华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金2018年第1季度报告

2018-03-31

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：2018-04-21

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、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别和连带责任。

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2018年4月21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，但不保证投资一定盈利。

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。

本报告书财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	华安季季鑫短期理财债券
场内简称	-
基金主代码	004010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012-06-13
报告期末基金份额总额	7,732,592,592.26
投资目标	在安全基金安全的前提下，追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金采用“证券组合管理”的方式操作。在证券期内，本基金将在投资组合配置原则下，采用自上而下的策略确定投资组合。基于对宏观经济、证券市场趋势的研判，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在分析国内外经济发展趋势、国家财政政策、货币政策、证券市场资金供求状况、利率水平变化趋势、证券市场估值水平等因素的基础上，对固定收益类资产的久期、信用风险、流动性风险、提前赎回风险进行分析，在控制风险的前提下，合理配置资产组合，以期获得较高的当期收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期风险和预期收益低于股票型基金，属于证券投资基金中风险较低、预期收益较为稳定的品种。其预期风险和收益不低于银行理财产品，属于基金中低风险收益品种。
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A类份额基金的名称	华安季季鑫短期理财债A
下属B类份额基金的场内简称	-
下属A类份额基金的代码	004010
下属B类份额基金的代码	004011
报告期末下属A类基金份额总额	18,780,592.58
报告期末下属B类基金份额总额	7,718,000,000.00

主要财务指标

单位：人民币元

项目	主要会计数据	华安季季鑫短期理财债A(人民币)	华安季季鑫短期理财债B(人民币)
		2018-01-01 - 2018-03-31	2018-01-01 - 2018-03-31
本期已实现收益		326,432.12	16,392,416.28
本期利润		326,432.12	16,392,416.28
期末基金资产净值		18,782,592.58	7,718,000,000.00

注：本期已实现收益指基金本期利润扣减公允价值变动损益后的余额，本期利润为本期利润减去本期公允价值变动损益，由于期货期货持有基金证券期末结算，因此，上述财务数据可能会有所不同。本期已实现收益和本期利润为负数时，本期已实现收益和本期利润以金额填写。

基金净值表现

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

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
-	-%	-%	-%	-%	-%	-%

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

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	1.35%	0.30%	-%	-%	-%	-%

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

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	1.35%	0.30%	-%	-%	-%	-%

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

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

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

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		
朱怡凡	本基金的基金经理	2018-03-02	-	9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、投资管理及投研管理工作。2014年9月起担任基金经理助理，2016年5月起担任华安日利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，本基金、华安日利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、华安日子盈利多策略证券投资基金的基金经理，2017年12月起，同时担任华安稳健回报混合型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。同时公告日与届满，证券从业的从业年限计算方式按证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的有关规定。

报告期内本基金运作遵守情况说明

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义务的情况发生。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内固定溢价（证券投资基金管理人在以平交易制度为原则，上一日内固定（证券投资基金管理人在以平交易原则制度）的原则式基金，开放式基金，特定客户资产管理计划及其他投资组合生产力不时实施，投资决策，交易执行等方面实行公平对待，并根据投资决策、交易执行、投资组合管理、业绩评估等一系列流程管理，对