华安纳斯达克100指数证券投资基金

2014 年度报告摘要

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:二〇一五年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	28,489,839.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		02111

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	8,115,805.39	7,025,959.65
本期利润	8,118,126.59	12,611,861.80
加权平均基金份额本期利润	0.1709	0.0710
本期基金份额净值增长率	16.70%	7.80%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2582	0.0671
期末基金资产净值	35,845,964.59	59,150,107.20
期末基金份额净值	1.258	1.078

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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3个月	3.28%	0.87%	4.04%	0.97%	-0.76%	-0.10%
过去6个月	7.43%	0.76%	9.44%	0.85%	-2.01%	-0.09%
过去1年	16.70%	0.73%	18.36%	0.85%	-1.66%	-0.12%
成立起至今	25.80%	0.67%	34.21%	0.81%	-8.41%	-0.14%

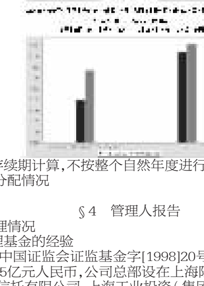
注:本基金业绩比较基准:纳斯达克100价格指数(Nasdaq 100 Price Index)收益率。

根据本基金合同的有关规定:本基金主要投资于纳斯达克100 指数成份股、备选成份股,与纳斯达克100 指数相关的公募基金、上市交易型基金等,固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金的投资比例限制:为投资于纳斯达克100 指数成份股、备选成份股以及与纳斯达克100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不低于基金资产的85%,其中投资于与纳斯达克100 指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的10%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

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

华安纳斯达克100指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年8月2日至2014年12月31日)



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至2014年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金(LOF)、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克100指数、华安黄金易(ETF)、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头(DAX)ETF、华安国际龙头(DAX)ETF联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药ETF联接等54只开放式基金。管理资产规模达到885亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	-	8年	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),8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8月起同时担任华安国际龙头(DAX)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。

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《华安纳斯达克100 指数证券投资基金基金合同》、《华安纳斯达克100 指数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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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、邮件发送、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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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,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%的情况共出现了3次。原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量极少,但由于个股流动性较差,交易量稀少,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2014年全年美国纳斯达克指数继续领先标普500,道琼斯30等指数,集中反映了科技股的强劲走势。第一季度受到阿根廷债务评级下降等因素,纳斯达克指数出现短期调整后,随着业绩披露后的强劲表现,纳斯达克指数在余下的三个季度均持续向上飙升。成份股中,苹果,微软等对纳斯达克100指数的表现贡献最大。而众多大型IPO的成功上市也极大地提振了投资者对成长股科技股的信心。 纳斯达克指数中,表现最好的仍然是生物医药和TMT子行业。

就美国经济而言,美国11月失业率已经降至5.8%,为近五年内的新低,制造业和服务业已经连续三年扩张,而美国新屋销售也大幅回暖。总体看,美国经济已经走出多年低速增长,有望继续引领全球经济的恢复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.258元,本报告期份额净值增长率为16.70%,同期业绩比较基准增长率为18.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2015年美国经济会加速恢复和增长的过程。首先失业率的改善和工资水平的上涨有利于消费的恢复,而低迷的油价对消费者来说也是有利的支持。其次,苹果可穿戴,特斯拉电动车,谷歌无人驾驶技术等新技术仍然层出不穷,技术发展的后动仍然充沛,因此科技股的投资仍然是主线。最后,美元的强劲走势将吸引更多的国际资金追捧美国资产,特别是美国称冠全球的科技类资产。值得密切关注美联储加息的时点,我们认为在市场充分消化的基础上,美联储加息的到来会被解读为美国经济的正常化,因此对美国股市的反应可能相对正面。

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。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1)公司方面

公司建立基金估值委员会,组成人员包括:首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

尚志民,首席投资官,工商管理硕士,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员,华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理,现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理,华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森,基金投资部兼全球投资部总监,工业工程学硕士。曾在台湾JP证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理,台湾中信证券投资总监助理,台湾保德信投信任基金经理。2008年4月加入华安基金管理有限公司,现华安香港精选、华安大中华升级基金的基金经理,基金投资部兼全球投资部总监。

杨明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺涛,金融学硕士,固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理,固定收益部副总监。

许之彦,指数投资部总监,理学博士,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,现任华安中国A股增强指数、华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安上证龙头ETF和华安上证龙头ETF联接、华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理,指数投资部总监。

陈林,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 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

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

2、本基金自2014年11月10日至2014年12月31日基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师边卓群、濮晓达签字出具了安永华明(2015)审字第60971571_B11号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安纳斯达克100指数证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:	-	-
银行存款	4,495,546.43	5,250,938.80
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	31,783,596.81	54,964,905.77
其中:股票投资	31,783,596.81	54,964,905.77
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,957,099.48
应收利息	272.44	444.77
应收股利	12,185.99	40,932.76
应收申购款	358,719.13	100,196.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	36,650,320.80	63,314,517.79
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	481,189.35	3,840,376.87
应付管理人报酬	24,001.43	48,573.73
应付托管费	7,500.45	15,179.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	291,664.98	260,280.71
负债合计	804,356.21	4,164,410.59
所有者权益:	-	-
实收基金	28,489,839.28	54,845,388.57
未分配利润	7,356,125.31	4,304,718.63
所有者权益合计	35,845,964.59	59,150,107.20
负债和所有者权益总计	36,650,320.80	63,314,517.79

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.258元,基金份额总额28,489,839.28份。

7.2 利润表

会计主体:华安纳斯达克100指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	9,149,381.85	13,744,282.94
1.利息收入	43,791.28	229,034.18
其中:存款利息收入	43,791.28	229,034.18
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	8,601,420.51	7,660,629.73
其中:股票投资收益	7,877,640.26	5,018,173.48
基金投资收益	24,657.54	2,075,183.23
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益		
衍生工具收益	-	-
股利收益	699,122.71	567,273.02
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,321.20	5,585,902.15
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	331,505.41	-25,882.64
5.其他收入(损失以"-"号填列)	170,343.45	294,599.52
减:二、费用	1,031,255.26	1,132,421.14
1.管理人报酬	436,477.24	610,757.96
2.托管费	136,399.09	190,861.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	16,783.54	84,592.51
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	441,595.39	246,208.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	8,118,126.59	12,611,861.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	8,118,126.59	12,611,861.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安纳斯达克100指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	54,845,388.57	4,304,718.63	59,150,107.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,118,126.59	8,118,126.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-26,355,549.29	-5,066,719.91	-31,422,269.20
其中:1.基金申购款	98,418,375.91	13,689,345.03	112,107,720.94
2.基金赎回款	-124,773,925.20	-18,756,064.94	-143,529,990.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	28,489,839.28	7,356,125.31	35,845,964.59
项目	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	273,039,419.53	-	273,039,419.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,611,861.80	12,611,861.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-218,194,030.96	-8,307,143.17	-226,501,174.13
其中:1.基金申购款	8,800,185.86	378,638.59	9,178,824.45
2.基金赎回款	-226,994,216.82	-8,685,781.76	-235,679,998.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	54,845,388.57	4,304,718.63	59,150,107.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:章国富,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安纳斯达克100指数证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]10号文《关于核准华安纳斯达克100指数证券投资基金募集的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2013年6月13日到2013年7月31日止期间向社会公开募集,基金合同于2013年8月2日正式生效,首次设立募集规模为273,039,419.53份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为美国道富银行 (State Street Bank and Trust Company)。

本基金主要投资于纳斯达克100指数成份股、备选成份股,与纳斯达克100指数相关的公募基金、上市交易型基金等,固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于纳斯达克100指数成份股、备选成份股以及与纳斯达克100指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不低于基金资产的85%,其中投资于与纳斯达克100指数相关的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产的10%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为:纳斯达克100价格指数(Nasdaq 100 Price Index)收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策变更的说明在7.4.2会计报表的编制基础中披露。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税;

(2) 基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税;

(3) 基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

项目	与本基金的关系
华安基金管理有限公司("华安基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("建设银行")	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	436,477.24	610,757.96
其中:支付销售机构的客户维护费	240,066.72	241,858.59

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.80%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	136,399.09	190,861.83

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年8月2日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	4,269,487.20	43,133.73	4,009,358.46	227,863.62
道富银行	226,059.23	159.47	1,241,580.34	1,170.56
合计	4,495,546.43	43,293.20	5,250,938.80	229,034.18

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管,按适用利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期和上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1公允价值

7.4.10.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为31,783,596.81元,无属于第二层次和第三层次余额。

于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为54,964,905.77元,无属于第二层次和第三层次余额。

7.4.10.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

7.4.10.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

关联方名称	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	31,783,596.81	86.72
	其中:普通股	31,180,366.88	85.08
	存托凭证	603,229.93	1.65
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	4,495,546.43	12.27
8	其他各项资产	371,177.56	1.01
9	合计	36,650,320.80	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	31,783,596.81	88.67
合计	31,783,596.81	88.67

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
工业	540,075.18	1.51
信息技术	19,588,636.54	54.65
非必需消费品	5,007,551.71	13.97
能源	-	-
保健	4,735,757.23	13.21
公用事业	-	-
必需消费品	1,575,061.20	4.39
电信服务	252,519.44	0.70
材料	83,995.51	0.23
合计	31,783,596.81	88.67

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

8.4 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

8.4.1 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

金额单位:人民币元

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	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	6,700	4,525,281.97	12.62
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克市场	美国	9,400	2,671,738.97	7.45
3	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克市场	美国	5,900	1,310,145.21	3.65
4	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克市场	美国	400	1,298,843.42	3.62
5	FACEBOOK INC	Facebook公司	FB US	纳斯达克市场	美国	2,300	1,098,030.07	3.06
6	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克市场	美国	6,100	1,038,219.91	2.90
7	GILEAD SCIENCES INC	Gilead 科学	GILD US	纳斯达克市场	美国	1,800	1,038,198.49	2.90
8	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯达克市场	美国	300	966,312.48	2.70
9	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克市场	美国	500	949,515.83	2.65
10	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克市场	美国	900	877,225.96	2.45

注:1.所用证券代码采用彭博代码。

2. 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文。

8.4.2 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

本基金本报告期末积极投资部分未持有股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL US	3,996,643.12	6.76
2	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,672,916.94	2.83
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,113,260.05	1.88
4	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	740,696.39	1.25
5	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	623,668.09	1.05
6	INTEL CORP	INTC US	534,062.68	0.90
7	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	526,140.58	0.89
8	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	507,299.04	0.86
9	CELGENE CORP	CELG US	459,195.75	0.78
10	FACEBOOK INC	FB US	438,568.00	0.74
11	EBAY INC	EBAY US	429,516.79	0.73
12	AMGEN INC	AMGN US	358,914.97	0.61
13	QUALCOMM INC	QCOM US	358,903.52	0.61
14	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	347,842.88	0.59
15	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	CTSH US	329,772.21	0.56
16	TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	FOXA US	328,466.13	0.56
17	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	324,454.65	0.55
18	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	ALXN US	292,495.65	0.49
19	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	280,463.97	0.47
20	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	265,862.43	0.45

注:本项"买入金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	AAPL US	8,488,174.27	14.35
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	3,868,252.71	6.54
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	2,811,512.55	4.75
4	INTEL CORP	INTC US	1,590,995.82	2.69
5	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	1,557,981.65	2.63
6	QUALCOMM INC	QCOM US	1,541,152.99	2.61
7	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	1,448,538.74	2.45
8	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	1,390,760.06	2.35
9	GOOGLE INC-CL C	GOOG US	1,350,006.06	2.28
10	FACEBOOK INC	FB US	1,349,342.84	2.28
11	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	1,345,948.40	2.28
12	CELGENE CORP	CELG US	1,134,430.32	1.92
13	AMGEN INC	AMGN US	1,037,898.63	1.75
14	GOOGLE INC-CL A	GOOGL US	999,756.09	1.69
15	EBAY INC	EBAY US	959,337.20	1.62
16	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	845,778.19	1.43
17	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	795,302.11	1.34
18	TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	FOXA US	781,123.22	1.32
19	PRICELINE.COM INC	PCLN US	763,059.60	1.29
20	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ESRX US	703,546.68	1.19

注:本项"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	21,315,330.22
卖出收入(成交)总额	52,376,600.64

8.6 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。

8.7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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1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,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。

8.11.2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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,185.99
4	应收利息	272.44
5	应收申购款	358,719.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	371,177.56

8.11.4 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。

8.11.5 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不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,107	25,736.08	-	-	28,489,839.28	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	19,808.28	0.069528%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0;

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年8月2日)基金份额总额	273,039,419.53
本报告期期初基金份额总额	54,845,388.57
本报告期基金总申购份额	98,418,375.91
减:本报告期基金总赎回份额	124,773,925.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,489,839.28

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下:

(1)2014年9月15日,基金管理人发布了华安基金管理有限公司董事长变更公告,朱仲群先生不再担任本基金管理人的董事长,由朱学华先生担任本基金管理人的董事长、法定代表人以及党总支书记。

(2)2014年9月17日,基金管理人发布了华安基金管理有限公司总经理变更公告,李勍先生不再担任本基金管理人的总经理,由董事长朱学华先生代任本基金管理人的总经理。

(3)2014年12月24日,基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告,童威先生新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下:

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币50,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	18,785,659.64	25.49%	3,863.09	24.92%	-
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	33,487,974.69	45.45%	5,055.74	32.61%	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	1,800,043.42	2.44%	30.79	0.20%	-
Barclays Capital Asia Limited.	-	19,614,075.29	26.62%	6,555.17	42.28%	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	

注:1.券商专用交易单元选择标准:

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持,具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下:

(1)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(2)具备高效、安全的通讯条件;可靠、诚信,能够公平对待所有客户,有效执行投资指令,取得较高质量的交易成交结果,交易差错少,并能满足基金运作高度保密的要求;

(3)交易和清算支持多种方案,软件再开发的能力强,系统稳定安全等;

(4)具有战略规划和定位,能够积极推动多边业务合作,最大限度地调动整体资源,为基金投资赢取机会;

(5)其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》,对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果,择优选出拟新增单元,填写《新增交易单元申请审核表》,对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核,并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》,并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无。

华安基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日