

华安双债添利债券型证券投资基金

2017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:交通银行股份有限公司
报告送达日期:二〇一八年三月二十七日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员在报告期内未因涉嫌犯罪被立案侦查,或导致诉讼或重大处罚,并与其内容的真实性、准确性和完整性不存在不利法律后果。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

基金管理人及交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月22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未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要请向广大投资者,投资者了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

\$2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 华安双债添利债券

基金代码 000140

交易代码 000140

基金运作方式 约定开放式

基金的管理费 0.13% (年费率)

基金的托管费 0.02% (年费率)

机构类基金份额总额 111,193,651.76份

基金的申购费用 不适用

下属分级基金的基金简称 华安双债添利债券A 华安双债添利债券C

下属分级基金的基金代码 000140 000150

报告期末下属分级基金的份额总额 65,646,397.95份 46,346,714.17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可转债和信用债市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金主要通过可转债和信用债市场的投资机会,基于此目标,本基金研究分析并把握可转债和信用债的投资机会,将可转债和信用债作为本基金的主要投资品种,同时通过可转债和信用债市场的行业特征,在信用债的基本面分析和信用评级的基础上,动态调整可转债和信用债的配置比例,以及各类型可转债的配置比例。

业绩比较基准 固定收益类理财产品收益率×40%+中债企业债指数收益率×40%+中债国债指数收益率×20%

风险收益特征 本基金为债券基金,属于证券投资基金中等风险的品种,其预期的年化收益率水平高于股票基金,低于货币市场基金。

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 交通银行股份有限公司

信息披露义务人 联系电话 021-38996999 邮箱 陆志波

电子邮箱 quanzhong@huamao.com.cn lutz@bankcomm.com

客户服务电话 4008860000

传真 021-68930314 021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网 www.huamao.com.cn

基金年度报告备查文件 上海市世纪大道1号上海国金中心二期121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 2017年 2016年 2015年

本期末基金资产净值 -1,231,112,128.00 73,396,204.13 31,023,131,447.00

本期利润 4,934,121.60 17,013.11 11,998,432.40

加权平均基金份额净值 0.9356 1.216 1.2036

本期基金份额变动比例 0.0305 0.0089 0.0103

0.0295 0.1254 0.1108

本期基金分红情况 不适用

3.1.2 期末可供分配基金份额 1.91% 1.50% 0.78%

3.44% 14.00% 13.75%

3.1.2.1 2017年末 2016年末 2015年末

本期末基金资产净值 73,232,49,777.00 1,443,344.32 114,327,96,734.00

本期基金资产净值 79,529 0.2934 813,421,687.16

本期基金份额净值 1.112 1.098 1.333

1.324 1.401 1.398

注:上述基金业绩报酬不包括持有认购或申购的基金的管理费(例如:认购基金时额外支付的认购费,开放式基金中的赎回费、申购费、赎回费、基金转换费、基金定期定额投资费等),计算时采用的基金净值以摊余成本法计算。

2.本期实现的收入包括利息收入、股息红利收入、其他收入(不含公允价值变动收益)和扣除相关费用后的余额。

3.期初(即报告期期初)未分配利润中未分配利润的孰低数(为期末

余额,不包含当期盈余)。

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

华安双债添利债券A

华安双债添利债券C

华安双债添利债券A

华安双债添利债券C