华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

[2015] 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月22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2015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	华安季季鑫短期理财债券	
基金主代码	040030	
交易代码	040030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月23日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,047,844.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
下属分级基金的交易代码	040030	040031
报告期末下属分级基金的份额总额	24,047,844.93份	5,000,000.00份

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。集中申购期内,本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	洪渊
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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	2015年		2014年		2013年	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
本期已实现收益	966,214.55	144,482.26	3,184,017.96	214,985.60	7,831,055.08	6,067,027.23
本期利润	966,214.55	144,482.26	3,184,017.96	214,985.60	7,831,055.08	6,067,027.23
本期净值收益率	2.6435%	2.9196%	4.0897%	4.3690%	4.5390%	4.8176%
3.1.2期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
期末基金资产净值	24,047,844.93	5,000,000.00	43,613,943.28	5,000,000.00	89,355,868.67	5,000,000.00
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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,由于短期理财债券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. 华安季季鑫短期理财债券A:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3357%	0.0004%	-	-	-	-
过去六个月	0.7633%	0.0007%	-	-	-	-
过去一年	2.6435%	0.0032%	-	-	-	-
过去三年	11.6902%	0.0067%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	14.0578%	0.0090%	-	-	-	-

2. 华安季季鑫短期理财债券B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.4038%	0.0004%	-	-	-	-
过去六个月	0.9001%	0.0007%	-	-	-	-
过去一年	2.9196%	0.0032%	-	-	-	-
过去三年	12.5903%	0.0067%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.1637%	0.0090%	-	-	-	-

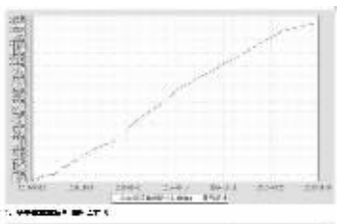
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

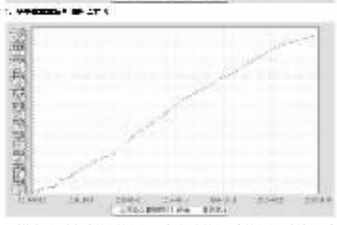
华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年5月23日至2015年12月31日)

1、华安季季鑫短期理财债券A





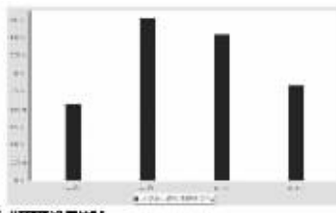
注:根据《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金合同》规定,本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

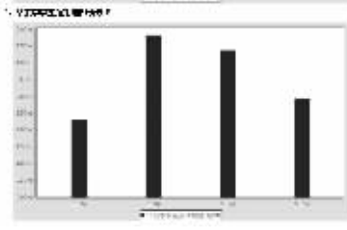
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、华安季季鑫短期理财债券A





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

华安季季鑫短期理财债券A:

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
2013年	2,148,455.68	5,809,776.26	-127,176.86	7,831,055.08	-
2014年	1,149,451.43	2,046,335.00	-11,768.48	3,184,017.95	-
2015年	406,269.93	569,954.11	-10,009.49	966,214.55	-
合计	3,704,177.04	8,426,065.37	-148,954.83	11,981,287.58	-

华安季季鑫短期理财债券B:

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
2013年	-	6,068,610.36	-1,583.13	6,067,027.23	-
2014年	-	215,034.72	-49.12	214,985.60	-
2015年	-	145,532.71	-1,050.45	144,482.26	-
合计	-	6,429,177.79	-2,682.70	6,426,495.09	-

§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2015年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、华安上证龙头企业ETF联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证300指数(LOF)、华安科技动力混合、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头(DAX)ETF、华安国际龙头(DAX)ETF联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板50指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等71只开放式基金。管理资产规模达到1558.45亿元人民币。

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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2013-10-08	-	18年	金融学硕士(金融工程方向),18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。2010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、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年7月起同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015年2月起担任华安年年益定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起担任固定收益部总监。2015年5月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年9月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	-	8年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,8年基金行业从业经历。2007年7月应届生毕业进入华安基金,历任金融工程风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月起同时担任本基金、华安汇财通货币市场基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安双债添利债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新回报灵活配置混合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《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金合同》、《华安季季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、交易执行等方面全面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,使用最会发言、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,集中报送交易所,投资组合经理以公平原则进行申报。若该业务属于定向发行,则按照公司内部制定的投资决策委员会、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