华安稳固收益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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月23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1月1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	3,072,079,635.14份
基金合同存续期	不定期

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	本基金建立逐期追求投资本金安全的风险控制目标和收益稳定递增的产品运作风格,以"3年运作周期滚动"的方式,实施开放式运作。在3年运作期内,本基金通过适当的投资策略和产品机制,增强对组合流动性的保护,以便于本基金达到避险目标,并力争超越业绩比较基准,优化基金组合的风险收益和流动性,从而力求满足投资人持续稳定地获得高于存款利率收益的需求。
业绩比较基准	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	钱鲲	洪渊
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

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、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	2014年	2013年
本期已实现收益	61,410,719.98	2,996,642.70	37,375,966.18
本期利润	70,082,343.27	23,476,764.79	8,783,282.41
加权平均基金份额本期利润	0.1022	0.1965	0.0109
本期基金份额净值增长率	7.49%	24.66%	-0.68%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0128	0.1350	0.0222
期末基金资产净值	3,333,995,346.01	103,567,116.81	214,606,529.94
期末基金份额净值	1.085	1.274	1.022

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

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3个月	1.82%	0.07%	1.49%	0.01%	0.33%	0.06%
过去6个月	3.75%	0.14%	2.99%	0.01%	0.76%	0.13%
过去1年	7.49%	0.35%	5.93%	0.01%	1.56%	0.34%
过去3年	33.09%	0.36%	17.39%	0.01%	15.70%	0.35%
过去5年	49.03%	0.29%	28.45%	0.02%	20.58%	0.27%
自基金成立起至今	49.18%	0.29%	28.61%	0.02%	20.57%	0.27%

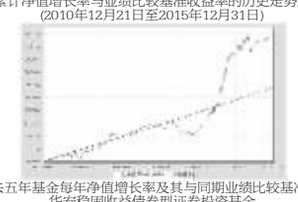
注:本基金业绩比较基准为:3年期银行定期存款收益率+1.68%

根据基金合同的有关规定,本基金为债券型基金,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。

投资组合比例范围为: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%。

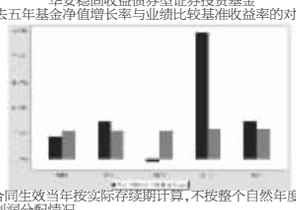
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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的历史走势对比图
(2010年12月21日至2015年12月31日)



3.2.3 过去五年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

华安稳固收益债券型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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

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	2.800	1,826,643,549.96	49,523,722.29	1,876,167,272.25	-
2014年	-	-	-	-	-
2013年	-	-	-	-	-
合计	2.800	1,826,643,549.96	49,523,722.29	1,876,167,272.25	-

§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国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(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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2015年度的第一次分红,本次分红方案为:2.80元/10份。权益登记日及除息日:2015年11月11日;现金红利发放日:2015年11月12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

本报告期内,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

本报告期内,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1次利润分配,分配金额为1,876,167,272.25元。

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2015年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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 单峰、周祎签字出具了普华永道中天审字(2016)第20874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:华安稳固收益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	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	58,178,208.51	1,502,578.06
结算备付金	23,006,820.29	4,991,165.87
存出保证金	9,705.63	18,144.44
交易性金融资产	2,508,631,865.78	127,920,690.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,508,631,865.78	127,920,690.00
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	705,000,000.00	-
应收证券清算款	55,136.35	-
应收利息	42,994,074.81	3,165,791.51
应收股利	-	-
应收申购款	140,654.99	177,188.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,338,016,466.36	137,775,558.20
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	-	32,799,865.30
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	237,449.05	916,617.70
应付管理人报酬	1,897,077.86	57,830.63
应付托管费	525,344.06	16,014.63
应付销售服务费	1,021,503.50	31,139.58
应付交易费用	43,725.45	3,492.70
应交税费	-	-
应付利息	-	6,820.03
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	296,019.84	376,660.82
负债合计	4,021,120.35	34,208,441.39
所有者权益:	-	-
实收基金	3,072,079,635.14	81,295,435.87
未分配利润	261,915,710.87	22,271,680.94
所有者权益合计	3,333,995,346.01	103,567,116.81
负债和所有者权益总计	3,338,016,466.36	137,775,558.20

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值 1.085元,基金份额总额3,072,079,635.14份。

7.2 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入	80,107,726.83	27,616,909.68
1.利息收入	27,954,020.48	8,888,282.21
其中:存款利息收入	1,681,462.79	122,093.63
债券利息收入	23,080,785.31	8,708,194.62
资产支持证券利息收入	-	18,060.27
买入返售金融资产收入	3,191,772.38	39,933.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,455,408.78	-2,738,046.67
其中:股票投资收益	-188,961.62	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,644,286.88	-2,144,569.96
资产支持证券投资收益	-	-593,476.71
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	83.52	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	8,671,623.29	20,480,122.09
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	40,026,674.28	986,552.05
减:二.费用	10,025,383.56	4,140,144.89
1. 管理人报酬	4,822,754.04	832,849.21
2. 托管费	1,335,531.88	230,635.14
3. 销售服务费	2,596,867.62	448,457.41
4. 交易费用	32,965.28	5,849.13
5. 利息支出	895,600.74	2,280,853.00
其中:卖出回购金融资产支出	895,600.74	2,280,853.00
6. 其他费用	341,664.00	341,501.00
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	70,082,343.27	23,476,764.79
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	70,082,343.27	23,476,764.79

7.3 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	81,295,435.87	22,271,680.94	103,567,116.81
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,082,343.27	70,082,343.27
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)	2,990,784,199.27	2,045,728,958.91	5,036,513,158.18
其中:1.基金申购款	6,743,908,582.51	2,331,804,034.64	9,075,712,617.15
2.基金赎回款	-3,753,124,383.24	-286,075,075.73	-4,039,199,458.97
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)	-	-1,876,167,272.25	-1,876,167,272.25
五.期末所有者权益(基金净值)	3,072,079,635.14	261,915,710.87	3,333,995,346.01
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	209,952,987.68	4,653,542.26	214,606,529.94
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,476,764.79	23,476,764.79
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)	-128,657,551.81	-5,858,626.11	-134,516,177.92
其中:1.基金申购款	77,731,054.04	3,796,917.62	81,527,971.66
2.基金赎回款	-206,388,605.85	-9,655,543.73	-216,044,149.58
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)	81,295,435.87	22,271,680.94	103,567,116.81

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。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2016年3月23日批准报出。

7.4.2 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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称企业会计准则)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值处理标准,更确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。

7.4.7 关联方关系

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
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,822,754.04	832,849.21
其中:支付销售机构的客户维护费	231,967.53	278,274.55

注:支付基金管理人 华安基金公司 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,335,531.88	230,635.14

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。

7.4.8.2.3 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 2015年1月1日至2015年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
中国工商银行	140,181.25	
华安基金公司	2,266,069.87	
合计	2,406,251.12	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华安基金公司	118,862.43	
中国工商银行	171,514.40	
合计	290,376.83	

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	122,036,417.32	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	58,178,208.51	553,370.43	1,502,578.06	37,915.89

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新债未上市	100.00	100.00	6,520.00	652,000.00	652,000.00	-

注:基金作为个人投资者参与网上认购获配的新债,从新债获配日至新债上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2015年12月31日止,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2015年12月31日止,本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为2,508,631,865.78元,无属于第一层级和第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次67,500,690.00元,第二层次60,420,000.00元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月30日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,508,631,865.78	75.15
	其中:债券	2,508,631,865.78	75.15
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	705,000,000.00	21.12
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	81,185,028.80	2.43
7	其他各项资产	43,199,571.78	1.29
8	合计	3,338,016,466.36	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	5,334,841.80	5.15

注:本项"买入金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	5,145,880.18	4.97

注:本项"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	5,334,841.80
卖出股票的收入(成交)总额	5,145,880.18

注:本项"买入股票的成本(成交)总额"和"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,995,800.00	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,481,750,000.00	44.44
	其中:政策性金融债	1,481,750,000.00	44.44
4	企业债券	70,423,065.78	2.11
5	企业短期融资券	933,811,000.00	28.01
6	中期票据	-	-
7	可转债	652,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,508,631,865.78	75.24

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150210	15国开10	3,100,000	335,916,000.00	10.08
2	150211	15国开11	2,800,000	280,812,000.00	8.42
3	150215	15国开15	2,800,000	280,364,000.00	8.41
4	150218	15国开18	1,100,000	115,522,000.00	3.46
5	150216	15国开16	1,000,000	104,660,000.00	3.14

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货