

华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十三日

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 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 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 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 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 37 |
| 7.6 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 | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 38 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 | 38 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 38 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 38 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 39 |
| 8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 39 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 错误！未定义书签。 |
| 8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 40 |

| | |
|--|------------------|
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 错误！未定义书签。 |
| 9 开放式基金份额变动 | 40 |
| 10 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 40 |
| 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 | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 41 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 41 |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 | 41 |
| 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 | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 41 |
| 10.8 其他重大事件 | 42 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 12 备查文件目录 | 错误！未定义书签。 |
| 12.1 备查文件目录 | 44 |
| 12.2 存放地点 | 44 |
| 12.3 查阅方式 | 45 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------------|------------------|
| 基金名称 | 华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华安聚利 18 个月定开债 | |
| 基金主代码 | 002948 | |
| 交易代码 | 002948 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 月 9 日 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,704,527,032.60 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002948 | 002949 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,502,867,319.78 份 | 201,659,712.82 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 | <p>封闭期内策略：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，动态调整大类资产配置比例，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，综合考量各类券种的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|------|------|--------------|--------------|
| 名称 | | 华安基金管理有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 钱鲲 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 010-58560666 |

| | | | |
|--------|------|--------------------------|-----------------------|
| 负责人 | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95568 |
| 传真 | | 021-68863414 | 010-58560798 |
| 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2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2号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | | 朱学华 | 洪崎 |

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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|
| | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C |
| 本期已实现收益 | 11,766,010.43 | 1,183,360.10 |
| 本期利润 | 9,299,787.02 | 851,733.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0062 | 0.0042 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.63% | 0.43% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.63% | 0.43% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日) | |
| | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C |
| 期末可供分配利润 | -18,035,639.31 | -3,127,614.31 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0120 | -0.0155 |

| | | |
|---------------------|------------------------------|-----------------|
| 期末基金资产净值 | 1,484,831,680.47 | 198,532,098.51 |
| 期末基金份额净值 | 0.9880 | 0.9845 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日) | |
| | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C |
| 基金份额累计净值增长率 | -1.20% | -1.55% |

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

华安聚利 18 个月定开债 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 | 1.01% | 0.03% | 0.90% | 0.06% | 0.11% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.56% | 0.05% | -0.88% | 0.08% | 1.44% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.63% | 0.05% | -2.11% | 0.08% | 2.74% | -0.03% |
| 过去一年 | -1.20% | 0.07% | -4.28% | 0.10% | 3.08% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.20% | 0.07% | -4.28% | 0.10% | 3.08% | -0.03% |

华安聚利 18 个月定开债 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 | 0.97% | 0.03% | 0.90% | 0.06% | 0.07% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.46% | 0.05% | -0.88% | 0.08% | 1.34% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.43% | 0.05% | -2.11% | 0.08% | 2.54% | -0.03% |
| 过去一年 | -1.55% | 0.07% | -4.28% | 0.10% | 2.73% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.55% | 0.07% | -4.28% | 0.10% | 2.73% | -0.03% |

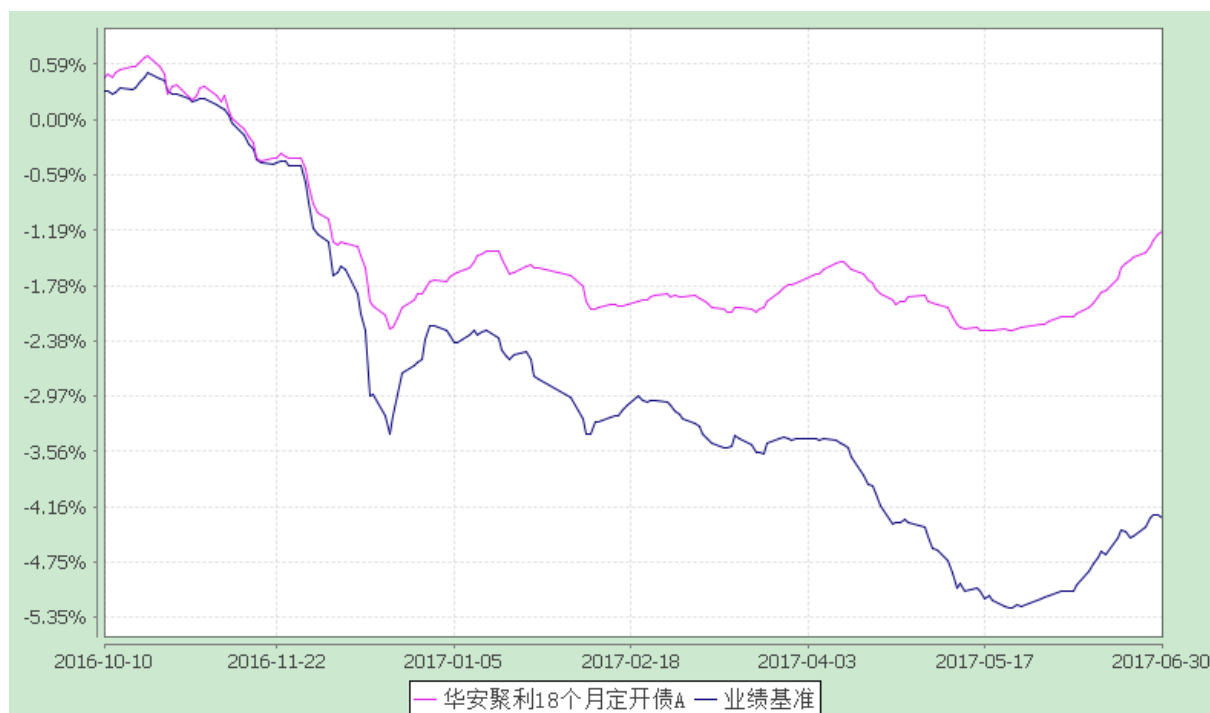
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

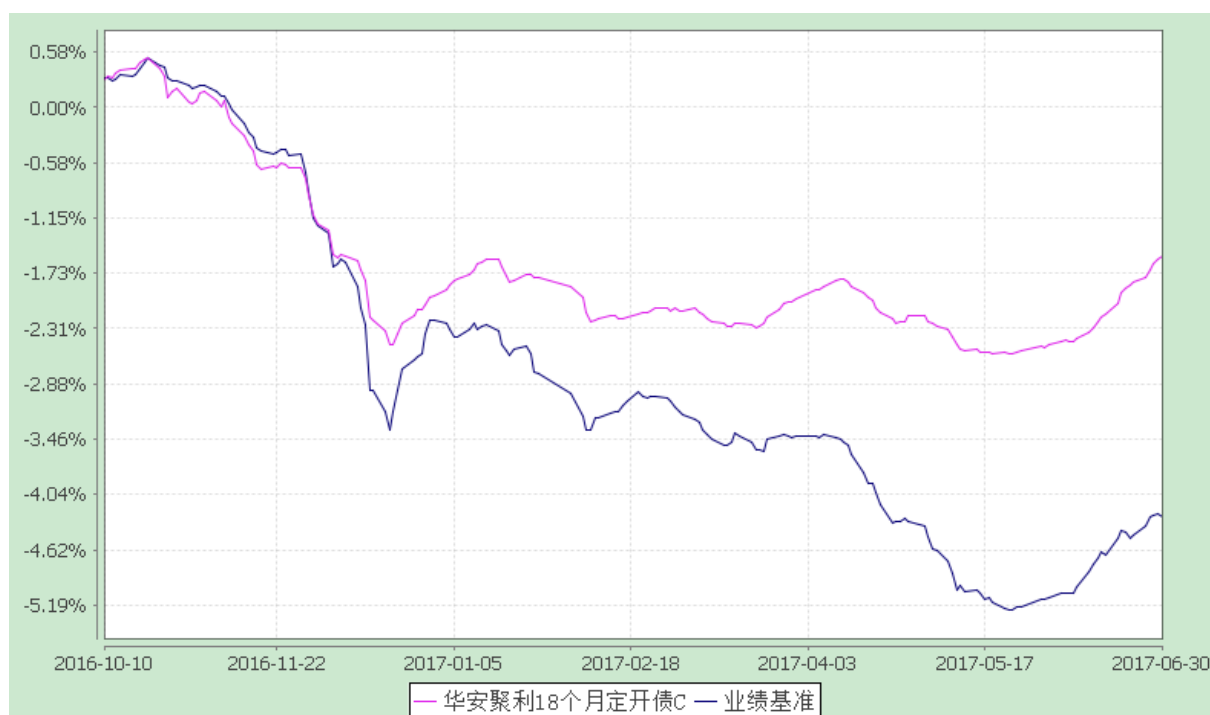
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 8 月 9 日至 2017 年 6 月 30 日)

华安聚利 18 个月定开债 A



华安聚利 18 个月定期开债 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。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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 | | |
| 石雨欣 | 本基金的基金经理 | 2016-08-09 | - | 10 年 | 硕士研究生，10 年相关行业从业经验，曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司，任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月至 2017 年 6 月，担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任本基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月起，同时担任华安新安平灵活配置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合规守信情况的说明

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、邮件发送、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，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，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，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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5

日内)的同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

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% 的次数为 0 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

2017 年上半年随着房地产和基建对经济的提振以及欧美经济的复苏带动,GDP 增速始终保持在 6.9% 的较高增速。工业生产保持平稳增长,工业增加值稳步回升,工业企业收入和盈利均保持良好的增长态势。上半年房地产调控不断升级,房地产销售增速有所下滑,但房地产投资增速回升,土地购置面积增速进一步上升;同时由于财政支出力度加大,基建保持了稳定的增长态势,制造业投资也有所恢复,投资总体上保持平稳增长。伴随欧美经济持续复苏,进出口出现显著恢复,出口对经济产生一定正面拉动作用。因此,上半年经济增长保持了较好的增长态势。上半年通胀总体保持温和,受食品价格的影响,CPI 前低后高,但总体上保持在 1.5% 以下的温和水平;PPI 上半年随着工业品价格的波动冲高回落,二季度 PPI 已经出现明显回落趋势。货币政策调控目标从保持经济增长转为降杠杆、防风险,央行一季度通过上调公开市场利率以及 MLF 等政策性工具利率,引导金融市场资金成本抬升,从而抑制金融杠杆的扩张。二季度在监管力度进一步加强对背景下,通过公开市场操作以及调节 MLF 投放力稳定市场预期,保持资金面的稳定。上半年债券市场在经济基本面保持稳定增长以及监管升级的影响下收益率总体震荡上行,其中 10 年期国债上行 55BP,5 年期 AA+ 中期票据收益率上行 70BP,上半年中债综合全价(总值)指数下跌 2.12%。

本基金上半年主要增持了短久期高等级信用债以及同业存单,保持组合短久期、高杠杆的操作,信用债配置坚持高等级为主,减持低等级信用债,提高组合流动性及信用水平,期内基金超过比较基准取得正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日,华安聚利 18 个月定开债 A 份额净值为 0.9880 元, C 份额净值为 0.9845 元;华安聚利 18 个月定开债 A 份额净值增长率为 0.63%, 同期业绩比较基准增长率为-2.11%, C 份额净值增长率为 0.43%, 同期业绩比较基准增长率为-2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年,随着财政支出力度的减弱以及地方债务整顿,基建增速下半年可能放缓,房地产调控的滞后效应可能在下半年逐步显现,同时企业去库存周期已经接近尾声,下半年经济增速有一定下滑风险。通胀水平三季度可能略有回升,但总体仍处于相对温和的水平,通胀对货币政策的压力相对可控。虽然近期 6 月份由于季节性因素,央行加大了对市场的投放力度,但从近期央行表态来看,中性的货币政策取向并未发生转变,金融防风险的进程还未结束,货币政策难言大幅放松,但基本面也不支持货币政策进一步收紧。总体上债券市场下半年的市场环境会好于上半年,债券的配置价值逐步显现。

本基金下半年计划根据市场情况进一步压缩久期,继续保持对中高等级短久期信用债及同业存单的投资为主,择机参与利率债波段性行情,保持组合流动性,继续提高组合收益水平。

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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,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;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 8,378,622.78 | 141,380,003.24 |

| | | | |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 结算备付金 | | 7,236,313.07 | 2,532,895.66 |
| 存出保证金 | | 59,473.73 | 17,196.73 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,598,127,581.00 | 1,050,615,245.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,598,127,581.00 | 1,050,615,245.00 |
| 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 | - | 499,889,680.33 |
| 应收证券清算款 | | 1,981,049.59 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 35,026,873.20 | 18,907,100.28 |
| 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 | | 2,650,809,913.37 | 1,713,342,121.24 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 965,547,838.12 | - |
| 应付证券清算款 | | - | 38,469,765.20 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | 6.4.10.2 | 1,099,880.61 | 1,135,138.54 |
| 应付托管费 | 6.4.10.2 | 206,227.63 | 212,838.50 |
| 应付销售服务费 | | 64,868.43 | 67,065.44 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 31,480.41 | 45,055.24 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 317,318.89 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 178,520.30 | 200,000.00 |
| 负债合计 | | 967,446,134.39 | 40,129,862.92 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,704,527,032.60 | 1,704,527,032.60 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -21,163,253.62 | -31,314,774.28 |
| 所有者权益合计 | | 1,683,363,778.98 | 1,673,212,258.32 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,650,809,913.37 | 1,713,342,121.24 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9876 元，基金份额总额 1,704,527,032.60

份，其中 A 类份额净值为 0.9880，基金份额总额为 1,502,867,319.78;C 类份额净值为 0.9845，基金份额总额为 201,659,712.82。

6.2 利润表

会计主体：华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|----------------------------|----------|---------------------------------|
| | | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 27,707,355.94 |
| 1.利息收入 | | 49,587,561.88 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 292,814.89 |
| 债券利息收入 | | 48,488,249.18 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 806,497.81 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -19,125,973.92 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -19,125,973.92 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -2,797,849.87 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 43,617.85 |
| 减：二、费用 | | 17,555,835.28 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 6,634,668.24 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 1,244,000.34 |
| 3. 销售服务费 | | 391,583.38 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 22,301.50 |
| 5. 利息支出 | | 9,060,789.82 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 9,060,789.82 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 202,492.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 10,151,520.66 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 10,151,520.66 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 1,704,527,032.60 | -31,314,774.28 | 1,673,212,258.32 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 10,151,520.66 | 10,151,520.66 |
| 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） | 1,704,527,032.60 | -21,163,253.62 | 1,683,363,778.98 |

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：朱兴华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安聚利 18 个月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[2016]1292 号《关于准予华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2016 年 7 月 6 日到 2016 年 8 月 5 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(2016)验字第 60971571_B14 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 2016 年 8 月 9 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 1,703,971,990.48 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 555,042.12

元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,704,527,032.60 元，折合 1,704,527,032.60 份基金份额，其中 A 类基金份额 1,502,867,319.78 份，C 类基金份额 201,659,712.82 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、债券回购、银行存款、同业存单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）。本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

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：基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但每次开放期开始前一个月至开放期结束后一个月的期间不受前述比例限制。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%，封闭期内不受上述 5% 的比例限制。

本基金业绩比较基准：中债综合全价指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 8 月 23 日批准报出。

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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

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。

6.4.4.1 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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为债券投资；

(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债券等，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，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) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交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；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2) 回购协议

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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) 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；

(6) 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；

(7) 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) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率逐日计提；

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，在每个封闭期起始日起 12 个公历月后对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日），若本基金每份 A 类基金份额的可供分配利润不低于 0.04 元，则本基金必须进行收益分配。收益分配基准日即为上述对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日），且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%；

(2) 本基金 A 类基金份额的收益分配方式分两种：现金分红或红利再投资，投资者可选择现金

红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金 C 类基金份额的收益分配方式为红利再投资；

(3) 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；

(4) 本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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[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 增值税

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。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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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 2017 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 8,378,622.78 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 8,378,622.78 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 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 | 542,305,726.46 | 528,096,581.00 | -14,209,145.46 |
| | 银行间市场 | 2,080,214,541.85 | 2,070,031,000.00 | -10,183,541.85 |
| | 合计 | 2,622,520,268.31 | 2,598,127,581.00 | -24,392,687.31 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,622,520,268.31 | 2,598,127,581.00 | -24,392,687.31 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 659.34 |
| 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 | 2,930.76 |
| 应收债券利息 | 35,023,258.98 |
| 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 | 24.12 |
| 合计 | 35,026,873.20 |

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017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 | 31,480.41 |
| 合计 | 31,480.41 |

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 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 | 39,671.58 |
| 预提信息披露费 | 138,848.72 |
| 合计 | 178,520.30 |

6.4.7.8 实收基金

华安聚利 18 个月定开债 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,502,867,319.78 | 1,502,867,319.78 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,502,867,319.78 | 1,502,867,319.78 |

华安聚利 18 个月定开债 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 201,659,712.82 | 201,659,712.82 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 201,659,712.82 | 201,659,712.82 |

6.4.7.9 未分配利润

华安聚利 18 个月定开债 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 | -8,292,842.23 | -19,042,584.10 | -27,335,426.33 |
| 本期利润 | 11,766,010.43 | -2,466,223.41 | 9,299,787.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,473,168.20 | -21,508,807.51 | -18,035,639.31 |

华安聚利 18 个月定开债 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 | -1,427,094.61 | -2,552,253.34 | -3,979,347.95 |
| 本期利润 | 1,183,360.10 | -331,626.46 | 851,733.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -243,734.51 | -2,883,879.80 | -3,127,614.31 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 52,243.50 |
| 定期存款利息收入 | 201,666.54 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 38,661.61 |
| 其他 | 243.24 |
| 合计 | 292,814.89 |

6.4.7.11 股票投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,198,396,040.98 |

| | |
|------------------------|------------------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,202,274,156.15 |
| 减：应收利息总额 | 15,247,858.75 |
| 买卖债券差价收入 | -19,125,973.92 |

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

无。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -2,797,849.87 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -2,797,849.87 |
| ——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 | -2,797,849.87 |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 其他收入_其他 | 43,617.85 |
| 合计 | 43,617.85 |

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 776.50 |

| | |
|-----------|-----------|
| 银行间市场交易费用 | 21,525.00 |
| 合计 | 22,301.50 |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 138,848.72 |
| 银行汇划费用 | 5,316.70 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 其他费用 | 655.00 |
| 合计 | 202,492.00 |

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

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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 |
| 中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”) | 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 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,634,668.24 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,680,793.90 |

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,244,000.34 |

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 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
|----------------|----------------------------|-----------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C | 合计 |
| 华安基金管理有限公司 | - | 224.19 | 224.19 |
| 中国民生银行 | - | 311,450.11 | 311,450.11 |
| 合计 | - | 311,674.30 | 311,674.30 |

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 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 8,378,622.78 | 52,243.50 |

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。

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管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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民生银行，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。

6.4.13.2.1 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 2017年6月30日 | 上年末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | 59,980,000.00 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,378,734,000.00 | 125,695,000.00 |
| 合计 | 1,438,714,000.00 | 125,695,000.00 |

注：未评级债券为超短期融资券。

6.4.13.2 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 2017年6月30日 | 上年末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 380,198,000.00 | 153,572,000.00 |
| AAA 以下 | 779,215,581.00 | 771,348,245.00 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 1,159,413,581.00 | 924,920,245.00 |

注：未评级债券为国债、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。

本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。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。

除卖出回购金融资产款到期日为一个半月以内且计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，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 2017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 | 8,378,622.78 | - | - | - | 8,378,622.78 |
| 结算备付金 | 7,236,313.07 | - | - | - | 7,236,313.07 |
| 存出保证金 | 59,473.73 | - | - | - | 59,473.73 |
| 交易性金融资产 | 1,831,229,000.00 | 682,053,581.00 | 84,845,000.00 | - | 2,598,127,581.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,981,049.59 | 1,981,049.59 |
| 应收利息 | - | - | - | 35,026,873.20 | 35,026,873.20 |
| 资产总计 | 1,846,903,409.58 | 682,053,581.00 | 84,845,000.00 | 37,007,922.79 | 2,650,809,913.37 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 965,547,838.12 | - | - | - | 965,547,838.12 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,099,880.61 | 1,099,880.61 |
| 应付托管费 | - | - | - | 206,227.63 | 206,227.63 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 64,868.43 | 64,868.43 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 31,480.41 | 31,480.41 |
| 应付利息 | - | - | - | 317,318.89 | 317,318.89 |
| 其他负债 | - | - | - | 178,520.30 | 178,520.30 |
| 负债总计 | 965,547,838.12 | - | - | 1,898,296.27 | 967,446,134.39 |
| 利率敏感度缺口 | 881,355,571.46 | 682,053,581.00 | 84,845,000.00 | 35,109,626.52 | 1,683,363,778.98 |
| 上年度末 2016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 | 141,380,003.24 | - | - | - | 141,380,003.24 |
| 结算备付金 | 2,532,895.66 | - | - | - | 2,532,895.66 |
| 存出保证金 | 17,196.73 | - | - | - | 17,196.73 |
| 交易性金融资产 | 166,401,000.00 | 749,390,245.00 | 134,824,000.00 | - | 1,050,615,245.00 |
| 买入返售金融资产 | 499,889,680.33 | - | - | - | 499,889,680.33 |
| 应收利息 | - | - | - | 18,907,100.28 | 18,907,100.28 |
| 资产总计 | 810,220,775.96 | 749,390,245.00 | 134,824,000.00 | 18,907,100.28 | 1,713,342,121.24 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人费 | - | - | - | 1,135,138.54 | 1,135,138.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | 212,838.50 | 212,838.50 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 45,055.24 | 45,055.24 |
| 应付销售费 | - | - | - | 67,065.44 | 67,065.44 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 38,469,765.20 | 38,469,765.20 |
| 其他负债 | - | - | - | 200,000.00 | 200,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 40,129,862.92 | 40,129,862.92 |
| 利率敏感度缺口 | 810,220,775.96 | 749,390,245.00 | 134,824,000.00 | -21,222,762.64 | 1,673,212,258.32 |

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 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 648 | 增加约 647 |
| 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 643 | 减少约 640 | |

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。

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 | 2,598,127,581.00 | 98.01 |
| | 其中：债券 | 2,598,127,581.00 | 98.01 |
| | 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 | 15,614,935.85 | 0.59 |
| 7 | 其他各项资产 | 37,067,396.52 | 1.40 |
| 8 | 合计 | 2,650,809,913.37 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 592,515,581.00 | 35.20 |
| 5 | 企业短期融资券 | 581,064,000.00 | 34.52 |
| 6 | 中期票据 | 566,898,000.00 | 33.68 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 857,650,000.00 | 50.95 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,598,127,581.00 | 154.34 |

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 | 136426 | 16 电投 01 | 1,000,000 | 99,240,000.00 | 5.90 |
| 2 | 111790665 | 17 杭州银行 CD018 | 1,000,000 | 95,740,000.00 | 5.69 |
| 3 | 122295 | 13 川投 01 | 800,000 | 81,856,000.00 | 4.86 |
| 4 | 111799766 | 17 青岛银 | 800,000 | 78,184,000.00 | 4.64 |

| | | | | | |
|---|-----------|-----------------|---------|---------------|------|
| | | 行 CD082 | | | |
| 5 | 011754090 | 17 康美 SCP001 | 600,000 | 60,162,000.00 | 3.57 |

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金投资的前十名股票中，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 | 59,473.73 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,981,049.59 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 35,026,873.20 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 37,067,396.52 |

7.12.4 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。

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的情况。

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 | 持有份额 | 占总份 |
| | | | | | | |

| | | | | 额比例 | | 额比例 |
|---------------------|-------|------------|----------------|--------|----------------------|-------------|
| 华安聚利 18 个月 定开债 A | 5,623 | 267,271.44 | 620,069,100.18 | 41.26% | 882,798,219.60 | 58.74% |
| 华安聚利 18 个月 定开债 C | 3,598 | 56,047.72 | 0.00 | 0.00% | 201,659,712.82 | 100.00 % |
| 合计 | 9,221 | 184,852.73 | 620,069,100.18 | 36.38% | 1,084,457,932. 42 | 63.62% |

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 | 华安聚利 18 个月定开 债 A | 8.36 | 0.00% |
| | 华安聚利 18 个月定开 债 C | 10,017.35 | 0.00% |
| | 合计 | 10,025.71 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发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 | 华安聚利 18 个月定开债 A | 华安聚利 18 个月定开债 C |
|-------------------------------|------------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 8 月 9 日）基金份额总额 | 1,502,867,319.78 | 201,659,712.82 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,502,867,319.78 | 201,659,712.82 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 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 | 1,502,867,319.78 | 201,659,712.82 |

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：

2017 年 8 月 9 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

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：

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

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 | |
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《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 |
| 东兴证券 | 410,481,516.61 | 100.00% | 6,947,765,000.00 | 100.00% | - | - |

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 | 2017-02-13 |
| 2 | 关于旗下华安旗下部分基金增加肯特瑞为销售机构的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-02-16 |
| 3 | 关于旗下部分基金增加朝阳永续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 | 2017-02-22 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | | 司网站 | |
| 4 | 华安基金关于参加平安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 | 2017-02-22 |
| 5 | 关于旗下部分基金增加华阳众惠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 | 2017-03-02 |
| 6 | 关于旗下部分基金增加华夏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 | 2017-03-21 |
| 7 | 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 | 2017-03-28 |
| 8 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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 | 2017-04-06 |
| 9 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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 | 2017-04-22 |
| 10 | 关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-25 |
| 11 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-25 |
| 12 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-26 |
| 13 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-27 |
| 14 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-28 |
| 15 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-04-29 |
| 16 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-05-03 |
| 17 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-05-04 |
| 18 | 华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务 | 《上海证券报》、《证券时 | 2017-05-06 |

| | | | |
|----|-------------------------------|-----------------------------|------------|
| | 管理指引》实施的风险提示性公告 | 报》、《中国证券报》和公司网站 | |
| 19 | 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 | 2017-05-10 |
| 20 | 关于旗下部分基金增加武汉伯嘉为销售机构并参加费率优惠的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-05-17 |
| 21 | 关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-06-07 |
| 22 | 华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-06-07 |
| 23 | 关于旗下部分基金增加科地瑞富为销售机构并参加费率优惠的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-06-12 |
| 24 | 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公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2017-06-27 |

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其更新招募说明书
- 3、《华安聚利 18 个月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聚利 18 个月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；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十三日