

华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

2019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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

1.重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、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确认，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2019年8月26日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内，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。

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理等人员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确认，并由董事长签发。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过系统检测的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗内（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情况。

本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。

基金管理人的董事、监事、高级管理人员、基金经理等人员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确认，并由董事长签发。

本报告基于财务资料未经审计。

本报告期自2019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

基金名称 华安年年盈定期开放债券基金

基金代码 000230

交易代码 000230

基金运作方式 到期定期开放式

基金合同生效日 2015年01月21日

基金管理人 华安基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

报告期末基金份额净值 60.265,534.01

基金简称 不定期

下属分级基金的基金简称 华安年年盈定期开放债券A

华安年年盈定期开放债券C

报告期末下属分级基金的份额总额 62,480,344.10份 7,400,193.06份

报告期末基金资产净值 0.00230

报告期末基金份额净值 0.00230

2.2基金产品说明

投资目标 在合理的风险收益水平下，全球通胀预期较低，国内政策加力提振，社融增速企稳回升，通胀缺口有所收敛，全球经济逐步趋稳，货币政策保持流动性合理充裕，金融供给侧改革稳步推进，基本面修复后，中小银行融资链生息链条未来要重塑，债券市场收益率以震荡行情为主。权益市场一季度估值修复上涨，二季度有所调整。

本基金在4月底结束前一期运作，并在5月底进入新一期的建仓期。债券投资上以票息策略为主，可转债投资将保持仓位高度灵活性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，华安年年盈A份额净值为1.038元，C份额净值为1.034元；华安年年盈A份额净值增长率为94.76%，C份额净值增长率为452%，期间业绩比较基准净值增长率为1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金在报告期对宏观经济、证券市场及行业走势的分析与判断与上期一致，不再赘述。

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，对基金持有的投资品种进行估值。本基金主要根据法律法规要求采用估值技术进行估值及净值计算的复核机制。

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，同时将使用的估值方法以及采信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、风险管理总监、固定收益总监、指数与量化投资总监和中后台总监组成，具有一定的证券、基金专业知识，熟悉相关政策法规，具备相应的估值能力。

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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等债券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规定。

本基金将继续根据市场价格情况灵活调整可转债仓位，债券方面保持适中的久期，积极把握操作机会。

4.6.1 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的封闭期为自基金合同生效之日起至1年内不办理申购与赎回业务，在每个封闭期结束后第一个工作日，基金管理人可将基金估值保持所有人的基金份额在其资产净值中继续保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为1.00元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。封闭期结束后，本基金将开放申购，投资者可在开放期内进行基金的申购与赎回，本基金每个开放申购原则上不超过5个工作日且最长不超过20个工作日。

本基金的估值方法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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等债券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规定。

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估值方法的选择说明

本基金在报告期内对基金估值方法的选择情况

本基金报告期内对基金估值方法的选择情况

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值低于5000万元的情形

本基金报告期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守规章、规范运作的情况

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在华安年年盈定期开放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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金信息披露办法》、《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《年度报告附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第4号《年度报告和半年度报告》及其他中国证监会协会修定的《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〉估值业务和份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务和份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露办法》、《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《年度报告附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第4号《年度报告和半年度报告》及其他中国证监会协会修定的相关规定。

本报告期内，本托管人以基金持续经营为基本原则。

5.2 托管人对报告期内基金估值政策、程序及参数设置等的情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金的经营运作、风险管理、法律合规及基金估值运作等方面的专业胜任能力、基金经理的道德品行、基金托管人对基金的估值政策、程序及参数设置等进行了认真地复核，未发现基金管理人在基金估值方面有利益的倾斜。

5.3 托管人对报告期内基金费用计提、支付、返还、调整等情况的说明

本报告期内的财务状况、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

5.4 半年度财务会计报告（未经审计）

6 资产负债表

华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

华安年年盈定期开放债券A

(2015年2月3日至2019年6月30日)

华安年年盈定期开放债券C

华安年年盈定期开放债券C