

華安匯聚中國債券基金

(華安匯聚基金系列之子基金)

中期財務報告（未經審計）
2012年3月2日至2012年6月30日期間



華安匯聚中國債券基金
中期財務報告 (未經審核)
2012年3月2日(成立日)至2012年6月30日期間

目錄	頁數
管理及行政	2
資產負債表 (未經審核)	3
綜合收益表 (未經審核)	4
權益變動表 (未經審核)	5
投資組合變動表 (未經審核)	6
投資表現報表	7
投資組合	8

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 管理及行政

基金經理

華安資產管理(香港)有限公司
香港
中環花園道8號花旗銀行廣場
工商銀行大廈38樓3808-9室

基金經理的董事

李勅先生
丁灝先生

受託人及過戶登記處

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

託管人

中國銀行(香港)有限公司
香港
花園道1號
中銀大廈14樓

基金經理律師

高偉紳律師行
香港
中環 康樂廣場1號
怡和大廈28樓

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
香港
中環
太子大廈廿二樓

華安匯聚中國債券基金
 資產負債表(未經審核)
 於2012年6月30日

	人民幣
資產	
透過損益賬以公平值列賬之金融資產	1,046,501,771
現金及現金等價物	11,276,808
銀行存款及債券的應收利息	6,643,689
應收股息	743,655
提前支付及其他應收款項	894,490
應收認購款項	-
資產合計	<u><u>1,066,060,413</u></u>
負債	
透過損益賬以公平值列賬之金融負債	-
應付經紀款	-
應付贖回款項	-
贖回單位應付款項	-
應付管理費	523,748
應付受託費	115,112
對單位持有人的應付分派	-
應付預扣所得稅	3,852,592
累計開支及其他應付款	119,609
負債合計	<u><u>4,611,061</u></u>
權益	
股本	1,050,100,000
未分配利潤	11,349,352
權益合計	<u><u>1,061,449,352</u></u>
負債和權益合計	<u><u>1,066,060,413</u></u>
已發行單位數目 (A 類)	1,000.0000
已發行單位數目 (I 類)	10,500,000.0000
	<u><u>10,501,000.0000</u></u>
每單位淨資產值(A 類)	100.89
每單位淨資產值(I 類)	101.08

華安匯聚中國債券基金
 綜合收益表（未經審核）
 2012年3月2日(成立日)至2012年6月30日期間

	人民幣
收入	
股息收入	3,033,827
透過損益帳以公平值列賬的財務資產的利息收入	3,788,430
銀行存款利息收入	484,818
透過損益帳以公平值列賬的財務資產的淨未變現(虧損) / 收益	11,559,805
透過損益帳以公平值列賬的財務資產的淨(虧損) / 收益	-
匯兌 (虧損) / 收益	-
	18,866,880
支出	
管理費	(1,854,266)
受託人費用	(409,523)
法律以及專業費用	-
許可費	-
託管費	(271,290)
核數師薪酬	(53,511)
初始費用	(370,970)
出版費用	-
經紀費及其他交易成本	(173,286)
預扣稅項	(4,383,471)
其他支出	(1,211)
	(7,517,528)
期內的利潤以及綜合收益合計	11,349,352

華安匯聚中國債券基金
 權益變動表 (未經審核)
 2012年3月2日(成立日)至2012年6月30日期間

	股本 人民幣	未分配利潤 人民幣	合計 人民幣
2012年3月2日(成立日)	-	-	-
認購單位	1,050,100,000	-	1,050,100,000
贖回單位	-	-	-
股息分派	-	-	-
期內綜合收益合計	-	11,349,352	11,349,352
	<hr/>	<hr/>	<hr/>
截至2012年6月30日	<u>1,050,100,000</u>	<u>11,349,352</u>	<u>1,061,449,352</u>

華安匯聚中國債券基金
投資表現報表
資產淨值

分支基金

	最高		最低	
	每單位資產淨值 人民幣		每單位資產淨值 人民幣	
財政年度結束 截至2012年6月30日	A類	I類	A類	I類
	102.14	102.31	98.53	98.55

華安匯聚中國債券基金
投資組合變動表(未經審核)
截至2012年6月30日期間

上市／掛牌投資

2012年6月30日
%

股票

中國

16.06

定息證券

中國

82.53

總投資

98.59

其他淨資產

1.41

截至2012年6月30日的淨資產

100.00

華安匯聚中國債券基金
 投資組合
 截至2012年6月30日期間

	面值	市場價值 人民幣	資產淨值%
上市／掛牌投資			
股票			
中國			
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD-A	1,516,500	3,927,735	0.37
AIR CHINA LTD-A	125,000	768,750	0.07
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	280,500	1,730,685	0.16
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	116,900	1,732,458	0.16
BANK OF CHINA LTD-A	568,800	1,604,016	0.15
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD-A	1,812,500	8,228,750	0.78
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD-A	387,000	1,671,840	0.16
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	353,100	1,412,400	0.13
CHINA COAL ENERGY CO LTD-A	134,800	1,043,352	0.10
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-A	704,100	2,957,220	0.28
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD-A	588,300	1,670,772	0.16
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-A	106,500	1,948,950	0.18
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD-A	977,300	10,672,116	1.01
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD-A	1,248,100	7,476,119	0.70
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-A	43,600	719,836	0.07
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO LTD-A	185,600	4,116,608	0.39
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP-A	307,300	1,935,990	0.18
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	368,800	947,816	0.09
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD-A	132,600	2,980,848	0.28
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD-A	321,700	1,669,623	0.16
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD-A	878,700	2,934,858	0.28
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD-A	621,100	2,310,492	0.22
CHINA VANKE CO LTD-A	713,200	6,354,612	0.60
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	362,400	2,464,320	0.23
CITIC SECURITIES CO LTD-A	543,600	6,865,668	0.65
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	433,300	3,046,099	0.29
GF SECURITIES CO LTD-A	65,400	1,950,882	0.18
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	451,800	4,350,834	0.41
HUANENG POWER INTL INC-A	108,400	699,180	0.07
HUAXIA BANK CO LTD-A	200,600	1,899,682	0.18
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD-A	1,159,300	4,579,235	0.43
INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	596,700	7,745,166	0.73
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD-A	11,880	1,598,454	0.15
JIANGXI COPPER CO LTD-A	61,100	1,460,901	0.14
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	30,500	7,294,075	0.69
PETROCHINA CO LTD-A	296,400	2,682,420	0.25
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD-A	352,600	16,127,924	1.52
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD-A	35,200	1,188,704	0.11
SAIC MOTOR CORP LTD-A	243,600	3,481,044	0.33
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	279,700	3,893,424	0.37
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD-A	64,000	291,840	0.03
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD-A	166,300	442,358	0.04
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD-A	1,030,800	8,380,404	0.79
SHENZHEN DEVELOPMENT BANK CO LTD-A	187,700	2,845,532	0.27
SUNING APPLIANCE CO LTD-A	384,400	3,225,116	0.30
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	139,800	4,579,848	0.43
YANZHOU COAL MINING CO LTD-A	27,600	523,848	0.05
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	578,600	2,244,968	0.21
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	344,800	3,458,344	0.33
ZTE CORP-A	154,400	2,155,424	0.20

華安匯聚中國債券基金
 投資組合
 截至2012年6月30日期間

	面值	市場價值 人民幣	資產淨值%
定息證券			
公司債			
中國			
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD 5.08% A 23MAY2016	642,000	65,811,420	6.20
DAQIN RAILWAY CO LTD 5.48% A 18AUG2013	502,100	51,214,200	4.82
JIANGXI COPPER CO LTD 1% A 22SEP2016 WW	586,260	50,805,292	4.79
SHANGHAI INTL PORT GROUP CO LTD 4.69% A 30MAR2016	707,000	71,675,660	6.75
可轉債			
中國			
BANK OF CHINA LTD CB 1.1% A 02JUN2016	993,680	96,496,264	9.08
CHINA PETROLEUM & CHEM CB 0.7% A 23FEB2017	906,800	90,553,048	8.53
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD CB 0.5% A 01AUG2017	986,290	96,192,864	9.06
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD CB 0.5% A 19AUG2017	768,590	86,381,830	8.14
HEBEI IRON & STEEL CO LTD CB 2% A 14DEC2012	771,915	83,994,387	7.91
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA CB 0.7% A 31AUG2016	863,510	94,010,334	8.86
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD CB 0.7% A 21MAR2017	858,140	89,074,932	8.39
總上市／掛牌投資		876,210,231	82.53
其他資產淨值		185,239,121	17.47
截至2012年6月30日的資產淨值		1,061,449,352	100.00
總投資成本		1,034,941,967	