基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

华安双债添利债券型证券投资基金

[2015] 半年度报告摘要

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月25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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安双债添利债券
交易代码	000149
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,596,216.83份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华安双债添利债券A / 华安双债添利债券C
下属分级基金的交易代码	000149 / 000150
报告期末下属分级基金的份额总额	179,967,654.02份 / 31,628,562.81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可转债和信用债市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要捕捉可转债和信用债市场中的投资机会。基于此目标,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,综合考量可转债的内在价值、信用债的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×40%+中债企业债总指数收益率×40%+中债国债总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其预期的风险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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱解	汤寓彦
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tangyay@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

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(2015年1月1日至2015年6月30日)	
	华安双债添利债券A	华安双债添利债券C
本期已实现收益	10,731,936.31	1,870,115.91
本期利润	13,922,657.43	3,006,631.08
加权平均基金份额本期利润	0.0967	0.0871
本期基金份额净值增长率	9.12%	8.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
	华安双债添利债券A	华安双债添利债券C
期末可供分配基金份额利润	0.2823	0.2817
期末基金资产净值	241,109,912.58	42,351,819.62
期末基金份额净值	1.340	1.339

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安双债添利债券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	0.45%	0.05%	-10.66%	2.18%	11.11%	-2.13%
过去三个月	5.59%	0.22%	-3.38%	1.51%	8.97%	-1.29%
过去六个月	9.12%	0.40%	-3.35%	1.21%	12.47%	-0.81%
过去一年	32.94%	0.41%	16.03%	0.94%	16.91%	-0.53%
自基金合同生效起至今	34.00%	0.38%	14.36%	0.68%	19.64%	-0.30%

华安双债添利债券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	0.45%	0.05%	-10.66%	2.18%	11.11%	-2.13%
过去三个月	5.60%	0.21%	-3.38%	1.51%	8.98%	-1.30%
过去六个月	8.95%	0.40%	-3.35%	1.21%	12.30%	-0.81%
过去一年	33.23%	0.41%	16.03%	0.94%	17.20%	-0.53%
自基金合同生效起至今	33.90%	0.38%	14.36%	0.68%	19.54%	-0.30%

注:本基金业绩比较基准:天相可转债指数收益率×40%+中债企业债总指数收益率×40%+中债国债总指数收益率×20%。

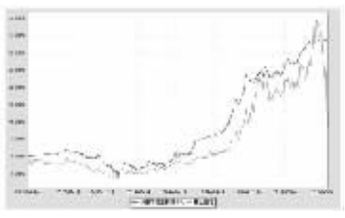
根据本基金合同的有关规定:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,其中对可转债和信用债的投资比例合计不低于非现金基金资产的80%;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%。

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

华安双债添利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
(2013年6月14日至2015年6月30日)



华安双债添利债券A

华安双债添利债券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15亿元人民币,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2015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、华安安利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金(LOF)、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深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、华安恒泰混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克100指数、华安黄金易(ETF)、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济、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、华安高分红指数增强、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、华安策取资本主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颖养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等67只开放式基金。管理资产规模达到1214.76亿元人民币。

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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2013-06-14	-	17年	金融学硕士,(金融工程方向)。17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3月起担任国投收益基金、华安月安鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月月鑫短期理财债券、华安稳定收益债券、华安信用增强债券、华安可转换债券基金的基金经理,2013年10月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安稳定收益债券、华安信用增强债券、华安可转换债券基金的基金经理。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月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2015年5月起担任国投收益基金的基金经理。2015年6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。
朱才敏	本基金的基金经理	2014-11-20	-	7年	金融工程硕士,具有基金从业资格证书,7年基金行业从业经历。2007年7月应聘华安基金,历任金融工程量化投资管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月起同时担任本基金、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、华安信用增强债券、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2016年6月起同时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。

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《华安双债添利债券型证券投资基金基金合同》、《华安双债添利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,使用魏会发言、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,超过授权限额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,以以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平分配。(3)银行间市场业务,投资组合经理根据投资决策委员会决议,在授权范围内以bwise系统向交易部下达投资意向,交易部以此进行报价,以确保中签结果与投资组合授权意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,以以公司名义获得,则投资部门在风险管理和投资监督参与下,进行公平分配。(4)投资决策委员会、投资总监、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、不同投资组合间同时临近交易日反向交易以及可能导致公平交易机制失效的异常交易行为进行监控,如:中债登的债券估值;定期对各投资组合业绩进行分析,并提出投资建议;公司对于各投资组合与交易对手之间以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)的本年度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、专户计划股票、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、专户同向同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部严控了同向交易价差系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了1次,原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合实施数量极少,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

上半年美国经济再次从复苏放缓中走出,在二季度持续温和扩张,制造业PMI连续3个月企稳回升,就业市场持续改善,年内加息预期较大,无论指数上行震荡,欧元区和日元政策刺激下,经济表现平稳复苏,失业率稳步下行。国内经济处于寻底过程,制造业、房地产投资增速持续下降,而受资金的宽松刺激基建投资在上半年也有所下滑,1-6月固定资产投资增速仅11.40%,较去年底下降4.3个百分点;消费增速低位徘徊,1-6月消费增速较去年底下降1.6个百分点;贸易数据继续呈现衰退式增长。受国际大宗商品低迷和内需疲弱等影响,上半年CPI、PPI继续下行并保持低位。货币政策从中性走向宽松,央行通过降息降准、公开市场操作、定向降准、增加抵押补充贷款额度等方式注入基础货币,在外汇占款持续流出、春节消费旺季、季节性因素以及新股申购扰动等多种因素影响下,资金面在一季度保持紧平衡状态,资金利率处于高位,随着货币政策宽松力度的加大,二季度资金面达到极度宽松,银行间7天回购加权利率平均值2.42%,较一季度下降近2个百分点。利率债短端受政动性影响,收益率在一季度处于高位,二季度大幅下行;长端在经济基本面疲弱和供给压力的影响下,收益率先下后上,之后保持震荡;收益率曲线大幅陡峭化。信用债市场受益于流动性宽松,收益率曲线亦呈现陡峭化下行;在经济增速下台阶背景下,传统企业经营压力不断增加,今年以来违约生过不断被打破,低等级企业信用债表现差于高等级企业信用债,中高等级信用债利差持续收窄、低等级信用债利差则有所走阔。转债受股票市场带动,先涨后跌,在牛市行情带动下多只转债在报告期内完成提前赎回,目前市场上仅存7只转债和2只可交换债;总体来看,在一季度个券表现分化较大,具备“一带一路”、互联网等主题概念的个券表现优异;二季度则主要受大盘和转债赎缺性影响,回落回跌。

上半年,本基金对转债进行波段操作,优选个券,并在二季度逐步降低转债仓位,增持短久期、中高等级信用债,保持信用债高仓位。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,华安双债添利债券A份额净值为1.340元,C份额净值为1.339元;华安双债添利债券A份额净值增长率为9.12%,C份额净值增长率为8.96%,同期业绩比较基准增长率为-3.35%。

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,美国经济在在稳步复苏的路上,年内加息将是大概率事件,美元强势将会持续,欧元区经济预期将保持复苏步伐,“希腊危机”的演化及其影响需要密切关注。国内经济复苏较为艰难,预期仍将采用宽财政宽货币的组合政策,随着地方债务置换的逐步推进和地方政资条件的放松,后续稳增长政策的落地执行或将推动基建投资增速重拾升势。下半年CPI在去年低基数以及猪肉价格上涨的带动下,预计将从年初起逐步走高,但上行幅度较为有限,关注1)猪肉价格、2)大宗商品价格变化、3)“厄尔尼诺”等风险因素对通胀上行的影响。随着近期股市调整,市场风险偏好出现较为明显的下降,同时受新股发行暂停等因素的影响,资产配置向权益转换的节奏将出现放缓,打新资金部回流债券市场,预计资金面仍将保持宽松态势,债券市场将延续年中行情,收益率曲线平坦化下行。本基金将追当拉长组合久期,保持信用债高仓位,转债方面等待股市充分调整后,关注个券配置机会。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.估值政策及本次变化

无。

2.估值政策重大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:基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、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:

翁钰森,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,台湾摩根士丹利投信投资管理股份有限公司基金经理,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、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理,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总监。

杨明,投资研究部高级总监,研究生学历,15年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安庄志的基金经理,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。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安现金富利货币、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的基金经理。

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指数证券投资基金(LOF)、华安易富黄金ETF及联接基金、华安中证商分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理,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

本基金的基金经理贺涛作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

无。

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

2015年上半年度,基金托管人在华安双债添利债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年上半年度,华安基金管理有限公司在华安双债添利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2015年上半年度,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安双债添利债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:华安双债添利债券型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	27,447,169.09	2,919,605.66
结算备付金	3,644,047.31	7,233,678.73
存出保证金	55,314.97	55,784.27
交易性金融资产	386,577,089.85	266,398,426.30
其中:股票投资	-	5,150,545.40
基金投资	-	-
债券投资	386,577,089.85	261,247,880.90
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	9,307,245.50	4,173,547.10
应收股利	-	-
应收申购款	9,947,940.57	444,710.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	436,978,807.29	281,225,752.85
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	130,153,705.70	153,674,695.20
应付证券清算款	21,510,360.87	1,150,818.64
应付赎回款	1,412,549.99	1,322,013.24
应付管理人报酬	146,832.29	75,843.03
应付托管费	41,952.09	21,669.44
应付销售服务费	10,908.63	12,661.96
应付交易费用	79,047.25	22,542.31
应交税费	-	-
应付利息	16,549.37	16,362.01
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	145,168.90	360,509.73
负债合计	153,517,075.09	156,657,115.56
所有者权益:		
实收基金	211,596,216.83	101,423,509.72
未分配利润	71,865,515.37	23,145,127.57
所有者权益合计	283,461,732.20	124,568,637.29
负债和所有者权益总计	436,978,807.29	281,225,752.85

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.340元,基金份额总额211,596,216.83份,其中A类基金份额净值1.340元,基金份额总额179,967,654.02份;B类基金份额净值1.339元,基金份额总额31,628,562.81份。

6.2 利润表

会计主体:华安双债添利债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	21,045,882.41	18,061,474.16
1.利息收入	9,033,699.38	11,857,288.17
其中:存款利息收入	89,075.89	175,907.90
债券利息收入	8,943,039.07	11,681,380.27
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	526.46	-
其他利息收入	1,057.96	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	7,330,383.81	-19,855,785.28
其中:股票投资收益	1,994,823.40	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,335,560.41	-19,855,785.28
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,327,236.29	26,010,733.05
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	354,562.93	49,238.22
减:二、费用	4,116,593.90	8,199,704.16
1. 管理人报酬	792,785.52	1,406,672.37
2. 托管费	226,510.18	401,906.40
3. 销售服务费	76,694.35	76,375.96
4. 交易费用	162,873.22	2,616.01
5. 利息支出	2,697,729.59	6,141,652.40
其中:卖出回购金融资产支出	2,697,729.59	6,141,652.40
6. 其他费用	160,001.04	170,481.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	16,929,288.51	9,861,770.00
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	16,929,288.51	9,861,770.00

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安双债添利债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	101,423,509.72	23,145,127.57	124,568,637.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,929,288.51	16,929,288.51
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)	110,172,707.11	31,791,099.29	141,963,806.40
其中:1.基金申购款	364,898,353.60	104,155,294.05	469,053,647.65
2.基金赎回款	-254,725,646.49	-72,364,194.76	-327,089,841.25
四、本期向基金分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)	211,596,216.83	71,865,515.37	283,461,732.20

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	527,231,737.91	-12,939,566.21	514,292,171.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,861,770.00	9,861,770.00
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)	-229,082,363.17	5,358,791.98	-223,723,571.19
其中:1.基金申购款	1,617,633.68	-29,053.06	1,588,580.62
2.基金赎回款	-230,699,996.85	5,387,845.04	-225,312,151.81
四、本期向基金分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)	298,149,374.74	2,280,995.77	300,430,370.51

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: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

华安双债添利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]680号文《关于核准华安双债添利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向社会公开募集,基金合同于2013年6月14日生效,首次设立募集规模为1,347,046,062.43份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益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。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,其中对可转债和信用债的投资比例合计不低于非现金基金资产的80%;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%。

本基金不投资股票。本基金不直接从二级市场买入股票,权证等权益类资产。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,其中对可转债和信用债的投资比例合计不低于非现金基金资产的80%;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%。本基金所指信用债包括中期票据、非政策性金融债、企业债、公司债、城投债、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债等除国债、政策性金融债和中央银行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益类金融工具。

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。

本基金的比较基准为:天相可转债指数收益率×40%+中债企业债总指数收益率×40%+中债国债总指数收益率×20%。

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》、《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行,2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日(基金合同生效日)至2015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

除下述会计估计变更的说明以外,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。

6.4.4.1 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2015年1月1日起至2015年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

在持有以