

**华安安心收益债券型证券投资基金**  
**2013 年半年度报告**  
**2013 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

## § 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 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 2013 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.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
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.....	10
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.....	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	35
7.1	期末基金资产组合情况.....	35
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.....	37
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	40
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.10	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.....	42

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.....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
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	华安安心收益债券型证券投资基金	
基金简称	华安安心收益债券	
基金主代码	040036	
交易代码	040036	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月7日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	457,856,457.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安安心收益债券A类	华安安心收益债券B类
下属分级基金的交易代码	040036	040037
报告期末下属分级基金的份额总额	229,474,617.48份	228,381,840.44份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制流动性和风险的前提下，力争持续稳定地实现超越比较基准的当期收益。
投资策略	本基金以“3年运作周期滚动”的方式投资运作。在每个运作期内采用“华安避险增值机制”，动态调整基础资产和风险资产的配置比例，定期锁定投资收益，控制基金资产净值的波动幅度，实现基金资产的长期稳定增值。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证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因子模型等数量工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定风险资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种和权益类资产之间的配置比例。

业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险和预期收益水平低于股票基金和混合基金，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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	胡涛
	联系电话	021-38969999	010-68858112
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4008850099	95580
传真		021-68863414	010-68858120
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	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		李劼	李国华

### 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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）	
	华安安心收益债券 A 类	华安安心收益债券 B 类
本期已实现收益	8,062,351.15	8,630,298.38
本期利润	8,552,704.52	9,443,326.04
加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0334
本期加权平均净值利润率	3.20%	3.24%
本期基金份额净值增长率	3.17%	3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	华安安心收益债券 A 类	华安安心收益债券 B 类
期末可供分配利润	8,124,906.30	8,411,188.05
期末可供分配基金份额利润	0.0354	0.0368
期末基金资产净值	239,096,376.45	238,285,398.84
期末基金份额净值	1.042	1.043
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	华安安心收益债券 A 类	华安安心收益债券 B 类
基金份额累计净值增长率	5.03%	5.13%

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）。

4、本基金于 2012 年 9 月 7 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

#### 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

华安安心收益债券 A 类

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

	率①	准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	-0.76%	0.31%	0.35%	0.00%	-1.11%	0.31%
过去三个月	1.46%	0.25%	1.06%	0.00%	0.40%	0.25%
过去六个月	3.17%	0.21%	2.11%	0.00%	1.06%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.03%	0.16%	3.45%	0.00%	1.58%	0.16%

华安安心收益债券 B 类

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	-0.86%	0.30%	0.35%	0.00%	-1.21%	0.30%
过去三个月	1.46%	0.24%	1.06%	0.00%	0.40%	0.24%
过去六个月	3.07%	0.20%	2.11%	0.00%	0.96%	0.20%
自基金合同生效起至今	5.13%	0.16%	3.45%	0.00%	1.68%	0.16%

注：本基金业绩比较基准：本基金整体业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）

根据本基金合同的有关规定：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、中央银行票据、地方政府债、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等固定收益类品种，国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资比例限制为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。

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

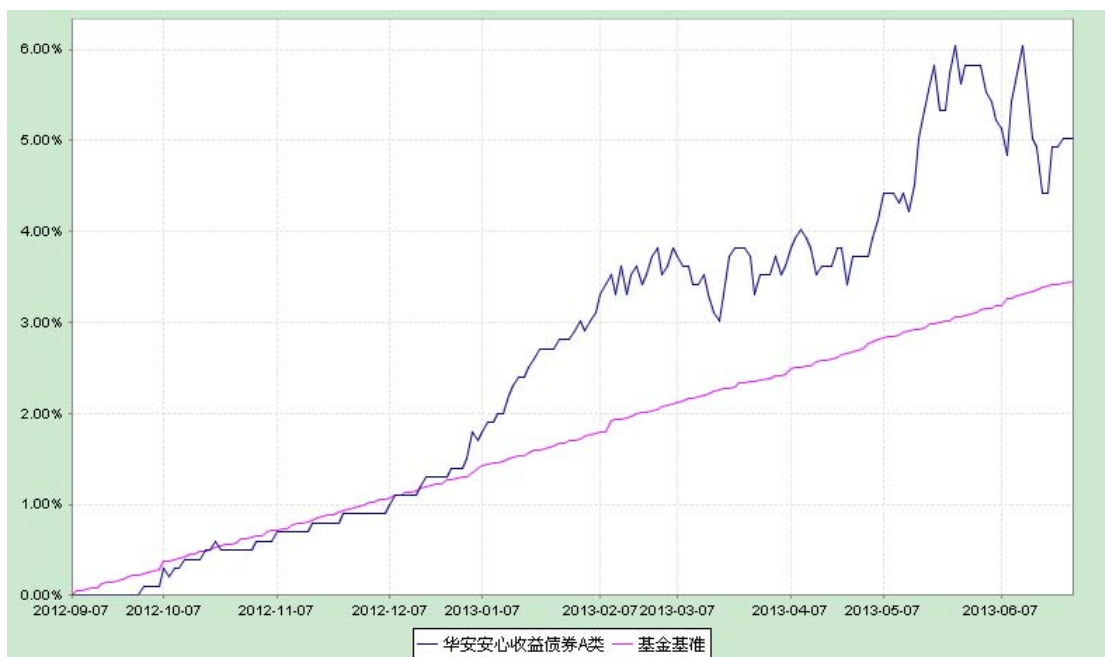
华安安心收益债券型证券投资基金

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

(2012 年 9 月 7 日至 2013 年 6 月 30 日)

华安安心收益债券 A 类





华安安心收益债券 B 类



注：1. 本基金于 2012 年 9 月 7 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。  
 2. 根据《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为 6 个月。  
 截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同中投资范围、投资限制的有  
 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 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 只封闭式证券投资基金，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、华安双月鑫短期理财债券、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、华安安信消费等 38 只开放式基金。管理资产规模达到 782.67 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		
郑可成	本基金的基金经理	2012-09-07	-	11 年	硕士研究生，11 年证券投资基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研

					<p>究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。</p> <p>2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2012 年 11 月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。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 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。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、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。  
2、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有关法律法规及《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安安心收益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 2 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极少，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

一季度，全球主要经济体持续货币宽松，尤其日本以前所未有的力度加入量化宽松的行列。国内经济延续去年四季度以来的复苏态势，但企业再库存力度弱于预期，制造业投资增速下滑。通胀温和，热钱加速流入，央行货币政策转为中性，春节后了加大公开市场货币回收力度。进入二季度，美联储的 QE 退出已经箭在弦上，对各市场造成较大负面的影响。国内经济复苏态势中止，各项宏观数据低于预期，外汇占款增速急剧下滑。制度层面二季度也是集中释放期，债券市场开始清理各种不合规交易行为，银行的表外资产扩张受到约束，这都对市场原有的资金链条产生较大冲击。加上央行货币政策转为收紧，五月中旬开始市场资金价格上升明显，六月中下旬达到顶点，多品种回购利率创历史新高。在此背景下，股票和债券市场双双走出了一波“过山车”行情。特别是中短期利率品种和信用品种，收益率在继续下行后，随资金面的紧张出现快速上升，部分品种达到 11 年的高点。而股票市场也在快速上涨后，又迅速下跌再创新低，板块之间分化严重。可转债市场的期权价值先膨胀后快速收缩，估值水平迅速下降至去年底水

平。

华安安心收益债券基金年初采用了较高的杠杆比率，并在配置上向中等评级低久期信用产品倾斜，取得了较好的票息回报，但在资本利得方面由于久期较短没有取得预期回报。进入二季度后在债券上降低杠杆，在权益类投资上加大投入，主要在 TMT、新媒体\消费以及军工板块进行了配置，取得了较好的正回报，但对净值造成较大的波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，华安安心收益债券 A 份额净值为 1.042 元，B 份额净值为 1.043 元；华安安心收益债券 A 份额净值增长率为 3.17%，B 份额净值增长率为 3.07%，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 2013 年下半年，全球经济继续再平衡。美国复苏态势平稳，欧洲仍在余震而日本则有望将安倍经济学维持较长一段时期。国内宏观经济将保持“弱衰退”态势，通胀保持相对低位。在“保底”思路的指导，经济将不会出现崩溃论预期的情形。但影子银行的清理以及对地方融资平台的限制，仍将影响基建和地产投资未来的增速。对投资的过度依赖使得任何刺激计划的效用都很微弱，经济刺激计划难以重现。央行的货币政策继续从紧，美元走强后外汇占款方面仍是资金面的一大风险，CPI 保持在低位。三季度股票市场 IPO 重启，资金面的风险以及经济数据低于预期的风险都将继续对股票估值形成系统压制。债券市场在深度调整后，信用产品静态收益已经具备一定的吸引力。在此背景下，我们对债券市场仍然持较乐观态度，预期收益率曲线将随资金面恢复常态呈现陡峭化。中短期信用品种在绝对收益方面将有较好表现，利率产品存在波段性机会。股票市场行情将继续分化，高成长的行业和公司将继续受到市场追捧，而传统周期性行业机会仍然较少。我们仍将坚持票息为主的债券配置策略，根据央行的货币政策力度及时调节杠杆和久期，关注利率产品的波段性机会。在权益类方面，坚持自下而上的个股精选，并结合市场趋势采用绝对收益的思路进行操作。在新股 IPO 重启后，将会在深入个股研究的基础上，积极参与。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：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，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，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

翁启森，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。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，负责 QDII 基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金（QDII）、华安大中华升级基金（QDII）的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，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，现任华安优选基金经理、投资研究部

总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券、华安 7 日鑫短期理财的基金经理、固定收益部总监。

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，华安中国 A 股增强指数。现任华安上证 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

本报告期内实施了 2012 年度的第一次分红, 分红方案为: 0.081 元/10 份基金份额。  
权益登记日、除息日: 2013 年 1 月 23 日; 现金红利发放日: 2013 年 1 月 24 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, 本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 诚信、尽责地履行了基金托管人义务, 不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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, 本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查, 未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内, 本基金进行了一次收益分配。

#### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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, 认为其真实、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：华安安心收益债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,329,163.53	1,029,390.95
结算备付金		5,434,509.09	2,399,692.21
存出保证金		193,447.90	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	664,207,176.62	884,049,498.00
其中：股票投资		49,047,696.62	62,625.00
基金投资		-	-
债券投资		605,159,480.00	873,986,873.00
资产支持证券投资		10,000,000.00	10,000,000.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,495,958.51	1,984,099.99
应收利息	6.4.7.5	17,258,657.80	10,821,092.10
应收股利		-	-
应收申购款		4,724.77	358,284.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		696,923,638.22	900,892,058.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		214,999,850.00	244,599,620.00
应付证券清算款		792,824.22	-
应付赎回款		2,544,953.79	2,287,965.84
应付管理人报酬		261,625.80	368,729.89
应付托管费		60,375.21	85,091.51
应付销售服务费		70,572.76	106,240.39
应付交易费用	6.4.7.7	179,212.59	7,227.59

应交税费		174,409.81	56,609.81
应付利息		59,120.56	116,092.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	398,918.19	420,000.00
负债合计		219,541,862.93	248,047,577.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	457,856,457.92	640,769,455.66
未分配利润	6.4.7.1 0	19,525,317.37	12,075,025.08
所有者权益合计		477,381,775.29	652,844,480.74
负债和所有者权益总计		696,923,638.22	900,892,058.06

注：（1）报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 457,856,457.92 份，其中 A 类基金份额净值 1.042 元，基金份额总额 229,474,617.48 份；B 类基金份额净值 1.043 元，基金份额总额 228,381,840.44 份。

（2）本基金合同于 2012 年 9 月 7 日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>26,651,729.02</b>
1. 利息收入		16,661,157.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	114,177.67
债券利息收入		16,288,977.62
资产支持证券利息收入		238,027.40
买入返售金融资产收入		19,974.33
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,883,341.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,256,741.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	3,326,996.76
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	299,603.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,303,381.03

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	1, 803, 849. 79
<b>减：二、费用</b>		<b>8, 655, 698. 46</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 807, 901. 45
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	417, 208. 06
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	508, 657. 73
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	422, 811. 01
5. 利息支出		5, 331, 954. 50
其中：卖出回购金融资产支出		5, 331, 954. 50
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	167, 165. 71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17, 996, 030. 56</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17, 996, 030. 56</b>

注：本基金 2012 年 9 月 7 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：华安安心收益债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	640, 769, 455. 66	12, 075, 025. 08	652, 844, 480. 74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17, 996, 030. 56	17, 996, 030. 56
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）	-182, 912, 997. 74	-5, 601, 300. 42	-188, 514, 298. 16
其中：1. 基金申购款	26, 213, 749. 32	706, 118. 02	26, 919, 867. 34
2. 基金赎回款	-209, 126, 747. 06	-6, 307, 418. 44	-215, 434, 165. 50
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）	-	-4, 944, 437. 85	-4, 944, 437. 85
五、期末所有者权益（基金净值）	457, 856, 457. 92	19, 525, 317. 37	477, 381, 775. 29

注：本基金 2012 年 9 月 7 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：

基金管理公司负责人：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

华安安心收益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【2012】951号《关于核准华安安心收益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于2012年8月6日到2012年9月5日向社会公开募集,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(2012)验字第60971571\_B06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2012年9月7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867,858,805.81元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币487,937.72元,以上实收基金(本息)合计为人民币868,346,743.53元,折合868,346,743.53份基金份额。本基金以“3年运作周期滚动”方式运作,每个运作期结束本基金将安排不少于5个工作日的过渡期。根据申购费用收取方式的不同,本基金基金份额分为A类和B类基金份额。对于A类基金份额,投资者在运作期及过渡期内申购时收取申购费用;对于B类基金份额,投资者在运作期及过渡期内申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。在运作期内,A类基金份额和B类基金份额的赎回均收取赎回费用;在过渡期内,A类基金份额和B类基金份额的赎回均不收取赎回费用。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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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、中央银行票据、地方政府债、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等固定收益类品种,国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具,但须符合中

中国证监会的相关规定。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，如国债期货等，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金整体业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

#### **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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 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、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》，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[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。

## 2、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、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。

## 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	6,329,163.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,329,163.53

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		50,400,201.92	49,047,696.62	-1,352,505.30
债券	交易所市场	268,333,020.37	273,004,480.00	4,671,459.63
	银行间市场	329,708,367.11	332,155,000.00	2,446,632.89
	合计	598,041,387.48	605,159,480.00	7,118,092.52
资产支持证券		10,000,000.00	10,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		658,441,589.40	664,207,176.62	5,765,587.22

#### 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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	1,668.57
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	2,279.34
应收债券利息	16,979,857.99
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.58
其他	274,849.32
合计	17,258,657.80

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。



6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	172,391.47
银行间市场应付交易费用	6,821.12
合计	179,212.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	152.48
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	148,765.71
银行手续费	-
合计	398,918.19

6.4.7.9 实收基金

华安安心收益债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	298,469,105.82	298,469,105.82
本期申购	6,411,153.41	6,411,153.41
本期赎回（以“-”号填列）	-75,405,641.75	-75,405,641.75
本期末	229,474,617.48	229,474,617.48

华安安心收益债券 B 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	342,300,349.84	342,300,349.84
本期申购	19,802,595.91	19,802,595.91
本期赎回（以“-”号填列）	-133,721,105.31	-133,721,105.31
本期末	228,381,840.44	228,381,840.44

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 华安安心收益债券 A 类

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	3,444,466.61	1,925,616.72	5,370,083.33
本期利润	8,062,351.15	490,353.37	8,552,704.52
本期基金份额交易产生的变动数	-1,105,294.09	-919,117.42	-2,024,411.51
其中：基金申购款	121,412.86	82,901.79	204,314.65
基金赎回款	-1,226,706.95	-1,002,019.21	-2,228,726.16
本期已分配利润	-2,276,617.37	-	-2,276,617.37
本期末	8,124,906.30	1,496,852.67	9,621,758.97

##### 华安安心收益债券 B 类

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	4,493,842.19	2,211,099.56	6,704,941.75
本期利润	8,630,298.38	813,027.66	9,443,326.04
本期基金份额交易产生的变动数	-2,045,132.04	-1,531,756.87	-3,576,888.91
其中：基金申购款	285,485.68	216,317.69	501,803.37
基金赎回款	-2,330,617.72	-1,748,074.56	-4,078,692.28
本期已分配利润	-2,667,820.48	-	-2,667,820.48
本期末	8,411,188.05	1,492,370.35	9,903,558.40

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	60,137.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	54,026.13
其他	14.24
合计	114,177.67

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	122,247,588.73
减：卖出股票成本总额	118,990,847.31

买卖股票差价收入	3,256,741.42
----------	--------------

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	438,614,571.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	425,874,534.46
减：应收利息总额	9,413,039.90
债券投资收益	3,326,996.76

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	299,603.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	299,603.00

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	1,303,381.03
——股票投资	-1,361,130.30
——债券投资	2,664,511.33
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,303,381.03

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	1,784,479.68
转换费收入	19,370.11

合计	1,803,849.79
----	--------------

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	419,036.01
银行间市场交易费用	3,775.00
合计	422,811.01

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	119,012.93
帐户维护费	18,000.00
其他费用	400.00
合计	167,165.71

**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**

本报告期关联方关系未发生变化。

**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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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 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 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,807,901.45	-
其中：支付销售机构的客户维护费	586,192.86	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.65% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	417,208.06	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**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 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安心收益债	华安安心收益债	合计

	券 A 类	券 B 类	
华安基金管理有限公司	-	104,809.72	104,809.72
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	372,031.00	372,031.00
合计	-	476,840.72	476,840.72

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费按本基金 B 类基金份额前一日基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为本基金 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
邮储银行	6,329,163.53	60,137.30	-	-

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 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

华安安心收益债券A类

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
1	2013-01-23	2013-01-23	0.081	2,200,274.62	76,342.75	2,276,617.37	-
合计	-	-	0.081	2,200,274.62	76,342.75	2,276,617.37	-

华安安心收益债券B类

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
1	2013-01-23	2013-01-23	0.081	2,629,843.45	37,977.03	2,667,820.48	-
合计	-	-	0.081	2,629,843.45	37,977.03	2,667,820.48	-

6.4.12 期末（2013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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600292	中电 远达	2013-06- 05	公告 重大 事项	19.37	2013-0 7-01	17.50	201,300	2,962,232.50	3,899,181.00	-

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 2013 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金融资产款余额人民币 19,999,850.00 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
------	------	-------	------------	-------	------------

1382191	13南京港 MTN1	2013-07-04	100.73	200,000	20,146,000.00
合计		-	-	200,000	20,146,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 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人民币 195,000,000.00 元,于 2013 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或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

本基金是一只债券型证券投资基金,属于较高流动性、低风险品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。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。而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特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,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。

本基金的基金管理人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邮政储蓄银行股份有限公司,其为具有证券投资基金托管资格的银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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;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。



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。

#### 6.4.13.3 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通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易,其余亦可在证券交易所上市,除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金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,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2013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	6,329,163.53	-	-	-	6,329,163.53
结算备付金	5,434,509.09	-	-	-	5,434,509.09
存出保证金	193,447.90	-	-	-	193,447.90
交易性金融资产	240,995,470.00	281,164,010.00	93,000,000.00	49,047,696.62	664,207,176.62
应收证券清算款	-	-	-	3,495,958.51	3,495,958.51
应收利息	-	-	-	17,258,657.80	17,258,657.80

应收申购款	200.00	-	-	4,524.77	4,724.77
资产总计	252,952,790.52	281,164,010.00	93,000,000.00	69,806,837.70	696,923,638.22
负债					
卖出回购金融资产款	214,999,850.00	-	-	-	214,999,850.00
应付证券清算款	-	-	-	792,824.22	792,824.22
应付赎回款	-	-	-	2,544,953.79	2,544,953.79
应付管理人报酬	-	-	-	261,625.80	261,625.80
应付托管费	-	-	-	60,375.21	60,375.21
应付销售服务费	-	-	-	70,572.76	70,572.76
应付交易费用	-	-	-	179,212.59	179,212.59
应付税费	-	-	-	174,409.81	174,409.81
应付利息	-	-	-	59,120.56	59,120.56
其他负债	-	-	-	398,918.19	398,918.19
负债总计	214,999,850.00	-	-	4,542,012.93	219,541,862.93
利率敏感度缺口	37,952,940.52	281,164,010.00	93,000,000.00	65,264,824.77	477,381,775.29
上年度末 2012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	1,029,390.95	-	-	-	1,029,390.95
结算备付金	2,399,692.21	-	-	-	2,399,692.21
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	450,750,204.00	274,859,716.50	158,376,952.50	62,625.00	884,049,498.00
应收证券清算款	-	-	-	1,984,099.99	1,984,099.99
应收利息	-	-	-	10,821,092.10	10,821,092.10
应收申购款	-	-	-	358,284.81	358,284.81
资产总计	454,179,287.16	274,859,716.50	158,376,952.50	13,476,101.90	900,892,058.06
负债					
卖出回购金融资产款	244,599,620.00	-	-	-	244,599,620.00
应付赎回款	-	-	-	2,287,965.84	2,287,965.84
应付管理人报酬	-	-	-	368,729.89	368,729.89
应付托管费	-	-	-	85,091.51	85,091.51
应付销售服务费	-	-	-	106,240.39	106,240.39

应付交易费用	-	-	-	7,227.59	7,227.59
应付税费	-	-	-	56,609.81	56,609.81
应付利息	-	-	-	116,092.29	116,092.29
其他负债	-	-	-	420,000.00	420,000.00
负债总计	244,599,620.00	-	-	3,447,957.32	248,047,577.32
利率敏感度缺口	209,579,667.16	274,859,716.50	158,376,952.50	10,028,144.58	652,844,480.74

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

#### 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）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约219.31万元	减少约428.33万元
	市场利率下降25个基点	增加约221.62万元	增加约433.45万元

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	49,047,696.62	10.27	62,625.00	0.01
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,047,696.62	10.27	62,625.00	0.01

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日, 本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 10.27% (2012 年 12 月 31 日: 0.01%), 因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 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。

##### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2013 年 8 月 23 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

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	49,047,696.62	7.04
	其中：股票	49,047,696.62	7.04
2	固定收益投资	615,159,480.00	88.27
	其中：债券	605,159,480.00	86.83
	资产支持证券	10,000,000.00	1.43
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,763,672.62	1.69
6	其他各项资产	20,952,788.98	3.01
7	合计	696,923,638.22	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,302,435.62	3.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,899,181.00	0.82
E	建筑业	4,068,900.00	0.85
F	批发和零售业	3,546,000.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,625,000.00	2.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,606,180.00	2.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	49,047,696.62	10.27
--	----	---------------	-------

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600252	中恒集团	350,000	4,858,000.00	1.02
2	300058	蓝色光标	115,400	4,812,180.00	1.01
3	300071	华谊嘉信	300,000	4,794,000.00	1.00
4	002148	北纬通信	130,000	4,243,200.00	0.89
5	002663	普邦园林	270,000	4,068,900.00	0.85
6	300203	聚光科技	300,000	4,068,000.00	0.85
7	300253	卫宁软件	100,000	4,060,000.00	0.85
8	600292	中电远达	201,300	3,899,181.00	0.82
9	601258	庞大集团	600,000	3,546,000.00	0.74
10	002292	奥飞动漫	140,058	3,135,898.62	0.66
11	002013	中航精机	215,700	2,551,731.00	0.53
12	300033	同花顺	130,000	2,321,800.00	0.49
13	002329	皇氏乳业	132,900	1,645,302.00	0.34
14	300037	新宙邦	24,680	501,004.00	0.10
15	300014	亿纬锂能	20,000	472,000.00	0.10
16	002701	奥瑞金	2,500	70,500.00	0.01

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	14,018,000.00	2.15
2	300088	长信科技	13,937,890.40	2.13
3	002368	太极股份	11,238,831.00	1.72
4	601318	中国平安	9,968,854.00	1.53
5	601555	东吴证券	9,636,636.27	1.48
6	300058	蓝色光标	9,241,397.49	1.42
7	601258	庞大集团	8,293,076.56	1.27
8	002329	皇氏乳业	7,139,556.20	1.09
9	002663	普邦园林	6,075,888.52	0.93

10	300203	聚光科技	5,337,673.00	0.82
11	601168	西部矿业	5,112,553.00	0.78
12	300037	新宙邦	5,079,159.65	0.78
13	600252	中恒集团	4,852,946.22	0.74
14	600795	国电电力	4,510,000.00	0.69
15	601808	中海油服	4,378,926.78	0.67
16	002148	北纬通信	4,363,233.00	0.67
17	300014	亿纬锂能	4,261,401.93	0.65
18	000562	宏源证券	4,204,000.00	0.64
19	300071	华谊嘉信	4,192,201.31	0.64
20	600153	建发股份	4,129,819.00	0.63

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300088	长信科技	21,338,025.39	3.27
2	601989	中国重工	11,958,042.00	1.83
3	002368	太极股份	11,473,895.86	1.76
4	601555	东吴证券	10,339,885.65	1.58
5	601318	中国平安	7,860,382.30	1.20
6	002329	皇氏乳业	5,943,996.77	0.91
7	300136	信维通信	4,898,888.13	0.75
8	300058	蓝色光标	4,585,123.28	0.70
9	300014	亿纬锂能	4,380,789.55	0.67
10	600795	国电电力	4,312,246.20	0.66
11	601258	庞大集团	4,295,271.04	0.66
12	601168	西部矿业	4,223,687.21	0.65
13	601808	中海油服	4,111,546.97	0.63
14	000562	宏源证券	3,766,914.92	0.58
15	300037	新宙邦	3,727,125.04	0.57
16	600153	建发股份	3,546,168.38	0.54
17	002450	康得新	2,529,500.00	0.39
18	300113	顺网科技	1,839,051.00	0.28
19	300304	云意电气	1,452,323.91	0.22
20	300033	同花顺	1,079,133.00	0.17

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	169,337,049.23
卖出股票的收入（成交）总额	122,247,588.73

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	29,985,000.00	6.28
	其中：政策性金融债	29,985,000.00	6.28
4	企业债券	275,702,080.00	57.75
5	企业短期融资券	190,814,000.00	39.97
6	中期票据	101,006,000.00	21.16
7	可转债	7,652,400.00	1.60
8	其他	-	-
9	合计	605,159,480.00	126.77

### 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

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	1282298	12 忠旺 MTN2	400,000	40,348,000.00	8.45
2	041258056	12 龙盛 CP002	400,000	40,220,000.00	8.43
3	122944	09 株城投	300,000	31,134,000.00	6.52
4	1282429	12 广汇 MTN2	300,000	30,225,000.00	6.33
5	122538	12 榕城乡	300,000	30,000,000.00	6.28

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119025	侨城 03	100,000	10,000,000.00	2.09



## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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

### 7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	193,447.90
2	应收证券清算款	3,495,958.51
3	应收股利	-
4	应收利息	17,258,657.80
5	应收申购款	4,724.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,952,788.98

### 7.10.4 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	113003	重工转债	7,652,400.00	1.60

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	----------	----------

				例 (%)	
1	600292	中电远达	3,899,181.00	0.82	重大事项停牌

## 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
华安安心收益债券 A 类	5,453	42,082.27	50,999,563.97	22.22%	178,475,053.51	77.78%
华安安心收益债券 B 类	5,985	38,159.04	50,001,001.35	21.89%	178,380,839.09	78.11%
合计	11,438	40,029.42	101,000,565.32	22.06%	356,855,892.60	77.94%

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华安安心收益债券 A 类	932.99	0.00%
	华安安心收益债券 B 类	19,291.59	0.01%
	合计	20,224.58	0.00%

注：1、分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、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	华安安心收益债券 A 类	华安安心收益债券 B 类
基金合同生效日(2012 年 9 月 7 日)基金份额总额	353,116,001.69	515,230,741.84
本报告期期初基金份额总额	298,469,105.82	342,300,349.84
本报告期基金总申购份额	6,411,153.41	19,802,595.91
减：本报告期基金总赎回份额	75,405,641.75	133,721,105.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,474,617.48	228,381,840.44

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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：无。
- 2、本基金托管人的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

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	
国泰君安证券股份有限公司	2	291,584,637.96	100.00%	261,051.23	100.00%	-

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、本报告期内，本基金交易单元变更情况：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
国泰君安证券股份有限公司	268,080,477.99	100.00%	8,159,000,000.00	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	关于电子直销平台开通“赎回转申购”业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-01-18
2	关于旗下部分开放式基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-01-24
3	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、公司网站	2013-02-05
4	关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-02-22
5	关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-02-25

6	关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司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、公司网站	2013-02-26
7	关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司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、公司网站	2013-02-27
8	关于旗下部分基金增加数米基金为代销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、公司网站	2013-03-14
9	关于电子直销平台开通“货币通：余额理财”业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-03-28
10	关于电子直销平台开通“货币通：快速取现”业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-04-10
11	关于华安旗下部分基金参加好买基金定期定额业务及参加基金定投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、公司网站	2013-04-11
12	关于旗下基金增加上海长量基金为代销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、公司网站	2013-04-12
13	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、公司网站	2013-05-04
14	关于电子直销平台“货币通：快速取现”业务升级的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-05-13
15	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-05-18
16	华安基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-05-18
17	关于电子直销平台开通“货币通：跨行取现”业务的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-05-30
18	关于旗下部分基金增加诺亚正行（上海）基金为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-06-04
19	关于旗下部分基金增加光大证券为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-06-07
20	关于旗下部分基金增加上海证券为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证	2013-06-07

		券报、公司网站	
21	关于基金电子直销平台开展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、公司网站	2013-06-17
22	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	2013-06-26

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安安心收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安心收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安心收益债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安心收益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  
二〇一三年八月二十四日