620份 / 36,955,620份 / 50,703,313.20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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-8,809,865.48
2.本期利润	7,007,495.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0380
4.期末基金资产净值	130,702,914.70
5.期末基金份额净值	1.049

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

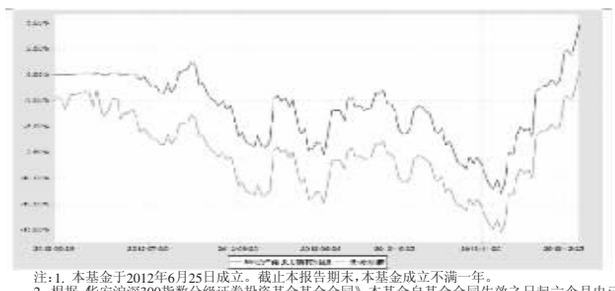
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.59%	1.22%	9.53%	1.22%	-0.94%	0.00%

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

华安沪深300指数分级证券投资基金

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

（2012年6月25日至2012年12月31日）



注：1. 本基金于2012年6月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2. 根据《华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同》，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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		
牛勇	本基金的基金经理	2012-6-25	-	8年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），8年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009年7月至2010年8月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理助理，2010年6月至2012年12月担任上证180交易型开放式指数证