华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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:上海银行股份有限公司
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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016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6月16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	华安添颐养老混合
基金主代码	001485
交易代码	001485
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2015年6月16日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,014,814,451.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持绝对收益投资理念,在严格控制风险的前提下,采取稳健的投资策略,追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金资产配置比例限制范围内,动态调整基金资产在股票、债券、现金类资产上的配置比例,控制基金资产净值的波动幅度,追求符合养老金投资需求的绝对回报。 在具体大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型,基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	叶亿红
	联系电话	021-38969999	021-68475888
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	zcygb@bankofshanghai.com
客户服务电话		4008850099	95594
传真		021-68863414	021-68476936

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6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	27,284,432.51
本期利润	77,567,322.11
加权平均基金份额本期利润	0.0322
本期基金份额净值增长率	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0098
期末基金资产净值	3,082,407,908.65
期末基金份额净值	1.022

注:1、本基金于2015年6月16日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2、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:封闭式基金交易佣金,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。

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

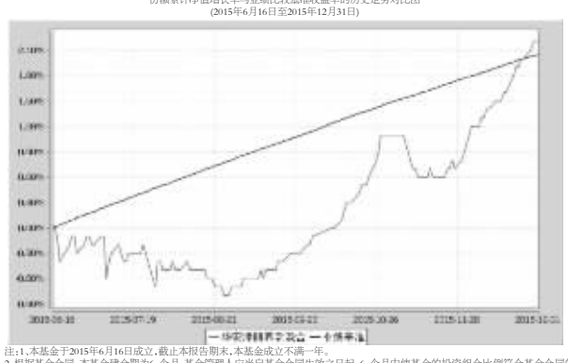
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.30%	0.08%	0.89%	0.01%	1.41%	0.07%
过去六个月	2.30%	0.10%	1.88%	0.01%	0.42%	0.09%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.10%	2.68%	0.01%	0.15%	0.09%

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

华安添颐养老混合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的历史走势对比图

(2015年6月16日至2015年12月31日)



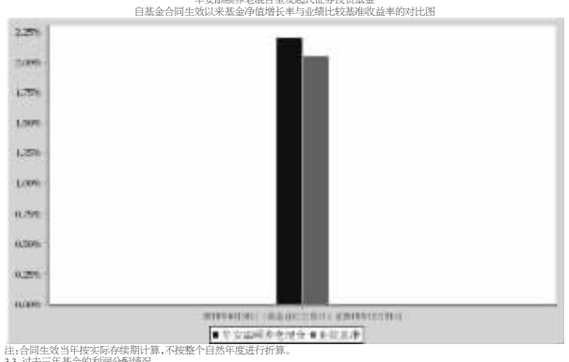
注:1、本基金于2015年6月16日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2、根据基金合同,本基金建仓期为6 个月,基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内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

华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来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

无。

§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债券、华安月月鑫短期理财债券、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、华安保本混合、华安双债添利债券、华安信消费混合、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量化增强、华安年年红债券、华安主题先混合、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安新顺灵活配置混合、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、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板50指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等71只开放式基金。管理资产规模达到1558.45亿元人民币。

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		
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监	2015-06-16	-	14年	硕士研究生,14年证券基金从业经历,2001年7月至2004年12月台国际证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建福林投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部,2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理,2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理,2012年11月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理,2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理,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,2014年8月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月起担任本基金的基金经理,2015年11月起,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月起,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。
孙丽娜	本基金的基金经理	2015-06-16	-	5年	硕士研究生,5年债券、基金行业从业经验,曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人,2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理,2014年8月起担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金、华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理,2015年2月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2015年6月起同时担任本基金的基金经理。

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《华安添颐养老混合型发起式证券投资基金基金合同》、《华安添颐养老混合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,研究员在充分尊重公司研究成果的基础上,使用独立观点、独立判断提出投资建议;在投资决策环节,公司各投资组合经理根据投资目标、风险收益特征、业绩比较基准、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,超过该授权限制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) 场外一级市场业务,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,且以公司名义获利,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swim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,且以公司名义获利,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、不同投资组合同日反向交易的监控与预警,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、报告和协助公认的第三方信息(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,对相关同向交易情况进行持续监控,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%的次数为1次,未出现异常交易,原因是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较少,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%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,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

2015年,全球经济继续分化,美国经济复苏好于预期,美联储启动加息;欧洲经济弱势复苏,量化宽松政策继续;日本经济复苏缓慢,经济持续弱于预期。国内经济持续下滑,经济增速再下台阶,传统产业的产能过剩压力继续加大,工业持续低迷;房地产销售量有回暖,但地产投资未见起色,基建投资对经济托底有限,经济下行压力依然较大。央行货币政策保持宽松,四次降息,五次降息,基准利率大幅下调125个基点,同时,央行通过SLO、MLF等工具配合实施,降低了市场对资金面波动的预期,资金利率低位保持稳定。在经济下行,产能过剩背景下,人民币贬值预期持续升温,8.11汇率改革后,人民币贬值预期进一步上升,随着外汇市场的持续下降,资金流出不断扩大,一定程度制约了货币政策的进一步放松。

在货币供给充裕但融资需求萎缩以及股票市场深度调整的情况下,资金涌向债券市场,债券市场继续呈现牛市特征。一季度央行通过大幅降准以及公开市场引导资金利率不断下行,7天回购平均下行近200个基点,短端债券收益率下行100多BP,资金利率明显下降;二季度地方债置换导致利率债供给大增,收益率以调整上行为主,同时提中大盘冷流了部分资金;下半年随着股市大幅下跌,IPO暂停,打新基金轮型债券基金,资本市场风险偏好发生转移,银行理财大规模资金流入债券市场,资产重新配置使得债券收益率大幅下降,随着经济下滑,企业经营压力不断增大,特别是过剩产能行业连年亏损,信用风险大幅上升,刚兑彻底打破,信用违约事件屡见不鲜,信用利差进一步分化,高等级利差进一步大幅压缩,低等级特别是过剩产能行业利差大幅上升。

权益市场上半年在市场各主体加杠杆的背景下,出现了较大涨幅,但在6月底趋势逆转,市场出现急速下跌。一直到年底市场维持了宽幅震荡的格局。可转债随股市行情,上半年表现出色,下半年经历了深度调整,全年表现为指数下跌。

本基金成立之后在权益市场主要参与IPO网下申购,以及债券配置主要以信用债为主,结合一定的流动性管理。在权益市场出现较大波动时,本基金由于权益仓位较低,波动幅度远小于市场,并且通过次新股和债券市场的配置取得了正收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.022元,本报告期份额净值增长率为2.20%,同期业绩比较基准增长率为2.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,全球低增长、低通胀、低利率的环境仍将持续,虽然美联储已启动加息,但市场已对其后续加息预期开始降低,美元走强可能弱于市场预期,人民币汇率的压力可能会有所缓解。虽然央行货币政策执行报告中指出,货币政策将保持适度宽松,货币政策的宽松预期可能有所减弱,但国内经济转型和供给侧改革仍是发展主基调,化解过剩产能是我国产业结构升级,提升经济运行效率的重要举措,国务院已下发关于煤炭、钢铁等行业过剩产能的指导意见,未来三至五年,经济仍将处于转型阵痛期,经济增长压力较大,债券市场的牛市基础仍在。但随着房地产政策的持续放松以及宽松财政政策的发力,可能会对经济悲观预期有所修正,同时地方债置换规模的扩大可能仍对债券市场产生一定冲击,汇率波动将继续对国内货币政策产生影响,2016年债券市场的波动可能进一步加剧。在经济下行及去产能背景下,信用风险溢价将继续上升,违约事件可能进一步增多,风险防范将成重中之重。

本基金在2016年将继续高等级信用债和无风险利率债的配置,在期限和等级利差均较低的情况下,采用中短久期、中低杠杆的策略,继续参与第一级市场投资,灵活调整基础股票仓位,目下而上的挖掘主题和行业的机会,我们将秉承稳健、专业的投资理念,以期为基金份额持有人谋求最大利益,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

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:总经理助理(分管投资研究)、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:

詹启森,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,现任安吞港精选、华安大中华升级基金、华安证券投资基金、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经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵 敏:研究生学历,曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作,历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理。

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 沛,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、华安双利债券基金、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

无。

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,上海银行股份有限公司(以下称"本托管人")在华安添颐养老混合型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 郭杭翔 蒋燕华签字出具了安永华明(2016)审字第60971571_B30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 资负债表

会计主体:华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

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
资产:	-
银行存款	436,095,434.06
结算备付金	7,846,437.85
存出保证金	126,030.45
交易性金融资产	3,158,482,266.58
其中:股票投资	47,632,019.38
基金投资	-
债券投资	3,110,850,247.20
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	52,355,969.77
应收股利	-
应收申购款	497.02
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,654,906,635.73
负债和所有者权益	本期末 2015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	569,998,500.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,560,105.00
应付托管费	390,026.23
应付销售服务费	-
应付交易费用	129,430.26
应交税费	-
应付利息	130,665.59
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	290,000.00
负债合计	572,498,727.08
所有者权益:	-
实收基金	3,014,814,451.49
未分配利润	67,593,457.16
所有者权益合计	3,082,407,908.65
负债和所有者权益总计	3,654,906,635.73

注:(1)报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.022元,基金份额总额3,014,814,451.49份。

(2)本基金合同于2015年6月16日生效,无上年末对比数据。

7.2 利润表

会计主体:华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	93,707,298.52
1.利息收入	50,310,103.38
其中:存款利息收入	1,630,802.89
债券利息收入	47,032,715.45
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,646,585.04
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-7,588,400.70
其中:股票投资收益	-11,762,830.66
基金投资收益	-
债券投资收益	4,114,626.57
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	59,803.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	50,282,889.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	702,706.24
减:二、费用	16,139,976.41
1. 管理人报酬	7,942,056.72
2. 托管费	1,985,514.16
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	337,661.80
5. 利息支出	5,565,988.44
其中:卖出回购金融资产支出	5,565,988.44
6. 其他费用	308,755.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	77,567,322.11
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	77,567,322.11

注:1、本财务报告实际编制期间为2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

2、本基金于2015年6月16日生效,无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月16日(基金合同生效日)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)	258,004,000.00	-	258,004,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	77,567,322.11	77,567,322.11
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)	2,756,810,451.49	-9,973,864.95	2,746,836,586.54
其中:1.基金申购款	2,937,195,886.21	-11,197,398.10	2,925,998,488.11
2.基金赎回款	-180,385,434.72	1,223,533.15	-179,161,901.57
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)	3,014,814,451.49	67,593,457.16	3,082,407,908.65

注:本财务报告实际编制期间为2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

2、本基金于2015年6月16日生效,无上年度可比期间。

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

华安添颐养老混合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[2015]1140号《关于准予华安添颐养老混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人于2015年6月12日向社会公开募集,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(2015)验字第60971571_B23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2015年6月16日生效,本基金为契约型开放式,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258,004,000.00元,募集资金在初始销售期间未产生利息,以上实收基金(本息)合计为人民币258,004,000.00元,折合258,004,000.00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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内法律法规及证监会允许投资的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为0~30%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金业绩比较基准:中国人民银行公布的一年期定期存款利率(税后)+2%。

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核订的《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年6月16日(基金合同生效日)至2015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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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2015年6月16日(基金合同生效日)起至2015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包括股票投资、债券投资和衍生工具;

(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股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,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或现金股利,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)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)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;

买入附息债券按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;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资,权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资,股指期货初始合约价值按成交金额确认;

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

(5)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付金额价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(6)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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报