

华安纳斯达克100指数证券投资基金

[2014] 第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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、完整性承担个别连带责任。

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10月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等各项内容，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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

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9月2日
报告期末基金份额总额	33,454,404.95份
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，力争在扣除基金管理费后的净值增长率超越标的指数。
投资策略	本基金将完全复制法，跟踪标的指数，以尽可能地复制指数成分股及指数权重股的涨跌趋势，进行被动式指数化投资。为更准确地实现基金的投资目标，本基金将对成份股的流动性、基金规模等因素进行综合考虑后进行适当的调整。
投资决策	本基金的决策机构是基金管理人。
基金经理	无
基金资产净值	3,724,632.20元
占基金总资产的比例(%)	82.48
其中：普通股	36,214,423.58元
存托凭证	1,029,159.62元
优先股	-
房地产信托	-
2 基金类型	-
3 国债型基金投资	-
4 货币市场基金投资	-
5 债券型基金投资	-
6 资产支持证券	-
7 金融衍生品投资	-
8 其他各项资产	2,859,445.46元
9 合计	45,154,610.61元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1本期已实现收益	971,096.95
2期初利润	1,639,328.37
3加权平均基金份额本期利润	0.0462
4期末基金资产净值	40,746,081.38
5期末基金份额净值	1.018

注:1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时所发生的费用(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2. 本期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,利息收入指报告期利息收入、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,利息收入指报告期利息收入、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。

3.2 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



注:1. 根据《华安纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期不超过6个月。基金管理人在基金合同生效后6个月内使基金的投资组合符合基金合同的有关约定。

§ 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间	说明
徐宜宣	本基金的基金经理	2013-8-2	
		8年	

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员执业行为准则》的相关规定。

4.2 报告期内基金运作合规情况说明

根据中国证监会《证券投资基金监督管理办法》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易制度指导意见》,将开放式基金、特定行业基金、货币市场基金以及其他投资基金的各投资组合合设信息、投资决策过程、公用账户、信息披露、研究分析系统等等方面来确保各投资组合在公平交易方面执行公平交易规则,并根据各投资组合具体执行公平交易规则,同时防范各投资组合因公平交易行为而影响投资绩效。若该业务由公司名义执行与公平交易相关的操作,则由徐宜宣担任。

4.3 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金监督管理办法》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易制度指导意见》,将开放式基金、特定行业基金、货币市场基金以及其他投资基金的各投资组合合设信息、投资决策过程、公用账户、信息披露、研究分析系统等等方面来确保各投资组合在公平交易方面执行公平交易规则,并根据各投资组合具体执行公平交易规则,同时防范各投资组合因公平交易行为而影响投资绩效。若该业务由公司名义执行与公平交易相关的操作,则由徐宜宣担任。

4.4 投资决策制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金监督管理办法》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易制度指导意见》,将开放式基金、特定行业基金、货币市场基金以及其他投资基金的各投资组合合设信息、投资决策过程、公用账户、信息披露、研究分析系统等等方面来确保各投资组合在公平交易方面执行公平交易规则,并根据各投资组合具体执行公平交易规则,同时防范各投资组合因公平交易行为而影响投资绩效。若该业务由公司名义执行与公平交易相关的操作,则由徐宜宣担任。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计纳斯达克指数今年第四季度将有较为乐观的调整,主要原因是对欧洲经济和美联储提前升息的担忧,但随着美国双低利率的出现,我们预计今年对于纳斯达克指数将有坚定的信心。

4.6 报告期内本基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为1.01%,同期业绩比较基准收益率为0.041%,同期业绩比较基准增长率为0.1%。

4.7 投资策略

本基金采用“定期存款+股票”的方式运作,在运作期内,本基金将在坚持长期持有、定期申购和定期赎回的原则的基础上,追求稳健的当期回报。

4.8 投资组合报告

根据中国证监会《证券投资基金监督管理办法》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易制度指导意见》,将开放式基金、特定行业基金、货币市场基金以及其他投资基金的各投资组合合设信息、投资决策过程、公用账户、信息披露、研究分析系统等等方面来确保各投资组合在公平交易方面执行公平交易规则,并根据各投资组合具体执行公平交易规则,同时防范各投资组合因公平交易行为而影响投资绩效。若该业务由公司名义执行与公平交易相关的操作,则由徐宜宣担任。

4.9 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年前三季度,沪深股市呈现震荡上行的态势,创业板指表现较好,整体涨幅较大,而中小板指表现一般,沪指表现相对疲弱,但整体表现仍好于去年。从宏观数据来看,预计2014年宏观经济增长3.0%,其中固定资产投资增长6.0%,GDP增长1.6%,核心CPI上涨1.7%,截止三季度末,我国失业率下降至0.5%,为历年新低。我们认为,新的一年经济形势仍然是科技创新驱动型,所以未来一年对于我们纳斯达克指数抱有坚定的信心。

4.10 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为1.01%,同期业绩比较基准收益率为0.041%,同期业绩比较基准增长率为0.1%。

4.11 备查文件目录

本基金在报告期间没有运用固有资金投资本基金。

§ 5 影响投资者决策的其他重要信息

本基金在报告期间没有运用固有资金投资明基。

5.1 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的债券。

5.2 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的股票。

5.3 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的基金。

5.4 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的贵金属。

5.5 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的保险产品。

5.6 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的期货。

5.7 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的期权。

5.8 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的权证。

5.9 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的外汇。

5.10 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.11 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的信托产品。

5.12 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.13 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.14 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的外汇。

5.15 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.16 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.17 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.18 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.19 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.20 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.21 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.22 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.23 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.24 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.25 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.26 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.27 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.28 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.29 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.30 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.31 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.32 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.33 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.34 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.35 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.36 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.37 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.38 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.39 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.40 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.41 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.42 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.43 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.44 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.45 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.46 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.47 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.48 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.49 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.50 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.51 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.52 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.53 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.54 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.55 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.56 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。

5.57 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的黄金。

5.58 报告期内未购买基金的客户不存在运用固有资金投资的理财产品。