华安沪深300指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2017年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安沪深300指数分级
场内简称	华安300
基金主代码	160417
交易代码	160417
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月25日
报告期末基金份额总额	210,344,923.15份
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。跟踪标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差,追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,华安沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;华安沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。
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

下属分级基金的基金简称	华安沪深300指数分级A	华安沪深300指数分级B	华安沪深300指数分级
下属分级基金的场内简称	HS300A	HS300B	华安300
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	4,984,778.00份	4,984,778.00份	200,375,367.15份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	5,605,991.80
2.本期利润	17,432,947.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0835
4.期末基金资产净值	284,704,553.46
5.期末基金份额净值	1.3535

注:1.所述基金业绩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、红利再投资、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

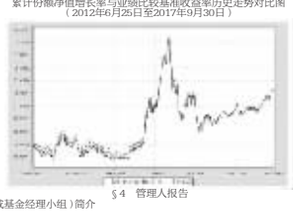
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差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	6.41%	0.56%	4.40%	0.56%	2.01%	0.00%

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

华安沪深300指数分级证券投资基金
累计净值份额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25日至2017年9月30日)



§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
		任职日期	离任日期		
钱晶	本基金的基金经理	2015-05-28	-	6年	硕士,6年证券、基金行业从业经验,曾任国信证券分析师。2014年12月加入华安基金,任指数投资部量化分析师。2015年5月起担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理。2015年8月起担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2016年8月起,同时担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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《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

4.3.1 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》,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、发送邮件、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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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,出现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%的次数为1次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,全球经济周期延续回升态势,贸易形势改善。美国经济维持复苏态势,居民消费稳健增长,通胀回升,失业率进一步下滑。9月美联储议息会议维持原利率区间,12月加息概率抬升;欧元区经济基本面好转,信贷环境改善,通胀逐步回升,欧央行考虑货币政策正常化的同时关注汇率对经济增长的影响;日本通胀超预期,制造业PMI上行,经济复苏动力增强,国内经济方面,工业生产和工业企业利润增速有所回落,制造业、房地产和基建投资放缓,仍表现出较强韧性,通胀表现温和;央行在流动性管理方面继续通过公开市场操作和MLF续作等方式来维稳资金面波动,临近季末,资金利率波动有所加大。9月30日,央行根据国务院部署,公布定向降准具体部署,改善市场情绪。由于货币政策稳健中性和经济基本面的较强韧性,三季度十年期国债维持3.6%收益中枢窄幅震荡,3Y-5Y期AAA级中短期票据震荡上行10bp左右,信用利差有所扩大。

本报告期内,合理安排组合久期,主要投资于利率较高的同业存款和同业存单,同时把握机会,配置银行间逆回购以获得可观的持有收益。组合整体在有效控制流动性风险的前提下,保证了适中的整体收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

华安季季鑫短期理财债券A:

投资回报:1.0708%

华安季季鑫短期理财债券B:

投资回报:1.1430%

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,政策控风险和金融去杠杆基调预计将维持不变,工业生产受供给侧改革与环保督查等影响难有显著改善,多个城市房地产调控政策继续升级,销售增速的下行带来投资增速的回落压力,叠加基建的资金约束进一步凸显,投资增速将拖累经济增长,而今年的贸易复苏呈现全球性和结构性,对经济增长有一定支撑,经济整体失速风险较小。全年来看,通胀预计维持温和,不会对货币政策构成较大压力,预计央行仍将定调稳健中性。债市影响因素边际上将有所改善,中长久期品种收益存在一定的下行空间。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握结构性机会,主要通过锁定高收益同业存款和甄选优质同业存单博取较高的持有收益,提高组合整体收益,为投资者创造更多价值。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报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	269,608,265.24	94.50
	其中:股票	269,608,265.24	94.50
2	固定收益投资	126,492.40	0.04
	其中:债券	126,492.40	0.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	15,519,581.13	5.44
7	其他各项资产	59,478.70	0.02
8	合计	285,313,817.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	32,102.99	0.01
C	制造业	2,297,105.58	0.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	73,585.60	0.03
F	批发和零售业	49,685.69	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	161,326.11	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,584.24	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	76,842.72	0.03
M	科学研究和技术服务业	226,970.32	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	51,243.66	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	111,126.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	189,196.74	0.07
S	综合	-	-
	合计	3,439,804.08	1.21

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	732,248.58	0.26
B	采矿业	8,589,896.52	3.02
C	制造业	96,375,322.77	33.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,628,523.40	2.33
E	建筑业	11,706,420.07	4.11
F	批发和零售业	5,572,716.82	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	7,724,265.04	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,309,206.95	4.67
J	金融业	93,355,768.00	32.79
K	房地产业	13,641,599.95	4.79
L	租赁和商务服务业	2,314,569.52	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,945,718.73	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	505,197.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	2,972,052.65	1.04
S	综合	794,956.16	0.28
	合计	266,168,461.16	93.49

5.2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	266,431	14,429,902.96	5.07
2	600036	招商银行	253,803	6,484,666.65	2.28
3	600519	贵州茅台	12,433	6,435,818.12	2.26
4	601166	兴业银行	306,524	5,299,799.96	1.86
5	000333	美的集团	111,253	4,916,270.07	1.73
6	600016	民生银行	581,506	4,663,678.12	1.64
7	000651	格力电器	118,352	4,485,540.80	1.58
8	000002	万 科A	167,295	4,391,493.75	1.54
9	601328	交通银行	675,648	4,270,095.36	1.50
10	600887	伊利股份	149,421	4,109,077.50	1.44

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600666	奥瑞德	18,880	328,512.00	0.12
2	300699	光威复材	4,292	307,264.28	0.11
3	601326	秦港股份	17,076	135,754.20	0.05
4	601949	中国出版	12,079	117,407.88	0.04
5	603882	金域医学	2,663	111,126.99	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	126,492.40	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	126,492.40	0.04

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	1,010	126,492.40	0.04

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	51,411.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,926.12
5	应收申购款	5,140.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,478.70

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600666	奥瑞德	328,512.00	0.12	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安沪深300指数分级A	华安沪深300指数分级B	华安沪深300指数分级
本报告期期初基金份额总额	7,763,146.00	7,763,146.00	188,703,427.43
报告期基金总申购份额	-	-	19,675,212.78
减:报告期基金总赎回份额	-	-	13,560,009.06
报告期基金拆分变动份额	-2,778,368.00	-2,778,368.00	5,556,736.00
本报告期期末基金份额总额	4,984,778.00	4,984,778.00	200,375,367.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无.

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无.

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170930	185,340,353.83	-	-	185,340,353.83	88.11%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同》

2、《华安沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》

3、《华安沪深300指数分级证券投资基金托管协议》

10.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一七年十月二十五日

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2017年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安季季鑫短期理财债券
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	7,648,360,046.05份
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稳定。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。
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

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	110,360,046.05份	7,538,000,000.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	华安季季鑫短期理财债券A	华安季季鑫短期理财债券B
1.本期已实现收益	2,108,271.77	56,531,325.24
2.本期利润	2,108,271.77	56,531,325.24
3.期末基金资产净值	110,360,046.05	7,538,000,000.00

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 本报告期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	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	1.0708%	0.0024%	-	-	-	-

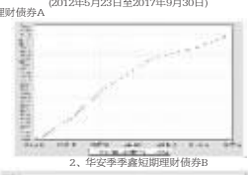
2、华安季季鑫短期理财债券B:

阶段	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	1.1430%	0.0023%	-	-	-	-

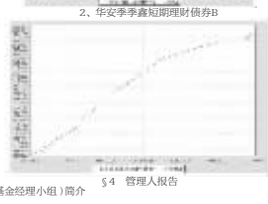
3.2.2日基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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6月23日至2017年9月30日)

1、华安季季鑫短期理财债券A



2、华安季季鑫短期理财债券B



§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
		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	2017-07-31	20年	金融学硕士(金融工程方向),20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月至2017年6月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月至2017年7月,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月至2017年7月,同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015年2月至2017年6月担任华安年年盈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月至2017年7月,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月至2017年7月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月起,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安新活力灵活配置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	2017-07-31	10年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,10年基金行业从业经历。2007年7月应届生毕业进入华安基金,历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月至2017年7月同时担任本基金、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11月起,同时担任华安汇财通货币市场基金、华安双债添利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。2016年4月起,同时担任华安安福保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月起,同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
李邦长	本基金的基金经理	2016-03-02	-	7年	硕士研究生,具有基金从业资格证书,曾任安永华明会计师事务所审计师。2010年3月加入华安基金管理有限公司,先后从事基金运营、债券交易和债券研究等工作。2014年9月起担任基金经理助理。2016年3月起担任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、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2016年11月起,同时担任华安鼎丰债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。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《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

4.3.1 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》,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、发送邮件、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,则投资部门在风控部门的监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理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。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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,出现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%的次数为1次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,全球经济周期延续回升态势,贸易形势改善。美国经济维持复苏态势,居民消费稳健增长,通胀回升,失业率进一步下滑。9月美联储议息会议维持原利率区间,12月加息概率抬升;欧元区经济基本面好转,信贷环境改善,通胀逐步回升,欧央行考虑货币政策正常化的同时关注汇率对经济增长的影响;日本通胀超预期,制造业PMI上行,经济复苏动力增强,国内经济方面,工业生产和工业企业利润增速有所回落,制造业、房地产和基建投资放缓,仍表现出较强韧性,通胀表现温和;央行在流动性管理方面继续通过公开市场操作和MLF续作等方式来维稳资金面波动,临近季末,资金利率波动有所加大。9月30日,央行根据国务院部署,公布定向降准具体部署,改善市场情绪。由于货币政策稳健中性和经济基本面的较强韧性,三季度十年期国债维持3.6%收益中枢窄幅震荡,3Y-5Y期AAA级中短期票据震荡上行10bp左右,信用利差有所扩大。

本报告期内,合理安排组合久期,主要投资于利率较高的同业存款和同业存单,同时把握机会,配置银行间逆回购以获得可观的持有收益。组合整体在有效控制流动性风险的前提下,保证了适中的整体收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

华安季季鑫短期理财债券A:

投资回报:1.0708%

华安季季鑫短期理财债券B:

投资回报:1.1430%

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,政策控风险和金融去杠杆基调预计将维持不变,工业生产受供给侧改革与环保督查等影响难有显著改善,多个城市房地产调控政策继续升级,销售增速的下行带来投资增速的回落压力,叠加基建的资金约束进一步凸显,投资增速将拖累经济增长,而今年的贸易复苏呈现全球性和结构性,对经济增长有一定支撑,经济整体失速风险较小。全年来看,通胀预计维持温和,不会对货币政策构成较大压力,预计央行仍将定调稳健中性。债市影响因素边际上将有所改善,中长久期品种收益存在一定的下行空间。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,优化组合资产配置计划,把握结构性机会,主要通过锁定高收益同业存款和甄选优质同业存单博取较高的持有收益,提高组合整体收益,为投资者创造更多价值。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报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,351,387,170.39	68.56
	其中:债券