华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
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 13
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 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16
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的真实、准确和完整发表意见 16
6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
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 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 38
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 39
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 39
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 39
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 39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 39
7.12 投资组合报告附注 40
8 基金份额持有人信息 41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 41
9 开放式基金份额变动 41
10 重大事件揭示 42
10.1 基金份额持有人大会决议 42
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 42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 42
10.4 基金投资策略的改变 42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 42
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 42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 42
10.8 其他重大事件 44
11 备查文件目录 47
11.1 备查文件目录 47
11.2 存放地点 47
11.3 查阅方式 47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安年年盈定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	华安年年盈定期开放债券	
基金主代码	000239	
交易代码	000239	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 2 月 3 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,218,667,487.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	000239	000240
报告期末下属分级基金的份额总额	968,967,007.49 份	249,700,480.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整固定收益类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。
业绩比较基准	一年期定期存款利率（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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008850099	95566
传真	021-68863414	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	朱学华	田国立

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 层、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 层、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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）**	
	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C
本期已实现收益	13,897,467.26	1,920,929.40
本期利润	7,294,071.17	1,765,401.14
加权平均基金份额本期利润	0.0096	0.0097
本期加权平均净值利润率	0.94%	0.95%
本期基金份额净值增长率	0.45%	0.22%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2016 年 6 月 30 日)**	
	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C
期末可供分配利润	20,928,459.95	5,039,764.11
期末可供分配基金份额利润	0.0216	0.0202

期末基金资产净值	989,895,467.44	254,740,244.19
期末基金份额净值	1.022	1.020
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2016 年 6 月 30 日)**	
	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C
基金份额累计净值增长率	6.83%	6.35%

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：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

华安年年盈定期开放债券 A

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	1.29%	0.10%	0.21%	0.07%	1.08%	0.03%
过去三个月	0.64%	0.10%	0.64%	0.19%	0.00%	-0.09%
过去六个月	0.45%	0.10%	1.53%	0.45%	-1.08%	-0.35%
过去一年	4.53%	0.13%	3.52%	1.07%	1.01%	-0.94%
自基金合同生效起至今	6.83%	0.12%	5.18%	1.54%	1.65%	-1.42%

华安年年盈定期开放债券 C

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	1.19%	0.10%	0.21%	0.07%	0.98%	0.03%
过去三个月	0.49%	0.10%	0.64%	0.19%	-0.15%	-0.09%
过去六个月	0.22%	0.10%	1.53%	0.45%	-1.31%	-0.35%
过去一年	4.26%	0.13%	3.52%	1.08%	0.74%	-0.95%
自基金合同生效起至今	6.35%	0.12%	5.18%	1.54%	1.17%	-1.42%

注：本基金业绩比较基准为：一年期定期存款利率（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、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可

交换债券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等债券类品种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。

基金的投资组合比例为：基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内，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%。

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

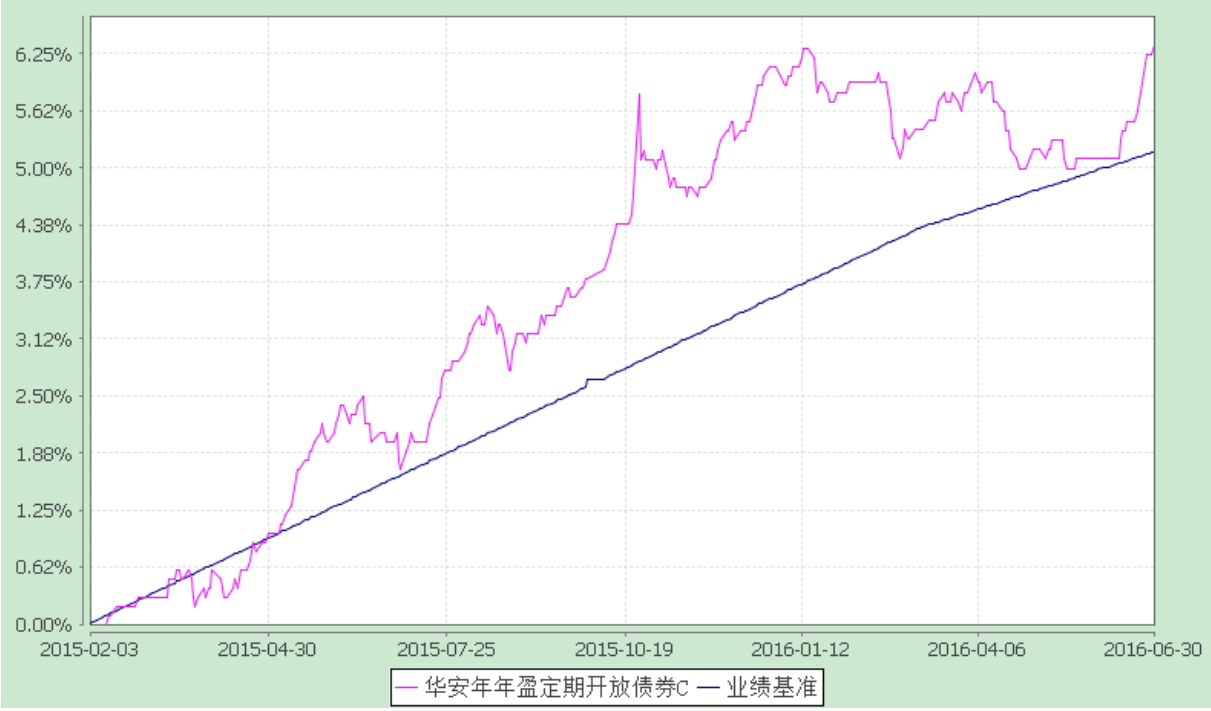
华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

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

（2015 年 2 月 3 日至 2016 年 6 月 30 日）

华安年年盈定期开放债券 A

华安年年盈定期开放债券 C



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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、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、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、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、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安外延增长、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息、华安创业板 50ETF 等 77 只开放式基金。管理资产规模达到 1403.87 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		
孙丽娜	基金经理	2015-02-17	-	5 年	硕士研究生，5 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金、华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华本基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。
贺涛	基金经理、固定收益部总监	2015-02-03	-	19 年	金融学硕士（金融工程方向），19 年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理.2011 年 6 月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资

					基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013 年 8 月起担任固定收益部副总监。2013 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安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的基金经理。2014 年 7 月起同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月起担任本基金的基金经理。2015 年 5 月起担任固定收益部总监。2015 年 5 月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月起，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起，同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 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，则投资部门在风控部门的监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。 本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好 。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边

交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 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

一季度国内启动需求侧刺激，信贷多增，房价上涨，通缩预期的改变使得债市调整。信用事件呈现多发，信用利差拉大。可转债市场受股市熔断影响整体估值受到挤压。二季度，美联储加息预期反复，6 月底英国脱欧超预期，美联储加息预期延后，海外中长期国债收益率创新低，黄金和原油期货价格同时上涨亦反映避险情绪和流动性宽松预期。二季度国内工业生产比较平稳，基建投资继续发挥逆周期稳定器作用，但民间投资和制造业投资加速下滑，反映经济仍在调整过程、远未出清。M2 和社融增速开始回落，PPI 同比跌幅继续收窄， CPI 受蔬菜价格影响逐步下行。5 月初人民日报发表“权威人士谈当前中国经济济”，提出经济 L 型走势，市场预期需求侧刺激边际力度将减弱，政策重点重回供给侧改革。央行继续运用 MLF 等微调手段维持流动性，货币市场总体平稳。中长久期利率债收益率冲高回落，信用债继续两极分化，过剩产能以及中低信用等级个券的信用利差不断拉大。可转债和可交换债市场估值继续受到压缩，但次新券表现良好。

本基金提升了组合信用等级，二季度择机拉长了组合久期，保持了一定的转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，华安年年盈 A 份额净值为 1.022 元，C 份额净值为 1.020 元；华安年年盈 A 份额净值增长率为 0.45%， C 份额净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准增长率为 1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，英国脱欧影响深远，孤立和民粹主义盛行不利于全球经济的合作发展。国内经济在财政托底的作用下失速风险小，而政治局会议首次提出“抑制资产泡沫”，火热的地产市场或将继续降温，下半年经济仍有下行压力。尽管总量放松概率下降，但预计货币政策仍将维持偏宽松基调。三会“严监管”旨在抑制货币空转堵塞政策套离空间，宽信用转为紧信用中长期有利于债市表现，短期需关注可能的流动性冲击。在供给侧改革背景下防范信用风险仍是首要任务。可转债和可交换债市场将迎来大盘债发行的考验，估值压缩和流动性提升两种不同力量的博弈或将决定市场仍以个券机会为主。本基金将以利率债和中高等级信用债为组合构建核心，动态调整组合久期，关注可转债个券投资机会。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，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：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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:

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，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，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利混合、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网主题股票、华安宝利配置混合、华安生态优先混合的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安国企改革灵活配置、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理,指数投资部高级总监。

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

本报告期内实施了二次分红，并公告第三次分红方案。

第一次分红，分红方案为：0.11 元/10 份基金份额（华安年年盈 A）、0.103 元/10 份基金份额（华安年年盈 C）。权益登记日、除息日：2016 年 1 月 20 日；现金红利发放日：2016 年 1 月 21 日。

第二次分红，分红方案为：0.155 元/10 份基金份额（华安年年盈 A）、0.149 元/10 份基金份额（华安年年盈 C）。权益登记日、除息日：2016 年 4 月 20 日；现金红利发放日：2016 年 4 月 21 日。

本基金的基金管理人于 2016 年 7 月 15 日发布公告：每 10 份基金份额派发红利 0.11 元（华安年年盈 A/C）。权益登记日及除息日：2016 年 7 月 19 日；现金红利发放日：2016 年 7 月 20 日。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安年年盈定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	41,106,819.03	1,313,065.26

结算备付金		6,320,814.91	1,977,998.98
存出保证金		32,693.17	24,101.22
交易性金融资产	6.4.7.2	1,962,732,512.70	460,152,206.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,962,732,512.70	460,152,206.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.3	17,388,009.09	9,592,955.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,027,580,848.90	473,060,327.00
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 6 月 30 日**	**上年度末 2015 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		747,598,802.25	121,936,725.00
应付证券清算款		34,008,086.55	97,179.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		707,754.06	207,256.28
应付托管费		202,215.46	59,216.09
应付销售服务费		62,087.55	6,985.18
应付交易费用	6.4.7.4	17,645.45	17,282.74
应交税费		-	-
应付利息		204,338.25	11,215.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	144,207.70	290,000.00
负债合计		782,945,137.27	122,625,860.95
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.6	1,218,667,487.57	335,604,454.14
未分配利润	6.4.7.7	25,968,224.06	14,830,011.91
所有者权益合计		1,244,635,711.63	350,434,466.05
负债和所有者权益总计		2,027,580,848.90	473,060,327.00

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.021 元，基金份额总额 1,218,667,487.57 份。

其中 A 类基金份额净值 1.022 元，基金份额总额 968,967,007.49 份；C 类基金份额净值 1.020 元，基金份额总额 249,700,480.08 份。

6.2 利润表

会计主体：华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		**17,274,486.86**	**9,252,497.16**
1.利息收入		20,194,664.31	7,820,908.57
其中：存款利息收入	6.4.7.8	280,774.10	2,298,407.59
债券利息收入		19,252,441.94	4,899,229.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		661,448.27	623,271.20
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,837,458.22	420,511.60
其中：股票投资收益		-	-400,008.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	3,837,458.22	797,532.25
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		-	22,988.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	-6,758,924.35	1,011,076.99
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	1,288.68	-
减：二、费用		**8,215,014.55**	**2,020,221.98**
1．管理人报酬		3,274,122.17	955,885.33
2．托管费		935,463.52	273,110.07
3．销售服务费		267,806.37	32,230.83
4．交易费用	6.4.7.12	24,904.90	26,434.14
5．利息支出		3,536,336.21	597,235.11
其中：卖出回购金融资产支出		3,536,336.21	597,235.11
6．其他费用	6.4.7.13	176,381.38	135,326.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**9,059,472.31**	**7,232,275.18**
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**9,059,472.31**	**7,232,275.18**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	335,604,454.14	14,830,011.91	350,434,466.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,059,472.31	9,059,472.31
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）	883,063,033.43	24,464,015.05	907,527,048.48
其中：1.基金申购款	1,126,346,832.96	32,098,122.25	1,158,444,955.21
2.基金赎回款	-243,283,799.53	-7,634,107.20	-250,917,906.73
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）	-	-22,385,275.21	-22,385,275.21
五、期末所有者权益（基金净值）	1,218,667,487.57	25,968,224.06	1,244,635,711.63
项目	**上年度可比期间** 2015 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 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）	335,523,980.19	-	335,523,980.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,232,275.18	7,232,275.18
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	335,523,980.19	7,232,275.18	342,756,255.37

金净值）			

报表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：朱学华，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

华安年年盈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]783 号《关于核准华安年年盈定期开放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自 2015 年 1 月 12 日至 2015 年 1 月 30 日止期间向社会公开募集，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（2015）验字第 60971571_B04 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 2015 年 2 月 3 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 335,393,132.33 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 130,847.86 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 335,523,980.19 元，折合 335,523,980.19 份基金份额，其中 A 类基金份额 309,111,551.85 份，C 类基金份额 26,412,428.34 份。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金以定期开放的方式运作，即基金以封闭期和开放期相结合的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效日（含该日）起或自每一个开放期结束之日次日（含该日）起至一个公历年后对应日（如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日）止的期间。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。在每个封闭期最后一个工作日，基金管理人可将基金份额持有人所持的基金份额在其资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。封闭期结束后，本基金将设开放期，投资者可在开放期内进行本基金的申购与赎回。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

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、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等债券类品种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。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债

而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起的 6 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：基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内，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%。

本基金业绩比较基准：一年期定期存款利率（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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

(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[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。

(2) 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

(3)企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(4)个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	41,106,819.03
定期存款	-
其他存款	-

合计	41,106,819.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 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	613,231,809.88	608,931,512.70	-4,300,297.18
	银行间市场	1,348,746,221.83	1,353,801,000.00	5,054,778.17
	合计	1,961,978,031.71	1,962,732,512.70	754,480.99
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,961,978,031.71	1,962,732,512.70	754,480.99

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,546.60
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	2,559.96
应收债券利息	17,382,889.30
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	13.23
合计	17,388,009.09

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	17,645.45
合计	17,645.45

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提账户维护费	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	119,344.68
合计	144,207.70

6.4.7.6 实收基金

华安年年盈定期开放债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	309,180,852.14	309,180,852.14
本期申购	882,500,555.11	882,500,555.11
本期赎回（以“-”号填列）	-222,714,399.76	-222,714,399.76
本期末	968,967,007.49	968,967,007.49

华安年年盈定期开放债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	26,423,602.00	26,423,602.00
本期申购	243,846,277.85	243,846,277.85
本期赎回（以“-”号填列）	-20,569,399.77	-20,569,399.77
本期末	249,700,480.08	249,700,480.08

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

华安年年盈定期开放债券 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
上年度末	6,775,095.94	6,923,555.95	13,698,651.89
本期利润	13,897,467.26	-6,603,396.09	7,294,071.17
本期基金份额交易产生的变动数	24,286,539.81	-5,949,129.19	18,337,410.62
其中：基金申购款	32,508,524.94	-7,153,277.31	25,355,247.63
基金赎回款	-8,221,985.13	1,204,148.12	-7,017,837.01
本期已分配利润	-18,401,673.73	-	-18,401,673.73
本期末	26,557,429.28	-5,628,969.33	20,928,459.95

华安年年盈定期开放债券 C

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	540,370.01	590,990.01	1,131,360.02
本期利润	1,920,929.40	-155,528.26	1,765,401.14
本期基金份额交易产生的变动数	8,011,190.46	-1,884,586.03	6,126,604.43
其中：基金申购款	8,749,782.60	-2,006,907.98	6,742,874.62
基金赎回款	-738,592.14	122,321.95	-616,270.19
本期已分配利润	-3,983,601.48	-	-3,983,601.48
本期末	6,488,888.39	-1,449,124.28	5,039,764.11

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	198,826.14
定期存款利息收入	51,527.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,222.01
其他	2,198.17
合计	280,774.10

6.4.7.9 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	985,454,877.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	961,565,149.62

减：应收利息总额	20,052,269.50
买卖债券差价收入	3,837,458.22

6.4.7.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-6,758,924.35
——股票投资	-
——债券投资	-6,758,924.35
——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	-6,758,924.35

6.4.7.11 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,209.07
转换费收入	79.61
合计	1,288.68

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全部归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费全部归入转出基金的基金资产。

6.4.7.12 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	8,229.90
银行间市场交易费用	16,675.00
合计	24,904.90

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	119,344.68
银行汇划费用	13,573.68
帐户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	176,381.38

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：

本基金的基金管理人于 2016 年 7 月 15 日发布公告：每 10 份基金份额派发红利 0.11 元（华安年年盈 A/C）。权益登记日及除息日：2016 年 7 月 19 日；现金红利发放日：2016 年 7 月 20 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

无。

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(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月3日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,274,122.17	955,885.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,286,757.28	444,044.46

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月3日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	935,463.52	273,110.07

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C	合计
华安基金管理有限公司	-	40,325.37	40,325.37
中国银行股份有限公司	-	16,331.89	16,331.89
合计	-	56,657.26	56,657.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年2月3日（基金合同生效日）至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C	合计
华安基金管理有限公司	-	1,222.04	1,222.04
中国银行股份有限公司	-	27,242.49	27,242.49
合计	-	28,464.53	28,464.53

注：支付基金销售机构的C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日基金资产净值 ×0.3% / 当年天数。

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

无。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年2月3日（基金合同生效日）

			至2015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
中国银行股份有限公司	41,106,819.03	198,826.14	2,991,356.04	53,816.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

华安年年盈定期开放债券 A

单位：人民币元

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
		场内	场外					
1	2016-01-20	-	2016-01-20	0.1100	3,334,368.32	66,621.15	3,400,989.47	-
2	2016-04-20	-	2016-04-20	0.1550	13,806,834.05	1,193,850.21	15,000,684.26	-
合计				0.2650	17,141,202.37	1,260,471.36	18,401,673.73	-

华安年年盈定期开放债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额	现金形式发放总额	再投资形式发放总	利润分配合计	备注

		场内	场外	分红数		额		
1	2016-01-20	-	2016-01-20	0.1030	264,298.03	7,865.01	272,163.04	-
2	2016-04-20	-	2016-04-20	0.1490	3,094,133.84	617,304.60	3,711,438.44	-
合计				0.2520	3,358,431.87	625,169.61	3,983,601.48	-

6.4.12 期末（2016 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 2016 年 6 月 30 日止，本基金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 398,498,802.25 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

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
160418	16 农发 18	2016-07-04	102.35	2,000,000.00	204,700,000.00
160303	16 进出 03	2016-07-04	100.26	500,000.00	50,130,000.00
160206	16 国开 06	2016-07-05	99.88	700,000.00	69,916,000.00
160303	16 进出 03	2016-07-05	100.26	500,000.00	50,130,000.00
160210	16 国开 10	2016-07-05	99.95	300,000.00	29,985,000.00
合计				4,000,000.00	404,861,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，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 349,100,000.00 元，于 2016 年 7 月 25 日前陆续到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，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

本基金为定期开放式的债券型基金，其预期的风险水平和收益水平为证券投资基金中的低风险品种，其长期预期的风险水平低于股票基金、混合基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。本基金在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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管理、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。

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本基金的托管行中国工商银行，因而与该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。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。针对兑付赎回

资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，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 20%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

应收证券清算款	-	-	-	-	-
银行存款	41,106,819.03	-	-	-	41,106,819.03
结算备付金	6,320,814.91	-	-	-	6,320,814.91
存出保证金	32,693.17	-	-	-	32,693.17
交易性金融资产	593,121,801.60	576,948,516.40	792,662,194.70	-	1,962,732,512.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	17,388,009.09	17,388,009.09
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	640,582,128.71	576,948,516.40	792,662,194.70	17,388,009.09	2,027,580,848.90
负债					
其他负债	-	-	-	144,207.70	144,207.70
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	747,598,802.25	-	-	-	747,598,802.25
应付证券清算款	-	-	-	34,008,086.55	34,008,086.55
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	707,754.06	707,754.06
应付托管费	-	-	-	202,215.46	202,215.46
应付销售服务费	-	-	-	62,087.55	62,087.55
应付交易费用	-	-	-	17,645.45	17,645.45
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	204,338.25	204,338.25
应付利润	-	-	-	-	-
负债总计	747,598,802.25	-	-	35,346,335.02	782,945,137.27
利率敏感度缺口	-107,016,673.54	576,948,516.40	792,662,194.70	-17,958,325.93	1,244,635,711.63
上年度末 2015 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	1,313,065.26	-	-	-	1,313,065.26
结算备付金	1,977,998.98	-	-	-	1,977,998.98
存出保证金	24,101.22	-	-	-	24,101.22

交易性金融资产	151,314,363.80	244,393,729.40	64,444,113.00	-	460,152,206.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,592,955.34	9,592,955.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	154,629,529.26	244,393,729.40	64,444,113.00	9,592,955.34	473,060,327.00
负债					
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	11,215.80	11,215.80
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	121,936,725.00	-	-	-	121,936,725.00
应付证券清算款	-	-	-	97,179.86	97,179.86
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	207,256.28	207,256.28
应付托管费	-	-	-	59,216.09	59,216.09
应付销售服务费	-	-	-	6,985.18	6,985.18
应付交易费用	-	-	-	17,282.74	17,282.74
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	290,000.00	290,000.00
负债总计	121,936,725.00	-	-	689,135.95	122,625,860.95
利率敏感度缺口	32,692,804.26	244,393,729.40	64,444,113.00	8,903,819.39	350,434,466.05

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者予以分类。

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：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 2,056	增加约 274
	市场利率上升 25 个基点	减少约 2,014	减少约 270

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

无。

7 投资组合报告

7.1 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,962,732,512.70	96.80
	其中：债券	1,962,732,512.70	96.80
	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	47,427,633.94	2.34
7	其他各项资产	17,420,702.26	0.86
8	合计	2,027,580,848.90	100.00

7.2 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期未买入股票。

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

本基金本报告期未卖出股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	181,842,000.00	14.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	644,741,000.00	51.80
	其中：政策性金融债	644,741,000.00	51.80
4	企业债券	304,772,878.80	24.49
5	企业短期融资券	579,820,000.00	46.59
6	中期票据	129,240,000.00	10.38
7	可转债（可交换债）	122,316,633.90	9.83

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,962,732,512.70	157.70

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

金额单位：人民币元

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	160210	16 国开 10	2,700,000	269,865,000.00	21.68
2	160418	16 农发 18	2,000,000	204,700,000.00	16.45
3	160303	16 进出 03	1,000,000	100,260,000.00	8.06
4	160206	16 国开 06	700,000	69,916,000.00	5.62
5	136330	16 扬城控	600,000	60,006,000.00	4.82

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投资。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,693.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,388,009.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,420,702.26

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132001	14 宝钢 EB	17,280,000.00	1.39

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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
华安年年盈定期开放债券 A	4,749	204,036.01	49,334,842.00	5.09%	919,632,165.49	94.91%
华安年年盈定期开放债券 C	2,182	114,436.52	0.00	0.00%	249,700,480.08	100.00%
合计	6,931	175,828.52	49,334,842.00	4.05%	1,169,332,645.57	95.95%

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）。

8.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安年年盈定期开放债券 A	1.44	0.00%
	华安年年盈定期开放债券 C	-	-
	合计	1.44	0.00%

注：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

项目	华安年年盈定期开放债券 A	华安年年盈定期开放债券 C
基金合同生效日（2015 年 2 月 3	309,111,551.85	26,412,428.34

日）基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	309,180,852.14	26,423,602.00
本报告期基金总申购份额	882,500,555.11	243,846,277.85
减：本报告期基金总赎回份额	222,714,399.76	20,569,399.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	968,967,007.49	249,700,480.08

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

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	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。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	145,856,661.70	38.56%	574,700,000.00	11.13%	-	-
长江证券	91,145,991.95	24.10%	239,840,000.00	4.65%	-	-
国信证券	-	-	1,022,100,000.00	19.80%	-	-
安信证券	141,236,602.10	37.34%	3,326,200,000.00	64.43%	-	-

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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加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	2016-01-14
5	华安基金管理有限公司关于华安年年盈定期开放债券型证券投资基金非货币市场基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-18
6	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝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	2016-01-19
7	关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-25
8	关于华安年年盈债券基金新增平安银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-28
9	华安年年盈定期开放债券型证券投资基金开	《上海证券报》、《证券时	2016-02-02

	放申购、赎回及转换业务的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
10	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工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	2016-02-03
11	关于旗下华安年年盈定期开放债券基金增加兴业银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-05
12	关于旗下华安年年盈定期开放债券基金增加上海银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-06
13	关于旗下华安年年盈定期开放债券基金增加渤海银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-18
14	关于旗下华安年年盈定期开放债券基金增加上海农商行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-18
15	关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
16	关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加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	2016-02-25
17	关于旗下部分基金增加好买基金为销售机构并参加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	2016-03-24
18	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24
19	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
20	关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加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	2016-03-30
21	华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
22	关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
23	华安基金管理有限公司关于华安年年盈定期开放债券型证券投资基金非货币市场基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-16

24	关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加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	2016-04-19
25	关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加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	2016-04-26
26	关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加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	2016-04-29
27	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
28	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
29	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
30	关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加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	2016-05-10
31	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工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	2016-05-10
32	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-13
33	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
34	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
35	关于旗下部分基金增加大连银行为销售机构并参加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	2016-05-28
36	关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加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	2016-06-02
37	关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加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	2016-06-03
38	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2016-06-03

		司网站	
39	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
40	关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加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	2016-06-14
41	关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加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	2016-06-21
42	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2016-06-28

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。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安年年盈定期开放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盈定期开放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

基金管理人及基金托管人住所，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

二〇一六年八月二十六日