

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

中期財務報告 (未經審計)

2013年1月1日

至2013年6月30日

期間

華安匯聚中國債券基金

(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

中期財務報告(未經審核)

2013年1月1日至2013年6月30日期間

目錄	頁數
管理及行政	3
資產負債表(未經審核)	4
綜合收益表(未經審核)	5
權益變動表(未經審核)	6
投資表現紀錄表(未經審核)	7
投資表現報表(未經審核)	8
投資組合變動表(未經審核)	9 - 10
投資組合(未經審核)	11 - 12

重要:

欲瞭解更多有關基金的資料，請參閱基金說明書。

基金說明書可於我們的網站下載：<http://www.huaan.com.hk/>。

投資者不應依賴此報告中所載的資料而作出投資決定。

華安匯聚中國債券基金

(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

管理及行政

基金經理的董事

丁灝
李勅

基金經理

華安資產管理(香港)有限公司
香港
中環
花園道3號
花旗銀行廣場
工商銀行大廈38樓
3808-9室

環球保管人

中國銀行(香港)有限公司
香港
花園道1號
中銀大廈14樓

中國次保管人

中國銀行股份有限公司
中國北京
復興門內大街1號
郵編100818

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港
中環皇后大道中15號
公爵大廈21樓

受託人及登記處

中銀國際英國保誠信託有限公司
香港
銅鑼灣
威菲路道18號
萬國寶通中心12樓及25樓

法律顧問

僅就香港法律(不包括稅法)
高偉紳律師行
香港
中環
康樂廣場1號
怡和大廈28樓

僅就中國法律
通力律師事務所
中國
上海陸家嘴
銀城中路68號
時代金融中心19樓
郵編200120

中國投資顧問

華安基金管理有限公司
中國上海世紀大道8號
國際金融中心二期31樓

華安匯聚中國債券基金

(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

**資產負債表 (未經審核)
於 2013 年 6 月 30 日**

	2013 年 6 月 30 日 人民幣	2012 年 12 月 31 日 人民幣
資產		
透過損益賬以公平值列賬的財務資產	1,086,196,486	1,053,730,581
應收股息及利息	9,419,223	8,639,748
預付款項、按金及其他應收款項	308,000	568,191
現金及現金等價物	13,827,121	14,199,583
資產合計	<u>1,109,750,830</u>	<u>1,077,138,103</u>
負債		
應付管理費	558,114	530,904
應付賬款及累計開支	185,271	724,763
預扣稅及資本收益稅撥備	5,353,387	4,543,261
		-
負債合計	<u>6,096,772</u>	<u>5,798,928</u>
單位持有人應佔資產淨值	<u>1,103,654,058</u>	<u>1,071,339,175</u>
權益合計	<u>1,103,654,058</u>	<u>1,071,339,175</u>
已發行基金單位		
A 類	1,000.0000	1,000.0000
I 類	10,976,598.9896	10,500,000.0000
每單位淨值		
A 類	99.71	101.51
I 類	100.54	102.02

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

綜合收益表 (未經審核)

2013年1月1日至2013年6月30日期間

	2013年1月1日 至 2013年6月30日期間 人民幣	2012年3月2日 (開始營運日)至 2012年12月31日期間 人民幣
收入		
股息收入	3,269,402	4,747,472
利息收入	8,674,367	6,273,764
透過損益賬以公平值列賬的財務資產的公平值變動淨額	(23,516,969)	25,177,146
匯兌(虧損)/收益	5	-
其他收入	-	20,756
投資收入合計	<u>(11,573,195)</u>	<u>36,219,138</u>
支出		
管理費	(3,372,077)	(4,982,595)
受託人費用	(626,624)	(1,000,136)
託管費	(402,799)	(642,270)
核數師薪酬	(102,164)	(145,528)
成立費用	(256,560)	(1,029,656)
經紀費及其他交易成本	(5,744)	(194,180)
其他支出	(7,408)	(1,000,761)
經營支出合計	<u>(4,773,376)</u>	<u>(8,995,126)</u>
除稅前(虧損)/利潤	(16,346,571)	27,224,012
預扣稅及資本收益稅	(1,338,546)	(5,984,837)
來自營運的單位持有人應佔資產淨值(減少)/增加	<u>(17,685,117)</u>	<u>21,239,175</u>

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

權益變動表 (未經審核)
2013年1月1日至2013年6月30日期間

	2013年1月1日 至 2013年6月30日期間 人民幣	2012年3月2日 (開始營運日)至 2012年12月31日期間 人民幣
期初的單位持有人應佔資產淨值	1,071,339,175	-
發行基金單位的所得款項	50,000,000	1,050,100,000
贖回基金單位的所付款項	-	-
來自基金單位交易的增加淨額	50,000,000	1,050,100,000
來自營運的單位持有人 應佔資產淨值(減少)/增加	(17,685,117)	21,239,175
期末的單位持有人應佔資產淨值	<u>1,103,654,058</u>	<u>1,071,339,175</u>

	2013年1月1日 至 2013年6月30日期間	2012年3月2日 (開始營運日)至 2012年12月31日期間
期初已發行基金單位數目	10,501,000.0000	-
期內發行基金單位數目		
- A類	-	1,000.0000
- I類	476,598.9896	10,500,000.0000
期內贖回基金單位數目		
- A類	-	-
- I類	-	-
期末已發行基金單位數目	<u>10,977,598.9896</u>	<u>10,501,000.0000</u>

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

	期內最高 每單位資產淨值 人民幣		期內最低 每單位資產淨值 人民幣	
	A類	I類	A類	I類
2013年1月1日至2013年6月30日期間	107.99	108.62	97.50	98.30
2012年3月2日(開始營運日)至 2012年12月31日期間	102.14	102.31	96.18	96.50

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

	每單位 資產淨值 人民幣		每類別 資產淨值 人民幣	
	A類	I類	A類	I類
於2013年6月30日	99.71	100.54	99,713	1,103,554,345
於2012年12月31日	101.51	102.02	101,506	1,071,237,669

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

投資組合變動表 (未經審核)
於 2013 年 6 月 30 日

		持有量			2013 年 6 月 30 日
		增加	紅股	減少	
投資					
上市股票					
中國					
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD-A	1,516,500	-	-	-	1,516,500
AIR CHINA LTD-A	125,000	-	-	-	125,000
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	280,500	-	-	-	280,500
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	116,900	-	-	-	116,900
BANK OF CHINA LTD-A	568,800	-	-	-	568,800
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD-A	1,812,500	-	-	-	1,812,500
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD-A	387,000	-	-	-	387,000
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	353,100	-	-	-	353,100
CHINA COAL ENERGY CO LTD-A	134,800	-	-	-	134,800
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD-A	70,000	-	-	-	70,000
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-A	704,100	-	-	-	704,100
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD-A	588,300	-	-	-	588,300
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-A	106,500	-	-	-	106,500
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD-A	977,300	-	-	-	977,300
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD-A	1,248,100	-	-	-	1,248,100
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-A	43,600	-	-	-	43,600
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO LTD-A	185,600	-	-	-	185,600
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP-A	366,300	-	109,890	-	476,190
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD-A	132,600	-	-	-	132,600
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD-A	321,700	-	-	-	321,700
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD-A	878,700	-	-	-	878,700
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD-A	621,100	-	-	-	621,100
CHINA VANKE CO LTD-A	713,200	-	-	-	713,200
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	362,400	-	-	-	362,400
CITIC SECURITIES CO LTD-A	543,600	-	-	-	543,600
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	433,300	-	-	-	433,300
GF SECURITIES CO LTD-A	130,800	-	-	-	130,800
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	451,800	-	-	-	451,800
HUANENG POWER INTL INC-A	108,400	-	-	-	108,400
HUAXIA BANK CO LTD-A	200,600	-	-	-	200,600
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD-A	1,159,300	-	-	-	1,159,300
INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	596,700	-	-	-	596,700
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL RARE-EARTH HI-TECH CO LTD-A	78,000	-	-	-	78,000
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD-A	11,880	-	-	-	11,880
JIANGXI COPPER CO LTD-A	61,100	-	-	-	61,100
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	30,500	-	-	-	30,500
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-A	11,000	-	-	-	11,000
PETROCHINA CO LTD-A	296,400	-	-	-	296,400
PING AN BANK CO LTD-A	187,700	-	112,620	-	300,320
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD-A	352,600	-	-	-	352,600
SAIC MOTOR CORP LTD-A	243,600	-	-	-	243,600
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	279,700	-	-	-	279,700
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD-A	64,000	-	-	-	64,000
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD-A	166,300	-	-	-	166,300
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD-A	1,030,800	-	-	-	1,030,800
SUNING COMMERCE GROUP CO LTD-A	384,400	-	-	-	384,400
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	139,800	-	-	-	139,800
YANZHOU COAL MINING CO LTD-A	27,600	-	-	-	27,600
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	578,600	-	-	-	578,600
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-	344,800	-	-	-	344,800

上市債務證券	2013年1月1日	增加	紅股	減少	2013年6月30日
中國					
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD 5.08% A 23MAY2016	642,000	-	-	-	642,000
BANK OF CHINA LTD CB 1.4% A 02JUN2016	993,680	-	-	-	993,680
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD CB 0.6% A 15MAR2019	-	539,050	-	-	539,050
CHINA PETROLEUM & CHEM CB 1% A 23FEB2017	906,800	-	-	-	906,800
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD CB 0.7% A 01AUG2017	986,290	-	-	-	986,290
DAQIN RAILWAY CO LTD 5.48% A 18AUG2013	502,100	-	-	-	502,100
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD CB 0.5% A 19AUG2017	768,590	-	-	-	768,590
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA CB 0.9% A 31AUG2016	863,510	-	-	-	863,510
JIANGXI COPPER CO LTD 1% A 22SEP2016 WW	586,260	-	-	-	586,260
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD CB 3.5% A 16OCT2018	809,000	-	-	-	809,000
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD 4.69% A 30MAR2016	707,000	-	-	-	707,000
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD CB 0.9% A 21MAR2017	858,140	-	-	-	858,140

華安匯聚中國債券基金
(於香港成立的華安匯聚基金系列的成分基金)

投資組合 (未經審核)
於 2013 年 6 月 30 日

		市場價值 人民幣	資產 淨值%
上市股票			
中國			
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD-A	1,516,500	3,730,590	0.34%
AIR CHINA LTD-A	125,000	530,000	0.05%
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	280,500	883,575	0.08%
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	116,900	1,564,122	0.14%
BANK OF CHINA LTD-A	568,800	1,541,448	0.14%
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD-A	1,812,500	7,376,875	0.67%
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD-A	387,000	1,520,910	0.14%
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	353,100	1,310,001	0.12%
CHINA COAL ENERGY CO LTD-A	134,800	659,172	0.06%
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD-A	70,000	283,500	0.03%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-A	704,100	2,922,015	0.26%
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD-A	588,300	1,700,187	0.15%
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-A	106,500	1,457,985	0.13%
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD-A	977,300	11,336,680	1.03%
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD-A	1,248,100	10,696,217	0.97%
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-A	43,600	614,324	0.06%
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO LTD-A	185,600	2,956,608	0.27%
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP-A	476,190	1,990,474	0.18%
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD-A	132,600	2,246,244	0.20%
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD-A	321,700	1,454,084	0.13%
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD-A	878,700	2,873,349	0.26%
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD-A	621,100	1,937,832	0.18%
CHINA VANKE CO LTD-A	713,200	7,025,020	0.64%
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	362,400	2,507,808	0.23%
CITIC SECURITIES CO LTD-A	543,600	5,506,668	0.50%
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	433,300	2,573,802	0.23%
GF SECURITIES CO LTD-A	130,800	1,449,264	0.13%
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	451,800	4,237,884	0.38%
HUANENG POWER INTL INC-A	108,400	578,856	0.05%
HUAXIA BANK CO LTD-A	200,600	1,809,412	0.16%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD-A	1,159,300	4,660,386	0.42%
INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	596,700	8,813,259	0.80%
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL RARE-EARTH HI-TECH CO LTD-A	78,000	1,627,860	0.15%
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD-A	11,880	645,084	0.06%
JIANGXI COPPER CO LTD-A	61,100	961,714	0.09%
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	30,500	5,867,285	0.53%
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-A	11,000	271,810	0.02%
PETROCHINA CO LTD-A	296,400	2,255,604	0.20%
PING AN BANK CO LTD-A	300,320	2,994,190	0.27%
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD-A	352,600	12,256,376	1.11%
SAIC MOTOR CORP LTD-A	243,600	3,217,956	0.29%
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	279,700	2,100,547	0.19%
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD-A	64,000	213,760	0.02%
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD-A	166,300	412,424	0.04%
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD-A	1,030,800	8,535,024	0.77%
SUNING COMMERCE GROUP CO LTD-A	384,400	1,925,844	0.17%
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	139,800	2,801,592	0.25%
YANZHOU COAL MINING CO LTD-A	27,600	259,440	0.02%
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	578,600	1,377,068	0.12%
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	344,800	1,872,264	0.17%
上市股票總值		150,344,393	13.60%

上市債務證券	面值 人民幣	市場價值 人民幣	資產 淨值%
中國			
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD 5.08% A 23MAY2016	642,000	64,842,000	5.88%
BANK OF CHINA LTD CB 1.4% A 02JUN2016	993,680	99,457,431	9.01%
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD CB 0.6% A 15MAR2019	539,050	56,018,076	5.08%
CHINA PETROLEUM & CHEM CB 1% A 23FEB2017	906,800	90,453,300	8.20%
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD CB 0.7% A 01AUG2017	986,290	90,866,898	8.23%
DAQIN RAILWAY CO LTD 5.48% A 18AUG2013	502,100	50,189,916	4.55%
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD CB 0.5% A 19AUG2017	768,590	82,538,880	7.48%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA CB 0.9% A 31AUG2016	863,510	94,329,832	8.55%
JIANGXI COPPER CO LTD 1% A 22SEP2016 WW	586,260	52,411,644	4.75%
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD CB 3.5% A 16OCT2018	809,000	80,430,780	7.29%
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD 4.69% A 30MAR2016	707,000	70,692,930	6.41%
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD CB 0.9% A 21MAR2017	858,140	103,620,406	9.39%
債務證券總額		<u>935,852,093</u>	<u>84.82%</u>
總投資		1,086,196,486	98.42%
其他資產淨值		<u>17,457,572</u>	<u>1.58%</u>
於 2013 年 6 月 30 日的資產淨值		<u>1,103,654,058</u>	<u>100.00%</u>
總投資成本		<u>1,090,828,712</u>	