

华安纯债债券型发起式证券投资基金 2014 年年度报告摘要

2014 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年三月三十日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 20 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 2014 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	华安纯债债券	
基金主代码	040040	
交易代码	040040	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2013 年 2 月 5 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	60,643,138.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	040040	040041
报告期末下属分级基金的份额总额	53,289,789.67 份	7,353,348.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，管理人在合理控制风险的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同债券品种和具体债券工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的价值增长和套利的机会，以确定基金资产在利率类固定收益品种（国债、央行票据等）和信用类固定收益品种之间的配置比例。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为纯债债券型基金，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	中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	钱鲲	李芳菲
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年		2013 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	
	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C
本期已实现收益	-1,623,969.09	-450,184.46	15,149,371.62	5,929,448.51
本期利润	4,889,288.38	667,276.96	11,095,243.53	4,880,064.20
加权平均基金份额本期利润	0.0459	0.0373	0.0158	0.0151
本期基金份额净值增长率	6.28%	5.80%	1.00%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末		2013 年末	
	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0202	0.0126	0.0034	0.0004
期末基金资产净值	56,819,647.86	7,781,814.36	240,305,984.46	43,938,986.65
期末基金份额净值	1.066	1.058	1.003	1.000

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

华安纯债债券 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
过去三个月	2.30%	0.28%	1.67%	0.17%	0.63%	0.11%
过去六个月	4.00%	0.20%	2.38%	0.13%	1.62%	0.07%
过去一年	6.28%	0.15%	6.54%	0.11%	-0.26%	0.04%
自基金合同生效起至今	7.34%	0.12%	2.02%	0.10%	5.32%	0.02%

华安纯债债券 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	2.32%	0.27%	1.67%	0.17%	0.65%	0.10%
过去六个月	3.83%	0.19%	2.38%	0.13%	1.45%	0.06%
过去一年	5.80%	0.15%	6.54%	0.11%	-0.74%	0.04%
自基金合同生效起至今	6.43%	0.11%	2.02%	0.10%	4.41%	0.01%

注：本基金业绩比较基准：中国债券综合指数收益率

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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。

本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产

的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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

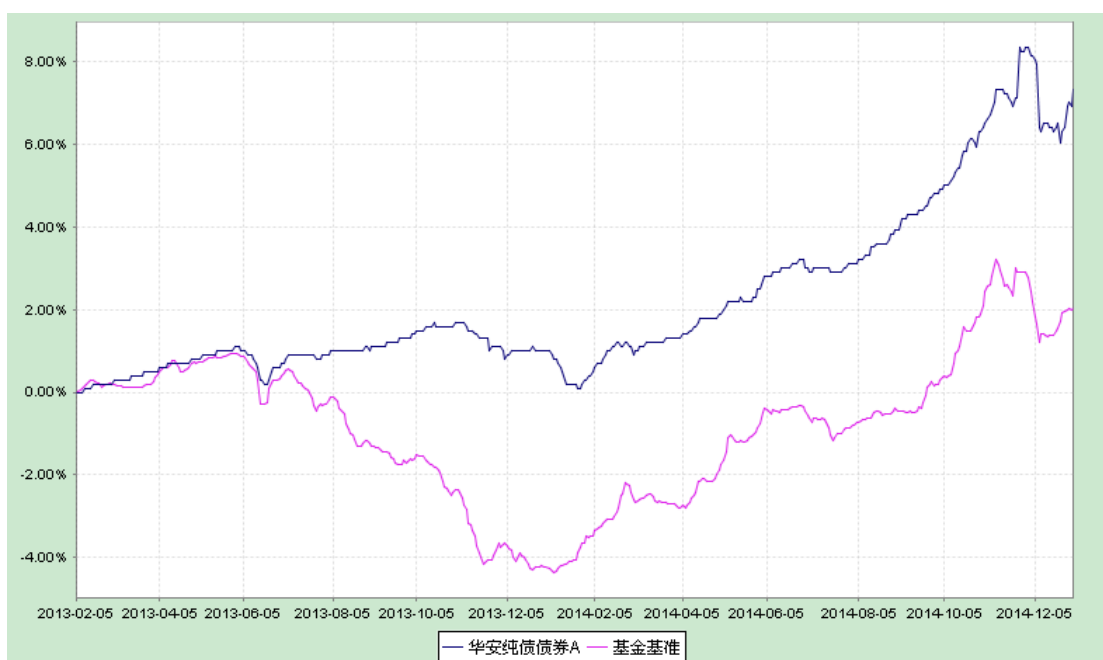
华安纯债债券型发起式证券投资基金

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

(2013 年 2 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日)

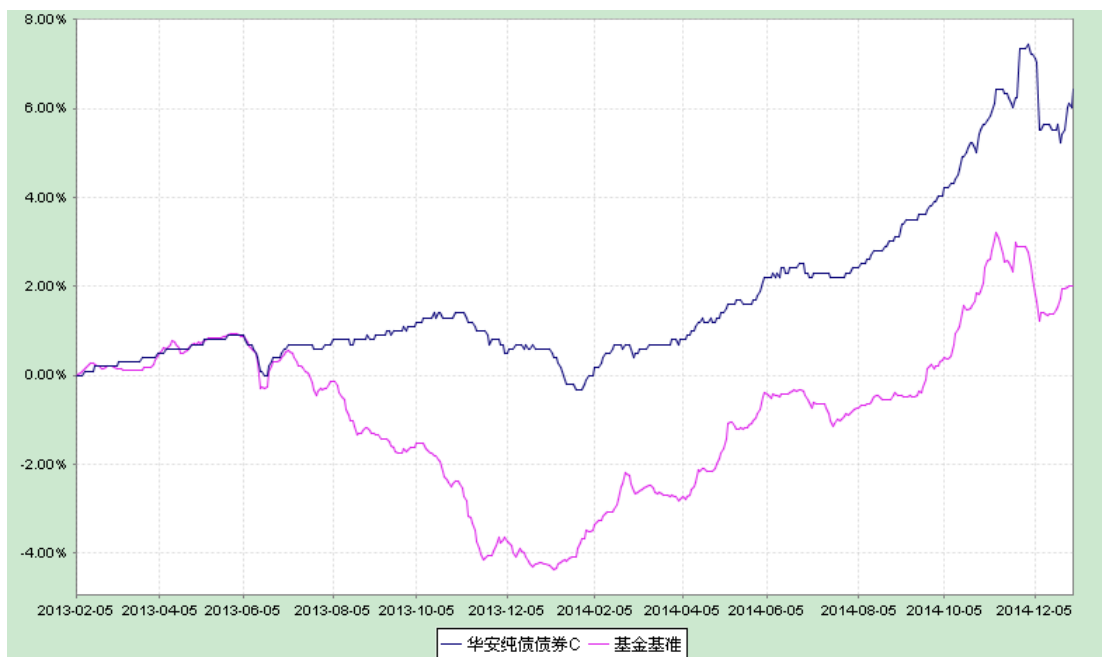
华安纯债债券 A

(2013 年 2 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日)



华安纯债债券 C

(2013 年 2 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日)

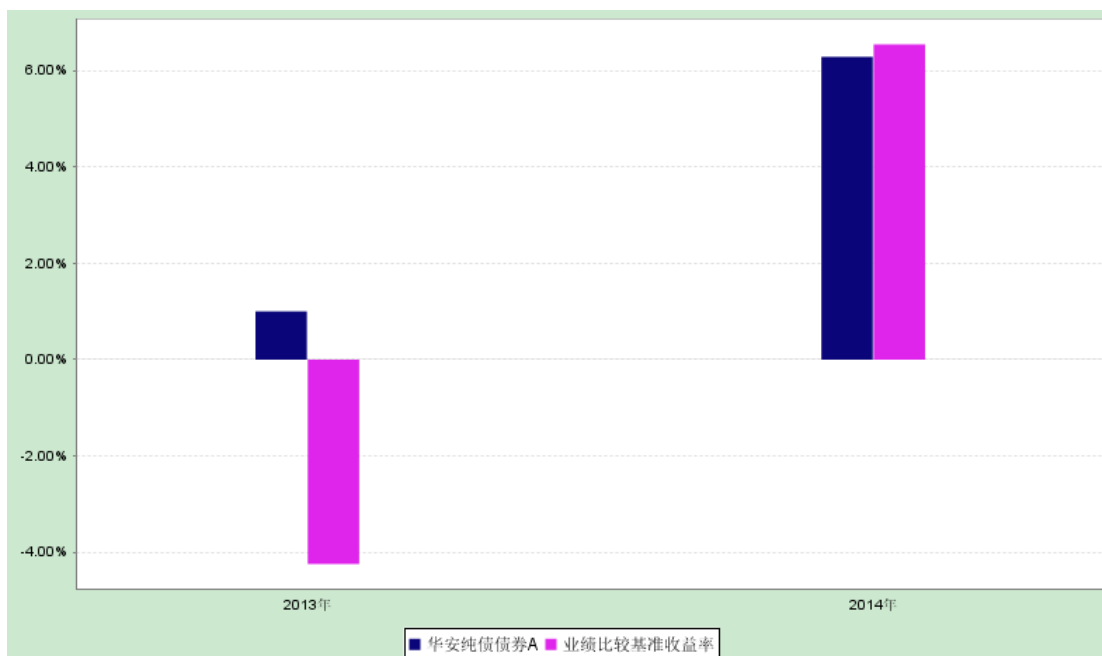


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

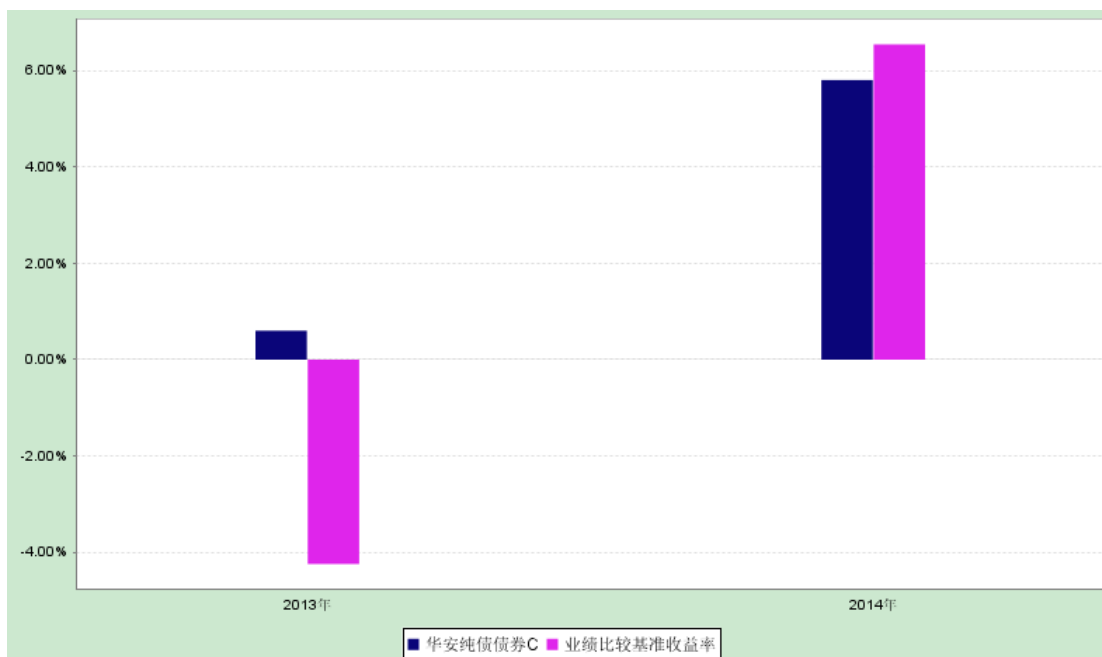
华安纯债债券型发起式证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

华安纯债债券 A



华安纯债债券 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 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、华安纯债债券 A

金额单位：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
2014	-	-	-	-	-
2013	0.070	2,336,562.70	86,356.88	2,422,919.58	-
合计	0.070	2,336,562.70	86,356.88	2,422,919.58	-

2、华安纯债债券 C

金额单位：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
2014	-	-	-	-	-
2013	0.060	526,664.22	10,712.47	537,376.69	-
合计	0.060	526,664.22	10,712.47	537,376.69	-

§ 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

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 2014 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、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、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债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、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 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、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、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 联接等 54 只开放式基金。管理资产规模达到 885 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		
苏玉平	本基金的基金经理	2013-02-05	-	16 年	货币银行硕士，16 年证券、基金行业从业经历。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理；交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理；中德安联保险有限公司投资部部门经理；国联安基金管理有限公司基金经理。2011 年 2 月加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月起担任华安强化收益债券型证券投资基金的基金经理；2011 年 12 月起同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 2 月

					起同时担任本基金的基金经理。2013 年 11 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。2014 年 4 月起同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张晟刚	本 基 金 的 基 金 经 理	2013-03-23	2014-08-30	15 年	硕士研究生，15 年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012 年 11 月加入华安基金管理有限公司。2013 年 1 月起担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金及华安日日鑫货币市场基金的基金经理；2013 年 3 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2013 年 10 月起同时担任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、华安现金富利投资基金的基金经理。2013 年 11 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。2014 年 8 月从华安基金离职。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安纯债债券型发起

式证券投资基金基金合同》、《华安纯债债券型发起式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% 的情况共出现了 2 次。原因：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%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

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

2014 年美国复苏态势良好，虽然年初受到寒冷天气影响，经济略有所下滑，但下半年经济增速迅猛。10 月美国彻底退出量化宽松政策。2014 年的中国经济下行压力加大，原因除了出口受制于外需而表现疲弱、消费受反腐影响而未有起色、部分产业正经历“去产能”阵痛等之外，更重要的因素，则是房地产市场的深度调整。

2014 年利率债市场整体走出“牛市”行情。在资金面宽松影响下，债券收益率一路下行。其中，3 月底受月末因素和海外套利资金外逃影响，7 月中旬受利率债供给高峰影响，12 月份受股市资金分流影响，收益率有一定幅度回调。但资金面宽松的局面使得利率债收益率整体处于下行通道中。

2014 年以来，投资级信用债的走势和利率债一样喜人。一季度债市大幅反弹，信用债 1-2 月份各期限收益率下行明显，3 月份受超日债事件影响收益率出现上行，二季度货币政策中性偏松得到进一步确认，4 月中旬以来收益率飞速下行。进入三季度，在定向宽松财政货币政策的引导下，收益率创年初以来新低。城投债是企业债里面表现较好的品种，四季度，信用债受到中证登质押新规带来的流动性冲击，但中长端信用债在此次黑天鹅事件中受到的影响较小。

本基金二季度投资风格由保守转向相对激进，主要通过加杠杆操作，所选标的以中高评级信用债为主。另外充分梳理持仓债券的个券风险，对信用风险可能提升的行业和个券进行剔除。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金资产净值为 0.65 亿元，A 类份额净值 1.066，

C 类份额净值 1.058，本报告期 A 类份额净值增长率为 6.28%，C 类份额净值增长率为 5.80%，同期业绩比较基准增长率为 6.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对全球经济增速分化的形势，2015 年全球央行的政策将渐行渐远。除美联储按照计划退出 QE 并预计于 2015 年 6—9 月间迎来首次加息之外，全球各大央行的政策取向几乎全部与美联储背道而驰。展望 2015 年，经济大概率偏弱，货币宽松背景下，信用债行情还将持续，但大牛市可能性不大，中高等级维持杠杆吃票息策略依然是首选。2015 年要继续防范信用风险，产业债的分化继续。上半年存在季节性的收益率下行，但是违约风险仍然需要关注。保持中性久期和提高信用等级是首选策略。通过把握风险偏好的切换进行择时操作是获得超额收益的重要途径，而投资标的的选择更要精挑细选。

2015 年全球流动性将继续宽裕、国内央行货币政策将由中性偏松、经济下滑态势不变，整体还是比较有利于债市。我们将加强组合的流动性管理，在市场信用风险偏好下行的情况下，规避个别行业，密切跟踪个券信用风险。争取在保证流动性和安全性的前提下，为投资人获取更好的收益。

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、估值政策重大变化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：首席投资官、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：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部

高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

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 JP 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裁助理、基金投资部兼全球投资部总监。

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

本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 20 日发布公告：每 10 份基金份额派发红利 0.11 元。权益登记日及除息日：2015 年 1 月 22 日；现金红利发放日：2015 年 1 月 23 日。

4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师边卓群、濮晓达签字出具了安永华明（2015）审字第 60971571_B08 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：华安纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	687,103.88	67,684,134.94
结算备付金	750,458.84	622,776.13
存出保证金	1,183.09	52.32
交易性金融资产	92,735,726.80	205,833,570.65
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	92,735,726.80	205,833,570.65
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	1,000,000.00	4,000,000.00
应收证券清算款	-	2,357,333.80
应收利息	2,718,450.97	6,404,753.38
应收股利	-	-
应收申购款	96,652.33	2,109.34
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	97,989,575.91	286,904,730.56
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	32,500,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	437,344.47	2,059,466.91
应付管理人报酬	41,215.54	196,988.52
应付托管费	11,775.85	56,282.41
应付销售服务费	3,093.11	22,709.86
应付交易费用	350.00	2,875.21
应交税费	-	178.20
应付利息	24,254.94	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	370,079.78	321,258.34
负债合计	33,388,113.69	2,659,759.45
所有者权益：		
实收基金	60,643,138.51	283,417,868.40
未分配利润	3,958,323.71	827,102.71
所有者权益合计	64,601,462.22	284,244,971.11
负债和所有者权益总计	97,989,575.91	286,904,730.56

注：（1）报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.065 元，基金份额总额 60,643,138.51 份，其中 A 类基金份额净值 1.066 元，基金份额总额 53,289,789.67 份；C 类基金份额净值 1.058 元，基金份额总额 7,353,348.84 份。

（2）本基金合同于 2013 年 2 月 5 日生效，上年度可比期间自 2013 年 2 月 5 日至 2013 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华安纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年2月5日（基金合 同生效日）至2013年12 月31日
一、收入	8,798,828.23	27,826,993.50
1.利息收入	9,055,805.73	37,941,061.33

其中：存款利息收入	700,195.68	9,308,007.46
债券利息收入	8,096,017.21	25,473,503.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	259,592.84	3,159,550.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,119,306.94	-5,599,046.69
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,119,306.94	-5,599,046.69
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,630,718.89	-5,103,512.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	231,610.55	588,491.26
减：二、费用	3,242,262.89	11,851,685.77
1. 管理人报酬	896,575.54	6,522,516.03
2. 托管费	256,164.55	1,863,575.97
3. 销售服务费	73,430.45	1,113,361.26
4. 交易费用	6,493.75	32,457.51
5. 利息支出	1,661,824.43	1,927,092.48
其中：卖出回购金融资产支出	1,661,824.43	1,927,092.48
6. 其他费用	347,774.17	392,682.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,556,565.34	15,975,307.73
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,556,565.34	15,975,307.73
-------------------	--------------	---------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	283,417,868.40	827,102.71	284,244,971.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,556,565.34	5,556,565.34
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）	-222,774,729.89	-2,425,344.34	-225,200,074.23
其中：1.基金申购款	42,260,652.69	691,344.48	42,951,997.17
2.基金赎回款	-265,035,382.58	-3,116,688.82	-268,152,071.40
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）	60,643,138.51	3,958,323.71	64,601,462.22
项目	上年度可比期间		
	2013年2月5日（基金合同生效日）至2013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）	3,048,594,718.03	-	3,048,594,718.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,975,307.73	15,975,307.73
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）	-2,765,176,849.63	-12,187,908.75	-2,777,364,758.38
其中：1.基金申购款	543,354,224.83	3,834,555.90	547,188,780.73
2.基金赎回款	-3,308,531,074.46	-16,022,464.65	-3,324,553,539.11
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）	-	-2,960,296.27	-2,960,296.27

五、期末所有者权益(基金净值)	283,417,868.40	827,102.71	284,244,971.11
-----------------	----------------	------------	----------------

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

华安纯债债券型发起式证券投资基金(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[2012]1480 号文《关于核准华安纯债债券型发起式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 2013 年 2 月 5 日正式生效, 首次设立募集规模为 3,048,594,718.03 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同, 本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。对于 A 类基金份额, 投资者在认购/申购时收取认购/申购费用; 对于 C 类基金份额, 投资者认购/申购时不收取认购/申购费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费。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, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产, 也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金不投资可转换债券, 但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。本基金各类资产的投资比例范围为: 固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%; 现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围, 其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金业绩比较基准: 中国债券综合指数收益率。

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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月,财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》;上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月,财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》,在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资

基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

7.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年2月5日（基金合同生 效日）至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	896,575.54	6,522,516.03
其中：支付销售机构的客户 维护费	343,624.38	2,530,502.52

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日	上年度可比期间 2013年2月5日（基金合同生 效日）至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	256,164.55	1,863,575.97

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基

金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 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		
	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C	合计
华安基金	-	1,042.30	1,042.30
农业银行	-	51,018.34	51,018.34
合计	-	52,060.64	52,060.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年2月5日（基金合同生效日）至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安纯债债券A	华安纯债债券C	合计
华安基金	-	74,342.79	74,342.79
农业银行	-	813,932.08	813,932.08
合计	-	888,274.87	888,274.87

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年2月5日（基金合同生效日）至 2013年12月31日	
	华安纯债债券A	华安纯债债券C	华安纯债债券A	华安纯债债券C
基金合同生效日 （2013年2月5日）持有的基金份额	-	-	10,002,250.23	-
期初持有的基金份额	10,002,250.23	-	10,002,250.23	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,002,250.23	-	10,002,250.23	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.77%	-	4.18%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上期末均未投资本基金。

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年2月5日（基金合同生效日）至2013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
中国农业银行	687,103.88	28,839.43	2,684,134.94	200,312.09

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的

证券。

7.4.9 期末（2014 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额人民币 32,500,000.00 元，于 2015 年 1 月 5 日及 2015 年 1 月 9 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 41,641,622.60 元，第二层次的余额为 51,094,104.20 元，无属于第三层次余额。

于 2013 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 26,679,226.65 元，第二层次的余额为 179,154,344.00 元，无属于第三层次余额。

7.4.10.1.2.2 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，本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。

7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	92,735,726.80	94.64
	其中：债券	92,735,726.80	94.64
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	1,000,000.00	1.02
5	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	1,437,562.72	1.47
7	其他各项资产	2,816,286.39	2.87
8	合计	97,989,575.91	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未买入股票。

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

本基金本报告期末未卖出股票。

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	-
卖出股票的收入（成交）总额	-

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	15,187,537.90	23.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	46,449,188.90	71.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	31,099,000.00	48.14
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	92,735,726.80	143.55

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	124822	14 合滨投	149,900	15,595,596.00	24.14
2	122299	13 中原债	150,000	15,448,500.00	23.91
3	101464016	14 津住建 MTN001	100,000	10,445,000.00	16.17
4	101458014	14 苏国资 MTN002	100,000	10,436,000.00	16.15
5	101460015	14 浦东土地 MTN001	100,000	10,218,000.00	15.82

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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,183.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,718,450.97
5	应收申购款	96,652.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,816,286.39

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户 数(户)	户均持 有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
华安 纯债 债券 A	824	64,672.07	10,081,787.49	18.92%	43,208,002.18	81.08%

华安纯债债券 C	355	20,713.66	0.00	0.00%	7,353,348.84	100.00%
合计	1,179	51,436.08	10,081,787.49	16.62%	50,561,351.02	83.38%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	华安纯债债券 A	-	-
	华安纯债债券 C	-	-
	合计	-	-

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,250.23	16.49%	10,002,250.23	0.33%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,002,250.23	16.49%	10,002,250.23	0.33%	

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安纯债债券 A	华安纯债债券 C
基金合同生效日(2013 年 2 月 5 日)基金份额总额	1,694,141,299.93	1,354,453,418.10
本报告期期初基金份额总额	239,497,105.19	43,920,763.21
本报告期基金总申购份额	36,837,317.49	5,423,335.20
减：本报告期基金总赎回份额	223,044,633.01	41,990,749.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,289,789.67	7,353,348.84

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2014 年 9 月 15 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司董事长变更公告，朱仲群先生不再担任本基金管理人的董事长，由朱学华先生担任本基金管理人的董事长、法定代表人以及党总支书记。

(2) 2014 年 9 月 17 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司总经理变更公告，李勃先生不再担任本基金管理人的总经理，由董事长朱学华先生代任本基金管理人的总经理。

(3) 2014 年 12 月 24 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，童威先生新任本基金管理人的副总经理。

(4) 2014 年 8 月 30 日，基金管理人发布了华安纯债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告，张晟刚先生不再担任本基金的基金经理，同时聘任苏玉平女士担任本基金的基金经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 50,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、本报告期内，本基金交易单元变更情况：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券股份有限公司	94,763,857.91	100.00%	1,637,500,000.00	100.00%	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一五年三月三十日