华安稳固收益债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月20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2018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	华安稳固收益债券	
基金主代码	040019	
交易代码	040019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月21日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,356,090,853.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安稳固收益债券A	华安稳固收益债券C
下属分级基金的交易代码	002534	040019
报告期末下属分级基金的份额总额	2,171,679,825.97份	184,411,027.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造高于比较基准收益的当期收益。
投资策略	本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测,结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具,优化基金资产在固定收益类资产和权益类资产之间,以及各类固定收益类金融工具之间的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价指数(2016年9月7日前为3年期银行定期存款收益率+1.68%)
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较低风险的品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱根	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105798
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68993414	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	华安稳固收益债券A	华安稳固收益债券C
本期已实现收益	56,360,596.99	3,909,623.34
本期利润	63,629,598.38	4,245,494.30
加权平均基金份额本期利润	0.0345	0.0227
本期基金份额净值增长率	2.42%	2.13%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	华安稳固收益债券A	华安稳固收益债券C
期末可供分配基金份额利润	0.2501	0.0283
期末基金资产净值	2,924,485,461.14	201,956,192.53
期末基金份额净值	1.347	1.095

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

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

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

4、自2016年3月22日起,本基金分设两级基金份额:A级基金份额和C级基金份额。详情请参阅相关公告。

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

华安稳固收益债券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	0.51%	0.06%	0.35%	0.06%	0.16%	0.00%
过去三个月	1.16%	0.10%	1.01%	0.10%	0.15%	0.00%
过去六个月	2.42%	0.08%	2.16%	0.08%	0.26%	0.00%
过去一年	3.46%	0.08%	0.83%	0.07%	2.63%	0.01%
自基金合同生效起至今	50.32%	1.89%	-0.82%	0.08%	51.14%	1.81%

华安稳固收益债券C

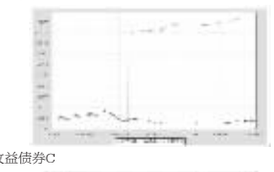
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.46%	0.06%	0.35%	0.06%	0.11%	0.00%
过去三个月	1.01%	0.10%	1.01%	0.10%	0.00%	0.00%
过去六个月	2.13%	0.08%	2.16%	0.08%	-0.03%	0.00%
过去一年	2.69%	0.09%	0.83%	0.07%	1.86%	0.02%
过去三年	6.64%	0.10%	3.33%	0.07%	3.31%	0.03%
自基金合同生效起至今	53.34%	0.24%	28.06%	0.05%	25.28%	0.19%

注:自2016年3月22日起,本基金分设两级基金份额:A级基金份额和C级基金份额。详情请参阅相关公告。

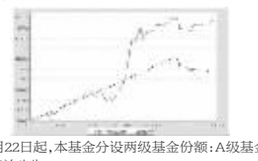
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安稳固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
(2010年12月21日至2018年6月30日)

华安稳固收益债券A



华安稳固收益债券C



注:自2016年3月22日起,本基金分设两级基金份额:A级基金份额和C级基金份额。详情请参阅相关公告。

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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。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2018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103只开放式基金,管理资产规模达到2,460.80亿元人民币。

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、固定收益部助理总监	2010-12-21	-	16年	硕士研究生,16年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在阿发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,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。2010年12月起担任本基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月至2017年7月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。2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年8月起,同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添顺混合型发起式证券投资基金的基金经理;2015年11月起,同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月至2018年1月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2017年7月,同时担任华安安福保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2017年7月,同时担任华安安盛保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月至2018年1月,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。
石雨欣	本基金的基金经理	2015-07-17	-	11年	硕士研究生,11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,担任本基金的基金经理。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月起同时担任华安聚利1个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。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。2018年2月起,同时担任华安丰利10个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、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,因组合流动性管理或投资策略调整需要,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3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

2018年上半年随着全球经济增速有所放缓以及中美贸易摩擦不断升级,国内经济增长稳中趋缓,出口对经济形成一定负面拖累。由于地方政府债务整顿以及财政支出的下滑,基建增速放缓,制造业投资有所好转但幅度有限,房地产投资保持了良好的增长,部分弥补了基建投资的下滑,总体上投资保持小幅回落。随着居民可支配收入增速下滑,消费上半年增速放缓。由于食品价格下跌,通胀总体上保持了温和态势,对货币政策的约束有限。上半年货币政策总体上保持稳健态势,但央行公开市场操作灵活度继续提高,二季度降准部分置换MLF使得货币市场维持相对宽松格局,资金利率中枢显著下移,但在去杠杆和资管新规落地的严监管下,非标压缩导致社融增速明显下滑。在宽货币紧信用格局下,债券收益率总体下行,利率债和高等级信用债收益下行幅度较大,中低等级信用债继续分化。

本基金期内规模有所上升,操作上投资中等久期、高等级信用债为主,同时参与利率债波段操作,组合保持了中等久期、适度杠杆操作,同时参与了转债的部分市场机会,期内取得良好的收益表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,华安稳固收益债券A份额净值为1.347元,C份额净值为1.095元; 华安稳固收益债券A份额净值增长率为2.42%, C份额净值增长率为2.13%,同期业绩比较基准增长率为2.16%。

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,国内经济依然存在一定下滑压力,央行货币政策边际放松有利于宽货币向宽信用传导,社融增速有望修复,基于上半年财政支出增长较好以及减税的推动,财政政策可能发力,经济下滑幅度有限。通胀总体上可能继续保持温和,货币政策将继续维持相对稳健。债市在经济基本面下滑幅度有限以及货币政策维持相对稳健的情况下,仍有一定下行空间,但幅度相对有限。

本基金下半年将继续保持中高等级信用债配置为主, 择机参与利率债波段操作,继续保持中等久期,合理运用杠杆操作,同时积极参与可转债行情增厚组合收益。

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

本报告期内实施了2018年度的两次分红。

2018年度第一次分红, 分红方案为:0.728元/10份 (华安稳固收益债券A)、0.050元/10份(华安稳固收益债券C)。权益登记日及除息日:2018年3月22日;现金红利发放日:2018年3月23日。

2018年度第二次分红, 分红方案为:0.620元/10份 (华安稳固收益债券A)、0.070元/10份(华安稳固收益债券C)。权益登记日及除息日:2018年6月25日;现金红利发放日:2018年6月26日。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期本基金托管人在对华安稳固收益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

本报告期华安稳固收益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稳固收益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、基金费用开支等问题上,不存在任何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,华安稳固收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了二次利润分配, 分配金额为270,094,490.33元。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安稳固收益债券型证券投资基金本报告期半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:华安稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	14,342,182.91	7,046,038.82
结算备付金	874,548.54	23,228.17
存出保证金	20,309.17	8,535.60
交易性金融资产	2,953,921,033.65	3,151,664,090.80
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,953,921,033.65	3,151,664,090.80
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	119,320,299.66	319,001,318.50
应收证券清算款	-	-
应收利息	45,433,709.67	64,390,472.74
应收股利	-	-
应收申购款	13,576.84	51,836.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,133,925,660.44	3,542,185,520.95
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	-	-
应付证券清算款	4,807,187.46	-
应付赎回款	74,560.88	381,111.09
应付管理人报酬	1,639,642.59	1,106,719.17
应付托管费	454,054.87	306,476.07
应付销售服务费	58,235.45	62,143.13
应付交易费用	44,967.54	34,231.26
应交税费	256,472.36	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	148,885.62	295,000.00
负债合计	7,484,006.77	2,185,680.72
所有者权益:	-	-
实收基金	2,356,090,853.79	2,492,916,568.69
未分配利润	770,350,799.88	1,047,083,271.54
所有者权益合计	3,126,441,653.67	3,539,999,840.23
负债和所有者权益总计	3,133,925,660.44	3,542,185,520.95

6.2 利润表

会计主体:华安稳固收益债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	82,253,488.39	4,260,879.83
1.利息收入	79,314,755.02	8,663,872.73
其中:存款利息收入	260,877.95	47,929.62
债券利息收入	73,460,972.96	8,315,964.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,592,904.11	299,978.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-7,831,202.10	-5,466,302.11
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,831,202.10	-5,466,302.11
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)	7,604,872.35	1,003,725.63
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	3,165,043.12	59,583.58
减:二、费用	14,378,375.71	2,430,493.71
1. 管理人报酬	9,057,996.99	1,216,391.30
2. 托管费	2,508,368.41	336,846.83
3. 销售服务费	354,458.28	588,506.22
4. 交易费用	58,614.60	10,750.84
5. 利息支出	1,987,990.46	86,903.81
其中:卖出回购金融资产支出	1,987,990.46	86,903.81
6.税金及附加	218,677.88	-
7. 其他费用	192,269.09	191,095.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	67,875,092.68	1,830,386.12
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	67,875,092.68	1,830,386.12

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安稳固收益债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	2,492,916,568.69	1,047,083,271.54	3,539,999,840.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	67,875,092.68	67,875,092.68
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)	-136,825,714.90	-74,513,074.01	-211,338,788.91
其中:1.基金申购款	1,532,889,338.27	671,272,486.99	2,204,161,825.26
2.基金赎回款	-1,669,715,053.17	-745,785,561.00	-2,415,500,614.17
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)	-	-270,094,490.33	-270,094,490.33
五、期末所有者权益(基金净值)	2,356,090,853.79	770,350,799.88	3,126,441,653.67
项目	上年度可比期间 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)	556,899,250.23	43,437,644.57	600,336,894.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,830,386.12	1,830,386.12
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)	-326,348,852.55	-19,258,785.32	-345,607,637.87
其中:1.基金申购款	23,363,587.20	12,435,365.62	35,798,952.82
2.基金赎回款	-349,712,439.75	-31,694,150.94	-381,406,590.69
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)	230,550,397.68	26,009,245.37	256,559,643.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人: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

华安稳固收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2010]第1362号《关于核准华安稳固收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,733,434,332.77元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第327号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于2010年12月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,733,751,055.10份基金份额,其中认购资金利息折合316,722.33份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。本基金每三年为一个运作期,前后两个运作期期间安排不少于5 个工作日的间隔期,便于本基金在前后两个运作期期间调整组合配置,并且投资者在过渡期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》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、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、央行票据、短期融资券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种;本基金还可投资于股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的80%,权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%,现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金权益类资产投资主要进行首次发行以及增发新股投资,并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票,不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金还可以持有股票所派发的权证和可分离债券产生的权证。本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款收益率+1.68%。

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2018年8月23日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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)》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《 华安稳固收益债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间的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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》,及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税 。

(2) 对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,股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	9,057,996.99	1,216,391.30
其中:支付销售机构的客户维护费	67,248.75	79,130.54

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.65% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 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	2,508,368.41	336,846.83

注:支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值0.18%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.18% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安稳固收益债券A	华安稳固收益债券C	合计
工商银行	-	30,514.13	30,514.13
华安基金管理有限公司	-	293,957.55	293,957.55
合计	-	324,471.68	324,471.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华安稳固收益债券A	华安稳固收益债券C	合计
华安基金管理有限公司	-	505,753.68	505,753.68
中国工商银行股份有限公司	-	42,238.84	42,238.84
合计	-	547,992.52	547,992.52

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给 华安基金公司 ,再由 华安基金公司 计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值× 0.35%/ 当年天数。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.3.2 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。

6.4.8.4 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	14,342,182.91	257,