华安保本混合型证券投资基金

【2013】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:二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月28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2013年5月14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	华安保本混合
基金主代码	000072
交易代码	000072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月14日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	799,919,461.90份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略(恒定比例组合保险策略)。基金管理人主要通过数量分析,根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数(即风险乘数),动态调整保本资产与风险资产的投资比例,以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现投资组合的保本增值目标。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、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,确定具体的投资券种选择,积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。
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	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

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	冯颖	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833

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、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	2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	9,020,944.53
本期利润	-12,853,153.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0149
本期基金份额净值增长率	-1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0153
期末基金资产净值	787,700,125.78
期末基金份额净值	0.985

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)。

4.本基金于2013年5月14日成立,截止本报告期末,本基金成立不足一年。

5.合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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

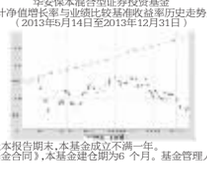
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.10%	0.22%	1.05%	0.01%	-2.15%	0.21%
过去六个月	0.31%	0.23%	2.13%	0.01%	-1.82%	0.22%
自基金合同生效起至今	-1.50%	0.24%	2.70%	0.01%	-4.20%	0.23%

注:本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)

根据本基金合同的有关规定:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定),本基金投资比例限制为:投资于股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%;现金或到期日在一年以内的政府债券投资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

华安保本混合型证券投资基金
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
(2013年5月14日至2013年12月31日)

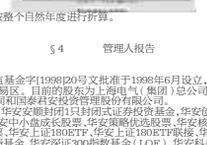


注:1.本基金于2013年5月14日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安保本混合型证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为6个月。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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

华安保本混合型证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



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

本基金过去三年没有利润分配。

§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,公司总部设在上海证券大厦,注册地为上海电气(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2013年12月31日,公司旗下共管理了华安安顺封闭1只封闭式证券投资基金,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(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、华安货币、华安信消费股票、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等46只开放式基金。管理资产规模达到838.62亿元人民币。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴丰利	本基金的基金经理	2013-05-14	-	10年	硕士研究生,10年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员,华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011年3月份加入华安基金管理有限公司,2012年7月2日担任华安红利股票型证券投资基金的基金经理。2012年10月起同时担任华安行业轮动股票型证券投资基金的基金经理。2012年12月起担任华安现金富利货币型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任本基金的基金经理。
张展明	本基金的基金经理	2013-05-24	2013-05-14	15年	硕士研究生,15年银行、证券行业从业经历。曾在中国银行上海分行、纽约分行、巴黎分行从事国际业务工作,从事债券风险管理工作。曾任上海证券交易所博士后研究工作站研究员、华安基金管理有限公司固定收益部基金经理。2012年11月加入华安基金管理有限公司,2013年5月14日起担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月月鑫货币市场基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安纯债债券型证券投资基金、华安年年红债券型证券投资基金、华安现金富利货币型证券投资基金的基金经理。2013年7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。
郑可成	本基金的基金经理	2013-05-14	-	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月在国泰君安证券股票投资公司担任研究员,从事债券研究及投资。2005年1月至2005年9月在长城基金管理有限公司担任基金经理。2005年9月至2006年1月在华安基金管理有限公司担任基金经理。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月起同时担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年3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。2012年11月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月起同时担任本基金的基金经理。2013年5月起同时担任本基金的基金经理。

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《华安保本混合型证券投资基金基金合同》、《华安保本混合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 管理人对报告期内以下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、特定客户资产管理及社会公众基金资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中,把制度落实到投资决策委员会、研究部、基金经理、交易部等各类投资决策小组的研究信息、投资建议过程中,使用最公发言、最终发送、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权的权限分配,同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各级投资决策小组的决策程序,在交易环节,公司应了强制公平交易机制,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,投资组合经理根据意愿独立进行业务申报,集中交易原则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,则以投资组合名义获得,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价格优先、时间优先、比例分配的原则,通过授权其同时向多家交易对手报价的控制方式,在有内部价格参考和结果、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、进行统计分析的非公开发行股票申购、认购公允性进行动态监控。(4)交易所二级市场业务,因部分投资品种交易量较少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。

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偏日反向交易的检查;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,并定期对组合的同向交易行为进行了重点分析。

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%的情况共计以自有资金交易了10次,原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合实卖数量极少,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

2013年欧美经济稳步复苏,股市连创新高。尤其是美国经济在多领域表现出了可持续的增长动力,就业和房地产市场的改善券实了消费的基础。5月开始美联储启动了QE退出的市场预期,美国国债利率大幅上升,12月18日正式迈出削减量化宽松第一步。欧元区经济低位企稳复苏,但地区间高度不平衡。同时,新兴经济体经济增速高位回落,较高的杠杆和缓软的消费迫使他们加快结构调整和转型。

2013年中国经济增速平稳,通胀温和,从“驾马车”的结构看,增长主要依靠投资拉动,结构失衡有所加剧。下此同时,中国依靠货币扩张的经济模式积聚了一定的金融风险。因此从二季度开始,央行开始收紧货币政策,倒逼金融机构去杠杆。资金总量层面的供需矛盾和结构性问题,国债收益率和房地产通过信托和委托贷款吸收了大量的融资,使得融资成本飙升。而互联网金融引领的利率市场化变革,加速分流银行存款,助推了资金成本的上升。使得2013年流动性问题集中爆发。

债券市场的走势与“明是欧云相似”,一季度在流动性宽松的背景下,延续了自11年四季度以来的牛市行情,收益率持续下行,高收益债券表现出色。进入二季度后,随着监管升级,银监会叫号过份合理影子银行;央行“锁长放短”扭曲操作,市场对流动性预期急速逆转,债市收益率节节走高,而传统的配债大户商业银行和保险在资金成本飙升情况下,更是“舍债追非”,为债市重上加霜,标杆性的10年国债最高触及4.72%,刷新了近九年来的记录。

股市整体震荡下行,但在经济放缓、结构转型和资金紧张的背景下,行情分化明显。虽然大盘指数跌幅并不大,但是传统蓝筹股受到持续的抛售,而TMT、环保、医药等表现服则,创业板指数大幅上涨。

本报告期内,保本基金以稳健的固定收益配置加上灵活的权益类投资结合的策略,固定收益方面,在债市大跌的背景下,通过积极配置策略收得稳健的回报;权益方面,加强了个股选择,偏向于成长性相对较好的价值股,但超配地产股有一定的负向贡献。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.985元,本报告期份额净值增长率为-1.50%,同期业绩比较基准增长率为2.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年欧美经济温和复苏,新兴市场国家结构调整,仍然延续,在QE退潮的背景下,欧洲和日本央行放水,一定程度上弥补了外部流动性不足。中国基本面好于一般新兴市场国家,随计外汇占款今年保持流入,国内方面,经济和通胀总体保持稳定,但改革和转型加速中,经济增速会有不确定性。地方债务问题和金融机构杠杆问题将考验执政的能力,经济结构转型任重道远。

货币政策和选动性仍是焦点。市场化和互联网金融带来的创新革命将延续和扩大化,降低了银行存款可得性,提高了银行的资金成本。但债市调整已经影响到实体经济的正常融资,同业业务监管制度已经配酿推出,协调有效的金融监管机制正在建立,因此货币政策出现放松的机会,流动性会较13年有所改善。债券收益率在去年年末高上行之后,部分品种的绝对收益有着较好的投资价值。

操作方面,我们将关注国内外宏观形势和国家政策的变化,积极提高债券的仓位,加大信用债投资,同时做好风险和收益的平衡。股票方面,顺势而为,坚持核心价值下,采取灵活的操作策略,积极参与新股申购。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。

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:

尚志国,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,现任华安权益投资证券投资基金经理,华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森,基金投资部基金全球投资部总监,工业工程学硕士。曾在台湾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代基金经理,台湾中信证券投资总监助理,台湾保德信投信任基金经理。2006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,基金投资部基金策略投资部副总监。

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。

贺鸿,金融学硕士,固定收益部副总监,曾任长城证券自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。

许之彬,博士,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,2006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。

6.三类资产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

本报告期不进行收益分配。

§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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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(2014)审字第60971571_B09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:华安保本混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日
资 产:	
银行存款	87,973,237.13
结算备付金	1,157,490.21
存出保证金	119,715.30
交易性金融资产	772,449,377.82
其中:股票投资	87,344,787.32
基金投资	-
债券投资	685,104,590.50
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	-
应收利息	11,674,809.64
应收股利	-
应收申购款	15,052.64
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	873,389,682.74
负债和所有者权益	本期末 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	79,999,805.00
应付证券清算款	992,100.88
应付赎回款	3,280,102.44
应付管理人报酬	817,252.95
应付托管费	136,208.82
应付销售服务费	-
应付交易费用	107,299.13
应交税费	-
应付利息	36,787.74
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	320,000.00
负债合计	85,689,556.96
所有者权益:	
实收基金	799,919,461.90
未分配利润	-12,219,336.12
所有者权益合计	787,700,125.78
负债和所有者权益总计	873,389,682.74

注:(1)报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.985元,基金份额总额799,919,461.90份。

(2)本基金合同于2013年5月14日生效。

7.2 利润表

会计主体:华安保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一.收入	-3,490,839.85
1.利息收入	22,837,660.10
其中:存款利息收入	8,556,095.65
债券利息收入	9,818,474.94
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,463,089.51
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-6,518,240.82
其中:股票投资收益	-3,417,583.96
基金投资收益	-
债券投资收益	-4,673,418.03
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,572,761.17
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-21,874,098.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,063,838.87
减:二.费用	9,362,313.62
1.管理人报酬	6,507,070.67
2.托管费	1,084,511.82
3.销售服务费	-
4.交易费用	841,944.49
5.利息支出	587,367.91
其中:卖出回购金融资产支出	587,367.91
6.其他费用	341,418.73
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-12,853,153.47
减:所得税费用	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	-12,853,153.47

注:本报告期为2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月14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)	901,938,256.03	-	901,938,256.03
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,853,153.47	-12,853,153.47
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)	-102,018,794.13	633,817.35	-101,384,976.78
其中:1.基金申购款	1,816,413.23	-9,437.71	1,806,975.52
2.基金赎回款	-103,835,207.36	643,255.06	-103,191,952.30
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)	799,919,461.90	-12,219,336.12	787,700,125.78

注:本报告期为2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人公司负责人:李勤,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

华安保本混合型证券投资基金(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[2013]218号文《关于核准华安保本混合型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4月11日到2013年5月10日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第60971571_B03号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年5月14日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币901,356,057.73元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币582,198.30元,以上实收基金(本息)分计为人民币901,938,256.03元,折合901,938,256.03份基金份额。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。

根据《华安保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金以每三年为一个保本周期。本基金的第一个保本周期自基金合同生效日起至三个公历年后的对应日止,如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。保本周期届满时,若符合保本基金存续条件,本基金转入下一保本周期;基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则,确定下一个保本周期的起始时间;第一个保本周期之后各保本周期日基金公告的保本周期起始之日起至三个公历年后对应日止,若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。本基金第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额累计分红金额之和低于认购保本金额,则基金管理人应补足该差额(即“保本赔付差额”),并在保本周期到期日后20个工作日内(含第20个工作日)将该差额支付给基金份额持有人。其后各保本周期到期日,如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额市当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额,由当期有效的基金合同(保证合同)规定的基金管理人或保本义务人将保本赔付差额支付给基金份额持有人。本基金到期操作期间内当期保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日)。

在到期操作期间内,本基金接受赎回和转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。如果基金份额持有人在到期操作期间内未选择赎回或转换转出,则基金管理人根据本基金合同约定形式规划默认选择转入下一保本周期或继续持有转型后的“华安稳健回报混合型证券投资基金”基金份额,默认操作日期为到期操作期间的最后一个工作日。

基金管理人有权视业务需要设定过渡期,过渡期指到期操作期间结束日的下一工作日至下一保本周期开始日前一工作日的时间区间,最长不超过20个工作日,具体由基金管理人在当期保本周期操作期间公告的到期处理规则中确定。过渡期内,本基金将暂停办理日赎回和转换转出业务,投资人在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内,投资人转换转入本基金基金份额,视同为过渡期申购。

本基金第一个保本周期的担保人为中国投资担保有限公司,对保本期付差额的支付提供不可撤销的连带责任保证;本基金第一个保本周期后各保本周期的担保人或保本义务人对外承担保证责任或保本赔付责任的情况及为本基金提供的保本保障额度,由基金管理人在当期保本周期开始前公告。保本周期届满时,若符合保本基金存续条件,本基金转入下一保本周期,在满足法律法规规定和基金合同规定的基金存续要求的前提下,若本基金不符合上述保本基金存续条件,则本基金将按基金合同的约定变更为“华安稳健回报混合型证券投资基金”。同时,基金的投资目标、投资范围等相关内容也将根据本合同约定做相应修改。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定),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。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的股性变化,按照投资组合保险机制对保本资产和风险资产的投资比例进行动态调整。本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%;现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金整体业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)。

7.4.2会计提则与编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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信息披露内容的指导意见》、《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<年度报告财务报表附注>》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。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年5月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2013年5月14日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

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。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资);

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止

确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法