

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)

2014 年 1 月 1 日

至 2014 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)

2014年1月1日至2014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
單位持有人應佔資產淨值變動表 (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 (未經審核)	9
投資組合變動表 (未經審核)	10

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

李劼
何移直
湯熠

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 2014 年 6 月 30 日

	2014 年 6 月 30 日 人民幣	2013 年 12 月 31 日 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	308,000	308,000
流動資產		
透過損益賬以公平值列賬的財務資產	424,143,265	25,591,763
應收利息	10,203,327	280,206
預付款項、按金及其他應收款項	16,580	-
現金及現金等價物	2,374,568	9,322,602
	<u>436,737,740</u>	<u>35,194,571</u>
資產合計	<u>437,045,740</u>	<u>35,502,571</u>
負債		
非流動負債		
遞延稅項負債	711,021	66,719
流動負債		
應付管理費	211,400	14,914
應付賬款及累計開支	145,732	235,845
稅項撥備	6,758,917	6,389,083
	<u>7,116,049</u>	<u>6,639,842</u>
負債合計 (不包括單位持有人應佔資產淨值)	<u>7,827,070</u>	<u>6,706,561</u>
單位持有人應佔資產淨值	<u>429,218,670</u>	<u>28,796,010</u>
權益合計	<u>429,218,670</u>	<u>28,796,010</u>
已發行基金單位		
A 類	1,039,8253	1,000,0000
I 類	4,284,124.9319	292,132.1839
每單位資產淨值		
A 類	98.73	97.13
I 類	100.16	98.24

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)**

2014年1月1日至2014年6月30日期間

	2014年1月1日 至 2014年6月30日期間	截至2013年 12月31日止年度
	人民幣	人民幣
收入		
股息收入	-	5,680,149
利息收入	7,605,214	14,035,323
透過損益賬以公平值列賬的財務資產的公平值變動淨額	6,795,239	(2,611,314)
匯兌(虧損)/收益	(64)	-
其他收入	-	5
投資收入合計	<u>14,400,389</u>	<u>17,104,163</u>
支出		
管理費	(1,088,947)	(5,355,003)
代管費	(271,218)	(1,076,742)
託管費	(128,888)	(771,690)
核數師薪酬	(117,034)	(145,049)
成立費用	-	(256,560)
交易成本	(52,496)	(410,967)
其他支出	(686,203)	(152,478)
經營支出合計	<u>(2,344,786)</u>	<u>(8,168,489)</u>
除稅前利潤	12,055,603	8,935,674
稅項	<u>(1,015,452)</u>	<u>(3,178,839)</u>
來自營運的單位持有人應佔資產淨值增加	<u>11,040,151</u>	<u>5,756,835</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)***單位持有人應佔資產淨值變動表**

2014年1月1日至2014年6月30日期間

	2014年1月1日 至 2014年6月30日期間 人民幣	截至2013年 12月31日止年度 人民幣
年/期初的單位持有人應佔資產淨值	28,796,010	1,071,339,175
發行基金單位的所得款項	417,894,357	50,000,000
贖回基金單位的所付款項	(28,511,848)	(1,098,300,000)
來自基金單位交易的(減少)/增加淨額	389,382,509	(1,048,300,000)
來自營運的單位持有人應佔資產淨值增加	11,040,151	5,756,835
年/期末的單位持有人應佔資產淨值	429,218,670	28,796,010

	2014年1月1日 至 2014年6月30日期間	截至2013年 12月31日止年度
年/期初已發行基金單位數目	293,132.1839	10,501,000.0000
期內發行基金單位數目		
- A類	1,039.8253	-
- I類	4,284,124.9319	476,598.9896
期內贖回基金單位數目		
- A類	(1,000.0000)	-
- I類	(292,132.1839)	(10,684,466.8057)
年/期末已發行基金單位數目	4,285,164.7572	293,132.1839

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)

最高及最低每單位資產淨值

	最高每單位 資產淨值		最低每單位 資產淨值	
	人民幣		人民幣	
	A 類	I 類	A 類	I 類
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日期間	98.73	100.16	95.99	97.10
截至 2013 年 12 月 31 日止年度	107.99	108.62	97.11	98.22

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)

資產淨值表

	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 2014 年 6 月 30 日	98.73	100.16	102,664	429,116,006
於 2013 年 12 月 31 日	97.13	98.24	97,128	28,698,882

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 2014 年 6 月 30 日

	持有量	市場價值 人民幣	資產 淨值%
非上市債務證券			
中國			
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 4.68% A 16OCT2015	400,000	40,174,680	9.36%
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 5.35% A 09DEC2015	400,000	40,538,720	9.44%
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA CO LTD 3.15% A 14MA	300,000	29,715,840	6.92%
CHINA DEV BK 3.39% A 09JUL2015	400,000	39,646,440	9.24%
CHINA DEV BK 3.8934% A 10JAN2016	700,000	69,445,460	16.20%
CHINA GENERAL NUCLEAR POWER HLDG CORP 5.7% A 26JUL2014	100,000	10,004,850	2.33%
CHINA MINMETALS CORP 5.2% A 19JUL2014	100,000	9,999,000	2.33%
CHINA NATIONAL CHEMICAL CORP 4.13% A 09JUN2015	100,000	9,923,400	2.31%
CHINA NATIONAL PETROLEUM CORP 4.09% A 29APR2015	150,000	14,932,095	3.48%
CHINA POWER INVESTMENT CORP 4.49% A 26FEB2016	200,000	19,891,380	4.63%
CHINA SOUTHERN POWER GRID CO LTD 4.42% A 26NOV2015	100,000	9,963,000	2.32%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.62% A 08MAR2016	200,000	19,742,620	4.60%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.98% A 17DEC2015	200,000	19,892,020	4.63%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.196% A 06AUG2015	400,000	39,963,960	9.31%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.82% A 24OCT2015	400,000	40,244,800	9.38%
SHENHUA GROUP CORP LTD 5.14% A 11MAR2016	100,000	10,065,000	2.34%
債務證券總額		<u>424,143,265</u>	98.82%
總投資		424,143,265	98.82%
其他淨資產		<u>5,075,405</u>	1.18%
於 2014 年 6 月 30 日的資產淨值		<u>429,218,670</u>	100.00%
總投資成本		<u>417,033,055</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)***投資組合變動表 (未經審核)**

於 2014 年 6 月 30 日

	2014 年 1 月 1 日	增加	持有量 紅股	減少	2014 年 6 月 30 日
投資					
上市債務證券					
中國					
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD 5.08% A 23MAY2016	24,500	-	-	(24,500)	-
BANK OF CHINA LTD CB 1.4% A 02JUN2016	23,900	-	-	(23,900)	-
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD CB 0.6% A 15MAR2019	23,310	-	-	(23,310)	-
CHINA PETROLEUM & CHEM CB 1% A 23FEB2017	24,720	-	-	(24,720)	-
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD CB 0.9% A 01AUG2017	26,420	-	-	(26,420)	-
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD CB 1% A 19AUG2017	21,980	-	-	(21,980)	-
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA CB 1.1% A 31AUG2016	22,300	-	-	(22,300)	-
JIANGXI COPPER CO LTD 1% A 22SEP2016 WW	27,470	-	-	(27,470)	-
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD CB 3.5% A 16OCT2018	24,430	-	-	(24,430)	-
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD 4.69% A 30MAR2016	24,170	-	-	(24,170)	-
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD CB 0.9% A 21MAR2017	18,680	-	-	(18,680)	-
非上市債務證券					
中國					
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 4.68% A 16OCT2015	-	400,000	-	-	400,000
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 5.35% A 09DEC2015	-	400,000	-	-	400,000
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA CO LTD 3.15% A 14MAY2015	-	300,000	-	-	300,000
CHINA DEV BK 3.39% A 09JUL2015	-	400,000	-	-	400,000
CHINA DEV BK 3.8934% A 10JAN2016	-	700,000	-	-	700,000
CHINA GENERAL NUCLEAR POWER HLDG CORP 5.7% A 26JUL2014	-	100,000	-	-	100,000
CHINA MINMETALS CORP 5.2% A 19JUL2014	-	100,000	-	-	100,000
CHINA NATIONAL CHEMICAL CORP 4.13% A 09JUN2015	-	100,000	-	-	100,000
CHINA NATIONAL PETROLEUM CORP 4.09% A 29APR2015	-	150,000	-	-	150,000
CHINA POWER INVESTMENT CORP 4.49% A 26FEB2016	-	200,000	-	-	200,000
CHINA SOUTHERN POWER GRID CO LTD 4.42% A 26NOV2015	-	100,000	-	-	100,000
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.62% A 08MAR2016	-	200,000	-	-	200,000
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.98% A 17DEC2015	-	200,000	-	-	200,000
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.196% A 06AUG2015	-	400,000	-	-	400,000
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.82% A 24OCT2015	-	400,000	-	-	400,000
SHENHUA GROUP CORP LTD 5.14% A 11MAR2016	-	100,000	-	-	100,000