

华安纳斯达克100指数证券投资基金

[2015] 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:二〇一五年四月二十一日

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不存虚假记载、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。

基金托管人对本报告期间基金运作的报告内容、报告书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。

本报告期中财务资料未审计。

§ 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	2013/8/12
报告期末基金份额总额	26,810,496.69份
投资目标	本基金为股票型基金,通过严格的行业配置策略和风险管理,紧密跟踪标的指数,力争在扣除相关费用后实现收益超越标的指数10%的收益。
投资策略	本基金采用完全复制法,即完全复制所选的标的指数,并定期根据标的指数成份股的分红派息情况调整组合,以使基金净值与标的指数的表现尽可能地一致。本基金将定期根据成份股的分红派息情况,对基金的组合进行调整,从而保证基金净值与标的指数的表现尽可能地一致。
业绩比较基准	纳斯达克100指数(Nasdaq 100 Price Index)收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高收益的基本品种,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金等其他类型基金。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	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(2015年1月1日至2015年3月31日)

1.本期已实现收益 282,152.11

2.本期利润 913,871.69

3.加权平均基金份额本期利润 0.0313

4.期末基金份额净值 34,415,994.86

5.期末基金份额净值 1.284

注:1.所列基金业报酬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,基金转换费等),计价费用后实际收益水平要低于列示数字。

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,本期利润为期末已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.07% 0.89% 2.69% 1.02% -0.62% -0.13%

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

华安纳斯达克100指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2013年8月2日至2015年3月31日)



注:根据《华安纳斯达克100指数证券投资基金合同》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1个月内便开始基金的投资组合比例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限	证券从业年限	说明
徐宜宣	本基金的基金经理	2013-8-2	-	8年 管理学硕士,CFA(国际金融分析师)、FRM(金融风险管理师)、SAS证书。曾任职于国泰君安证券研究所,从事金融行业研究工作;2011年1月加入华安基金管理有限公司,现被任命为公司权益投资部基金经理,负责公司旗下所有主动管理型股票基金的管理工作。2012年12月担任正基金经理兼交易部执行总监,2013年1月起担任公司旗下华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年7月1日起担任公司旗下华安上证综指分级基金的基金经理。2013年8月1日起担任公司旗下华安创业板指数分级基金的基金经理。2014年8月1日起担任公司旗下华安纳斯达克100指数证券投资基金(DAX)的基金经理。

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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《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求最大利益,不存在违法或违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

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》,公司制定了“华安基金管理有限公司公平交易制度”,特别对资产管理组合及各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等环节中确保投资决策公平、公正、透明,并形成书面记录,并报监察稽核部存档。在投资环节,公司投资组合作出具体投资决策后,由基金经理向研究组提供研究报告,由研究组向交易执行部门发送投资建议,由交易执行部门根据投资建议制定投资组合,并经基金经理同意后,由交易执行部门实施交易。投资决策由基金经理独立行使,基金经理与其他投资管理人员不得共同行使投资决策权。基金经理在投资决策过程中,不得与他人串通,共同操纵市场价格,损害基金份额持有人的利益。

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》,公司公平交易制度特别规定,在投资决策、交易执行等环节中确保投资决策公平、公正、透明,并形成书面记录,并报监察稽核部存档。在投资环节,公司投资组合作出具体投资决策后,由基金经理向研究组提供研究报告,由研究组向交易执行部门发送投资建议,由交易执行部门根据投资建议制定投资组合,并经基金经理同意后,由交易执行部门实施交易。投资决策由基金经理独立行使,基金经理与其他投资管理人员不得共同行使投资决策权。基金经理在投资决策过程中,不得与他人串通,共同操纵市场价格,损害基金份额持有人的利益。

4.4 公平交易执行的情况

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制度”,特别对资产管理组合及各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等环节中确保投资决策公平、公正、透明,并形成书面记录,并报监察稽核部存档。在投资环节,公司投资组合作出具体投资决策后,由基金经理向研究组提供研究报告,由研究组向交易执行部门发送投资建议,由交易执行部门根据投资建议制定投资组合,并经基金经理同意后,由交易执行部门实施交易。投资决策由基金经理独立行使,基金经理与其他投资管理人员不得共同行使投资决策权。基金经理在投资决策过程中,不得与他人串通,共同操纵市场价格,损害基金份额持有人的利益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

我们预计纳斯达克指数基金在2015年将继续保持良好的投资收益。美国经济进一步走强的信号将

持续显现,并进一步体现在企业盈利中。从基本面来看,美国科技股估值仍然合理,创新能力和成长性依旧值得肯定。

作为纳斯达克100指数基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪误差,同时通过定期评估和调整组合,努力使基金的收益与标的指数的收益相拟合。

4.6 报告期内本基金持有人数或基金份额资产净值均未发生重大变动。

1.本报告期末本基金持有人数或基金份额资产净值均未发生重大变动。

2.本基金报告期(2015年1月1日至2015年3月31日)基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

5.5 投资组合报告

持续显现,并进一步体现在企业盈利中。从基本面来看,美国科技股估值仍然合理,创新能力和成长性依旧值得肯定。

作为纳斯达克100指数基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪误差,同时通过定期评估和调整组合,努力使基金的收益与标的指数的收益相拟合。

4.7 报告期内本基金没有发生重大关联交易。

4.8 报告期内本基金没有发生重大诉讼。

4.9 报告期内本基金没有进行托管费计提。

4.10 报告期内本基金没有进行份额折算。

4.11 报告期内本基金没有进行收益分配。

4.12 报告期内本基金没有进行申购赎回。

4.13 报告期内本基金没有进行定期定额投资。

4.14 报告期内本基金没有进行巨额赎回。

4.15 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.16 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.17 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.18 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.19 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.20 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.21 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.22 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.23 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.24 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.25 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.26 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.27 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.28 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.29 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.30 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.31 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.32 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.33 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.34 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.35 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.36 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.37 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.38 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.39 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.40 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.41 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.42 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.43 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.44 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.45 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.46 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.47 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.48 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.49 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.50 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.51 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.52 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.53 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.54 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.55 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.56 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.57 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.58 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.59 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.60 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.61 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.62 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.63 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.64 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.65 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.66 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.67 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.68 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.69 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.70 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.71 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.72 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.73 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.74 报告期内本基金没有进行定期定额申购。

4.75 报告期内本基金没有进行定期定额转换。

4.76 报告期内本基金没有进行定期定额赎回。

4.77 报告期内本基金没有进行定期定额申购。