

华安纳斯达克100指数证券投资基金

[2014] 第一季度报告

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：二〇一四年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人中银基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金托管费的计提情况、基金名称、基金的类别、运作方式、交易时间安排、申购赎回安排、基金合同当事人各方的权利和义务、基金份额持有人的环境保护、基金合同的变更、终止和清算等涉及基金投资人实质内容的条款，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，基金托管人对本报告的内容不负法律责任，但不对基金的投资决策进行复核。

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。

本报告公告的财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	50,801,719.85	76.59
	其中：股票	58,538,006.91	74.97
	优先股	1,263,412.93	1.62
	债券	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
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	18,087,413.33	23.16
8	其他各项资产	192,844.65	0.25
9	合计	58,981,970.80	100.00

投资目标

本基金为股票指数基金，通过严控的指数化投资策略与风险管理，紧密跟踪标的指数，力求实现跟踪误差最小化。

本基金采用完全复制法，按照标的指数的构成及其权重，完全按照规定的投资组合及其投资比例成成分级投资于股票、现金等金融工具，以实现对标的指数的跟踪效果。

本基金在追求长期资本增值的基础上，力争在扣除基金管理费和托管费后的净值增长率超越标的指数收益率10%以上。

本基金在追求长期资本增值的基础上，力争在扣除基金管理费和托管费后的净值增长率不超过49%（以美元定价计算）。

风险收益特征

本基金为股票基金，属较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和收益水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。

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

境外资产账户人英文名称：State Street Bank and Trust Company

境外资产账户人中文名称：美国富国银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)

1.本期已实现收益

1,184,952.16

2.本期利润

836,809.68

3.期间平均基金份额利润

0.0128

4.期末基金资产净值

75,482,050.17

5.期末基金份额净值

1.008

注：1.所有固定收益类指标不包括持有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、赎回费、基金转换费)；其公允价值变动收益水平低于所列数字。

2.本期净资产收益、赎回费用、利息收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.2.1 本期净利得或损失扣除税款后加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 本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

净值增长率为①

净值增长率差额为②

业绩比较基准收益率为③

①③-②④

过去三个月 0.93% 0.67% 1.01% 0.83% -0.08% -0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来以其基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1.本基金于2013年8月2日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》规定，本基金成立后6个月内基金管理人有权根据实际情况决定是否将基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

§ 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

徐宜宣

本基金的基金经理

2013-8-2

7年

管理学硕士，CFA(国际金融分析师)、FRM(金融风险管理师)、7年证券、基金行业从业经验，历任华安基金管理有限公司基金经理助理、量化投资部基金经理，量化分析部和风险管理部等部门负责人。2011年1月加入华安基金管理有限公司，现任华安基金管理有限公司基金经理，负责主动管理型产品的研究工作。2011年5月至2012年12月在上海东亚企业财务部任开放基金产品经理，2012年1月起担任华安纳斯达克100指数证券投资基金基金经理，2013年1月起担任华安货币基金基金经理，2013年6月起担任华安沪深300指数证券投资基金基金经理，2013年12月起担任华安创业板指数证券投资基金基金经理，2014年3月起担任华安纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。

注：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。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同，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取最大利益，不损害基金份额持有人的利益。

4.3 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》，并成立了公平交易小组，制定了公平交易制度，确保各投资组合在投资决策、投资组合的构建、投资时机选择、投资对象选择、投资比例限制、交易时机选择、交易价格等方面得到公平对待。

4.4 报告期内基金的业绩表现

4.4.1 报告期内基金投资组合情况

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

4.4.3 报告期内基金投资组合的回报情况

4.4.4 报告期内基金的费用情况

4.4.5 报告期内基金份额持有人数及资产负债

4.4.6 报告期内基金管理人接受审计的情况

4.4.7 报告期内基金管理人报酬情况

4.4.8 报告期内基金管理人损失情况

4.4.9 报告期内基金管理人余利分配情况

4.4.10 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.11 报告期内基金管理人投资顾问情况

4.4.12 报告期内基金管理人参与股票发行承销情况

4.4.13 报告期内基金管理人投资参股情况

4.4.14 报告期内基金管理人从事其他证券交易情况

4.4.15 报告期内基金管理人投资决策咨询委员会的活动情况

4.4.16 报告期内基金管理人关联交易情况

4.4.17 报告期内基金管理人证券投资活动

4.4.18 报告期内基金管理人未进行估值调整

4.4.19 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.20 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.21 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.22 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.23 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.24 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.25 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.26 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.27 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.28 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.29 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.30 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.31 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.32 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.33 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.34 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.35 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.36 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.37 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.38 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.39 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.40 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.41 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.42 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.43 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.44 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.45 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.46 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.47 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.48 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.49 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.50 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.51 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.52 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.53 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.54 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.55 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.56 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.57 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.58 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.59 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.60 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.61 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.62 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.63 报告期内基金管理人所持基金投资情况

4.4.64 报告期内基金管理人所持基金投资情况