华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月26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	华安月安鑫短期理财债券	
基金主代码	040033	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	514,814,322.94份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B
下属分级基金的交易代码	040033	040034
报告期末下属分级基金的份额总额	191,785,874.46份	323,028,448.48份

注:根据中国证监会2013 年12 月3 日下发的《关于华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]1026 号),华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金自2013 年12 月27 日起变更为华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、运作期、基金的基本情况、基金的备案、基金份额的集中申购、赎回与转换、基金份额持有人大会等条款。修订后的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》自2013 年12 月27 日起正式生效。

2.2 基金产品说明

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。
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 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		2012年6月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B
本期已实现收益	25,090,315.47	16,072,543.16	9,343,108.37	4,092,093.45	32,032,821.87	14,964,445.16
本期利润	25,090,315.47	16,072,543.16	9,343,108.37	4,092,093.45	32,032,821.87	14,964,445.16
本期基金份额净值收益率	3.8927%	4.1465%	5.1674%	5.4181%	1.8868%	2.0226%
3.1.2期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末	
	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B
期末基金资产净值	191,785,874.46	323,028,448.48	1,930,257,685.76	1,573,005,953.00	289,190,404.34	22,594,530.15
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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. 华安月安鑫短期理财债券A

阶段	份额净值收益率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	0.7270%	0.0056%	–	–	–	–
过去六个月	1.6470%	0.0044%	–	–	–	–
过去一年	3.8927%	0.0046%	–	–	–	–
自基金成立起至今	11.3219%	0.0074%	–	–	–	–

2. 华安月安鑫短期理财债券B

阶段	份额净值收益率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	0.7875%	0.0056%	–	–	–	–
过去六个月	1.7697%	0.0044%	–	–	–	–
过去一年	4.1465%	0.0046%	–	–	–	–
自基金成立起至今	12.0088%	0.0074%	–	–	–	–

注:根据中国证监会2013 年12 月3 日下发的《关于华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]1026 号),华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金自2013 年12 月27 日起变更为华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、运作期、基金的基本情况、基金的备案、基金份额的集中申购、赎回与转换、基金份额持有人大会等条款。修订后的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》自2013 年12 月27 日起正式生效。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

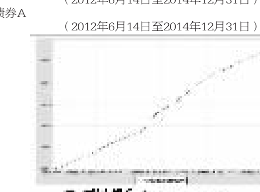
华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

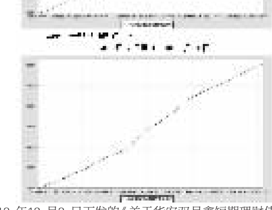
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年6月14日至2014年12月31日)

1、华安月安鑫短期理财债券A

(2012年6月14日至2014年12月31日)





注:(1)根据中国证监会2013 年12 月3 日下发的《关于华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]1026 号),华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金自2013 年12 月27 日起变更为华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、运作期、基金的基本情况、基金的备案、基金份额的集中申购、赎回与转换、基金份额持有人大会等条款。修订后的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》自2013 年12 月27 日起正式生效。

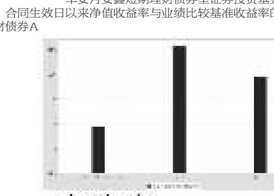
(2)根据《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》和《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

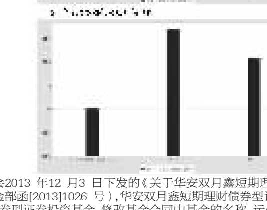
3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安月安鑫短期理财债券A





注:(1)根据中国证监会2013 年12 月3 日下发的《关于华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]1026 号),华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金自2013 年12 月27 日起变更为华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金,修改基金合同中基金的名称、运作期、基金的基本情况、基金的备案、基金份额的集中申购、赎回与转换、基金份额持有人大会等条款。修订后的《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》自2013 年12 月27 日起正式生效。

(2)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

1、华安月安鑫短期理财债券A

金额单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012	291,038.51	31,538,047.97	203,735.39	32,032,821.87	–
2013	336,738.55	7,413,141.86	1,593,227.96	9,343,108.37	–
2014	360,615.66	26,673,549.61	–1,943,849.80	25,090,315.47	–
合计	988,392.72	65,624,739.44	–146,886.45	66,466,245.71	–

2、华安月安鑫短期理财债券B

金额单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012	–	14,947,537.11	16,908.05	14,964,445.16	–
2013	–	2,602,725.19	1,489,368.26	4,092,093.45	–
2014	–	17,814,916.72	–1,742,373.56	16,072,543.16	–
合计	–	35,365,179.02	–236,097.25	35,129,081.77	–

§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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2013-10-08	–	17年	金融学硕士(金融工程方向),17年证券、基金从业经历。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。2008年4月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011年6月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。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。2013年6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监。2013年8月起担任固定收益部副总监。2013年10月起同时担任本基金、华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年7月起同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。
张晟刚	本基金的基金经理	2013-10-08	2014-08-30	15年	硕士研究生,15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月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安七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。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。2013年10月起同时担任本基金、华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2013年11月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014年8月从华安离职。
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	–	7年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,7年基金行业从业经历。2007年7月应届生毕业进入华安基金,历任金融工程部风险管理员、产品经理,固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月起同时担任本基金、华安汇财通货币市场基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安双债添利债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券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 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《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《华安月安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 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,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,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,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2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

美国经济在商业投资大幅增长、房地产市场持续回暖以及消费和出口增长等因素的共同驱动下强劲反弹,失业率大幅下降,从上年末的6.7%降至2014年末的5.6%,在此背景下,美联储于2014年11月宣布结束量化宽松政策。欧元区经济弱于预期,通缩压力不断加大,实际内需下降明显,失业率居高不下,虽然欧央行出台了一系列宽松货币政策,但仍未能提振欧元区经济。日本经济受消费税率上调等因素影响,经济增速明显回落,消费和投资信心低迷,物价水平面临较大下行压力。新兴市场经济体增长普遍放缓,在美国货币政策回归正常化、地缘政治风险增大、国际油价大幅下跌、结构性问题凸显的背景下,部分新兴市场经济体面临资本外流风险。

国内经济延续2013年以来的调整态势,经济下行压力增加,在外需疲弱、内需持续回落、制造业去产能、房地产投资增速下滑等因素的共同作用下,2014年GDP全年增长7.4%,较2013年下降0.3个百分点。与此同时,受国际大宗商品价格下跌和内需疲弱等影响,PPI、CPI持续走低,均处于近5年来的低位,通缩风险加大。受美联储退出QE和央行降息等事件的影响,人民币兑美元汇率日内波动区间,受美联储退出QE和央行降息等事件的影响,人民币兑美元汇率一改单边升值走势,双边波动加剧,人民币结汇需求减弱,外汇占款大幅下降,截止2015年1月已连续两月出现千亿级别的净减少,央行通过公开市场操作、SLF、MLF、定向降准、再贷款、PSL和降准等多种方式注入基础货币,货币市场流动性整体较为宽裕,但货币市场利率在IPO、年末等部分时间节点仍阶段性走高。

债券市场全年在基本面和流动性的双重驱动下走出了一波牛市行情。一季度债市收益率下行,季末受"保增长"以及流动性边际收紧预期的影响,长久期债券出现调整,收益率曲线呈现陡峭化形态;在信托、公司债和中小企业私募债违约事件增多的影响下,市场信用风险偏好下降,中低等级产业债信用利差扩大,城投债因享受隐性国家信用而收益率下行。二季度债市在"宽货币"和"严监管"的双重驱动下继续演绎牛市行情,中长端收益率加速下行;中高等级短融和有政府信用背书的城投债仍然是信用债市场上交投的热点。三季度在国内经济重新下行的推动下,债券市场继续呈现牛市特征,收益率曲线平坦化下行,信用利差继续压缩。债券市场在四季度前段呈现快牛行情,后段受资金面趋紧以及中证登质押新规影响进入震荡市,收益率曲线平坦化下行,信用利差有所扩大。全年来看,收益率曲线平坦化下行,长端国开债下行幅度超过170BP,短端下行150BP左右;信用利差出现分化,中高等级有所收窄,低等级则明显扩大。货币市场方面,银行间隔夜和7天回购日平均利率较上年分别下行56BP和49BP至2.78%和3.63%;长期限资金价格也有所下降,1月Shibor较上年下行23BP至4.58%。

本报告期内,月安鑫合理安排组合久期,主要滚动投资于利率较高的同业存款和银行间逆回购,同时把握机会,配置优质中高等级短期融资券以获得丰厚的持有收益。组合整体在有效控制流动性风险的前提下,保证了较高的整体收益率,为投资者提供了可观的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2014年华安月安鑫投资收益率及规模变化:

1.华安月安鑫短期理财A

投资回报:3.8927%

期初规模:19.30亿 期末规模:1.92亿

2.华安月安鑫短期理财B

投资回报:4.1465%

期初规模:15.73亿 期末规模:3.23亿

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2015年,美国经济继续向好,可能在下半年实现首次加息,欧日经济复苏仍存在较大不确定性,面临经济增长乏力和通胀下行问题,新兴经济体仍面临调整压力和资金外流风险。大宗商品价格预计仍将低位徘徊,加之内需疲弱、产能过剩,国内通胀面临下行压力。从"三驾马车"看,固定资产投资增速在制造业投资去产能和地产投资远未改善的背景下,又面临基建投资资金来源不确定的问题,消费和进出口增长预计稳中趋降,因此判断国内经济增长下行压力仍然较大。一月份社会融资总量和M2增速双双创历史新低,人民币有效汇率升值,通胀下行导致实际利率维持高位,国内货币条件偏紧;与此同时,在国内经济不振和美国加息预期影响下,人民币兑美元汇率贬值预期不改,外汇占款预计仍将维持低位甚至持续负增长。因此预计货币政策仍将维持宽松,预计债券市场上半年延续牛市行情,下半年在经过半年的政策刺激后,随着经济动能的回升逐渐进入震荡行情,收益率曲线有望陡峭化,信用利差继续分化,中高等级信用利差继续收窄,低等级则继续扩大。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握市场结构性机会,通过月末时点锁定高收益同业存款和甄选优质中高等级短期融资券博取较高的持有收益,提高组合整体收益,为投资者创造更多价值。

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。

4.6 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,现任华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理,华安基金管理有限公司总裁助理、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、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理,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,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安深证300指数证券投资基金(LOF)、华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定,本基金收益根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每月集中支付收益。本报告期华安月安鑫短期理财A累计收益分配金额25,090,315.47元,华安月安鑫短期理财B累计收益分配金额16,072,543.16元。

4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

无。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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_B03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:华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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	90,508,518.71	3,503,708,196.58
结算备付金	45,865.00	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	352,072,749.92	–
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	352,072,749.92	–
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	59,993,409.99	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	12,256,617.73	3,569,615.34
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	514,877,161.35	3,507,277,811.92
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	–	–
应付管理人报酬	36,055.01	247,492.18
应付托管费	9,614.60	65,997.70
应付销售服务费	17,716.26	97,407.19
应付交易费用	3,436.24	1,036.43
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–382,983.70	3,303,239.66
递延所得税负债	–	–
其他负债	379,000.00	299,000.00
负债合计	62,838.41	4,014,173.16
所有者权益:		
实收基金	514,814,322.94	3,503,263,638.76
未分配利润	–	–
所有者权益合计	514,814,322.94	3,503,263,638.76
负债和所有者权益总计	514,877,161.35	3,507,277,811.92

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额514,814,322.94份,其中A类基金份额总额191,785,874.46份;B类基金份额总额323,028,448.48份。

7.2 利润表

会计主体:华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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1月1日至2013年12月31日
一、收入	45,926,495.47	15,245,549.97
1.利息收入	45,926,495.47	15,245,549.97
其中:存款利息收入	44,159,054.93	11,659,018.28
债券利息收入	–448,119.52	122,506.09
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	2,215,560.06	3,464,025.60
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	–	–
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–	–
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	–	–
减:二、费用	4,763,636.84	1,810,348.15
1. 管理人报酬	2,440,165.82	752,447.87
2. 托管费	650,711.18	200,651.76
3. 销售服务费	1,333,376.65	469,054.92
4. 交易费用	–	–
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	339,383.19	388,193.60
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	41,162,858.63	13,435,201.82
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列	41,162,858.63	13,435,201.82

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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)	3,503,263,638.76	–	3,503,263,638.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	41,162,858.63	41,162,858.63
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)	–2,988,449,315.82	–	–2,988,449,315.82
其中:1.基金申购款	6,743,425,150.78	–	6,743,425,150.78
2.基金赎回款	–9,731,874,466.60	–	–9,731,874,466.60
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)	–	–41,162,858.63	–41,162,858.63
五、期末所有者权益(基金净值)	514,814,322.94	–	514,814,322.94
项目	上年度可比期间 2013年1月1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)	311,784,934.49	–	311,784,934.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	13,435,201.82	13,435,201.82
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)	3,191,478,704.27	–	3,191,478,704.27
其中:1.基金申购款	7,029,303,978.79	–	7,029,303,978.79
2.基金赎回款	–3,837,825,274.52	–	–3,837,825,274.52
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)	–	–13,435,201.82	–13,435,201.82
五、期末所有者权益(基金净值)	3,503,263,638.76	–	3,503,263,638.76

报告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

华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金(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[2012]681号《关于核准华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2012年6月14日正式生效,首次设立募集规模为5,527,473,577.18份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期不定。本基金以"运作期滚动"方式运作。自基金合同生效日起,本基金在运作期内不开放当期的日常申购与赎回,仅在运作期倒数第2个工作日开放当期赎回。每个运作期临近到期日前,本基金将开放下一运作期的集中申购,集中申购的开放日不超过5个工作日。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据2013年召开的华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议,本基金更名为华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金。本基金的运作期为基金管理人事先确定的封闭运作期间。本基金在运作期内不开放当期的日常申购与赎回,仅在运作期倒数第2个工作日开放当期赎回。每个运作期临近到期日前,本基金将开放下一运作期的集中申购,集中申购的开放日不超过5个工作日(首个运作期的集中申购不受此限,但不超过10个工作日)。中国证监会于2013年12月3日出具了《关于华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2013]1026号),上述基金份额持有人大会决议已在中证监会完成备案,本次持有人大会决议生效。根据基金份额持有人大会决议,华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同自2013年第六期运作期结束之次日即2013年12月27日起生效。

本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量,对基金份额持有人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别:A类基金份额和B类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的A类基金份额达到或超过500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的A类基金份额全部升级为B类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的B类基金份额低于500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额。

本基金投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、银行定期存款、大额存单、债券回购、短期融资券、国债、中央银行票据、金融债、中期票据、企业债及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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。

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

7.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.2个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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
上海锦江国际投资管理有限公司	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
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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及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1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,440,165.82	752,447.87
其中:支付销售机构的客户维护费	1,450,239.56	275,553.21

注:在通常情况下,基金管理费按前一日的基金资产净值的0.3%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.3%/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,逐日累计至每个运作期结束月末,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前2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、公休假等,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1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	650,711.18	200,651.76

注:在通常情况下,基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.08%/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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个运作期结束月末,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	合计
华安基金管理有限公司	17,206.26	4,990.17	22,196.43
中国银行	679,013.34	6,769.21	685,782.55
合计	696,219.60	11,759.38	707,978.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B	合计
华安基金管理有限公司	15,972.70	2,937.76	18,910.46
中国银行	386,167.75	1,773.57	387,941.32
合计	402,140.45	4,711.33	406,851.78

注:本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年基金销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用B类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H＝E×各类基金份额的销售服务费年费率/当年天数

H为每日各类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日的各类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每个运作期结束月末,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前2个工作日内从基金财产中划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	20,375,032.33	–	–	–	–	–

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及上年度可比期间均未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及上年度末均未投资本基金。

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1月1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
中国银行	1,508,518.71	151,696.81	5,708,196.58	24,000.58

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及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。

7.4.9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无余额,第二层次的余额为352,072,749.92元,无属于第三层次余额。

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无余额,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

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	352,072,749.92	68.38
	其中:债券	352,072,749.92	68.38
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	59,993,409.99	–
	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	90,554,383.71	17.59
4	其他各项资产	12,256,617.73	2.38
	合计	514,877,161.35	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

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	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。

8.3 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%。

8.4 基金投资组合平均剩余期限

8.4.1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	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	32
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

在本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 60 天。

8.4.2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	97.63	–
	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	97.63	–

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	352,072,749.92	68.39
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	352,072,749.92	68.39
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041462001	14淮南矿业CP001	500,000	50,467,820.16	9.80
2	011456003	14中交建SCP003	500,000	50,237,177.29	9.76
3	011447002	14华润SCP002	500,000	50,227,172.48	9.76
4	041452003	14云投CP001	400,000	40,401,216.82	7.85
5	011409002	14国电集SCP002	300,000	30,130,355.24	5.85
6	011452002	14南航SCP002	300,000	30,130,058.21	5.85
7	011410003	14中电投SCP003	300,000	30,115,007.40	5.85
8	011499042	14华润药SCP001	300,000	30,002,340.09	5.83
9	041473001	14丹东港CP001	200,000	20,186,812.23	3.92
10	041456001	14漳电CP001	200,000	20,174,790.00	3.92

8.7 "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
报告期内偏离度的最高值	0.1671%
报告期内偏离度的最低值	-0.0002%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0278%

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2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。

8.9.3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。

8.9.4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	应收利息	12,256,617.73
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	12,256,617.73

§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

份额级别	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
华安月安鑫短期理财债券A	1,513	126,758.67	1,675,092.75	0.87%	190,110,781.71	99.13%
华安月安鑫短期理财债券B	19	17,001,497.29	–	–	323,028,448.48	100.00%
合计	1,532	336,040.68	1,675,092.75	0.33%	513,139,230.19	99.67%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华安月安鑫短期理财债券A	82061.20	0.04279%
	华安月安鑫短期理财债券B	–	–
	合计	82061.20	0.01594%

注:1、分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、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

项目	华安月安鑫短期理财债券A	华安月安鑫短期理财债券B
基金合同生效日(2012年6月14日)基金份额总额	3,663,164,901.95	1,864,308,675.23
本报告期期初基金份额总额	1,930,257,685.76	1,573,005,953
本报告期基金总申购份额	5,705,633,702.30	1,037,791,448.48
减:本报告期基金总赎回份额	7,444,105,513.60	2,287,768,953
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	191,785,874.46	323,028,448.48

§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。

(4)2014年8月30日,基金管理人发布了华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金经理变更公告,张晟刚先生不再担任本基金的基金经理,由贺涛先生继续担任本基金的基金经理。

(5)2014年11月20日,基金管理人发布了华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金经理变更公告,增聘朱才敏女士为本基金的基金经理,与贺涛先生共同管理本基金。

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:

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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的情况

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	
安信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	1	–	–	–	–	–
西南证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国信证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中信金通证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券股份有限公司	–	–	46,600,000.00	43.68%	–	–
齐鲁证券有限公司	–	–	22,100,000.00	20.72%	–	–
西南证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	–	–	273,000.00	0.26%	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国信证券有限责任公司	–	–	37,700,000.00	35.34%	–	–
中信金通证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–

注:1、基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1)内部管理规范、严谨;具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(2)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;

(3)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;

(4)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、本报告期内,本基金未变更交易单元。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

无。

华安基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日