

# 华安稳固收益债券型证券投资基金

## [2016]第四季度报告

2016年12月31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  
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§ 1 基本情况

基金管理人的董事会及高级管理人员根据法律法规和基金合同的规定,履行了勤勉尽责的义务并承诺对本基金信息披露内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据法律法规和基金合同的规定,履行了监督职责。

报告期(自2016年10月1日起至2016年12月31日)

§ 2 基金产品概况

基金简称 华安稳固收益债券

基金代码 040019

基金运作方式 灵活配置开放式

基金合同生效日 2010年10月21日

报告期末基金份额总额 566,896,294.23份

投资目标 本基金在追求资金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的收入。

投资策略 本基金通过分析宏观经济指标、利率水平、信用利差等影响债券价格的因素,结合对市场利率走势的判断,综合运用久期策略、收益率曲线策略、期限结构策略、类属资产配置策略、息差策略、骑乘策略、杠杆策略等积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,力求获得超越业绩基准的稳定回报。

基金经理的简介 陈晓华,男,1976年出生,复旦大学金融学硕士。2000年7月至2002年6月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2002年6月至2004年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2004年1月至2005年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2005年1月至2006年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2006年1月至2007年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2007年1月至2008年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2008年1月至2009年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2009年1月至2010年1月就职于国泰君安证券有限公司,从事债券研究工作;2010年1月加入华安基金管理有限公司,任固定收益部总监兼基金经理,2010年10月起担任本基金基金经理。

风险收益特征 本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益均低于股票型基金,高于货币市场基金。

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

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 000234 040019

报告期末下属分级基金的份额总额 190,106,244.61份 306,794,006.62份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年10月1日-2016年12月31日)

华安稳固收益债券A 华安稳固收益债券C

1.本期已实现收益 -4,430,499.36 -11,647,884.28

2.本期利润 -16,661,761.03 -15,029,401.47

3.权准平均基金份额本期利润 -0.0261 -0.0406

4.期末基金份额净值 206,146,236.18 306,190,568.62

5.期末基金总份额 1,079 1,077

注:1.本基金的财务数据不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如:封闭式基金赎回费、开放式基金的申购费、赎回费等),计算基金份额净值时不考虑上述费用的影响。  
2.本期所列数据不包含持有人认购或交易本基金所产生的交易费用。

3.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。

4.权准平均基金份额净值是指截至资产负债表日,将基金资产减去负债后每份基金份额所代表的净资产。

5.期末基金份额净值=基金资产总值/基金份额总数。

6.报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 506,131,961.36 83.97

3 货币市场工具 - -

4 其他 - -

5 买入返售金融资产 77,600,206.40 12.90

6 中长期应收款 - -

7 其他资产 - -

8 合计 506,131,961.36 100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资明细

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 国家债券 - -

2 外行票据 - -

3 财政债 239,361,000.00 39.87

4 其中:政策性金融债 239,361,000.00 39.87

5 企业债 154,620,695.16 25.76

6 中票 60,150,000.00 10.02

7 短融券 31,350,000.00 5.22

8 可转债(可交债) 366,296.00 0.06

9 其他 19,294,000.00 3.21

10 合计 506,131,961.36 84.14

7.3 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债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 150418 15农发18 1,100,000.00 18.32

2 160317 16进17 1,000,000.00 16.64

3 041600012 16农企二债 CPO01 400,000.00 6.69

4 160006 16农克苏债 400,000.00 6.54

5 120304 12建投04 300,000.00 5.01

7.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 买入黄金 - -

2 买入白银 - -

3 买入铂金 - -

4 买入钯金 - -

5 其他 - -

6 合计 506,131,961.36 84.14

7.5 报告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

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 150418 15农发18 1,100,000.00 18.32

2 160317 16进17 1,000,000.00 16.64

3 041600012 16农企二债 CPO01 400,000.00 6.69

4 160006 16农克苏债 400,000.00 6.54

5 120304 12建投04 300,000.00 5.01

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及其它金融工具投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 买入权证 - -

2 买入股指期货 - -

3 买入国债期货 - -

4 买入利率期货 - -

5 买入商品期货 - -

6 买入期权 - -

7 其他 - -

8 合计 506,131,961.36 84.14

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

2 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

3 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

4 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

5 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

6 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 506,131,961.36 83.97

3 货币市场工具 - -

4 其他 - -

5 买入返售金融资产 77,600,206.40 12.90

6 中长期应收款 - -

7 其他资产 - -

8 合计 506,131,961.36 100.00

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及其它金融工具投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 买入权证 - -

2 买入股指期货 - -

3 买入国债期货 - -

4 买入利率期货 - -

5 买入商品期货 - -

6 买入期权 - -

7 其他 - -

8 合计 506,131,961.36 100.00

7.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 买入黄金 - -

2 买入白银 - -

3 买入铂金 - -

4 买入钯金 - -

5 其他 - -

6 合计 506,131,961.36 100.00

7.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

2 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

3 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

4 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

5 华安稳固收益债券A 306,794,006.62

6 华安稳固收益债券C 306,794,006.62

7.12 报告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组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 150418 15农发18 1,100,000.00 18.32

2 160317 16进17 1,000,000.00 16.64

3 041600012 16农企二债 CPO01 400,000.00 6.69

4 160006 16农克苏债 400,000.00 6.54

5 120304 12建投04 300,000.00 5.01

6 合计 506,131,961.36 84.14

7.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及其它金融工具投资组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例 (%)

1 买入权证 - -

2 买入股指期货 - -

3 买入国债期货 - -

4 买入利率期货 - -

5 买入商品期货 - -

6 买入期权 - -

7 其他 - -

8 合计 506,131,961.36 100.00