华安添鑫中短债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

（原华安信用增强债券型证券投资基金转型）

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。

基金托管人根据本基金合同规定，于2019年8月26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

2.1.1 华安添鑫中短债债券型证券投资基金

基金名称	华安添鑫中短债债券型证券投资基金	
基金简称	华安添鑫中短债	
基金主代码	040045	
交易代码	040045	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月25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	
报告期末基金份额总额	10,249,599.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安添鑫中短债A	华安添鑫中短债C
下属分级基金的交易代码	040045	007020
报告期末下属分级基金的份额总额	4,068,646.09份	6,180,953.05份

2.1.2 华安信用增强债券型证券投资基金

基金名称	华安信用增强债券型证券投资基金
基金简称	华安信用增强债券
基金主代码	040045
交易代码	040045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月24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
报告期末基金份额总额	7,704,241.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

2.2.1 华安添鑫中短债债券型证券投资基金

投资目标	本基金在力求本金安全的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	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，动态调整大类资产配置比例，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，综合考量各类券种的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债总财富（1-3年）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

2.2.2 华安信用增强债券型证券投资基金

投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象，合理控制信用风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用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，本着追求绝对收益的原则动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；同时，在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，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	中债企业债总指数收益率
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆瑾	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	huying@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	刘连舸

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
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 华安添鑫中短债债券型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年2月25日至2019年6月30日)	
	华安添鑫中短债A	华安添鑫中短债C
本期已实现收益	10,296.03	85,663.01
本期利润	36,298.34	92,818.83
加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.0042
本期加权平均净值利润率	0.61%	0.42%
本期基金份额净值增长率	0.75%	0.69%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	华安添鑫中短债A	华安添鑫中短债C
期末可供分配利润	-359,387.82	41,469.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0883	0.0067
期末基金资产净值	4,099,265.38	6,222,422.10
期末基金份额净值	1.0075	1.0067
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
	华安添鑫中短债A	华安添鑫中短债C
基金份额累计净值增长率	0.75%	0.69%

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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

华安添鑫中短债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	0.40%	0.02%	0.37%	0.02%	0.03%	0.00%
过去三个月	0.75%	0.02%	0.58%	0.03%	0.17%	-0.01%
自基金转型起至今	0.75%	0.02%	0.75%	0.03%	0.00%	-0.01%

华安添鑫中短债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	0.37%	0.02%	0.37%	0.02%	0.00%	0.00%
过去三个月	0.68%	0.02%	0.58%	0.03%	0.10%	-0.01%
自基金转型起至今	0.69%	0.02%	0.75%	0.03%	-0.06%	-0.01%

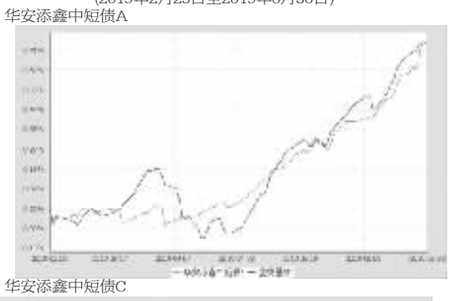
3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安添鑫中短债债券型证券投资基金

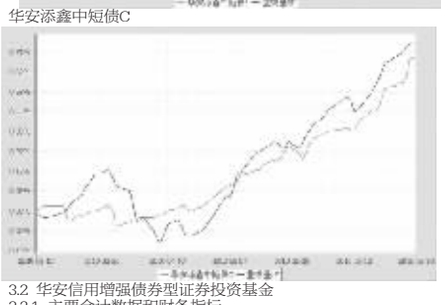
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年2月25日至2019年6月30日)

华安添鑫中短债A



华安添鑫中短债C



3.2 华安信用增强债券型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年2月24日)
本期已实现收益	-11,264.60
本期利润	-11,264.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0013
本期加权平均净值利润率	-0.15%
本期基金份额净值增长率	-0.19%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年2月24日)
期末可供分配利润	-673,803.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0875
期末基金资产净值	7,030,438.01
期末基金份额净值	0.9125
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年2月24日)
基金份额累计净值增长率	27.33%

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

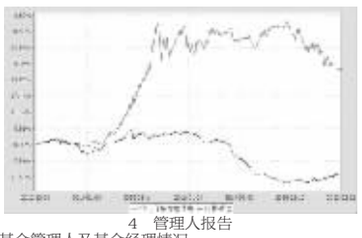
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.04%	0.01%	0.29%	0.04%	-0.33%	-0.03%
过去三个月	-1.87%	0.24%	1.35%	0.05%	-3.22%	0.19%
过去六个月	-5.82%	0.37%	2.68%	0.04%	-8.50%	0.33%
过去一年	-10.56%	0.43%	3.12%	0.05%	-13.68%	0.38%
过去三年	-6.56%	0.36%	-13.90%	0.09%	7.34%	0.27%
自基金成立至今	27.33%	0.38%	-10.40%	0.09%	37.73%	0.29%

3.2.2.2 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

华安信用增强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12月24日至2019年2月24日）



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证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、西安、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2019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123只开放式基金，管理资产规模达到3171.00亿元人民币。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
郑可成	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2012-12-29	2019-04-02	17年	硕士研究生，17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，2006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月同时担任华安日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月至2019年2月，同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019年2月起，同时担任本基金的基金经理。2013年5月至2019年6月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019年6月起，同时担任华安稳健回报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，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2018年6月，同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年6月起，同时担任华安新机遇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月至2018年5月，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年5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，同时担任华安安禧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。
马晓晓	本基金的基金经理	2018-10-18	-	5年	5年基金行业从业经验。历任德勤华永会计师事务所高级审计员、德勤咨询（上海）有限公司财务咨询经理。2013年11月加入华安基金，历任固定收益部研究员、专户固收部投资经理。2018年9月起担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2018年10月至2019年2月，同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019年2月起，同时担任本基金的基金经理。2019年5月起，同时担任华安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。
郑如照	本基金的基金经理	2019-04-02	-	15年	复旦大学硕士，15年相关从业经验。历任上海远东资信评估有限公司评级分析师、太平资产管理有限公司信用研究员、华泰证券股份有限公司投资经理、交易团队负责人，2017年5月加入华安基金，任固定收益部研究员。2017年7月起，担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018年2月至2018年5月，同时担任华安慧赚快选定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月起，同时担任华安安悦债券型证券投资基金、华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018年11月起，同时担任华安鼎益债券型证券投资基金的基金经理。2019年1月起，同时担任华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年4月起，同时担任本基金的基金经理。2019年6月起，同时担任华安安平6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合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》，将各投资组合在研究分析、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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、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。同时加强了对各类投资组合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%的次数为0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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，债券利率整体呈现震荡走势，半年末10年国债、5年AAA中票利率分别比上年末下行了0bp、5bp。跨过年底后流动性非常宽松，带动各期限利率出现明显下行，各债券品种（尤其是利率债）利率也到达了今年到目前为止的最低点。1月7日央行宣布全面降准后，当月出台的一些政策（比如央行创设央票互换工具）使得市场对宽信用的预期有所上升，1月份社融数据在增速和结构改善方面均显著超预期，市场逐渐形成社融增速继续回升的预期，A股市场也逐渐回暖，股债跷跷板效应开始显现，推动收益率持续上升。3月下旬A股出现一定调整，同时美联储3月议息会议释放更强的鸽派信号，年内加息周期告终的概率显著增加，并开始产生降息预期，美债利率继续突破新低，对国内债市有一定提振作用，利率出现一波回落。4月至5月由于经济数据强于预期，央行货币政策委员会一季度例会增加“战略定力”、“总闸门”、“防风险”表述，中央政治局会议提到“加快金融供给侧结构性改革”，使市场产生央行货币政策导向边际有所收紧的担忧，利率出现了一波明显的上行。但从5月下半月起，随着中美贸易争端的升级，5月经济数据也弱于预期，利率重新步入回落。期间包商银行被接管事件有所超出市场预期，曾引发流动性的担忧，但央行持续的维稳措施最终使得二季度末平稳度过。

本基金主要运用利率债交易策略，选取交易所高流动性个券，把握市场波动，适时灵活调整组合久期。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，华安添鑫中短债A份额净值为1.0075元，本报告期（2019年2月25日-2019年6月30日）份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准增长率为0.75%；华安添鑫中短债C份额净值为1.0067元，本报告期（2019年2月25日-2019年6月30日）份额净值增长率为0.69%，同期业绩比较基准增长率为0.75%。截至2019年2月22日，华安信用增强债券基金份额净值为0.9125元，本报告期（2019年1月1日-2019年2月22日）份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准增长率为1.06%。

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，首先经济基本面维持底部震荡或者小幅下行的可能性偏大，基本面对债市影响偏正面。（1）从社融来看，上半年社融总额比去年有一定回升，但观察社融增长结构中源于企业的部分，只有债券融资表现较好，但中长期贷款仍然疲弱，而委托贷款、信托贷款只是去年的大幅下滑态势有所收敛。包商银行接管事件虽为个案，但将对中小银行的负债端构成持续压力，继而影响其信用投放。因此中期看社融存量增速要继续显著上升，难度较大。（2）上半年财政支出力度加大，财政政策发力基建托底经济意图明显，下半年财政持续发力可期。但地产周期预期见顶回落，基建主要受到地方隐性债务管控的约束，故对冲地产回落难度较大。

其次，货币政策转向的可能性较小，流动性预计仍保持合理充裕，随着美联储可能降息，央行动货币政策也存在了空间，因此对债市影响也为偏正面。

当然也需要看到，新增短期影响因素，比如可能提高地方债额度及财政预算，股市反弹，贸易战紧张程度暂时缓解，这些对债市边际影响均为偏负面。

因此对后市判断仍将维持震荡市，利率下行空间略大于上行空间，信用利差可能有所向上修复。

本基金在下半年仍然会坚持以积极的利率债交易性策略为主。

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、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、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

本基金报告期内基金持有人数不低于200人；基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安添鑫中短债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、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“金融工具风险及管理”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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 华安添鑫中短债债券型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：华安添鑫中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日
资 产：	
银行存款	84,087.40
结算备付金	251,547.13
存出保证金	6,689.63
交易性金融资产	9,312,059.59
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	9,312,059.59
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	600,000.00
应收证券清算款	934,065.83
应收利息	153,847.13
应收股利	-
应收申购款	79.98
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	11,342,376.69
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30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	881,365.13
应付赎回款	108,004.27
应付管理人报酬	2,934.75
应付托管费	978.26
应付销售服务费	1,895.17
应付交易费用	4,799.76
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	20,711.87
负债合计	1,020,689.21
所有者权益：	
实收基金	10,639,606.25
未分配利润	-317,918.77
所有者权益合计	10,321,687.48
负债和所有者权益总计	11,342,376.69

注：报告截止日2019年6月30日，A基金份额净值1.0075元，基金份额总额4,068,646.09份；C基金份额净值1.0067元，基金份额总额6,180,953.05份。

6.1.2 利润表

会计主体：华安添鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年2月25日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年2月25日至2019年6月30日
一、收入	215,371.88
1.利息收入	244,832.66
其中：存款利息收入	9,872.88
债券利息收入	180,923.02
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	54,036.76
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-49,686.39
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-49,686.39
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	10,628.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,596.68
减：二、费用	86,254.71
1. 管理人报酬	24,541.98
2. 托管费	8,180.71
3. 销售服务费	18,575.47
4. 交易费用	5,176.96
5. 利息支出	1,081.55
其中：卖出回购金融资产支出	1,081.55
6. 税金及附加	161.36
7. 其他费用	28,536.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	129,117.17
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	129,117.17

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安添鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年2月25日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月25日至2019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）	7,704,241.40	-673,803.39	7,030,438.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,117.17	129,117.17
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）	2,935,364.85	226,767.45	3,162,132.30
其中：1.基金申购款	123,029,176.99	-804,305.02	122,224,871.97
2.基金赎回款	-120,093,812.14	1,031,072.47	-119,062,739.67
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）	10,639,606.25	-317,918.77	10,321,687.48

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：

基金管理公司负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

华安添鑫中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安信用增强债券型证券投资基金转型而成，华安信用增强债券型证券投资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]1627号文《关于核准华安信用增强债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2012年12月24日生效，首次设立募集规模为910,991,983.70份基金份额。经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]53号文变更注册，并依据2019年2月22日华安信用增强债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，本基金2019年2月25日转型并更名为华安添鑫中短债债券型证券投资基金，《华安添鑫中短债债券型证券投资基金基金合同》自2019年2月25日起生效。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和注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的，称为A类基金份额；在投资人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的，称为C类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、同业存单、银行存款、货币市场工具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)。 本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产 80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 本基金所指的中短期债券是指剩余期限不超过三年的债券资产，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分等。 当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金的业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.1.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及自2019年2月25日（基金合同转型日）起至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》 和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自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自2019年2月25日（基金合同转型日）起至2019年6月30日止。

6.1.4.4.2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。

6.1.4.4.3 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债券投资等；

(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。

6.1.4.4.4 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债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所