

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 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
报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

§ 1 重要提示及目录

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 2013 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。

本报告期自 2012 年 5 月 23 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
§2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	8
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6	审计报告.....	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	15
6.2	注册会计师的责任.....	15
6.3	审计意见.....	15
§7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注.....	18
§8	投资组合报告.....	31
8.1	期末基金资产组合情况.....	31
8.2	债券回购融资情况.....	31
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	31
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
8.5	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	32
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	32
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	32
8.8	投资组合报告附注.....	32

§9	基金份额持有人信息.....	33
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	33
§10	开放式基金份额变动.....	33
§11	重大事件揭示.....	34
11.1	基金份额持有人大会决议.....	34
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	34
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	34
11.4	基金投资策略的改变.....	34
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	35
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	35
11.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	37
11.9	其他重大事件.....	37
§12	备查文件目录.....	41
12.1	备查文件目录.....	41
12.2	存放地点.....	41
12.3	查阅方式.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金	
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	278,699,567.32 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	273,699,567.32 份	5,000,000 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	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李勃	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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	2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 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
本期已实现收益	27,159,459.18	3,191,453.63
本期利润	27,159,459.18	3,191,453.63
本期基金份额净值收益率	2.1204%	2.2863%
3.1.2 期末数据和指标	2012 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
期末基金资产净值	273,699,567.32	5,000,000.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012 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
基金份额累计净值收益率	2.1204%	2.2863%

注：1、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。

2、本基金于 2012 年 5 月 9 日成立，截至本报告期末，本基金成立未满一年。

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	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	0.9541%	0.0163%	-	-	-	-
过去六个月	1.7966%	0.0172%	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	2.1204%	0.0157%	-	-	-	-

2. 华安季季鑫短期理财债券 B

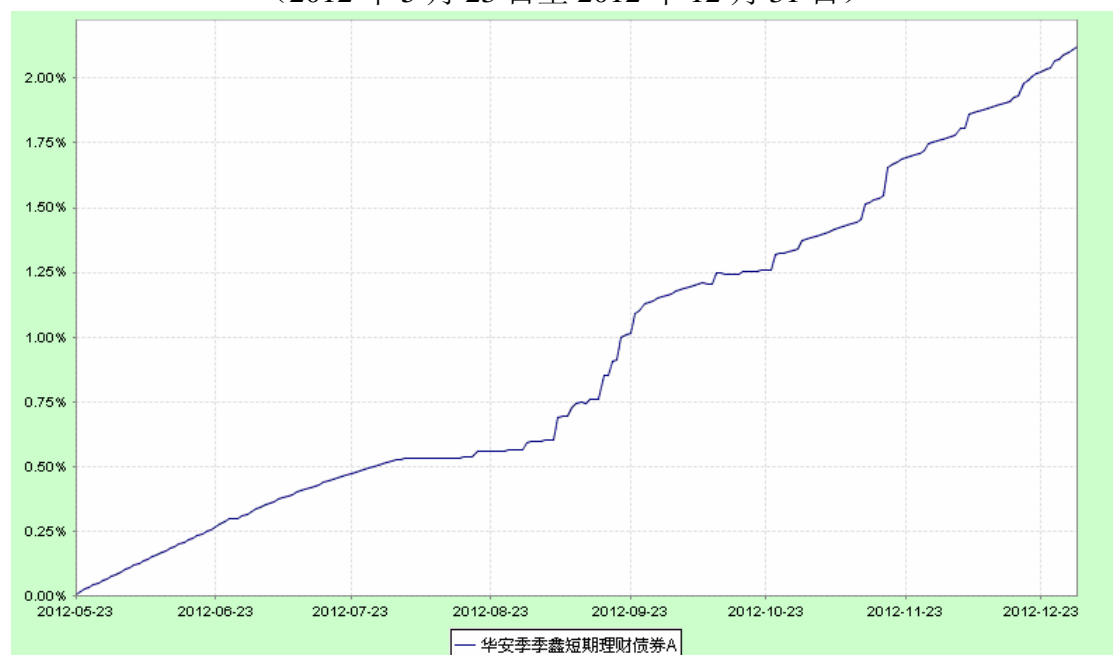
阶段	份额净值 收益率①	净值收益 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.0227%	0.0163%	-	-	-	-
过去六个月	1.9349%	0.0172%	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	2.2863%	0.0157%	-	-	-	-

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
份额累计净值增长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 2012 年 12 月 31 日)

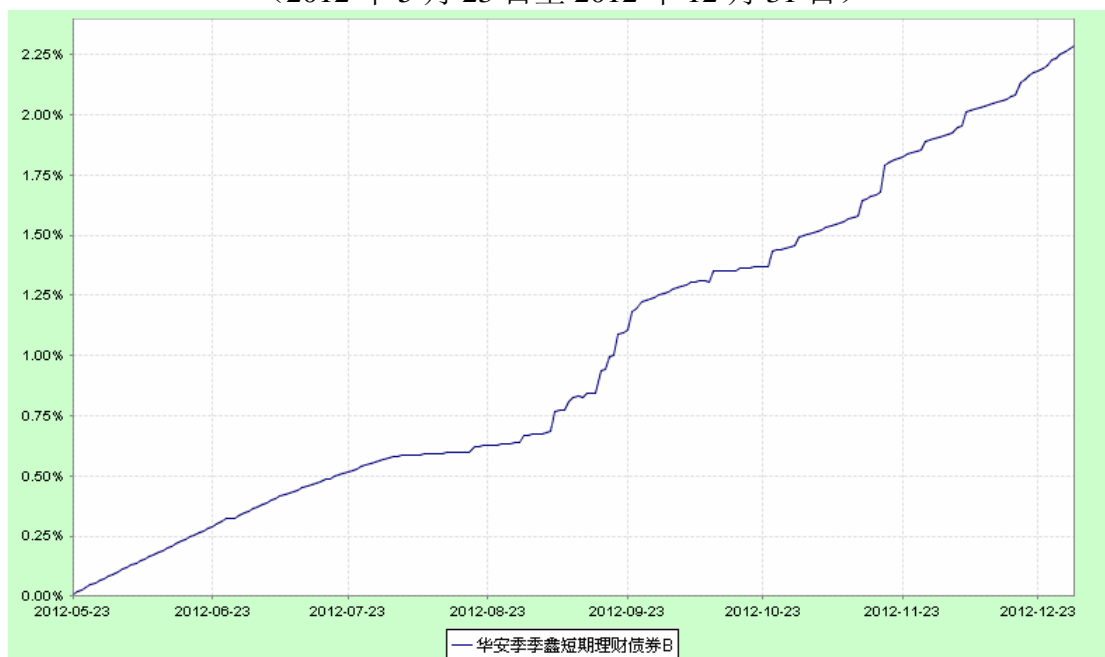
1、华安季季鑫短期理财债券 A

(2012 年 5 月 23 日至 2012 年 12 月 31 日)



2、华安季季鑫短期理财债券 B

(2012 年 5 月 23 日至 2012 年 12 月 31 日)



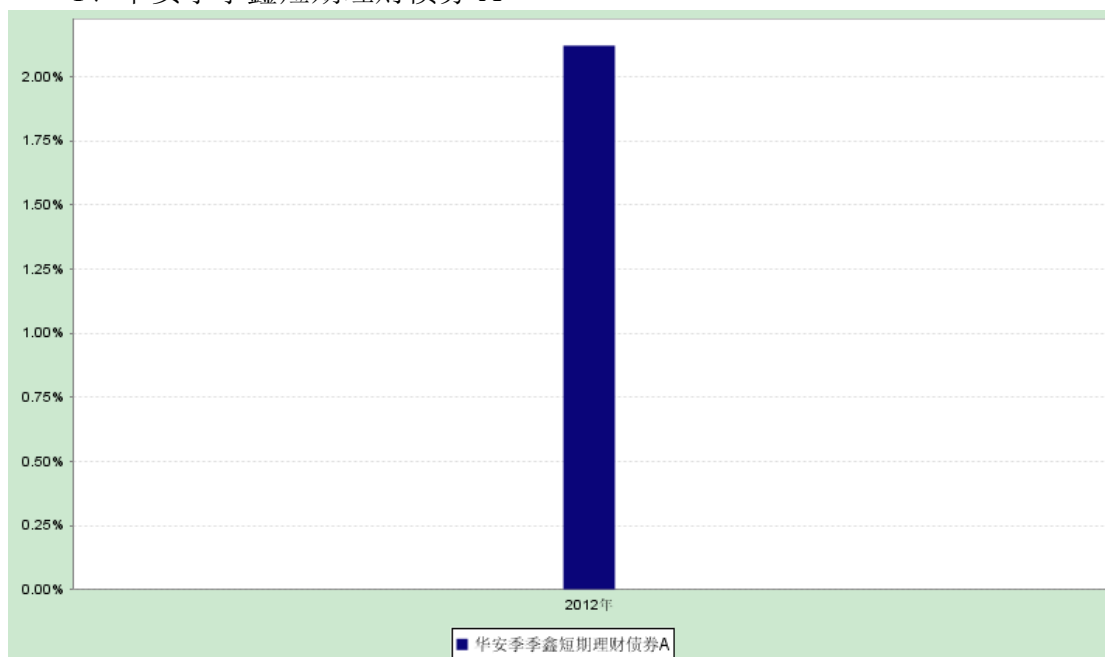
注：本基金于 2012 年 5 月 23 日成立，截至报告期末本基金成立未满一年。根据《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的 10 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

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

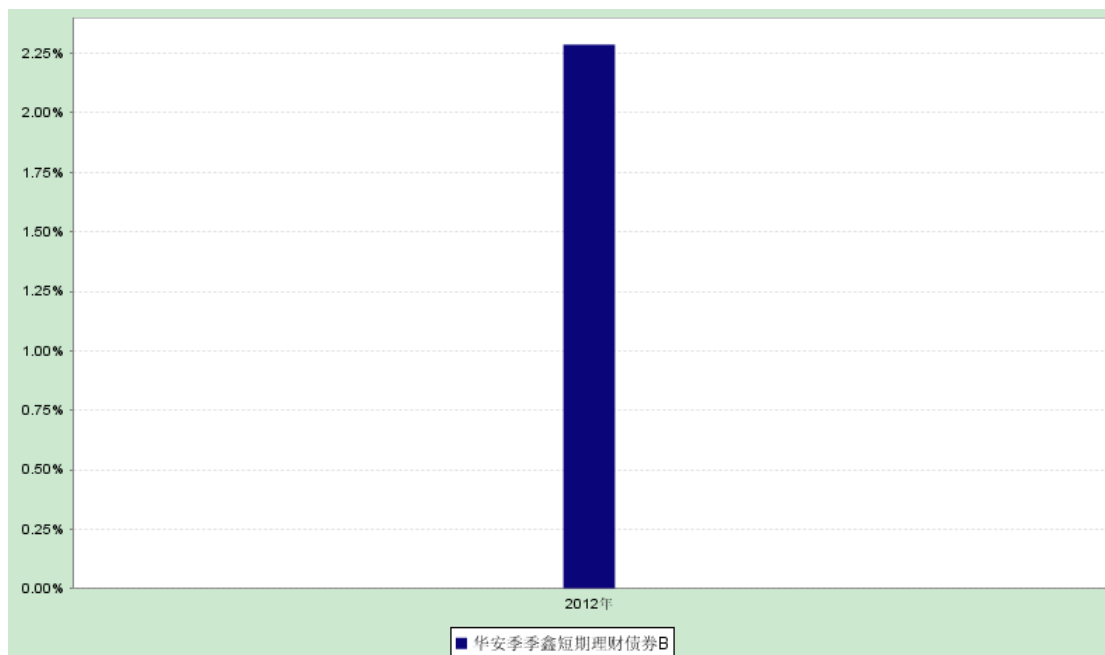
华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

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



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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、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
2012 年	3,639,671.20	23,369,716.87	150,071.11	27,159,459.18	-
合计	3,639,671.20	23,369,716.87	150,071.11	27,159,459.18	-

2、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
2012 年	-	3,188,460.06	2,993.57	3,191,453.63	-
合计	-	3,188,460.06	2,993.57	3,191,453.63	-

注：本基金于 2012 年 5 月 23 日成立，截至报告期末本基金成立未满一年。

§ 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 2012 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，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、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、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、华安双月月鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、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、华安信用增强债券等 34 只开放式基金。管理资产规模达到 955.90 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		
杨柳	本基金的基金经理	2012-05-23	-	10 年	金融学硕士，10 年保险、基金从业经历。曾先后在平安保险资产营运中心、太平人寿投资部从事流动性管理及债券交易工作。2005 年 8 月加入华安基金管理有限公司，任集中交易部高级交易员。2009 年 12 月至 2012 年 11 月担任华安现金富利投资基金的基金经理助理。2012 年 5 月起担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金及本基金的基金经理，2012 年 6 月起同时担任华安双月月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月起同时担任华安现金富利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合规守信情况的说明

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，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 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，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% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年美国的经济持续缓慢增长，就业市场恢复缓慢。欧元区经济增速大幅放缓，甚至呈现衰退迹象，主要源于全球需求降低、债务危机导致的消费者信心下降、金融市场不景气、主要国家财政紧缩政策导致的内部需求下降以及部分国家政局不稳等因素。为了缓解金融市场和政府债务危机，提振投资者信心，2012 年美、欧、日央行进一步释放流动性，其中包括 2 月份欧央行实施了第二轮长期再融资操作，以及 9 月份美联储推出了 QE3 计划、欧央行推出购买主权债计划、日央行增加资产购买规模。

中国经济在外部环境偏紧的情况下，2012 年前三季度经济增速不断回落，进入四季度，出口反弹和实际消费支出的强劲增长带动 GDP 强劲反弹。2012 年通货膨胀水平在第三季度触底反弹，温和回升。2012 年外汇占款增量大幅下滑，广义货币增长显著走弱。央行实施稳健的货币政策，根据形势变化适时适度进行预调微调。上半年央行灵活开展公开市场操作，通过不同期限的正、逆回购调节货币市场流动性。下调存款准备金率两次，降低存贷款基准利率一次，以引导货币信贷的适度增长，稳定经济形势。7 月初在央行进行了年内第二次降息之后，主要通过公开市场操作向市场注入流动性。货币市场利率中枢持续回落，仍存在季节性波动。3 月 Shibor 利率从年初的 5.46% 下降到期末的 3.90%，一年央票二级市场利率从年初的 3.47% 下降到期末的 3.00%。受经济增速和通货膨胀低位运行、货币政策以及流动性改善等利好因素的影响，2012 年债券市场，主要是信用债市场，呈现出牛市格局。

在上述环境下，本基金抓住有利时机，积极操作，在货币市场利率脉冲走高时开展定期存款、回购等业务，提高组合的收益性。

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收益率及规模变化：

1、华安季季鑫短期理财 A

投资回报：2.1204%

期初规模：46.90 亿 期末规模：2.74 亿

2、华安季季鑫短期理财 B

投资回报：2.2863%

期初规模：8.37 亿 期末规模：0.05 亿

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济方面，经济复苏仍将是缓慢而疲弱的，预期美国在采取新的财政紧缩的同时，将可能实施大幅宽松的货币政策。债务上限、“财政悬崖”问题仍不可忽视。欧元区信贷持续低迷，经济增长难见好转，欧元区债务危机依然可能再次出现，由此产生的政治分歧很可能引发新一轮的政治、社会问题，从而拖累整个欧元区经济。

国内经济方面，预期 2013 年上半年宏观经济增速略有回升，通胀水平维持低位。中央经济工作会议提到适当扩大社会融资规模的同时，强调切实降低实体经济发展的融资成本，这意味着明年的货币政策总体仍是中性偏松的，即债券供给增加的同时将保证市场利率水平不出现明显回升。预计上半年央行将继续保持稳健的货币政策，资金面稳中略松，整体流动性将有所改善，债券市场整体上维持乐观态度。但下半年债券市场的不确定性来源于经济走势和资金面的变数，而经济形势走势决定着未来外资是否继续流入以及货币政策的方向。可以预见的是，在“两会”结束后，随着几个主要金融监管部门的人事调整的结束，宏观政策走向将会逐渐明确，尤其要关注的是管理层对影子银行业务规模可能的限制政策、房地产调控进一步细则出台的情况、二季度之后信贷规模投放的变化，这些因素对下半年以及今后一段时间里的宏观经济形势走势的判断至关重要。

根据上述基本判断，本基金将比较短期融资券、回购和定期存款等各类资产的收益水平，进行合理配置，力争为持有人提供安全高效、有竞争力的理财品种。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司从维护基金份额持有人利益，保障基金合规运作出发，强化公司制度流程的落实，合规监察稽核部对公司产品开发、基金投资、基金销售、后台运行、员工行为的合规性进行定期和不定期检查，根据相关法规的变化和业务发展的需要，深化员工的合规意识，推动公司内部风险控制机制的完善与优化。监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，坚守“三条底线”，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密等方面的合规培训和检查，保持公司良好的内控环境和合规文化。

(2) 进一步提高在新基金产品开发、新投资品种、新业务推进中法律、合规及风险控制方面的支持力度，加强了对新产品的风险评估。

(3) 坚持做好投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司首席投资官。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任投资研究部总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF（国际数量金融工程师）。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理，指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本报告期华安季季鑫短期理财 A 累计收益分配金额 27,159,459.18 元，华安季季鑫短期理财 B 累计收益分配金额 3,191,453.63 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年，本基金托管人在对华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年，华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和、基金利润分配、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2013）审字第 60971571_B02 号
华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表和 2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华安基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 徐艳 濮晓达
北京市东城区
东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16 层
2013-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金
报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	276,073,156.20

结算备付金		15,909.09
存出保证金		138,392.87
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	203,313.54
应收股利		-
应收申购款		3,543,676.64
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		279,974,448.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬	7.4.10.2	346,300.60
应付托管费	7.4.10.2	102,607.36
应付销售服务费		355,733.75
应付交易费用	7.4.7.7	8,174.63
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		153,064.68
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	309,000.00
负债合计		1,274,881.02
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	278,699,567.32
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		278,699,567.32
负债和所有者权益总计		279,974,448.34

注：（1）报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金净值为 1.00 元，基金份额总额 278,699,567.32 份，其中 A 类基金份额总额 273,699,567.32 份；B 类基金份额总额 5,000,000.00 份。

(2) 本基金合同于 2012 年 5 月 23 日生效。

7.2 利润表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至 2012年12月31日
一、收入		37,482,762.44
1.利息收入		36,080,261.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	32,858,796.41
债券利息收入		2,441,383.30
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		780,081.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,398,334.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	1,398,334.43
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,166.67
减：二、费用		7,131,849.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2	2,520,805.51
2. 托管费	7.4.10.2	746,905.20
3. 销售服务费		2,357,250.72
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		1,153,697.37
其中：卖出回购金融资产支出		1,153,697.37
6. 其他费用	7.4.7.19	353,190.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,350,912.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,350,912.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,526,551,295.11	-	5,526,551,295.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,350,912.81	30,350,912.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,247,851,727.79	-	-5,247,851,727.79
其中：1.基金申购款	190,445,740.08	-	190,445,740.08
2.基金赎回款	-5,438,297,467.87	-	-5,438,297,467.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-30,350,912.81	-30,350,912.81
五、期末所有者权益（基金净值）	278,699,567.32	-	278,699,567.32

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2012】539 号《关于核准华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人于 2012 年 5 月 14 日到 2012 年 5 月 21 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2012）验字第 60971571_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012 年 5 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 5,525,797,098.38 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 754,196.73 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 5,526,551,295.11 元，折合 5,526,551,295.11 份基金份额。本基金以“运作期滚动”方式运作。自基金合同生效日起，本基金在运作期内不开放日常申购与赎回，仅在运作期最后 1 日开放当期赎回。每个运作期结束后，本基金将安排一个集中申购期，开放下一运作期的集中申购。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量，对基金份额持有人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别：

A 类基金份额和 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 A 类基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。若基金份额持有人在单个基金交易账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金交易账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。

本基金投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、银行定期存款、大额存单、债券回购、短期融资券、国债、中央银行票据、金融债、中期票据、企业债及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）起至 2012 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入

损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率逐日计提；

(3) A 类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值 0.28% 的年费率逐日计提；B 类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额对应的可分配收益将有所不同，同类每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按人民币 1.00 元的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金根据每个运作期的基金收益情况，在每个运作期末将当期收益全部分配；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按人民币 1.00 元的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(5) 投资人在每个运作期末收益支付时，若期末收益为正值，则根据投资人选择的收益分配方式进行现金分红或为投资人增加相应的基金份额；若其期末收益为负值，则缩减投资人相应的基金份额或赎回金额；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	6,073,156.20
定期存款	270,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	270,000,000.00
其他存款	-
合计	276,073,156.20

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产余额。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应收活期存款利息	14,624.03
应收定期存款利息	188,680.60
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7.92
应收债券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.99
其他	-
合计	203,313.54

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	8,174.63
合计	8,174.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	60,000.00
预提信息披露费	240,000.00
预提账户维护费	9,000.00
合计	309,000.00

7.4.7.9 实收基金

华安季季鑫短期理财债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	4,689,974,322.86	4,689,974,322.86
本期申购	148,445,740.08	148,445,740.08
本期赎回（以“-”号填列）	-4,564,720,495.62	-4,564,720,495.62
本期末	273,699,567.32	273,699,567.32

华安季季鑫短期理财债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	836,576,972.25	836,576,972.25
本期申购	42,000,000.00	42,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-873,576,972.25	-873,576,972.25
本期末	5,000,000.00	5,000,000.00

注：（1）申购含红利再投和 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级

而增加的基金份额，赎回含 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而减少的基金份额。

(2) 本基金合同于 2012 年 5 月 23 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 5,525,797,098.38 元，折合 5,525,797,098.38 份基金份额。募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 754,196.73 元，折合 754,196.73 份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币 5,526,551,295.11 元，折合 5,526,551,295.11 份基金份额，其中 A 类基金份额 4,689,974,322.86 份，B 类基金份额 836,576,972.25 份。

7.4.7.10 未分配利润

华安季季鑫短期理财债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	27,159,459.18	-	27,159,459.18
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-27,159,459.18	-	-27,159,459.18
本期末	-	-	-

华安季季鑫短期理财债券 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,191,453.63	-	3,191,453.63
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,191,453.63	-	-3,191,453.63
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日
活期存款利息收入	193,550.12
定期存款利息收入	32,662,708.10
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	646.37
其他	1,891.82
合计	32,858,796.41

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	852,030,757.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	810,429,073.67
减：应收利息总额	40,203,349.53
债券投资收益	1,398,334.43

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日
基金赎回费收入	-
其他收入	4,166.67
合计	4,166.67

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	240,000.00
账户维护费	18,500.00
银行汇划费用	34,690.83
合计	353,190.83

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气（集团）总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,520,805.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,216,460.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个运作期结束月末，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月23日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	746,905.20

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个运作期结束月末，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年5月23日（基金合同生效日）至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安季季鑫短期理财债券 A	华安季季鑫短期理财债券 B	合计
华安基金管理有限公司	8,879.79	739.62	9,619.41
工商银行	2,008,884.54	8,166.42	2,017,050.96
合计	2,017,764.33	8,906.04	2,026,670.37

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.28%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times \text{各类基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日各类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日的各类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个运作期结束月末，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于每个运作期结束后次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期 2012 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	116,599,977.60	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2012 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	86,073,156.20	8,147,821.06

注：当期利息收入包括活期存款利息收入和定期存款利息收入。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

1、华安季季鑫短期理财债券 A

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
3,639,671.20	23,369,716.87	150,071.11	27,159,459.18	-

2、华安季季鑫短期理财债券B

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
-	3,188,460.06	2,993.57	3,191,453.63	-

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和

定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具,通过特定的风险量化指标、模型,形成常规的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行,并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选,因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险;在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

由于本基金运作期内封闭,在每个运作期结束前公布下一运作期的具体时间安排,滚动运作,针对定期开放时兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人会在运作期内保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。

在运作期内,本基金投资的各类金融工具的到期日不得晚于该运作期的最后一日;本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 40%;本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 5%;本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例,合计不得超过基金资产净值的 10%;本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利

率风险。本基金的基金管理人在运作期内对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的定期存款由于事先协定利率，对市场利率波动不敏感，但存在定期存款存期超过运作期的情况，如提前支取会存在一定利息损失，但由于比例控制均在基金可控范围之内，故相关风险较小。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	276,073,156.20	-	-	-	276,073,156.20
结算备付金	15,909.09	-	-	-	15,909.09
存出保证金	-	-	-	138,392.87	138,392.87
应收利息	-	-	-	203,313.54	203,313.54
应收申购款	22,800.00	-	-	3,520,876.64	3,543,676.64
资产总计	276,111,865.29	-	-	3,862,583.05	279,974,448.34
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	346,300.60	346,300.60
应付托管费	-	-	-	102,607.36	102,607.36
应付销售服务费	-	-	-	355,733.75	355,733.75
应付交易费用	-	-	-	8,174.63	8,174.63
应付利润	-	-	-	153,064.68	153,064.68
其他负债	-	-	-	309,000.00	309,000.00
负债总计	-	-	-	1,274,881.02	1,274,881.02
利率敏感度缺口	276,111,865.29	-	-	2,587,702.03	278,699,567.32

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2013 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	276,089,065.29	98.61
4	其他各项资产	3,885,383.05	1.39
	合计	279,974,448.34	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.26	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 40% 的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 40%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

不适用。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	16
报告期内偏离度的最高值	0.3422%
报告期内偏离度的最低值	-0.0001%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0933%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

8.8.2 本报告期内本基金不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

8.8.3 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	138,392.87
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	203,313.54
4	应收申购款	3,543,676.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,885,383.05

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安季季鑫短期理财债券 A	4,493	60,916.89	961.60	0.00%	273,698,605.72	100.00%
华安季季鑫短期理财债券 B	1	5,000,000.00	-	-	5,000,000.00	100.00%
合计	4,494	62,015.93	961.60	0.00%	278,698,605.72	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司 所有从业人员 持有本基金	华安季季鑫短期理财债券 A	1,131,996.07	0.41 %
	华安季季鑫短期理财债券 B	-	-
	合计	1,131,996.07	0.41 %

注：1. 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安季季鑫短期理财债券 A	华安季季鑫短期理财债券 B
基金合同生效日(2012 年 5 月 23 日)基金份额总额	4,689,974,322.86	836,576,972.25
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	148,445,740.08	42,000,000
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	4,564,720,495.62	873,576,972.25
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	273,699,567.32	5,000,000
-------------	----------------	-----------

注：申购含红利再投及分级份额调增份额；赎回含分级份额调减份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2012 年 2 月 3 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(2) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，秦军先生任华安基金管理有限公司副总经理。秦军先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(3) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，章国富先生不再担任华安基金管理有限公司督察长，转任华安基金管理有限公司副总经理。章国富先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(4) 2012 年 9 月 24 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，薛珍女士任华安基金管理有限公司督察长。薛珍女士经中国证监会核准取得高管任职资格。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：
无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	2	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选

择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署

基金管理人 与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

(5) 通知托管人

通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	55,000,000.00	8.09%	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	624,500,000.00	91.91%	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

无。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于住所变更公告，住所变更为上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
2	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-16
3	关于基金电子交易平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-02
4	华安季季鑫短期理财债券型基金基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-09
5	华安季季鑫短期理财债券型基金基金合同	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-09
6	华安季季鑫短期理财债券型基金托管协议	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-09
7	华安季季鑫短期理财债券型基金招募说明书	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-09

8	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-14
9	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-16
10	华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-24
11	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金（2012 年第 1 期）投资组合构建情况说明的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-12
12	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-19
13	华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 1 期赎回开放日及 2012 年第 2 期集中申购开放日相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-21
14	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-27
15	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-28
16	华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 1 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-29
17	关于电子直销平台开通“智能再平衡”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-03
18	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-10
19	关于电子直销平台开通“农行机构电子直销”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-20
20	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2012 年第 2 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-23
21	关于旗下部分基金增加华融证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-08-20

22	关于旗下部分开放式基金增加天相投资顾问有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-08-28
23	关于旗下部分开放式基金增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-19
24	华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 2 期赎回开放日及 2012 年第 3 期集中申购开放期相关安排的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-21
25	华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 2 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-28
26	关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金投资组合构建情况说明的公告（2012 年第 3 期）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-10-29
27	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-11-03
28	关于旗下部分开放式基金增加中山证券有限责任公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-11-09
29	关于电子直销平台开通“货币通”货币基金份额电子支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-03
30	关于旗下部分基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-06
31	关于旗下部分开放式基金新增招商证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-06
32	关于旗下部分基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-12
33	关于电子直销平台开通“支付宝”资金结算方式的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-12
34	2013 年度季季鑫运作期安排的预告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-17
35	关于旗下部分开放式基金新增天风证券有限责任公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-17

36	华安基金管理有限公司关于华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金 2012 年第 3 期收益支付公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-28
----	--	-----------------------------	------------

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 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>。

12.3 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
二〇一三年三月二十七日