华安纯债债券型发起式证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月21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2013年2月5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	283,417,868.40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	239,497,105.19份	43,920,763.21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	冯颖	李芳菲
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-63201816

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	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
本期已实现收益	15,149,371.62	5,929,448.51
本期利润	11,095,243.53	4,880,064.20
加权平均基金份额本期利润	0.0158	0.0151
本期基金份额净值增长率	1.00%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	
	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	0.0034	0.0004
期末基金资产净值	240,305,984.46	43,938,986.65
期末基金份额净值	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)。

4、本基金于2013年2月5日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年。

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	-1.08%	0.11%	-2.67%	0.10%	1.59%	0.01%
过去六个月	0.39%	0.06%	-4.54%	0.09%	4.93%	-0.03%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.06%	-4.24%	0.09%	5.24%	-0.03%

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	-1.09%	0.10%	-2.67%	0.10%	1.58%	0.00%
过去六个月	0.20%	0.06%	-4.54%	0.09%	4.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.06%	-4.24%	0.09%	4.84%	-0.03%

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。

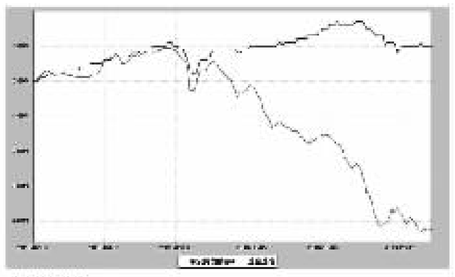
本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

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2013年12月31日)

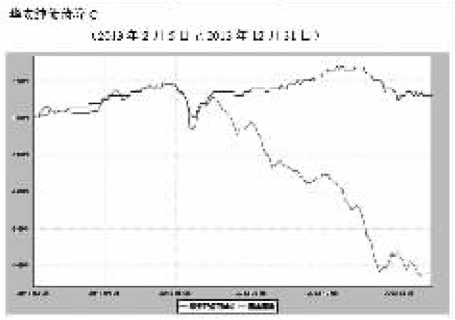
华安纯债债券A

(2013年2月5日至2013年12月31日)



华安纯债债券C

(2013年2月5日至2013年12月31日)



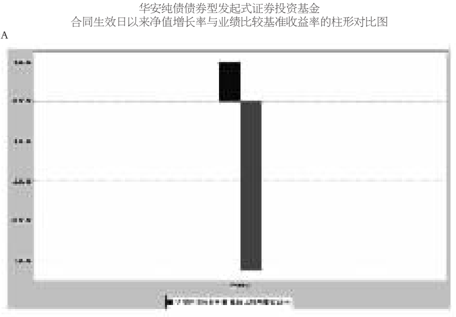
注:1、本基金于 2013 年2月5日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2、根据《华安纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

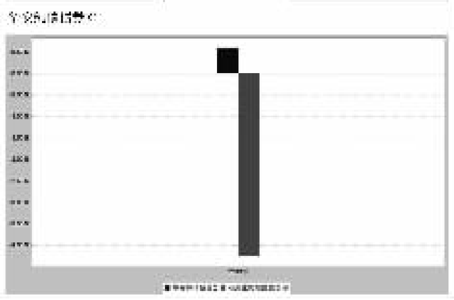
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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过去三年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
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
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

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2013年12月31日,公司旗下共管理了华安安顺封闭1只封闭式证券投资基金,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等46只开放式基金。管理资产规模达到838.62亿元人民币。

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。
张晟刚	本基金的基金经理	2013-03-23	-	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。

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,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核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;风险管理部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3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

2013年中债指数整体大幅下滑,其中上半年平稳,下半年大幅度下降。9月下旬,美联储暂停退出 QE 曾一度给市场带来曙光,但10月份经济数据继续改善,CPI超预期等因素给市场带来较大的调整压力。特别是10月份央行上调逆回购操作利率,彻底打破了市场的幻想。随后,收益率快速上行,各品种收益率均创历史新高。进入12月,各品种收益率呈现企稳的迹象。

纯债基金上半年在建仓期,操作相对保守,所以未能完全抓住年初的牛市行情。但对于利率市场化和债券市场治理力度有充分重视,所以相对比较保守的投资策略在6月份"钱荒",和11月份"债荒"中受到的负面影响较小。尤其是四季度,稳健操作避免了较大的净值波动和损失,保持了本该基金低风险、净值波动较小的特色,业绩超越基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金资产净值为2.84亿元,A类份额累计净值1.003,C类份额累计净值1.000,本报告期A类份额净值增长率为1.00%,C类份额净值增长率为0.60%,同期业绩比较基准增长率为-4.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储退出政策相对温和,同时也表明了对美国经济恢复的信心,这也有利于海外市场的表现。对全球流动性的影响也相对较小。后期美联储只要没有超预期的措施出现,整体负面影响也将会降到最小。若QE退出步伐超预期,央行可以下调目前处于高位的存准率对冲,并且我国外汇储备充裕,去年"影子银行"和地方融资平台治理初见成效,我们相信掌握主动权的央行将会稳控全局,为中国经济转型和平稳发展全力保驾护航。我国利率市场化已步入中期。从中期看,市场利率上行压力趋弱,从长期看,利率下行的曙光已现。预计全年CPI将呈现前高后低的表现,受到翘尾因素的影响,高点可能出现在5月前后,同比涨幅在3.3-3.4%,下半年稳定在2.6-3.0%之间;输入型压力不大,PPI受到基数影响,将由负转正。

基本面将对1季度的债市提供支撑,如果央行货币政策如其在四季度货币政策执行情况报告中暗示的那样有所松动,则资金面不会继续压制债市,通胀预计也在低位徘徊,因此一季度债市有望走出一波估值修复行情。部分短期品种的绝对收益率已经远高于可比贷款利率,投资价值相对突出,因此把握债市结构性机会,在一季度可望获得不错的收益。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发,重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作,从维护基金持有的利益、保障基金的合规运作出发,深化员工的合规意识,推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面:

(1)结合《证券投资基金法》的实施,推动相关制度流程的建立、修订和完善,适应公司产品与业务创新发展的需要。

(2)深化"主动合规"的管理理念,坚守"三条底线",强化全体员工的合规意识和风险控制意识,通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计,推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(3)做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持,坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4)推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化,细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责,降低操作风险发生的概率。

(5)按照法规的要求,做好旗下各只基金的信息披露工作,做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6)有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核,强化对公司制度执行和风险措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、华安大中华升级股票的基金经理,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,现任华安中国A股增强指数、华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安上证龙头ETF和华安上证龙头ETF联接、华安深证300指数证券投资基金(LOF)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。

4.8 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2013年度的第一次分红,本次分红方案为:0.07元/10份基金份额(华安纯债债券A)、0.06元/10份基金份额(华安纯债债券C)。权益登记日及除息日:2013年10月25日;现金红利发放日:2013年10月28日。

§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

在托管华安纯债债券型发起式证券投资基金的过程中,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《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托管协议》的约定,对华安纯债债券型发起式证券投资基金管理人—华安基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 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华安纯债债券型发起式证券投资基金的投资运作、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华安纯债债券型发起式证券投资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(2014)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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日
资 产:	
银行存款	67,684,134.94
结算备付金	622,776.13
存出保证金	52.32
交易性金融资产	205,833,570.65
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	205,833,570.65
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	4,000,000.00
应收证券清算款	2,357,333.80
应收利息	6,404,753.38
应收股利	-
应收申购款	2,109.34
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	286,904,730.56
负债和所有者权益	本期末 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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	2,059,466.91
应付管理人报酬	196,988.52
应付托管费	56,282.41
应付销售服务费	22,709.86
应付交易费用	2,875.21
应交税费	178.20
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	321,258.34
负债合计	2,659,759.45
所有者权益:	
实收基金	283,417,868.40
未分配利润	827,102.71
所有者权益合计	284,244,971.11
负债和所有者权益总计	286,904,730.56

注:(1)报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.003元,基金份额总额283,417,868.40份,其中A类基金份额净值1.003元,基金份额总额239,497,105.19份;C类基金份额净值1.000元,基金份额总额43,920,763.21份。

(2)本基金合同于2013年2月5日生效。

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:2013年2月5日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年2月5日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	27,826,993.50
1.利息收入	37,941,061.33
其中:存款利息收入	9,308,007.46
债券利息收入	25,473,503.59
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	3,159,550.28
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-5,599,046.69
其中:股票投资收益	0.00
基金投资收益	-
债券投资收益	-5,599,046.69
资产支持证券投资收益	-
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)	-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)	588,491.26
减:二、费用	11,851,685.77
1.管理人报酬	6,522,516.03
2.托管费	1,863,575.97
3.销售服务费	1,113,361.26
4.交易费用	32,457.51
5.利息支出	1,927,092.48
其中:卖出回购金融资产支出	1,927,092.48
6.其他费用	392,682.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,975,307.73
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列	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:2013年2月5日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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:

基金管理公司负责人:李勍,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,由华安基金管理有限公司作为发起人自2013年1月7日至2013年2月1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(2013)验字第60971571_B01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2013年2月5日生效。本基金为契约型开放式发起式,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3,047,314,648.35元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,280,069.68元,以上实收基金(本息)合计为人民币3,048,594,718.03元,折合3,048,594,718.03份基金份额,其中A类基金份额1,694,141,299.93份,C类基金份额1,354,453,418.10份。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为A类;在投资者认购/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的,称为C类。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2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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。

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2013年12月31日的财务状况以及2013年2月5日(基金合同生效日)至2013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

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2013年2月5日(基金合同生效日)起至2013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为债券投资;

(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的债券等,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有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,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的,该金融负债或其一部分将终止确认;

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方);本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(2)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次,第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的,以该报价为依据确定公允价值;第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价,或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的,以该报价为依据做必要调整确定公允价值;第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的,以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值;

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;

2)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(2)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(6)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(8)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提;

(3)本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提;

(4)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11基金的收益分配政策

(1)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同,本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权;

(2)在符合有关基金分红条件的前提下,每季度末基金份额可供分配利润超过人民币0.01元时,本基金至少进行收益分配1次,本基金每年收益分配次数最多为12次;每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的50%,每年度末收益分配比例不得低于基金该年度末可供分配利润的90%。若《基金合同》生效不满3 个月可不进行收益分配;

(3)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对A类和C类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的,同一类别基金份额的分红资金将按红利发放日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式,如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

(4)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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 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	6,522,516.03
其中:支付销售机构的客户维护费	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×0.70%/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 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	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×0.20%/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 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×0.40%/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

本基金本报告期末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 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
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	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	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

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 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
中国农业银行	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

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9期末(2013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2013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2013年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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。

7.4.10.2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。

7.4.10.3财务报表的批准

本财务报表已于2014年3月28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	205,833,570.65	71.74
	其中:债券	205,833,570.65	71.74
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	4,000,000.00	1.39
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	68,306,911.07	23.81
6	其他各项资产	8,764,248.84	3.05
7	合计	286,904,730.56	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未卖出股票。

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	14,004,200.00	4.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,526,370.65	18.13
5	企业短期融资券	140,303,000.00	49.36
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	205,833,570.65	72.41

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	041359009	13南高轮CP001	500,000	50,260,000.00	17.68
2	041358003	13广汇汽车CP001	200,000	20,184,000.00	7.10
3	041352018	13联合水泥CP002	200,000	19,936,000.00	7.01
4	122257	12岳纸01	150,000	14,010,000.00	4.93
5	019302	13国债02	140,000	14,004,200.00	4.93

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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

序号	名称	金额
1	存出保证金	52.32
2	应收证券清算款	2,357,333.80
3	应收股利	-
4	应收利息	6,404,753.38
5	应收申购款	2,109.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,764,248.84

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	2,270	105,505.33	15,346,459.97	6.41%	224,150,645.22	93.59%
华安纯债债券C	742	59,192.40	760,263.70	1.73%	43,160,499.51	98.27%
合计	3,012	94,096.24	16,106,723.67	5.68%	267,311,144.73	94.32%

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	994.63	0.00042%
	华安纯债债券C	1000.59	0.00228%
	合计	1995.22	0.00070%

注:1、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)。

2、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	3.53%	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	3.53%	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
本报告期基金总申购份额	361,343,218.79	182,011,006.04
减:本报告期基金总赎回份额	1,815,987,413.53	1,492,543,660.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	239,497,105.19	43,920,763.21

§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)2013年3月23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,聘任张晟刚先生为本基金的基金经理,与苏玉平女士共同管理本基金。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下:

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80000.00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如下:

新增中信证券股份有限公司上海交易单元1个;

新增中信证券股份有限公司深圳交易单元1个。

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	12,611,054.67	100.00%	12,261,916,000.00	100.00%	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日