

华安信用四季红债券型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

- 1、估值政策及重大变化
- 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响
- 3、有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

公司建立基金投资决策委员会, 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组合价格的影响程度, 评估该基金估值的价格风险, 确定采用的估值方法, 确定该证券的公允价值, 同时将采用的方法以及采用方法对相关证券估值后与基金托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

翁启森, 基金投资部全球投资部高级总监、总经理助理, 工业工程硕士。曾在高IP证券任金融分析师及投资经理, 台湾摩根士打利投资管理担任基金经理, 台湾中信证券投资总监助理, 台湾信德投资担任基金经理。2006年4月加入华安基金管理有限公司, 现任安睿精选股票、华安大中华升级股票、华安弘利股票、华安大中国经济策略、华安顺弘资产配置组合、华安物联网股票、华安弘利配置、华安生态化主题股票基金经理。华安基金管理有限公司总经理助理, 基金投资部全球投资部总监。

杨明, 投资研究部基金总监, 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, 现任华安生态主题股票、投资研究部高级总监。

贺涛, 金融硕士, 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, 债券投资风险管理专员, 固定收益部基金经理。华安双债稳健债券基金、华安可转债基金、华安增利债券基金。

许之滨, 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从事金融工程工作, 2006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, 现任投资部上述1800ETF及华安上证1800ETF联接、华安深证300指数增强股票基金(LOF)、华安富嘉黄金ETF联接基金、华安中证高分红指数增强型、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(中国注册会计师非执业会员), 曾在光大证券从事财务工作, 2004年调入华安基金管理有限公司, 曾任财务经理兼基金运营部总监, 公司财务部部长助理, 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. 基金管理人参与或决定估值的原则

本基金估值程序由基金管理人制定, 基金估值程序由基金管理人制定。

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何重大利益冲突。

6. 已签订的任何定价服务的性质与程度等类似

4. 7 管理人应对报告期内基金和利润分配情况的说明

报告期内未发生一次分红, 并公告了第二次分红方案。

第一次分红, 分红方案为: 0.19/10份基金份额。权益登记日: 2015年3月25日; 现金红利发放日: 2015年3月26日。

第二次分红, 分红方案为: 0.19/10份基金份额。权益登记日: 2015年3月25日; 现金红利发放日: 2015年3月26日。

4. 8 报告期内管理人对于本基金持有15%或基金资产净值增值情况的说明

无。

5. 1 报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

报告期内, 华安信用四季红债券型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了托管人义务。

5. 2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守程序、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内, 华安信用四季红债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安信用四季红债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要环节的运作严格依照基金合同的规定进行。报告期内, 华安信用四季红债券型证券投资基金的基金管理人进行了1次利润分配, 分配金额为10.64、724.91元。

5. 3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为华安基金管理有限公司编制和披露的华安信用四季红债券型证券投资基金2015年半年度报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确、完整。

6. 1 资产负债表

6. 2 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体: 华安信用四季红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
银行存款	2,032,224.84	20,419,265.63
结算备付金	6,136,754.81	12,277,574.76
存放同业款项	20,656.17	28,465.63
交易性金融资产	1,088,812,864.76	1,150,666,261.88
其中: 股票投资	-	-
基金投资	1,088,812,864.76	1,150,666,261.88
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	10,891,028.07	17,694,096.00
应收利息	17,946,977.97	33,528,405.97
应收股利	-	-
应收中款款	26,556,344.97	20,734.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	1,161,464,861.59	1,234,933,682.16
资产总计	1,161,464,861.59	1,234,933,682.16

负债:

负债	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
应付短期融资券	-	-
应付赎回款	568,069,497.26	596,097,151.06
应付证券清算款	6,574,646.76	16,898,752.76
应付利息	1,021,682.72	18,666,316.68
应付管理人报酬	326,757.37	474,566.92
应付托管费	33,073.62	13,500.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,978.54	20,844.28
应交税费	-	-
应付利息	311,736.93	201,689.72
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,716.03	404,000.00
负债合计	568,069,368.69	634,168,943.22
所有者权益:	-	-
实收基金	562,268,410.48	588,066,447.24
未分配利润	42,230,044.62	12,718,265.69
所有者权益合计	594,498,455.10	600,784,732.93
负债和所有者权益总计	1,161,464,861.59	1,234,933,682.16

注: 报告截止日2015年6月30日, 基金资产净值1,076元, 基金份额总额562,268,410.48份。

会计主体: 华安信用四季红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	本期末 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	53,806,893.03	95,947,289.92
1.利息收入	37,866,204.48	86,871,326.15
其中: 存款利息收入	126,158.42	3,377,712.88
债券利息收入	37,866,204.48	81,708,602.02
资产支持证券利息收入	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	14,147,013.59	43,063,093.17
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	426,767.68	2,506,615.76
5.其他收入	13,674,181.22	24,619,183.49
其中: 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,089,684.76	7,694,091.30
2.其他收入	568,168.92	2,156,464.67
3.其他收入	-	-
4.其他收入	-	-
5.其他收入	-	-
6.其他收入	-	-
7.其他收入	-	-
8.其他收入	-	-
9.其他收入	-	-
10.其他收入	-	-
11.其他收入	-	-
12.其他收入	-	-
13.其他收入	-	-
14.其他收入	-	-
15.其他收入	-	-
16.其他收入	-	-
17.其他收入	-	-
18.其他收入	-	-
19.其他收入	-	-
20.其他收入	-	-
21.其他收入	-	-
22.其他收入	-	-
23.其他收入	-	-
24.其他收入	-	-
25.其他收入	-	-
26.其他收入	-	-
27.其他收入	-	-
28.其他收入	-	-
29.其他收入	-	-
30.其他收入	-	-
31.其他收入	-	-
32.其他收入	-	-
33.其他收入	-	-
34.其他收入	-	-
35.其他收入	-	-
36.其他收入	-	-
37.其他收入	-	-
38.其他收入	-	-
39.其他收入	-	-
40.其他收入	-	-
41.其他收入	-	-
42.其他收入	-	-
43.其他收入	-	-
44.其他收入	-	-
45.其他收入	-	-
46.其他收入	-	-
47.其他收入	-	-
48.其他收入	-	-
49.其他收入	-	-
50.其他收入	-	-
51.其他收入	-	-
52.其他收入	-	-
53.其他收入	-	-
54.其他收入	-	-
55.其他收入	-	-
56.其他收入	-	-
57.其他收入	-	-
58.其他收入	-	-
59.其他收入	-	-
60.其他收入	-	-
61.其他收入	-	-
62.其他收入	-	-
63.其他收入	-	-
64.其他收入	-	-
65.其他收入	-	-
66.其他收入	-	-
67.其他收入	-	-
68.其他收入	-	-
69.其他收入	-	-
70.其他收入	-	-
71.其他收入	-	-
72.其他收入	-	-
73.其他收入	-	-
74.其他收入	-	-
75.其他收入	-	-
76.其他收入	-	-
77.其他收入	-	-
78.其他收入	-	-
79.其他收入	-	-
80.其他收入	-	-
81.其他收入	-	-
82.其他收入	-	-
83.其他收入	-	-
84.其他收入	-	-
85.其他收入	-	-
86.其他收入	-	-
87.其他收入	-	-
88.其他收入	-	-
89.其他收入	-	-
90.其他收入	-	-
91.其他收入	-	-
92.其他收入	-	-
93.其他收入	-	-
94.其他收入	-	-
95.其他收入	-	-
96.其他收入	-	-
97.其他收入	-	-
98.其他收入	-	-
99.其他收入	-	-
100.其他收入	-	-

6. 3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安信用四季红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	本期末 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、所有者权益(基金净值)变动表	-	-
1.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
2.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
3.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
4.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
5.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
6.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
7.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
8.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
9.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
10.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
11.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
12.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
13.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
14.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
15.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
16.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
17.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
18.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
19.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
20.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
21.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
22.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
23.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
24.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
25.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
26.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
27.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
28.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
29.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
30.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
31.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
32.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
33.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
34.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
35.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
36.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
37.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
38.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
39.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
40.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
41.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
42.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
43.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
44.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
45.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
46.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
47.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
48.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
49.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
50.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
51.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
52.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
53.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
54.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
55.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
56.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
57.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
58.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
59.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
60.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
61.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
62.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
63.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
64.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
65.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
66.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
67.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
68.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
69.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
70.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
71.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
72.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
73.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
74.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
75.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
76.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
77.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
78.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
79.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
80.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
81.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
82.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
83.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
84.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
85.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
86.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
87.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
88.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
89.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
90.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
91.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
92.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
93.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
94.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
95.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
96.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
97.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
98.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
99.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
100.所有者权益(基金净值)变动表	-	-

6. 4 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安信用四季红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	本期末 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、所有者权益(基金净值)变动表	-	-
1.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
2.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
3.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
4.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
5.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
6.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
7.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
8.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
9.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
10.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
11.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
12.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
13.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
14.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
15.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
16.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
17.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
18.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
19.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
20.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
21.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
22.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
23.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
24.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
25.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
26.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
27.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
28.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
29.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
30.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
31.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
32.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
33.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
34.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
35.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
36.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
37.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
38.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
39.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
40.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
41.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
42.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
43.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
44.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
45.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
46.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
47.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
48.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
49.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
50.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
51.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
52.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
53.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
54.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
55.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
56.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
57.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
58.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
59.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
60.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
61.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
62.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
63.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
64.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
65.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
66.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
67.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
68.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
69.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
70.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
71.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
72.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
73.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
74.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
75.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
76.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
77.所有者权益(基金净值)变动表	-	-
78.所有者权益(基金净值)变动表		