

华安纳斯达克 100 指数证券投资基金

2014 年第 3 季度报告

2014 年 9 月 30 日

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 2014 年 10 月 17 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 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8月2日
报告期末基金份额总额	33,454,140.64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，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的

	情况下投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。 本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 4%（以美元计价计算）。
业绩比较基准	纳斯达克100价格指数（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。
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	美国道富银行

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	971,096.95
2.本期利润	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	1.218

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、红利再投资费、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	4.01%	0.65%	5.19%	0.72%	-1.18%	-0.07%

3.2.2 自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 2014 年 9 月 30 日)



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 个月内已使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
		任职日期	离任日期		
徐宜宜	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），8年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业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职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及本基金的基金经理。2013年12月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安国际龙头（DAX）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。
--	--	--	--	--	--------------------

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

2014 年 3 季度，纳斯达克指数上涨 5.19%，指数成分股表现活跃。特别是

互联网和生物医药行业，均创出过去十年新高。单季度，微软股票上涨 11.18%，英特尔上涨 12.7%，苹果上涨 8.41%，大幅跑赢小盘科技股的总体水平，说明美国经济已经进入恢复的后半期。从美国宏观数据来看，预计 2014 年实际 GDP 增速达 3.0%，其中固定资产投资增长 6.9%；CPI 为 1.6%，核心 CPI 为 1.7%；截止三季度末，美国失业率下降至 5.9%，为历年新低。我们认为，新一轮经济增长仍然是科技创新驱动型，所以未来一年我们对纳斯达克指数抱有坚定的信心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.218 元，本报告期份额净值增长率为 4.01%，同期业绩比较基准增长率为 5.19%。

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基金在第四季度将有率先经历一波调整，主要原因是对欧洲经济和对美联储提前升息的担忧。但随着年底双节因素临近，我们预计美国经济进一步走强的信号将持续显现，而企业第三季度业绩表现也将公布，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具有全球优势。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，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	37,243,642.20	82.48
	其中：普通股	36,214,482.58	80.20
	存托凭证	1,029,159.62	2.28
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,071,522.95	11.23
8	其他各项资产	2,839,445.46	6.29
9	合计	45,154,610.61	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	37,243,642.20	91.40
合计	37,243,642.20	91.40

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	-	-
工业	289,770.45	0.71

信息技术	22,868,833.30	56.13
非必需消费品	6,396,163.65	15.70
能源	-	-
保健	5,084,739.78	12.48
公用事业	-	-
必需消费品	1,826,366.55	4.48
电信服务	626,361.60	1.54
材料	-	-
合计	37,092,235.33	91.03

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融		
工业		
信息技术		
非必需消费品	151,406.87	0.37
能源		
保健		
公用事业		
必需消费品		
电信服务		
材料		
合计	151,406.87	0.37

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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股票及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投

资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在 证 券市 场	所属国 家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人民币 元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯 达克 市场	美国	7,600	4,710,969.25	11.56
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯 达克 市场	美国	9,400	2,681,161.06	6.58
3	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	GOOGL US	纳斯 达克 市场	美国	700	2,534,134.77	6.22
4	GOOGLE INC-CL C	谷歌公司	GOOG US	纳斯 达克 市场	美国	600	2,131,324.44	5.23
5	AMAZON.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯 达克 市场	美国	900	1,785,430.89	4.38
6	INTEL CORP	英特尔公 司	INTC US	纳斯 达克 市场	美国	6,800	1,456,764.34	3.58
7	FACEBOOK INC	Facebook 公司	FB US	纳斯 达克 市场	美国	2,600	1,264,363.36	3.10
8	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科 学	GILD US	纳斯 达克	美国	1,800	1,178,880.53	2.89

				市场				
9	CELGENE CORP	Celgene公 司	CELG US	纳斯 达克 市场	美国	2,000	1,166,267.90	2.86
10	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯 达克 市场	美国	7,200	1,114,980.66	2.74

5.4.2 积极投资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益投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名 称(中 文)	证券 代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	自由国 际传媒 公司	LBTYK US	纳斯达 克市场	美国	600	151,406.87	0.37

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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，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。

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

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,093,991.19
3	应收股利	19,682.16
4	应收利息	556.10
5	应收申购款	725,216.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,839,445.46

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告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中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	35,694,540.02
报告期期间基金总申购份额	12,768,627.70
减：报告期期间基金总赎回份额	15,009,027.08
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	33,454,140.64

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金的基金资产净值从8月8日至9月30日连续超过20个工作日低于5000万元。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》

9.2 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>。

9.3 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

二〇一四年十月二十四日