华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

2015 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:二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年2月3日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安年年盈定期开放债券	
基金主代码	000239	
交易代码	000239	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月3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	335,604,454.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000239	000240
报告期末下属分级基金的份额总额	309,180,852.14份	26,423,602.00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债券市场投资机会,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,综合考量各类债券的流动性、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	一年期定期存款利率(税后)+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种

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	钱娴	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
本期已实现收益	12,647,650.71	1,006,464.17
本期利润	19,570,221.19	1,597,299.03
加权平均基金份额本期利润	0.0633	0.0605
本期加权平均净值利润率	6.20%	5.93%
本期基金份额净值增长率	6.35%	6.11%
3.1.2期末数据和指标	2015年末	
	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0219	0.0205
期末基金资产净值	322,879,504.03	27,554,962.02
期末基金份额净值	1.044	1.043

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)。

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

1. 华安年年盈定期开放债券A:

3.1.1期间数据和指标	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
过去三个月	2.30%	0.20%	0.97%	0.27%	1.33%	-0.07%
过去六个月	4.06%	0.16%	1.96%	0.59%	2.10%	-0.43%
自基金合同生效起至今	6.35%	0.13%	3.59%	1.04%	2.76%	-0.91%

2. 华安年年盈定期开放债券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
过去三个月	2.24%	0.19%	0.97%	0.27%	1.27%	-0.08%
过去六个月	4.03%	0.15%	1.96%	0.59%	2.07%	-0.44%
自基金合同生效起至今	6.11%	0.13%	3.59%	1.04%	2.52%	-0.91%

本基金业绩比较基准:同期一年期定期存款收益率(税后)+1.2%

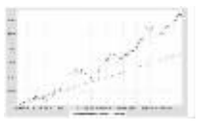
根据本基金合同的有关规定:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等债券类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为:基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,但开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内,基金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%。

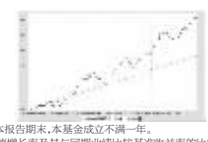
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安年年盈定期开放债券型证券投资基金自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2015年2月3日至2015年12月31日)

1、华安年年盈定期开放债券A



2、华安年年盈定期开放债券C



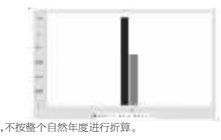
注:本基金于2015年2月3日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安年年盈定期开放债券型证券投资基金自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安年年盈定期开放债券A

2、华安年年盈定期开放债券C



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、华安年年盈定期开放债券A:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	0.190	5,802,269.01	71,130.95	5,873,399.96	-
合计	0.190	5,802,269.01	71,130.95	5,873,399.96	-

2、华安年年盈定期开放债券C:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	0.177	454,765.35	11,458.10	466,223.45	-
合计	0.177	454,765.35	11,458.10	466,223.45	-

§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恒泰君安投资管理股份有限公司。

截至2015年12月31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、华安宏利混合、华安安利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、华安上证龙头企业ETF联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证300指数(LOF)、华安科技动力混合、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(ODII-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、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、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量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、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、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板50指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等71只开放式基金。管理资产规模达到1558.45亿元人民币。

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	2015-02-03	-	18年	金融学硕士(金融工程方向),18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6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013年8月起担任固定收益部副总监。2013年10月起同时担任华安现金富利投资基金、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月起担任本基金的基金经理。2015年5月起担任固定收益部总监。2015年5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。2015年9月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2015-02-17	-	5年	硕士研究生,5年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理。2014年8月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金、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10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式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有关法律法规及《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金合同》、《华安年年盈定期开放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公平交易制度和控制方法

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。(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,集中交易原则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winner撮,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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3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,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1次,未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量极少,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%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,全球经济继续分化,美国经济复苏好于预期,美联储启动加息;欧洲经济弱势复苏,量化宽松政策继续;日本经济复苏缓慢,经济持续弱于预期。国内经济进入新常态,传统产业的产能过剩压力继续加大,工业增加值低增长;房地产销售虽有回暖,但地产投资未见起色,基建投资对经济托底有限,经济下行压力依然较大。人民币贬值预期持续升温,8.11汇率改革后,人民币贬值幅度扩大,外汇占款的持续负增,央行货币政策保持宽松,四次降准、五次降息,基准利率大幅下调。市场对资金面波动的预期下降,资金利率低位保持稳定。

在货币供给充裕但融资需求萎缩以及股票市场波动加大的情况下,资金不断涌向债券市场,债券市场继续呈现牛市特征。其中,随着地方债务置换顺利推进,市场对地方融资平台债务违约的担心下降,城投债收益率持续下行,成为全年表现最好的品种。长久期的国债和政策性金融债下半年表现最为亮丽,收益率降至历史低位。随着刚性兑付打破、违约事件增多,信用债收益率在整体下行过程中出现分化。其中,中高等级信用债收益率跟随无风险利率下行,而过剩产能行业个券信用利差进一步拉大。可转债市场上半年跟随权益市场大幅上涨,大盘转债纷纷触发强制赎回条款,市场容量大幅萎缩、市场估值高企。下半年可转债市场回调但溢价率依然处于高位,随着可交换债和传统可转债一级市场供应逐步恢复,市场估值水平逐步得以修复。

本基金以信用债为主要持仓,维持较高的杠杆比例,择机对长久期利率债和可转债进行了波段操作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,华安年年盈A份额净值为1.044元,C份额净值为1.043元;华安年年盈A份额净值增长率为6.35%,C份额净值增长率为6.11%,同期业绩比较基准增长率为3.59%。

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2016年,预计全球经济依然处于调整和分化过程,以中国为代表的新兴市场国家总需求仍在萎缩,美国经济表现相对稳健。美联储货币政策收紧的预期极大影响和扰动了金融市场风险偏好,黄金和债券等保值类资产持续有资金流入,汇率和股票等风险类资产波动加大,资金持续流出。供给侧改革的提出深化了中国经济新常态的内涵,中央经济工作会议提出去产能、去房地产库存、去杠杆、降低企业成本以及补短板等五大任务,经济预计L型走势。由于货币政策总量放松的空间有限,财政政策将担当国内经济的稳定器。人民币贬值预期下外汇占款预计仍将维持负增,央行将更多地动用微调工具保持货币市场的稳定,并将结合国内经济运行情况适时下调存准、国内经济下行压力仍大,通胀走高动力不足,债市收益率上行风险不大。随着经济结构调整,信用债违约事件将增多。本基金将维持适度的杠杆,提升组合的信用等级,动态调整组合久期,择机波段操作可转债。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.估值政策及重大变化

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:总经理助理(分管投资研究)、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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:

翁启森,基金投资部兼全球投资部总监,工业工程学硕士。曾在台湾IP证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理,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,现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理,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。

赵 敏:研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明,投资研究部总监,研究生学历,12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,现任华安优选的基金经理,投资研究部总监。

贺 涛,金融学硕士,固定收益部副总监。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、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理,固定收益部副总监。

许之彦,指数投资部总监、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及联接基金的基金经理、指数投资部总监。

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

本报告期内实施了二次分红,并公告第三次分红方案。

第一次分红,分红方案为:0.094元/10份基金份额(华安年年盈A)、0.088元/10份基金份额(华安年年盈C)。权益登记日、除息日:2015年7月20日;现金红利发放日:2015年7月21日。

第二次分红:分红方案为:0.096元/10份基金份额(华安年年盈A)、0.089元/10份基金份额(华安年年盈C)。权益登记日、除息日:2015年10月26日;现金红利发放日:2015年10月27日。

本基金的基金管理人于2016年1月18日发布2015年第三次分红公告:本次分红方案为:0.110元/10份基金份额(华安年年盈A)、0.103元/10份基金份额(华安年年盈C)。权益登记日及除息日:2016年1月20日;现金红利发放日:2016年1月21日。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华安年年盈定期开放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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 郭杭翔 蒋燕华签字出具了安永华明(2016)审字第60971571_B19号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资产:	-
银行存款	1,313,065.26
结算备付金	1,977,998.98
存出保证金	24,101.22
交易性金融资产	460,152,206.20
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	460,152,206.20
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	9,592,955.34
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	473,060,327.00
负债和所有者权益	本期末 2015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	121,936,725.00
应付证券清算款	97,179.86
应付赎回款	-
应付管理人报酬	207,256.28
应付托管费	59,216.09
应付销售服务费	6,985.18
应付交易费用	17,282.74
应交税费	-
应付利息	11,215.80
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	290,000.00
负债合计	122,625,860.95
所有者权益:	-
实收基金	335,604,454.14
未分配利润	14,830,011.91
所有者权益合计	350,434,466.05
负债和所有者权益总计	473,060,327.00

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.044元,基金份额总额335,604,454.14份,其中A类基金份额净值1.044元,基金份额总额309,180,852.14份;C类基金份额净值1.043元,基金份额总额26,423,602.00份。

2.本基金合同于2015年2月3日生效。

7.2 利润表

会计主体:华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	27,102,656.22
1.利息收入	20,024,406.19
其中:存款利息收入	2,355,325.52
债券利息收入	17,045,809.47
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	623,271.20
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-435,155.31
其中:股票投资收益	-871,112.26
基金投资收益	-
债券投资收益	413,523.14
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	22,433.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7,513,405.34
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	5,935,136.00
1. 管理人报酬	2,174,623.00
2. 托管费	621,320.86
3. 销售服务费	73,308.04
4. 交易费用	37,325.72
5. 利息支出	2,707,490.12
其中:卖出回购金融资产支出	2,707,490.12
6. 其他费用	321,068.26
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	21,167,520.22
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	21,167,520.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	335,523,980.19	-	335,523,980.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,167,520.22	21,167,520.22
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)	80,473.95	2,115.10	82,589.05
其中:1.基金申购款	80,473.95	2,115.10	82,589.05
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-6,339,623.41	-6,339,623.41
五、期末所有者权益(基金净值)	335,604,454.14	14,830,011.91	350,434,466.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安年年盈定期开放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]783号《关于核准华安年年盈定期开放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自2015年1月12日至2015年1月30日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571_B04号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年2月3日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币335,393,132.33元,在募集期间产生的存款利息为人民币130,847.86元,以上实收基金(本息)合计为人民币335,523,980.19元,折合335,523,980.19份基金份额,其中A类份额309,111,551.85份,C类份额26,412,428.34份。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的封闭期为自基金合同生效日(含该日)起或自每一个开放期结束之日次日(含该日)起至一个公历年后对应日(如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日)止的期间。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务。在每个封闭期最后一个工作日,基金管理人可将基金份额持有人所持的基金份额在其资产净值总额保持不变的前提下,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,本基金将设开放期,投资者可在开放期内进行本基金的申购与赎回。本基金每个开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。

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相关规定。

本基金的投资组合比例为:基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,但开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内,基金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%。 本基金业绩比较基准:一年期定期存款利率(税后)+1.2%。

7.4.2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》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

7.4.3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12月31日的财务状况以及2015年2月3日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4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。

7.4.4.1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2月3日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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;

(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。

7.4.4.4 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期间取得的利息或现金股利,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,或该金融资产已转移,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