

华安年年红定期开放债券型证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

§ 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。本半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 2014 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 | 5 |
| 2.4 | 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 | 其他相关资料 | 5 |
| 3 | 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 5 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 6 |
| 4 | 管理人报告 | 7 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 10 |
| 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说明 | 12 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 5 | 托管人报告 | 16 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 16 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16 |
| 5.3 | 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 16 |
| 6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 | 资产负债表 | 17 |
| 6.2 | 利润表 | 18 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 | 报表附注 | 20 |
| 7 | 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 45 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 46 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 46 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 46 |
| 7.6 | 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 | 47 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 47 |
| 7.8 | 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贵金属投资明细 | 47 |
| 7.9 | 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 | 47 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 47 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 47 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 48 |
| 8 | 基金份额持有人信息 | 48 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 48 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 49 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 49 |
| 10 | 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 10.2 | 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 | 49 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 50 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 50 |
| 10.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况 | 50 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 50 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 56 |
| 11 | 备查文件目录 | 58 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 58 |
| 11.2 | 存放地点 | 58 |
| 11.3 | 查阅方式 | 58 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 华安年年红定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华安年年红债券 |
| 基金主代码 | 000227 |
| 交易代码 | 000227 |
| 基金运作方式 | 契约性开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年11月14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 | 299,340,438.31份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于固定收益品种，在合理控制信用风险的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过分析宏观经济、国家政策等可能影响债券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的多种数量模型工具，分析和比较不同债券品种和具体债券工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的价值增长和套利的机会，以确定基金资产在利率类固定收益品种（国债、央行票据等）和信用类固定收益品种之间的配置比例。同时结合基金的封闭运作期限和现金流预测调整债券组合的平均久期，决定投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 同期一年期定期存款收益率（税后）+1.2% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。 |

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 | 赵会军 |
| | 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 |
| 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 | | 李劼 | 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 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------|
| 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、32 层 |

3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日） |
|----------------------|---|

| | |
|----------------------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | 10,115,615.57 |
| 本期利润 | 17,899,003.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0600 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.85% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.01% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 8,142,494.94 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0272 |
| 期末基金资产净值 | 315,103,366.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.053 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 6.64% |

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 1.64% | 0.14% | 0.36% | 0.01% | 1.28% | 0.13% |
| 过去三个月 | 4.04% | 0.10% | 1.05% | 0.01% | 2.99% | 0.09% |
| 过去六个月 | 6.01% | 0.08% | 2.08% | 0.01% | 3.93% | 0.07% |
| 自基金成立起至今 | 6.64% | 0.08% | 2.64% | 0.01% | 4.00% | 0.07% |

注：本基金业绩比较基准：同期一年期定期存款收益率（税后）+1.2%

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不从二级市场买入股票，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。

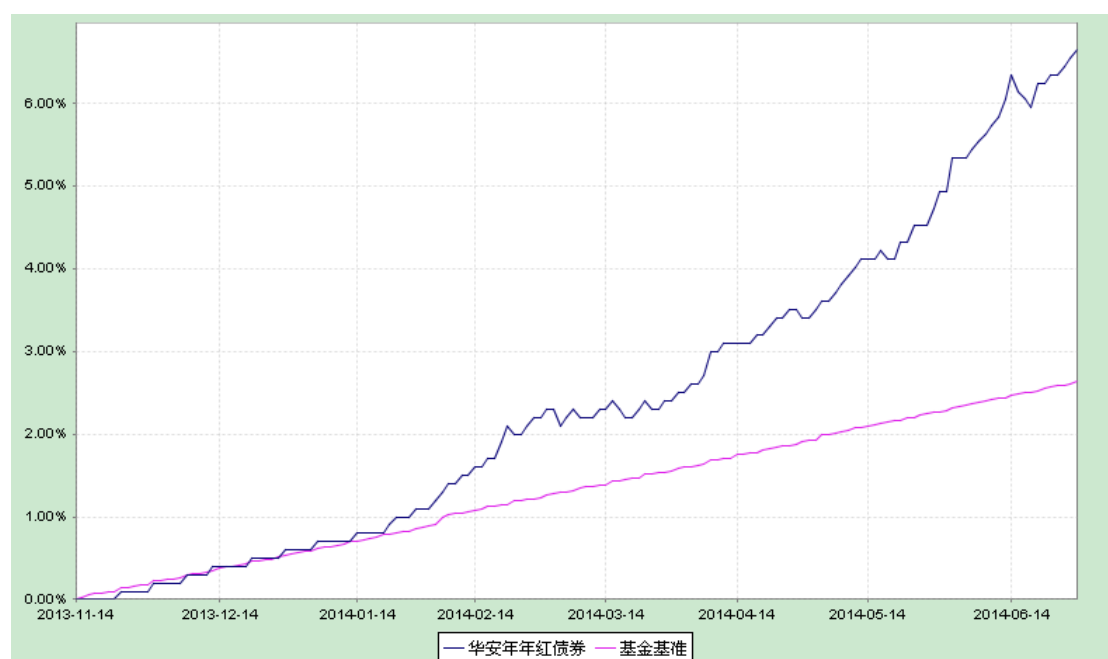
除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华安年年红定期开放债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 11 月 14 日至 2014 年 6 月 30 日)



注：1.本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安年年红债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期不超过 6 个月。基金管理人应当在基金合同生效后 6 个月内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 2014 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安创新混合、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、华安月安鑫短期理财债券、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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、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 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、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、华安安顺混合等 49 只开放式基金。管理资产规模达到 688.13 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 | | |
| 苏玉平 | 本基金的基金经理 | 2013-11-14 | - | 16 年 | 货币银行硕士，16 年证券、基金行业从业经历。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理；交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理；中德安联保险有限公司投资部 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|---|
| | | | | | 部门经理；国联安基金管理有限公司基金经理。2011 年 2 月加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月起担任华安强化收益债券型证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 2 月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 4 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。 |
| 张晟刚 | 本基金的基金经理 | 2013-11-14 | - | 15 年 | 硕士研究生，15 年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012 年 11 月加入华安基金管理有限公司。2013 年 1 月起担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金及华安日日鑫货币市场基金的基金经理；2013 年 3 月起同时担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 基金经理。2013 年 10 月起同时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、华安现金富利投资基金的基金经理。2013 年 11 月起同时担任本基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

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《华安年年红债券型证券投资基金基金合同》、《华安年年红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，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 1 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单只股票的数量较小，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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，一季度经济增速下行至 7.4%，其中房地产是增长面临的最大下行风险。二季度以来，政府在保持定力的基础上，陆续出台 17 项微刺激稳增长措施。随着政策的落实和显效，6 月基本面在基建投资发力的带动下，经济短期内企稳。年初以来央行货币政策态度转为“总量稳定，结构优化”，通过定向降准和国开行再贷款支持“三农”和小微，并且尽量熨平资金面的季节性波动。

债券市场上半年在基本面和流动性的双重驱动下逐渐走出一波牛市行情。银行间隔夜和 7 天回购利率中枢较去年下半年分别下移近 80BP 和 70BP。长限资金价格降幅更甚，1 月 shibor 较去年下半年回落 110BP。债市收益率曲线一季度陡峭化下行，二季度长端大幅回落，曲线趋向平坦化。10 年金融债最低降至 4.90% 附近，距离年初高点回落近 90BP。信用债市场，信托和中小企业私募债违约事件加重市场对信用风险的担忧，中高等级的短融和有政府信用背书的城投债成为市场追逐热点，收益较年初下行了 150BP 和 100BP 以上，信用利差明显收窄。

本报告期内，本基金增加了久期，增加了城投债配置，利率债波段操作。通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.053 元，本报告期份额净值增长率为 6.01%，同期业绩比较基准增长率为 2.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，宏观经济增速下行压力仍然较大。定向刺激下，基建投资抵御房地产周期的下滑效果有限，出口在全球经济新常态下亦难以全面发力。通胀短期将不构成压力。

但另一方面，保增长政策将为短期经济托底。央行着力化解货币堆积，引导银行增加信贷支持实体经济。定向刺激、基建投资、结构性减税将推动短期内经济反弹。大额 CD 推出，长远看将提升银行的负债成本。财税体制改革深化，地方债发行规模增加，都将带来利率债收益率阶段性上行。还需要关注 IPO 带来的资金扰动，流动性有可能将结构性和阶段性失衡。债市短期内将面临反复，需警惕基本面和配置力量边际上的变化。信用债方面，总体看受益于中央降低企业融资成本的政策，但民企中低资质违约风险较大的注意回避；城投债有地方政府隐形担保，地方债务替代降低供给，并具备高票息优势。

操作方面，将继续坚持高票息策略，并深度挖掘信用品种的相对价值。利率债配置机会下降，但仍有交易性机会。在控制组合风险的基础上，为投资者积极赚取高收益。

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 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，现任华安安顺混合、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利和华安大国新经济股票基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

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，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。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。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理，固定收益部副总监。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施 2014 年度第一次分红，本次分红方案为：0.13 元/10 份。权益登记日及除息日：2014 年 4 月 16 日；现金红利发放日：2014 年 4 月 17 日。

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

本报告期内，本基金托管人在对华安年年红定期开放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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华安年年红定期开放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年年红定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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。本报告期内，华安年年红定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 3,872,439.05 元。

5.3 托管人对本半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年年红定期开放债券型基金管理有限公司编制和披露的华安年年红定期开放债券型证券投资基金2014年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,748,100.87 | 70,379,726.15 |
| 结算备付金 | | 4,106,284.48 | 3,881,963.81 |
| 存出保证金 | | 45,199.12 | 1,873.14 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 573,919,245.30 | 57,272,752.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 573,919,245.30 | 57,272,752.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | 167,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 927,118.67 | 508,340.83 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 12,206,626.62 | 850,860.54 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 594,952,575.06 | 299,895,516.47 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 279,179,433.23 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 144,023.42 | 142,209.02 |
| 应付托管费 | | 51,436.96 | 50,788.92 |
| 应付销售服务费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 12,416.53 | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 32,012.80 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 429,885.63 | 113,840.95 |
| 负债合计 | | 279,849,208.57 | 306,838.89 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 299,340,438.31 | 297,880,059.75 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 15,762,928.18 | 1,708,617.83 |
| 所有者权益合计 | | 315,103,366.49 | 299,588,677.58 |
| 负债和所有者权益总计 | | 594,952,575.06 | 299,895,516.47 |

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.053 元，基金份额总额 299,340,438.31 份。

6.2 利润表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 22,522,923.18 | - |
| 1.利息收入 | | 12,781,065.47 | - |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,150,253.72 | - |
| 债券利息收入 | | 10,889,640.71 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 741,171.04 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 6.4.7.12 | 1,958,470.23 | - |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 1,958,470.23 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|---|
| 股利收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.13 | 7,783,387.48 | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 减：二、费用 | | 4,623,920.13 | - |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,061,182.82 | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 303,195.07 | - |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.14 | 7,347.91 | - |
| 5. 利息支出 | | 3,085,323.19 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 3,085,323.19 | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.15 | 166,871.14 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 17,899,003.05 | - |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 17,899,003.05 | - |

注：本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安年年红定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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） | 297,880,059.75 | 1,708,617.83 | 299,588,677.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 17,899,003.05 | 17,899,003.05 |
| 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） | - | 27,746.35 | 27,746.35 |
| 其中：1.基金申购款 | - | 27,746.35 | 27,746.35 |

| | | | |
|--|---------------------------------|---------------|----------------|
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 1,460,378.56 | -3,872,439.05 | -2,412,060.49 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 299,340,438.31 | 15,762,928.18 | 315,103,366.49 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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) | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | - | - |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | - | - | - |

注：本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李勍，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：

陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安年年红定期开放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[2013]755 号文《关于核准华安年年红定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管

理人华安基金管理有限公司自 2013 年 10 月 16 日至 2013 年 11 月 12 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2013）验字第 60971571_B15 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 2013 年 11 月 14 日正式生效，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 297,730,602.09 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 149,457.66 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 297,880,059.75 元，折合 297,880,059.75 份基金份额。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。

本基金以定期开放方式运作。自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该次日）一年（含一年）的期间内，本基金采取封闭运作模式，称为封闭运作期；封闭运作期的最后一日称为支点浮动费率计算基准日；支点浮动费率计算基准日后的不超过五个工作日期间称为封闭清算期。封闭运作期和封闭清算期统称为本基金的封闭期。本基金的第一个封闭运作期为自基金合同生效日起一年。下一个封闭运作期为首个开放期结束之日次日起的一年，依此类推。本基金封闭期内不办理申购、赎回等业务。本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入下一个开放期，开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不从二级市场买入股票，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的 6 个月内卖出。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的 1 个月内卖出。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。

本基金的投资组合比例为：除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

本基金的业绩比较基准为：同期一年期定期存款收益率（税后）+1.2%。

6.4.2 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制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

6.4.3 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终

止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易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；

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易

可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券

价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 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金融资产公允价值的，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方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 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账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 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；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金的基准管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率逐日计提；若当期封闭运作期本基金复权单位净值增长率超过同期业绩比较基准收益率 20% 及以上且未发生基金转换运作方式的情况，基金管理人有权上调本封闭运作期管理费率，使得管理费率调整后本封闭运作期复权单位净值增长率等于同期业绩比较基准的 120%；管理费率上调的上限是 20%，当管理费率上调至基准管理费率的 120% 时，不再上调。若当期封闭运作期本基金复权单位净值增长率低于同期业绩比较基准收益率且未发生基金转换运作方式的情况，基金管理人将下调本封闭运作期管理费率，使得管理费率调整后的封闭运作期内本基金复权单位净值增长率等于同期业绩比较基准收益率；管理费率下调的上限是 20%，当管理费率下调达到基准管理费率的 80% 时，不再下调。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 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；

(4) 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，每季度末基金份额可供分配利润超过 0.01 元时，本基金至少进行收益分配 1 次，本基金每年收益分配次数最多为 12 次；每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 50%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：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；如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；

(4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 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》的规定，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、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得

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。

6.4.6.3 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 3,748,100.87 |
| 定期存款 | - |

| | |
|------|--------------|
| 其他存款 | - |
| 合计 | 3,748,100.87 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 293,844,838.65 | 297,144,245.30 |
| | 银行间市场 | 272,465,260.35 | 276,775,000.00 |
| | 合计 | 566,310,099.00 | 573,919,245.30 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 566,310,099.00 | 573,919,245.30 | 7,609,146.30 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 527.84 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,663.11 |
| 应收债券利息 | 12,204,417.40 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 18.27 |
| 合计 | 12,206,626.62 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 12,416.53 |
| 合计 | 12,416.53 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付后端申购费 | - |
| 债券利息税 | - |
| 预提费用 | 163,808.12 |
| 银行手续费 | - |
| 其他应付款 | 266,077.51 |
| 合计 | 429,885.63 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 297,880,059.75 | 297,880,059.75 |
| 本期申购 | 1,460,378.56 | 1,460,378.56 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 299,340,438.31 | 299,340,438.31 |

6.4.7.10 未分配利润

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 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 1,882,859.01 | -174,241.18 | 1,708,617.83 |
| 本期利润 | 10,115,615.57 | 7,783,387.48 | 17,899,003.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 16,459.41 | 11,286.94 | 27,746.35 |
| 其中：基金申购款 | 16,459.41 | 11,286.94 | 27,746.35 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -3,872,439.05 | - | -3,872,439.05 |
| 本期末 | 8,142,494.94 | 7,620,433.24 | 15,762,928.18 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 28,247.45 |
| 定期存款利息收入 | 1,101,638.90 |
| 其他存款利息收入 | 210.52 |
| 结算备付金利息收入 | 20,156.85 |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,150,253.72 |

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 331,108,978.29 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 323,403,961.27 |
| 减：应收利息总额 | 5,746,546.79 |
| 债券投资收益 | 1,958,470.23 |

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 7,783,387.48 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 7,783,387.48 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | 7,783,387.48 |

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|----------------------|----------|
| 交易所市场交易费用 | 1,310.41 |
| 银行间市场交易费用 | 6,037.50 |
| 合计 | 7,347.91 |

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 119,012.93 |
| 银行汇划费用 | 14,513.02 |
| 帐户维护费 | 7,650.00 |
| 其他费用 | 900.00 |
| 合计 | 166,871.14 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2014 年 7 月 15 日发布公告，向截至 2014 年 7 月 17 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.15 元。现金红利发放日：2014 年 7 月 18 日。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-----------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金”) | 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(“工商银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6 月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,061,182.82 | - |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 502,055.25 | - |

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6 月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 303,195.07 | - |

注：支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本年度：无。

本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|
| | | |

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|--------------|--------------|-----------|------|--------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 3,748,100.87 | 28,247.45 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

本基金于 2013 年 11 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|--------------|--------------|--------------|----|
| 1 | 2014-04-16 | 2014-04-16 | 0.130 | 2,384,314.14 | 1,488,124.91 | 3,872,439.05 | - |
| 合计 | - | - | 0.130 | 2,384,314.14 | 1,488,124.91 | 3,872,439.05 | - |

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 111,179,433.23 元，是以如下债券作为抵押：

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---------|--------|------------|--------|---------|---------------|
| 1280360 | 12张建发债 | 2014-07-02 | 101.16 | 200,000 | 20,232,000.00 |
| 1382255 | 13云城投 | 2014-07-02 | 98.51 | 200,000 | 19,702,000.00 |

| | | | | | |
|-----------|-----------------|------------|--------|-----------|----------------|
| | MTN2 | | | | |
| 041459002 | 14镇城投 CP001 | 2014-07-02 | 101.43 | 100,000 | 10,143,000.00 |
| 041472001 | 14宁技发 CP001 | 2014-07-02 | 100.89 | 200,000 | 20,178,000.00 |
| 041359007 | 13粤发电 MTN001 | 2014-07-02 | 101.14 | 230,000 | 23,262,200.00 |
| 041456010 | 14云城投 MTN001 | 2014-07-02 | 103.39 | 100,000 | 10,339,000.00 |
| 041462011 | 14嘉发 MTN001 | 2014-07-02 | 100.79 | 100,000 | 10,079,000.00 |
| 合计 | | - | - | 1,130,000 | 113,935,200.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 168,000,000.00 元, 于 2014 年 7 月 2 日和 2014 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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控制委员会, 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; 根据公司章程, 在管理层层面设立合规与风险控制委员会, 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。风险管理部向督察长和总裁汇报工作。

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控制委员会, 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; 根据公司章程, 在管理层层面设立合规与风险控制委员会, 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。风险管理部向督察长

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。

6.4.13.2 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行合约责任,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。

本公司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,并根据本公司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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2014年6月30日 | 上年末 2013年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | 30,321,000.00 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 50,200,000.00 | - |
| 合计 | 80,521,000.00 | - |

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2014年6月30日 | 上年末 2013年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 48,128,966.00 | - |
| AAA 以下 | 445,269,279.30 | 57,272,752.00 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 493,398,245.30 | 57,272,752.00 |

注:未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债。

6.4.13.3 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，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。

本基金不从二级市场买入股票，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的 6 个月内卖出。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的 1 个月内卖出。除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | |
|---------------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------------------|-------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,748,100.87 | - | - | - | 3,748,100.87 |
| 结算备付金 | 4,106,284.48 | - | - | - | 4,106,284.48 |
| 存出保证金 | 45,199.12 | - | - | - | 45,199.12 |
| 交易性金融资产 | 208,414,865.20 | 134,705,220.00 | 230,799,160.10 | - | 573,919,245.30 |
| 应收利息 | - | - | - | 12,206,626.62 | 12,206,626.62 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 927,118.67 | 927,118.67 |
| 资产总计 | 216,314,449.67 | 134,705,220.00 | 230,799,160.10 | 13,133,745.29 | 594,952,575.06 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 279,179,433.23 | - | - | - | 279,179,433.23 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 赎回款 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 180,029.27 | 180,029.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 51,436.96 | 51,436.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 12,416.53 | 12,416.53 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | 32,012.80 | 32,012.80 |
| 其他负债 | - | - | - | 393,879.78 | 393,879.78 |
| 负债总计 | 279,179,433.23 | 0.00 | 0.00 | 669,775.34 | 279,849,208.57 |
| 利率敏感度缺口 | -62,864,983.56 | 134,705,220.00 | 230,799,160.10 | 12,463,969.95 | 315,103,366.49 |
| 上年度末 2013 年 12 月 31 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |

| | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 银行存款 | 70,379,726.15 | - | - | - | 70,379,726.15 |
| 结算备付金 | 3,881,963.81 | - | - | - | 3,881,963.81 |
| 存出保证金 | 1,873.14 | - | - | - | 1,873.14 |
| 交易性金融资产 | 15,610,752.00 | 11,662,000.00 | 30,000,000.00 | - | 57,272,752.00 |
| 买入返售金融资产 | 167,000,000.00 | - | - | - | 167,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 850,860.54 | 850,860.54 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 0.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 508,340.83 | 508,340.83 |
| 资产总计 | 256,874,315.10 | 11,662,000.00 | 30,000,000.00 | 1,359,201.37 | 299,895,516.47 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|----------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 清算款 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 142,209.02 | 142,209.02 |
| 应付托管费 | - | - | - | 50,788.92 | 50,788.92 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 113,840.95 | 113,840.95 |
| 负债总计 | - | - | - | 306,838.89 | 306,838.89 |
| 利率敏感度缺口 | 256,874,315.10 | 11,662,000.00 | 30,000,000.00 | 1,052,362.48 | 299,588,677.58 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|--------------------|----------------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币） |

| | 本期末 2014 年 6 月 30 日 | 上年度末 2013 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------------------|--------------------------|
| 市场利率上升25个基点 | 减少约264.69万元 | 减少约50.56万元 |
| 市场利率下降25个基点 | 增加约267.49万元 | 增加约50.72万元 |

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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

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。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2014 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 573,919,245.30 | 96.46 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：债券 | 573,919,245.30 | 96.46 |
| | 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 | 7,854,385.35 | 1.32 |
| 7 | 其他各项资产 | 13,178,944.41 | 2.22 |
| 8 | 合计 | 594,952,575.06 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

7.5 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,053,000.00 | 6.36 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,053,000.00 | 6.36 |
| 4 | 企业债券 | 330,731,519.30 | 104.96 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,468,000.00 | 19.19 |
| 6 | 中期票据 | 125,630,000.00 | 39.87 |
| 7 | 可转债 | 37,036,726.00 | 11.75 |
| 8 | 其他 | - | - |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 573,919,245.30 | 182.14 |
|---|----|----------------|--------|

7.6 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 1280360 | 12 张建发债 | 500,000 | 50,580,000.00 | 16.05 |
| 2 | 124400 | 13 渝双福 | 343,190 | 34,933,310.10 | 11.09 |
| 3 | 122033 | 09 富力债 | 336,570 | 33,845,479.20 | 10.74 |
| 4 | 1082062 | 10 永煤MTN1 | 300,000 | 30,042,000.00 | 9.53 |
| 5 | 124163 | 13 蓉文旅 | 300,000 | 29,973,000.00 | 9.51 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 45,199.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | 927,118.67 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,206,626.62 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,178,944.41 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1 | 110023 | 民生转债 | 18,949,760.00 | 6.01 |
| 2 | 113005 | 平安转债 | 17,625,300.00 | 5.59 |
| 3 | 113002 | 工行转债 | 357,306.00 | 0.11 |
| 4 | 110018 | 国电转债 | 104,360.00 | 0.03 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 2,815 | 106,337.63 | 29,999,000.00 | 10.02% | 269,341,438.31 | 89.98% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 1,007.96 | 0.00034% |

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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2013 年 11 月 14 日) 基金份额总额 | 297,880,059.75 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 297,880,059.75 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,460,378.56 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 299,340,438.31 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 证券有限 责任公司 | | | | | | |
| 财富里昂 证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 经纪有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发华福 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 有限责任 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰联合 证券有限 责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 开源证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际 金融有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国民族 证券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河 证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中投 证券有限 责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中天证券 有限责任 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 中信证券 有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 证券有限公司 | 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和合规性进行阐述。

(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) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

10.7.2 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 |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 财富里昂证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券经纪有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发华福有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券有限责任公司 | 410,282,988.67 | 75.17% | 3,698,900,000.00 | 99.22% | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---------------|--------|---------------|-------|---|---|
| 有限责任公司 | | | | | | |
| 宏源证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限责任公司 | 89,876,064.37 | 16.47% | - | - | - | - |
| 世纪证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 45,624,143.49 | 8.36% | 29,000,000.00 | 0.78% | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 中国国际金融有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国民族证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 关于旗下部分基金增加和讯科技为代销机构并开通基金定投、转换业务的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2014-02-21 |
| 2 | 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 | 2014-03-13 |
| 3 | 关于旗下基金参加工商银行开展个人电子银行基金申购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 | 2014-03-28 |
| 4 | 关于华安年年红定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2014-04-14 |
| 5 | 关于电子直销平台“微钱宝”账户转换交易费率优惠的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、 | 2014-06-10 |

| | | | |
|---|-------------------------------------|---|------------|
| | | 《中国证券报》 和公司网站 | |
| 6 | 关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告 | 《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站 | 2014-06-12 |
| 7 | 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 | 2014-06-13 |

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。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安年年红债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安年年红债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安年年红债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安年年红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；

11.2 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>。

11.3 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
二〇一四年八月二十九日