华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月21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	3,503,263,638.76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	1,930,257,685.76份	1,573,005,953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	冯颖	唐州徽
	联系电话	021-38969999	95566
	电子邮箱	fengying@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

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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	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
本期已实现收益	9,343,108.37	4,092,093.45	32,032,821.87	14,964,445.16
本期利润	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	5.1674%	5.4181%	1.8868%	2.0226%
3.1.2期末数据和指标	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
期末基金资产净值	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
3.1.3累计期末指标	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
基金份额累计净值收益率	7.1512%	7.5498%	1.8868%	2.0226%

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	1.3570%	0.0020%	-	-	-	-
过去六个月	3.2148%	0.0050%	-	-	-	-
过去一年	5.1674%	0.0078%	-	-	-	-
自基金成立起至今	7.1512%	0.0086%	-	-	-	-

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	1.4176%	0.0020%	-	-	-	-
过去六个月	3.3380%	0.0050%	-	-	-	-
过去一年	5.4181%	0.0078%	-	-	-	-
自基金成立起至今	7.5498%	0.0086%	-	-	-	-

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。

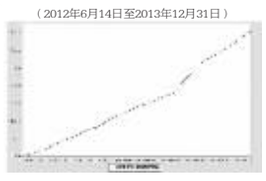
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

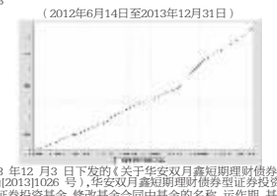
(2012年6月14日至2013年12月31日)

1、华安月安鑫短期理财债券A



2、华安月安鑫短期理财债券B

(2012年6月14日至2013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。

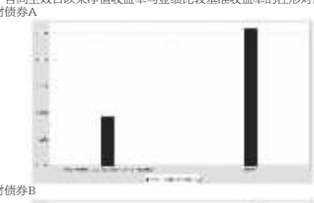
(2)根据《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》和《华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

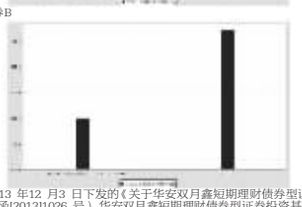
华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金

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



2、华安月安鑫短期理财债券B



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自基金合同生效以来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	-
合计	627,777.06	38,951,189.83	1,796,963.35	41,375,930.24	-

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	-
合计	-	17,550,262.30	1,506,276.31	19,056,538.61	-

§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2013年12月31日,公司旗下共管理了华安领财纯1天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、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(ODII-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		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	2012-6-14	2013-10-8	11年	金融学硕士,11年保险、基金从业经历。曾先后在平安保险资产管理中心、太平人寿投资部从事流动性管理及债券交易工作。2005年8月至2013年10月任职于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月至2013年10月担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金及华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2012年6月至2013年10月同时担任本基金的基金经理。2012年11月至2013年10月同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2013-10-8	-	16年	金融学硕士(金融工程方向),16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。固定收益部助理总监。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。
张晓刚	本基金的基金经理	2013-10-8	-	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《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》、《华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》、《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

2013年欧美经济稳步复苏,股市选创新高。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夯实了消费的基础。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,较高的杠杆和疲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“三驾马车”的结构看,增长主要依靠投资拉动,结构失衡有所加剧。于此同时,中国依靠货币扩张的经济模式和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,即融资平台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,助推了资金价格,使得2013年流动性问题集中爆发。

债券市场的走势可谓是跌宕起伏。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8号文出台治理影子银行;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”,为债市雪上加霜。标杆性的10年国债最高触及4.72%,刷新了近九年来的记录。信用债发行遭遇寒冬,AAA短融全年收益上行超过200BP,5年AAA中票上行超过130BP。

本报告期内,通过审慎和积极的管理,回避了金融市场的风险,把握了月末时点货币市场利率冲高的机会,进行了回购和定存的交易,为投资者赚取了较高收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2013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:5.1674%

期初规模:2.89亿 期末规模:19.30亿

2.华安月安鑫短期理财B

投资回报:5.4181%

期初规模:0.23亿 期末规模:15.73亿

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年欧美经济温和复苏,新兴市场国家结构调整,仍将延续,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,预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者的能力,经济结构转型任重道远。

货币政策和流动性仍是焦点。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酝酿推出,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。债券收益率在去年全面大幅上行之后,部分品种的绝对收益有着较好的投资价值。

操作方面,我们将继续利用资金利率走高的机会,续做回购和定存。权衡收益和流动性进行积极配置,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。

4.7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9,343,108.37元,华安月安鑫短期理财B累计收益分配金额4,092,093.45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(原名华安双月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)有限公司审计,注册会计师徐艳、濮晓达签字出具了安永华明(2014)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

(原名华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金)

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	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	3,503,708,196.58	312,161,826.48
结算备付金	-	54,545.45
存出保证金	-	-
交易性金融资产	-	-
其中:股票投资	-	-
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	-	-
应收利息	3,569,615.34	313,053.73
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,507,277,811.92	312,529,425.66
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	247,492.18	124,461.31
应付托管费	65,997.70	33,189.72
应付销售服务费	97,407.19	96,566.85
应付交易费用	1,036.43	629.85
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	3,303,239.66	220,643.44
递延所得税负债	-	-
其他负债	299,000.00	269,000.00
负债合计	4,014,173.16	744,491.17
所有者权益:		
实收基金	3,503,263,638.76	311,784,934.49
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,503,263,638.76	311,784,934.49
负债和所有者权益总计	3,507,277,811.92	312,529,425.66

注:(1)报告截止日2013年12月31日,基金净值为1.00元,基金份额总额3,503,263,638.76份,其中A类基金份额总额1,930,257,685.76份;B类基金份额总额1,573,005,953.00份。

(2)本基金合同于2012年6月14日生效,上年度可比期间自2012年6月14日至2012年12月31日。

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

(原名华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金)

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年6月14日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	15,245,549.97	56,306,260.35
1.利息收入	15,245,549.97	53,404,099.22
其中:存款利息收入	11,659,018.28	52,593,114.51
债券利息收入	122,506.09	594,039.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,464,025.60	216,944.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-	2,902,161.13
其中:股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,902,161.13
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	1,810,348.15	9,308,993.32
1.管理人报酬	752,447.87	4,242,667.84
2.托管费	200,651.76	1,131,377.97
3.销售服务费	469,054.92	2,496,720.76
4.交易费用	-	-
5.利息支出	-	1,145,269.41
其中:卖出回购金融资产支出	-	1,145,269.41
6.其他费用	388,193.60	292,957.34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	13,435,201.82	46,997,267.03
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	13,435,201.82	46,997,267.03

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

(原名华安双月鑫短期理财债券型证券投资基金)

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2012年6月14日(基金合同生效日)至2012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)	5,527,473,577.18	-	5,527,473,577.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	46,997,267.03	46,997,267.03
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)	-5,215,688,642.69	-	-5,215,688,642.69
其中:1.基金申购款	31,420,055.89	-	31,420,055.89
2.基金赎回款	-5,247,108,698.58	-	-5,247,108,698.58
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)	-	-46,997,267.03	-46,997,267.03
五、期末所有者权益(基金净值)	311,784,934.49	-	311,784,934.49

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:

基金管理公司负责人:李劲,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及下一运作期的集中申购。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国[illegible]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