

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)

2015年1月1日

至 2015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)

2015年1月1日至2015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。

基金說明書可於基金經理的網站下載：<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

何移直
董威
許諾
朱學華

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 2015 年 6 月 30 日

	2015 年 6 月 30 日 人民幣	2014 年 12 月 31 日 人民幣
資產		
非流動資產		
存款準備金	95,257	104,175
流動資產		
透過損益賬以公平值列賬的財務資產	392,268,310	435,395,825
應收利息	9,978,103	8,309,883
預付款項、按金及其他應收款項	17,488	4,026
現金及現金等價物	21,689,543	1,794,605
	<u>423,953,444</u>	<u>445,504,339</u>
資產合計	<u>424,048,701</u>	<u>445,608,514</u>
負債		
非流動負債		
遞延稅項負債	848,112	391,654
流動負債		
應付管理費	218,579	236,905
應付賬款及累計開支	149,127	248,848
稅項撥備	7,291,524	7,406,729
	<u>7,659,230</u>	<u>7,892,482</u>
負債合計 (不包括單位持有人應佔資產淨值)	<u>8,507,342</u>	<u>8,284,136</u>
單位持有人應佔資產淨值	<u>415,541,359</u>	<u>437,324,378</u>
權益合計	<u>415,541,359</u>	<u>437,324,378</u>
已發行基金單位		
A 類	1,039,8253	1,039,8253
I 類	3,993,124.9319	4,284,124.9319
每單位資產淨值		
A 類	101.92	100.29
I 類	104.04	102.06

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)**

2015年1月1日至2015年6月30日期間

	2015年1月1日 至 2015年6月30日期間	截至2014年 12月31日止年度
	人民幣	人民幣
收入		
利息收入	8,829,587	21,024,569
透過損益賬以公平值列賬的財務資產的公平值變動淨額	1,608,500	3,752,019
其他收入	-	-
投資收入合計	<u>10,438,087</u>	<u>24,776,588</u>
支出		
管理費	(1,267,168)	(2,400,237)
受託人費用	(286,826)	(567,666)
託管費	(156,820)	(286,732)
核數師薪酬	(99,210)	(214,831)
成立費用	-	-
交易成本	(5,363)	(58,871)
法律及其他專業服務費用	(61,497)	(697,009)
其他支出	(27,989)	(60,777)
經營支出合計	<u>(1,904,873)</u>	<u>(4,286,123)</u>
除稅前利潤	8,533,214	20,490,465
稅項	<u>(341,733)</u>	<u>(1,344,606)</u>
來自營運的單位持有人應佔資產淨值增加	<u>8,191,481</u>	<u>19,145,859</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 (未經審核)**

2015年1月1日至2015年6月30日期間

	2015年1月1日 至 2015年6月30日期間 人民幣	截至2014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	437,324,378	28,796,010
發行基金單位的所得款項	-	417,894,357
贖回基金單位的所付款項	(29,974,500)	(28,511,848)
來自基金單位交易的(減少)/增加淨額	(29,974,500)	389,382,509
來自營運的單位持有人應佔資產淨值增加	8,191,481	19,145,859
年/期末的單位持有人應佔資產淨值	415,541,359	437,324,378

	2015年1月1日 至 2015年6月30日期間	截至2014年 12月31日止年度
年/期初已發行基金單位數目	4,285,164.7572	293,132.1839
期內發行基金單位數目		
- A類	-	1,039.8253
- I類	-	4,284,124.9319
期內贖回基金單位數目		
- A類	-	(1,000.0000)
- I類	(291,000.0000)	(292,132.1839)
年/期末已發行基金單位數目	3,994,164.7572	4,285,164.7572

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)

投資表現紀錄表 (未經審核)

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
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日期間	101.97	104.05	100.32	102.10
截至 2014 年 12 月 31 日止年度	100.36	102.06	95.99	97.10

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)

投資表現報表 (未經審核)

資產淨值

	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 2015 年 6 月 30 日	101.92	104.04	105,982	415,435,377
於 2014 年 12 月 31 日	100.29	102.06	104,280	437,220,098

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 2015 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 3.68% A 27FEB2016	30,000,000	30,182,730	7.26%
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 4.68% A 16OCT2015	40,000,000	40,276,120	9.69%
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 5.35% A 09DEC2015	40,000,000	40,495,920	9.75%
CHINA ACADEMY OF TELECOM TECHNOLOGY 4.15% A 14AUG2015	10,000,000	10,002,400	2.41%
CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.39% A 09JUL2015	40,000,000	40,011,320	9.63%
CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.8934% A 10JAN2016	60,000,000	60,356,760	14.54%
CHINA NATIONAL GOLD GROUP CORP 4.67% A 06NOV2015	10,000,000	10,034,230	2.41%
CHINA POWER INVESTMENT CORP 4.49% A 26FEB2016	20,000,000	20,122,540	4.84%
CHINA SOUTHERN POWER GRID CO LTD 4.42% A 26NOV2015	10,000,000	10,040,110	2.42%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.62% A 08MAR2016	20,000,000	20,117,600	4.84%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 3.98% A 17DEC2015	20,000,000	20,132,300	4.84%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.196% A 06AUG2015	40,000,000	40,071,000	9.64%
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 4.82% A 24OCT2015	40,000,000	40,311,760	9.70%
SHENHUA GROUP CORP LTD 5.14% A 11MAR2016	10,000,000	10,113,520	2.43%
債務證券總值		<u>392,268,310</u>	94.40%
總投資市值		392,268,310	94.40%
其他淨資產		<u>23,273,049</u>	5.60%
於 2015 年 6 月 30 日的資產淨值		<u>415,541,359</u>	100.00%
總投資成本		<u>383,868,611</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 2015 年 6 月 30 日

	2015 年 1 月 1 日	增加	持有量 紅股	減少	2015 年 6 月 30 日
投資					
非上市債務證券					
中國					
AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.68% A 27FEB2016	-	300,000	-	-	300,000
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 ACADEMY OF TELECOM TECHNOLOGY 4.15% A 14AUG2015	100,000	-	-	-	100,000
CHINA DATANG CORP 4.75% A 21APR2015	100,000	-	-	(100,000)	-
CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.39% A 09JUL2015	400,000	-	-	-	400,000
CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.8934% A 10JAN2016	600,000	-	-	-	600,000
CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 4.09% A 09JUN2015	100,000	-	-	(100,000)	-
CHINA HUANENG GROUP CORP 4.5% A 02APR2015	100,000	-	-	(100,000)	-
CHINA NATIONAL CHEMICAL CORP 4.13% A 09JUN2015	100,000	-	-	(100,000)	-
CHINA NATIONAL GOLD GROUP CORP 4.67% A 06NOV2015	-	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