

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金 （原安顺证券投资基金转型）2014 年半年度 报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月18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。

本报告中财务资料未经审计。

原安顺证券投资基金本报告期自2014年1月1日起至5月11日止，华安安顺灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2014年5月12日（基金合同生效日）起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标	8
3.1.2 基金净值表现	8
3.2 安顺证券投资基金	10
3.2.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2.2 基金净值表现	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§ 6 年度财务报表	18
6.1 安顺证券投资基金	18
6.1.1 资产负债表	18
6.1.2 利润表	19
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
6.1.4 报表附注	22
6.2 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	35
6.2.1 资产负债表	35
6.2.2 利润表	37
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表	38
6.2.4 报表附注	38
§ 7 投资组合报告	56
7.1 安顺证券投资基金	56
7.1.1 期末基金资产组合情况	56

7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合	56
7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	60
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	60
7.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	60
7.1.9 投资组合报告附注	60
7.2 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	61
7.2.1 期末基金资产组合情况	61
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合	61
7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	62
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	64
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	65
7.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	65
7.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.3 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末上市基金前十名持有人	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 12 备查文件目录	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	
基金名称	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安安顺灵活配置-转型后
基金主代码	519909
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月12日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,748,357,091.15
基金合同存续期	不定期
安顺证券投资基金	
基金名称	安顺证券投资基金
基金简称	华安安顺封闭
基金主代码	500009
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年6月15日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999-06-22

2.2 基金产品说明

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	
投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，并结合对个股、个券的精选策略，以追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。

	<p>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。</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。</p> <p>个股投资方面，本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法筛选个股。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金，基金的预期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。</p>
<p>安顺证券投资基金</p>	
<p>投资目标</p>	<p>本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。</p> <p>本基金主要投资于成长型上市公司，并兼顾对收益型上市公司及债券的投资，从而使投资者在承受一定风险的情况下，有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。</p>
<p>投资策略</p>	<p>本基金为平衡型基金，兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 40-80%，现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，60%左右投资于具有良好成长性的上市公司股票，40%左右投资于收益型上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。</p> <p>本基金界定的成长型股票主要指主业发展前</p>

	景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期GDP的增长率。 本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定，具有良好分红能力，预期每股收益高于市场平均水平，预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	王涛
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		李勃	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	上海市陆家嘴东路166号中保大厦36楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2014 年 5 月 12 日-2014 年 6 月 30 日
本期已实现收益	20,875,424.37
本期利润	190,056,970.25
加权平均基金份额本期利润	0.0553
本期加权平均净值利润率	5.31%
本期基金份额净值增长率	3.32%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末 2014 年 6 月 30 日
期末可供分配利润	285,982,221.58
期末可供分配基金份额利润	0.0763
期末基金资产净值	3,844,089,481.57
期末基金份额净值	1.026
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末 2014 年 6 月 30 日
基金份额累计净值增长率	3.32%

注：1. 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4. 原安顺证券投资基金于 2014 年 5 月 12 日转型为安顺灵活配置混合型证券投资基金，截止本报告期末，安顺灵活配置混合型证券投资基金成立未满一年。

5. 本基金已于 2014 年 6 月 9 日对原安顺证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:1.085545777。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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	净值增长率 ①	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
自基金合同生效起至今	3.32%	1.08%	0.01%	0.41%	3.31%	0.67%

注：本基金业绩比较基准：50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、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）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。

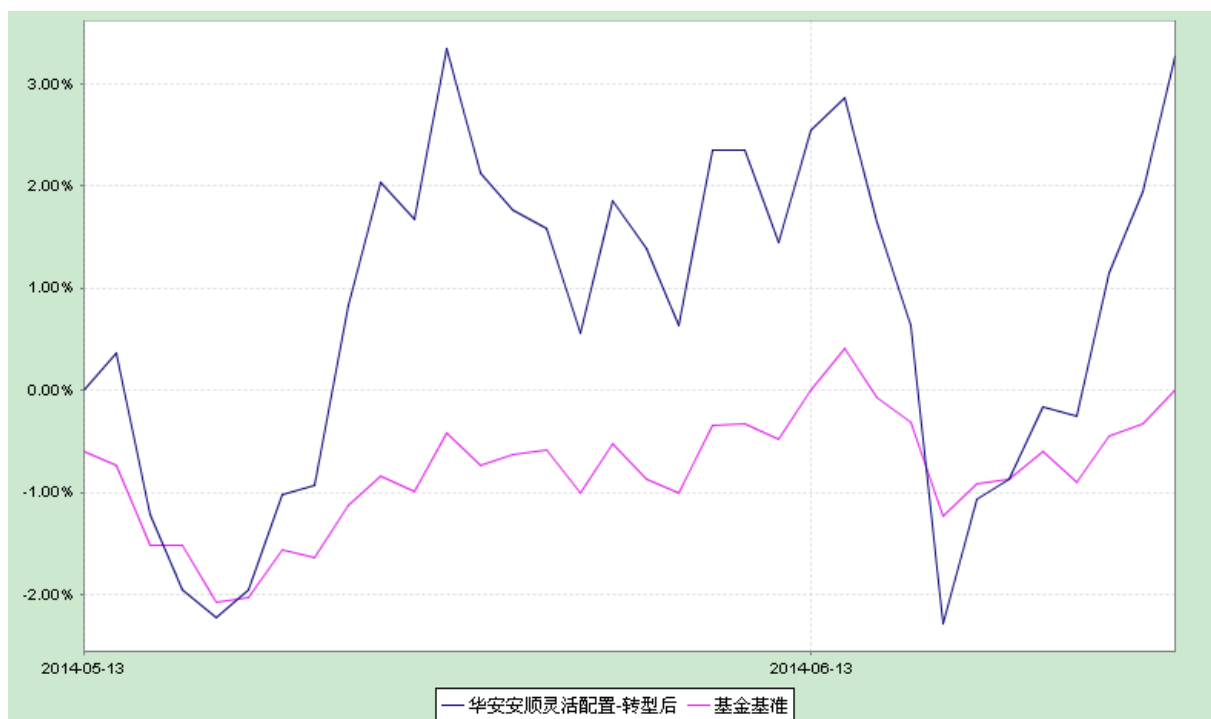
基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

3.1.2.2 自基金转型以来基金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

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 5 月 12 日至 2014 年 6 月 30 日）



注： 1、本基金转型日期为 2014 年 5 月 12 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定，基金管理人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 安顺证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	2014年1月1日-2014年5月11日
本期已实现收益	219,510,732.78
本期利润	-126,818,663.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0423
本期加权平均净值利润率	-3.64%
本期基金份额净值增长率	-4.05%
3.2.1.2 期末数据和指标	2014年5月11日
期末可供分配利润	172,904,977.06
期末可供分配基金份额利润	0.0576
期末基金资产净值	3,172,904,977.06
期末基金份额净值	1.0576
3.2.1.3 累计期末指标	2014年5月11日
基金份额累计净值增长率	741.99%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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
2014.4.11-2014.5.11	-6.37%	1.72%	-	-	-	-
2014.2.11-2014.5.11	-8.89%	2.02%	-	-	-	-
2013.11.11-2014.5.11	3.54%	2.21%	-	-	-	-
2013.5.11-2014.5.11	2.87%	2.07%	-	-	-	-
2011.5.11-2014.5.11	1.98%	2.05%	-	-	-	-
自基金成立-2014.5.11	741.99%	2.45%	-	-	-	-

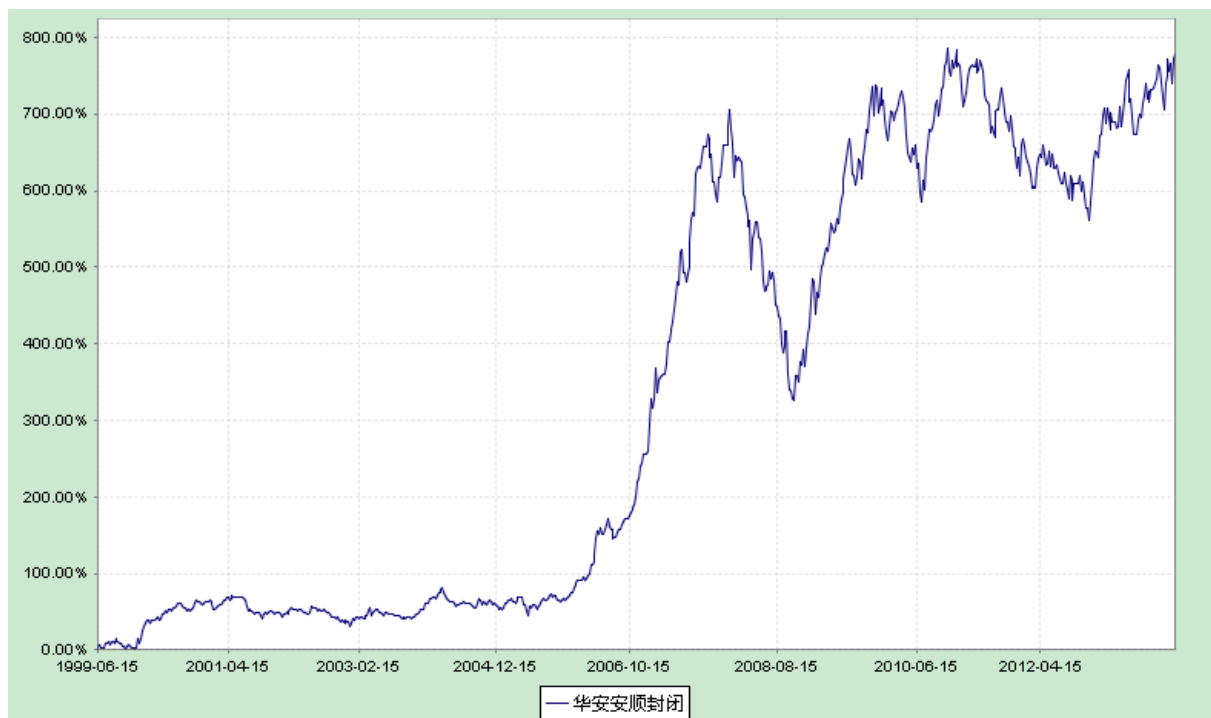
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金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

安顺证券投资基金

转型前累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（1999 年 6 月 15 日至 2014 年 5 月 11 日）



§ 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 2014 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安创新混合、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、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、

华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、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、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、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 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、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、华安安顺混合等 49 只开放式基金。管理资产规模达到 688.13 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚志民	本基金的基金经理，首席投资官，副总经理	2003-9-18	-	17 年	工商管理硕士，17 年证券、基金从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，现任公司副总经理，首席投资官。1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任本基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 2 月起担任华安基金副总经理兼首席投资官。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《安顺证

券投资基金基金合同》、《安顺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 公平交易制度的执行情况

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，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，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，超过投资权限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）交易所一级市场业务，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，且以公司名义获得，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 iwind 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，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、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、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易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；风险管理部根据市场公认的第三方信息（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。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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，对相关同向交易指标进行持续监控，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%的情况共出现了1次。原因：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单只股票的数量较小，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%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，A股市场走出了结构性分化行情，上证指数上半年下跌3.20%，中小板指数下跌3.72%，而创业板指数涨幅达到7.69%。行业涨幅差距巨大，涨幅最大的计算机行业和跌幅最大的采掘行业差距超过26个百分点。

报告期内，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，股票投资上限由原来的80%提高到95%，本基金始终保持相对积极的仓位，操作上主要增加了电子、房地产、传媒等行业的配置，降低了建材、化工、医药等行业的配置，在转开放式运行后取得较好收益，业绩超越比较基准3.31个百分点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为1.026元。报告期内，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，转型前（2014.1.1-2014.5.11）增长率-4.05%，转型后（2014-5.12-2014.6.30）增长率+3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期公布的各项经济数据显示经济下行有所趋缓，但地产销售和 investment 数据持续下降，将给政府稳增长目标带来压力。管理层多次强调7.5%的经济增长目标，并且用多种“微刺激”手段来促进经济增长，PMI数据回升到荣枯线之上，表明“微刺激”政策显效，预计经济增长在三季度有望进一步改善。央行连续在公开市场进行净投放操作，银监会修改存贷比规则释放信贷额度等，资金面得到改善，流动性保持较好态势，有利于行情的进一步发展。

在经济下行压力缓解、资金面得到改善的情况下，我们对后期市场持较为积极的态度，低估值蓝筹在经济基本面好转、流动性改善的情况下有反弹空间。由于在上证指数与沪深300指数中，传统经济个股占据较大权重，这些指数持续走强的可能性较小，经济转型背景下成长股依然有较大的投资机会。从目前A股市场中消费、医药、TMT等成长性行业占整体市场的市值比重来看，与成熟股市相比还有相当大的差距，未来成长股的表现更有可能是以时间换取空间，我们重点选取符合转型方向、业绩有望超预期的成长股进行配置。

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、估值政策重大变化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：首席投资官、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:

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺混合、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森，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，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利和华安大国新经济股票基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

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。

贺涛，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，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）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

本基金的基金经理尚志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

本报告期内共实施一次分红，分红方案为：0.8 元/10 份，权益登记日：2014 年 4 月 10 日，除息日：2014 年 4 月 11 日(场内)，现金红利发放日：2014 年 4 月 17 日。

§ 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

2014 年上半年度，基金托管人在华安安顺灵活配置混合型证券投资基金（原安顺证券投资基金）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 年上半年度，华安基金管理有限公司在华安安顺灵活配置混合型证券投资基金（原安顺证券投资基金）投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 240,000,000 元。

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

2014年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安安顺灵活配置混合型证券投资基金（原安顺证券投资基金）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 安顺证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：安顺证券投资基金

报告截止日：2014年5月11日

单位：人民币元

资产	附注号	2014年5月11日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.1.4.7.1	308,658.59	5,181,240.53
结算备付金		100,506,922.72	8,869,629.31
存出保证金		1,023,590.42	1,247,988.35
交易性金融资产	6.1.4.7. 2	3,153,858,148.85	3,510,493,044.16
其中：股票投资		2,500,843,338.85	2,794,000,389.76
基金投资		-	-
债券投资		653,014,810.00	716,492,654.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.1.4.7. 3	-	-
买入返售金融资产	6.1.4.7. 4	-	-
应收证券清算款		-	22,782,106.76
应收利息	6.1.4.7. 5	21,220,082.51	16,135,578.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.1.4.7. 6	-	-
资产总计		3,276,917,403.09	3,564,709,587.56
负债和所有者权益	附注号	2014年5月11日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.1.4.7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		96,999,734.50	16,208,732.65
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,463,297.43	4,408,545.28
应付托管费		243,882.91	734,757.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.1.4.7. 7	4,263,269.35	2,393,011.98
应交税费		58,900.00	58,900.00
应付利息		25,671.63	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.1.4.7. 8	957,670.21	1,181,999.20
负债合计		104,012,426.03	24,985,946.62
所有者权益：			
实收基金	6.1.4.7. 9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.1.4.7. 10	172,904,977.06	539,723,640.94
所有者权益合计		3,172,904,977.06	3,539,723,640.94
负债和所有者权益总计		3,276,917,403.09	3,564,709,587.56

注：报告截止日2014年5月11日，基金份额净值1.0576元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.1.2 利润表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月11日

单位：人民币元

项 目	附注号	2014年1月1日-2014年5	上年度可比期间
-----	-----	------------------	---------

		月 11 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-95,889,365.28	125,874,699.70
1. 利息收入		9,424,195.67	10,102,361.89
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	443,203.35	962,095.98
债券利息收入		8,980,992.32	9,140,265.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		240,906,836.51	225,338,325.41
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	232,459,443.31	198,778,004.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.1.4.7.13	1,968,079.20	673,599.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.1.4.7.14	-	-
股利收益	6.1.4.7.15	6,479,314.00	25,886,721.45
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	-346,329,396.66	-109,565,987.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	108,999.20	-
减：二、费用		30,929,298.60	35,329,816.10
1. 管理人报酬		18,938,310.48	23,921,672.67
2. 托管费		3,156,385.16	3,986,945.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.1.4.7.18	7,231,690.65	7,184,434.43
5. 利息支出		684,025.10	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.1.4.7.19	918,887.21	236,763.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-126,818,663.88	90,544,883.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-126,818,663.88	90,544,883.60

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月11日

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11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）	3,000,000,000.00	539,723,640.94	3,539,723,640.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-126,818,663.88	-126,818,663.88
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-240,000,000.00	-240,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	172,904,977.06	3,172,904,977.06
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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）	3,000,000,000.00	27,869,355.04	3,027,869,355.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,544,883.60	90,544,883.60
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	118,414,238.64	3,118,414,238.64

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

安顺证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司、上海国际信托投资公司(后更名为上海国际信托有限公司)、山东证券有限责任公司(后更名为天同证券有限责任公司)和浙江证券有限责任公司(后更名为方正证券有限责任公司)四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》(后更名为《安顺证券投资基金基金合同》)发起,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字(1999)15 号文批准,于 1999 年 6 月 15 日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期 15 年,发行规模为 30 亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1999)第 36 号文审核同意,于 1999 年 6 月 22 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字(1999)15 号文的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

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 2014 年 8 月 28 日批准报出。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安顺证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准并经上交所同意,本基金的基金管理人华安基金管理有限公司已将本基金于基金合同失效日转型为华安安顺灵活配置混合型证券投资基金并相应延长

存续期至不定期，因此本基金本年度财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年上半年度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 2014 年 5 月 11 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 11 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.1.4.5 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

（4）基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	2014年5月11日
活期存款	308,658.59
定期存款	-
其他存款	-
合计	308,658.59

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	2014年5月11日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,557,362,436.26	2,500,843,338.85	-56,519,097.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,047,771.18	13,178,810.00
	银行间市场	639,752,217.14	639,836,000.00
	合计	652,799,988.32	653,014,810.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,210,162,424.58	3,153,858,148.85	-56,304,275.73

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无金额。

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	2014年5月11日
应收活期存款利息	68,642.18
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	247,214.77
应收债券利息	20,902,076.68
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,148.88
合计	21,220,082.51

6.1.4.7.6 其他资产

无余额。

6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	2014年5月11日
交易所市场应付交易费用	4,260,252.30
银行间市场应付交易费用	3,017.05
合计	4,263,269.35

6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	2014年5月11日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
预提费用	457,670.21
合计	957,670.21

6.1.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

	2014年5月11日	
	基金份额	帐面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	249,698,520.01	290,025,120.93	539,723,640.94
本期利润	219,510,732.78	-346,329,396.66	-126,818,663.88
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-240,000,000.00	-	-240,000,000.00

本期末	229,209,252.79	-56,304,275.73	172,904,977.06
-----	----------------	----------------	----------------

6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
活期存款利息收入	96,324.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	340,912.81
其他	5,966.06
合计	443,203.35

6.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
卖出股票成交总额	2,438,120,088.73
减：卖出股票成本总额	2,205,660,645.42
买卖股票差价收入	232,459,443.31

6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	661,275,538.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	640,262,342.10
减：应收利息总额	19,045,117.34
债券投资收益	1,968,079.20

6.1.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.1.4.7.15 股利收益

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
股票投资产生的股利收益	6,479,314.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,479,314.00

6.1.4.7.16 公允价值变动收益

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
1. 交易性金融资产	-346,329,396.66
——股票投资	-350,237,969.36
——债券投资	3,908,572.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-346,329,396.66

6. 1. 4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
证券交易监管费退回确认收入	108,999.20
	-
合计	108,999.20

6. 1. 4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
交易所市场交易费用	7,228,140.65
银行间市场交易费用	3,550.00
合计	7,231,690.65

6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日
审计费用	45,000.00
信息披露费	107,670.21
银行汇划费用	2,217.00
上市年费	25,000.00
帐户维护费	9,000.00
其他费用	10,000.00
分红手续费	720,000.00
合计	918,887.21

6. 1. 4. 8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6. 1. 4. 8. 1 或有事项

无。

6. 1. 4. 8. 2 资产负债表日后事项

无。

6. 1. 4. 9 关联方关系

6. 1. 4. 9. 1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期关联方关系未发生变化。

6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金发起人、基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
方正证券有限责任公司（“方正证券”）	基金发起人
上海国际信托有限公司（“上海国际信托”）	基金发起人、基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.10.1.1 股票交易

无。

6.1.4.10.1.2 权证交易

无。

6.1.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.1.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

6.1.4.10.2 关联方报酬

6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,938,310.48	23,921,672.67
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。如持有现金比例高于基金资产净值的20%（由于卖出回购证券和现金分红的原因造成可以除外），超出部分不计提基金管理人报酬。

6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	3,156,385.16	3,986,945.42
----------------	--------------	--------------

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

2014年1月1日-2014年5月11日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	10,012,368.08	-	-	-	-	-

6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	2014年1月1日-2014年5月11日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	24,325,003.00	24,325,003.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	24,325,003.00	24,325,003.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.81%	0.81%

6.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	2014年5月11日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海国际信托有限公司	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

方正证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
------	--------------	-------	--------------	-------

注：以上信息摘自中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的截至 2014 年 05 月 11 日安顺证券投资基金持有人名册。

6.1.4.10.5 由关联方 保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	2014年1月1日-2014年5月11日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	308,658.59	96,324.48	20,748,965.19	62,319.92

6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 5 月 11 日）和上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	利润分配 合计	备注
	2014-04-10	2014-04-11	0.800	240,000,000.00	-	240,000,000.00	-
合计	-	-	0.800	240,000,000.00	-	240,000,000.00	-

6.1.4.12 期末（2014 年 5 月 11 日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 5 月 11 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 96,999,734.50 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代 码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
130227	13 国开 27	2014-5-13	100.01	1,000,000	100,010,000.00
合计				1,000,000	100,010,000.00

6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；根据公司章程，在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向督察长和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2014年6月30日，本基金未持有信用类债券（2013年12月31日：本基金未持有信用类债券）。

6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间

同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2014年5月11日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	308,658.59	0	0	0	308,658.59
结算备付金	100,506,922.72	0	0	0	100,506,922.72
存出保证金	1,023,590.42	0	0	0	1,023,590.42
交易性金融资产	610,241,000.00	38,470,200.00	4,303,610.00	2,500,843,338.85	3,153,858,148.85
应收证券清算款	0	0	0	0	0
应收利息	0	0	0	21,220,082.51	21,220,082.51
资产总计	712,080,171.73	38,470,200.00	4,303,610.00	2,522,063,421.36	3,276,917,403.09
负债					
卖出回购金融资产款	96,999,734.50	-	-	-	96,999,734.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,463,297.43	1,463,297.43
应付托管费	-	-	-	243,882.91	243,882.91
应付交易费用	-	-	-	4,263,269.35	4,263,269.35

应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
应付利息				25,671.63	25,671.63
其他负债	-	-	-	957,670.21	957,670.21
负债总计	96,999,734.50	-	-	7,012,691.53	104,012,426.03
利率敏感度缺口	615,080,437.23	38,470,200.00	4,303,610.00	2,515,050,729.83	3,172,904,977.06
上年度末2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,181,240.53	-	-	-	5,181,240.53
结算备付金	8,869,629.31	-	-	-	8,869,629.31
存出保证金	1,247,988.35	-	-	-	1,247,988.35
交易性金融资产	678,547,692.00	31,706,774.40	6,238,188.00	2,794,000,389.76	3,510,493,044.16
应收证券清算款	-	-	-	22,782,106.76	22,782,106.76
应收利息	-	-	-	16,135,578.45	16,135,578.45
资产总计	693,846,550.19	31,706,774.40	6,238,188.00	2,832,918,074.97	3,564,709,587.56
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,208,732.65	16,208,732.65
应付管理人报酬	-	-	-	4,408,545.28	4,408,545.28
应付托管费	-	-	-	734,757.51	734,757.51
应付交易费用	-	-	-	2,393,011.98	2,393,011.98
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
其他负债	-	-	-	1,181,999.20	1,181,999.20
负债总计	-	-	-	24,985,946.62	24,985,946.62
利率敏感度缺口	693,846,550.19	31,706,774.40	6,238,188.00	2,807,932,128.35	3,539,723,640.94

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2014年5月11日	上年度末 2013年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约 71	增加约 88

市场利率上升25个基点	下降约 71	下降约 87
-------------	--------	--------

6.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 5 月 11 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,500,843,338.85	78.82	2,794,000,389.76	78.93
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	2,500,843,338.85	78.82	2,794,000,389.76	78.93
----	------------------	-------	------------------	-------

6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2014年5月11日	上年度末 2013年12月31日
	“中标300指数×75%+ 中信国债指数×20%+ 金融同业存款利率 ×5%” 上升5%	增加约 15,698 万元	增加约 16,995 万元
“中标300指数×75%+ 中信国债指数×20%+ 金融同业存款利率 ×5%” 下降5%	下降约 15,698 万元	下降约 16,995 万元	

6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

6.2 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日
资产：		
银行存款	6.2.4.7.1	80,488.09
结算备付金		221,974,201.14
存出保证金		1,048,549.72
交易性金融资产	6.2.4.7.2	3,578,831,119.99
其中：股票投资		3,578,831,119.99
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

衍生金融资产	6.2.4. 7.3	-
买入返售金融资产	6.2.4. 7.4	-
应收证券清算款		80,140,435.89
应收利息	6.2.4. 7.5	85,508.63
应收股利		-
应收申购款		42,836.01
递延所得税资产		-
其他资产	6.2.4. 7.6	-
资产总计		3,882,203,139.47
负债和所有者权益		本期末 2014年6月30日
负 债:	附注号	
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.2.4. 7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		27,849,961.33
应付管理人报酬		4,680,002.97
应付托管费		780,000.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.2.4. 7.7	3,797,989.62
应交税费		58,900.00
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.2.4. 7.8	946,803.51
负债合计		38,113,657.90
所有者权益:		
实收基金	6.2.4. 7.9	3,453,086,336.76
未分配利润	6.2.4. 7.10	391,003,144.81
所有者权益合计		3,844,089,481.57
负债和所有者权益总计		3,882,203,139.47

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 3,748,357,091.15 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 5 月 12 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日。

6.2.2 利润表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 5 月 12 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	2014 年 5 月 12 日-2014 年 6 月 30 日
一、收入		201,749,993.43
1. 利息收入		847,051.21
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	595,819.41
债券利息收入		251,231.80
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,721,788.11
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	2,015,865.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-75,991.32
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.2.4.7.14	-
股利收益	6.2.4.7.15	25,781,913.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.16	169,181,545.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.17	3,999,608.23
减：二、费用		11,693,023.18
1. 管理人报酬		7,336,733.13
2. 托管费		1,222,788.83
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.2.4.7.18	3,013,328.24
5. 利息支出		17,114.42
其中：卖出回购金融资产支出		17,114.42
6. 其他费用	6.2.4.7.19	103,058.56
三、利润总额（亏损总额以“-”		190,056,970.25

号填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		190,056,970.25

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年5月12日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30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）	3,000,000,000.00	172,904,977.06	3,172,904,977.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	190,056,970.25	190,056,970.25
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）	453,086,336.76	28,041,197.50	481,127,534.26
其中：1. 基金申购款	1,012,532,050.59	86,405,888.12	1,098,937,938.72
2. 基金赎回款	-559,445,713.83	-58,364,690.62	-617,810,404.46
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）	3,453,086,336.76	391,003,144.81	3,844,089,481.57

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从6.2至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由安顺证券投资基金(以下简称“基金安顺”)转型而成。依据中国证券监督管理委员会2014年4月22日证券基金机构监管部部函[2014]66号《关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》，基金安顺由封闭式基金转为开放式基金。原基金安顺为契约式封闭式基金，存续期限至2013年5月11日止。根据上海证券交易所[2014]184号文同意，自

2014年5月12日起，原基金安顺终止上市，原基金安顺更名为华安安顺灵活配置混合型证券投资基金。《安顺证券投资基金基金合同》失效的同时《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金安顺于基金合同失效前经审计的基金资产净值为3,172,904,977.06元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于原安顺证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定，本基金于2014年6月9日进行了基金份额拆分，拆分比例为1:1.085545777，并于2014年6月10日进行了变更登记。

本基金自2014年5月15日至2014年6月4日期间内开放集中申购，共募集集中申购资金1,081,514,229.95元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息390,635.25元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第308号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2014年6月9日基金份额折算后的基金份额净值1.0000元折合为1,081,514,229.95份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的390,635.25份基金份额，并于2014年6月10日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股)、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)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票等权益类资产占基金资产的比例为0-95%，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%。本基金的业绩比较基准为： $50\% \times \text{中证800指数收益率} + 50\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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2014年8月28日批准报出。

6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日止期间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2014年6月30日的财务状况以及2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日。

6.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.2.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.2.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公

允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.2.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号

《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	80,488.09
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
合计	80,488.09

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,465,953,849.84	3,578,831,119.99	112,877,270.15
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,465,953,849.84	3,578,831,119.99	112,877,270.15

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,790.57
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	83,017.99
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	275.45
其他	424.62
合计	85,508.63

6.2.4.7.6 其他资产

无余额。

6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,792,697.57
银行间市场应付交易费用	5,292.05
合计	3,797,989.62

6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	8,165.80
预提费用	438,637.71
合计	946,803.51

6.2.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	基金份额	帐面金额
基金合同生效日	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
基金份额折算调整	256,618,813.00	-
未领取红利份额折算调整	441,509.00	441,510.22
集中申购募集资金本金及利息	1,081,514,229.95	996,251,363.63
基金拆分和集中申购完成后	4,338,574,551.95	3,996,692,873.85
本期申购	17,191,136.50	15,839,176.75
本期赎回（以“-”号填列）	-607,408,597.30	-559,445,713.84
本期末	3,748,357,091.15	3,453,086,336.76

6.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	229,209,252.79	-56,304,275.73	172,904,977.06

本期利润	20,875,424.37	169,181,545.88	190,056,970.25
本期基金份额交易产生的变动数	35,897,544.42	-7,856,346.92	28,041,197.50
其中：基金申购款	81,520,245.90	4,885,642.22	86,405,888.12
基金赎回款	-45,622,701.48	-12,741,989.14	-58,364,690.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	285,982,221.58	105,020,923.23	391,003,144.81

6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
活期存款利息收入	66,626.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	526,585.33
其他	2,608.06
合计	595,819.41

6.2.4.7.12 股票投资收益

6.2.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
卖出股票成交总额	681,042,583.54
减：卖出股票成本总额	679,026,717.85
买卖股票差价收入	2,015,865.69

6.2.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年5月12日-2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	673,877,305.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	652,799,988.32
减：应收利息总额	21,153,308.48
债券投资收益	-75,991.32

6.2.4.7.14 衍生工具收益

6.2.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,781,913.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,781,913.74

6.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
1. 交易性金融资产	169,181,545.88
——股票投资	169,396,367.56
——债券投资	-214,821.68
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	169,181,545.88

6.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
基金赎回费收入	3,999,608.23
合计	3,999,608.23

6.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
交易所市场交易费用	3,011,053.24
银行间市场交易费用	2,275.00
合计	3,013,328.24

6.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
审计费用	19,872.00
信息披露费	41,095.50
持有人大会费	40,000.00
银行划款手续费	1,091.06
其他费用	1,000.00
合计	103,058.56

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 或有事项

无。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.2.4.9 关联方关系

6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
 本报告期内未发生变化。

6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

无。

6.2.4.10.1.2 权证交易

无。

6.2.4.10.1.3 债券交易

无。

6.2.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,336,733.13
其中：支付销售机构的客户维护费	110,232.66

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2. 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,222,788.83

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2. 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	2014年5月12日-2014年6月30日
基金合同生效日(2014年5月12日)持有的基金份额	24,325,003.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	2,080,901.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	26,405,904.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.70%

6.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	2014年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海国际信托有限公司	4,070,796.00	0.11%

6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方	2014年5月12日-2014年6月30日

名称	期末余额	当期利息收入
交通银行	80,488.09	66,626.02

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于2014年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.2.4.11 利润分配情况

无。

6.2.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002059	云南旅游	2014-06-23	重大事项停牌	8.93	2014-08-14	9.82	1,689,930	14,595,355.49	15,091,074.90	-

6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，并结合对个股、个券的精选策略，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长

期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；根据公司章程，在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向督察长和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市

场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注6.2.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.2.4.13.4.1 利率风险

6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	------	------	-----	----

2014年6月30日					
资产					
银行存款	80,488.09	-	-	-	80,488.09
结算备付金	221,974,201.14	-	-	-	221,974,201.14
存出保证金	1,048,549.72	-	-	-	1,048,549.72
交易性金融资产	-	-	-	3,578,831,119.99	3,578,831,119.99
应收证券清算款	-	-	-	80,140,435.89	80,140,435.89
应收利息	-	-	-	85,508.63	85,508.63
应收申购款	-	-	-	42,836.01	42,836.01
资产总计	223,103,238.95	-	-	3,659,099,900.52	3,882,203,139.47
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	27,849,961.33	27,849,961.33
应付管理人报酬	-	-	-	4,680,002.97	4,680,002.97
应付托管费	-	-	-	780,000.47	780,000.47
应付交易费用	-	-	-	3,797,989.62	3,797,989.62
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	946,803.51	946,803.51
负债总计	-	-	-	38,113,657.90	38,113,657.90
利率敏感度缺口	223,103,238.95	-	-	3,620,986,242.62	3,844,089,481.57

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票等权益类资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,578,831,119.99	93.10
交易性金融资产-债券投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	3,578,831,119.99	93.10

6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）
		本期末

		2014年6月30日
	业绩比较基准上升5%	增加约 44,588 万元
	业绩比较基准下降5%	下降约 44,588 万元

6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 安顺证券投资基金

7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,500,843,338.85	76.32
	其中：股票	2,500,843,338.85	76.32
2	固定收益投资	653,014,810.00	19.93
	其中：债券	653,014,810.00	19.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	100,815,581.31	3.08
6	其他各项资产	22,243,672.93	0.68
7	合计	3,276,917,403.09	100.00

7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	农、林、牧、渔业	-	-
2	采矿业	-	-
3	制造业	1,398,075,062.94	44.06
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	129,179,784.70	4.07

6	批发和零售业	106,533,900.00	3.36
7	交通运输、仓储和邮政业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	信息传输、软件和信息技术服务业	353,654,507.17	11.15
10	金融业	29,903,900.00	0.94
11	房地产业	281,986,387.38	8.89
12	租赁和商务服务业	-	-
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	90,217,514.72	2.84
15	居民服务、修理和其他服务业	-	-
16	教育	-	-
17	卫生和社会工作	-	-
18	文化、体育和娱乐业	111,292,281.94	3.51
19	综合	-	-
20	合计	2,500,843,338.85	78.82

7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300002	神州泰岳	19,090,000	218,771,400.00	6.90
2	002001	新和成	9,699,909	193,222,187.28	6.09
3	600352	浙江龙盛	11,550,000	182,259,000.00	5.74
4	002415	海康威视	8,880,000	169,164,000.00	5.33
5	002450	康得新	7,559,918	156,339,104.24	4.93
6	002285	世联行	9,999,913	140,998,773.30	4.44
7	002250	联化科技	7,290,000	139,457,700.00	4.40
8	002375	亚厦股份	5,999,990	129,179,784.70	4.07
9	300133	华策影视	4,555,558	111,292,281.94	3.51
10	002241	歌尔声学	3,990,000	110,163,900.00	3.47
11	600309	万华化学	6,699,900	106,997,403.00	3.37
12	600153	建发股份	18,990,000	106,533,900.00	3.36
13	002376	新北洋	10,000,000	101,300,000.00	3.19
14	600196	复星医药	5,500,000	100,375,000.00	3.16
15	600048	保利地产	12,699,666	90,167,628.60	2.84
16	600770	综艺股份	8,999,930	88,649,310.50	2.79
17	300070	碧水源	2,319,900	79,317,381.00	2.50
18	002335	科华恒盛	5,280,000	75,187,200.00	2.37
19	000002	万科A	6,999,998	50,819,985.48	1.60

20	002456	欧菲光	2,199,938	50,796,568.42	1.60
21	601166	兴业银行	2,990,000	29,511,300.00	0.93
22	002439	启明星辰	770,000	22,368,500.00	0.71
23	300271	华宇软件	408,288	12,934,563.84	0.41
24	601965	中国汽研	1,000,000	12,490,000.00	0.39
25	002059	云南旅游	1,296,092	10,900,133.72	0.34
26	002410	广联达	339,979	10,801,132.83	0.34
27	601318	中国平安	10,000	392,600.00	0.01
28	300146	汤臣倍健	10,000	323,000.00	0.01
29	600406	国电南瑞	10,000	129,600.00	0.00

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	208,735,820.97	5.90
2	002241	歌尔声学	171,684,040.38	4.85
3	002375	亚厦股份	148,636,479.11	4.20
4	600153	建发股份	142,239,796.62	4.02
5	002450	康得新	140,502,839.31	3.97
6	300133	华策影视	114,725,652.37	3.24
7	600585	海螺水泥	114,116,755.45	3.22
8	002396	星网锐捷	107,857,557.16	3.05
9	002285	世联行	107,233,242.41	3.03
10	300002	神州泰岳	101,706,105.67	2.87
11	600048	保利地产	98,654,809.95	2.79
12	600770	综艺股份	95,629,040.25	2.70
13	600703	三安光电	87,881,110.90	2.48
14	600518	康美药业	86,774,075.61	2.45
15	300070	碧水源	85,956,860.23	2.43
16	000100	TCL 集团	76,653,100.00	2.17
17	000002	万科A	62,111,000.00	1.75
18	002456	欧菲光	47,794,356.36	1.35
19	002439	启明星辰	33,996,735.08	0.96
20	002001	新和成	33,279,122.14	0.94

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	270,015,231.75	7.63
2	600718	东软集团	185,834,995.69	5.25
3	600703	三安光电	137,040,450.10	3.87
4	002022	科华生物	135,913,189.24	3.84
5	300146	汤臣倍健	128,040,805.30	3.62
6	300032	金龙机电	107,944,331.19	3.05
7	002376	新北洋	102,882,249.38	2.91
8	002396	星网锐捷	94,310,552.28	2.66
9	600196	复星医药	91,656,812.47	2.59
10	600086	东方金钰	86,657,238.80	2.45
11	002255	海陆重工	84,791,359.56	2.40
12	300332	天壕节能	84,387,689.38	2.38
13	002310	东方园林	84,315,796.82	2.38
14	002241	歌尔声学	82,698,244.34	2.34
15	600518	康美药业	80,126,043.74	2.26
16	000100	TCL 集团	78,015,916.67	2.20
17	601318	中国平安	75,646,984.80	2.14
18	600352	浙江龙盛	71,445,059.28	2.02
19	300335	迪森股份	55,610,977.91	1.57
20	002422	科伦药业	48,966,600.60	1.38

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,262,741,563.87
卖出股票的收入（成交）总额	2,438,120,088.73

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	13,178,810.00	0.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	639,836,000.00	20.17
	其中：政策性金融债	639,836,000.00	20.17
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	653,014,810.00	20.58

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	NF0706	07 农发 06	2,100,000	210,063,000.00	6.62
2	GK1327	13 国开 27	1,200,000	120,012,000.00	3.78
3	GK1336	13 国开 36	1,100,000	110,110,000.00	3.47
4	NF0708	07 农发 08	900,000	89,982,000.00	2.84
5	GK0716	07 国开 16	500,000	50,050,000.00	1.58

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.9 投资组合报告附注

7.1.9.1 报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.1.9.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.1.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,023,590.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,220,082.51

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,243,672.93

7.1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.2 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,578,831,119.99	92.19
	其中：股票	3,578,831,119.99	92.19
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	222,054,689.23	5.72
6	其他各项资产	81,317,330.25	2.09
7	合计	3,882,203,139.47	100.00

7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,680,091,050.75	43.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	642,500.00	0.02
E	建筑业	225,598,172.64	5.87

F	批发和零售业	98,100,000.00	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	484,167,403.68	12.60
J	金融业	411,078,848.95	10.69
K	房地产业	334,917,660.97	8.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	152,536,824.90	3.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	191,698,658.10	4.99
S	综合	-	-
	合计	3,578,831,119.99	93.10

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300002	神州泰岳	19,990,000	314,842,500.00	8.19
2	601318	中国平安	6,880,000	270,659,200.00	7.04
3	002415	海康威视	15,699,998	265,957,966.12	6.92
4	002241	歌尔声学	9,500,000	253,270,000.00	6.59
5	002450	康得新	10,099,918	229,773,134.50	5.98
6	002375	亚厦股份	9,999,919	225,598,172.64	5.87
7	600352	浙江龙盛	12,999,900	209,948,385.00	5.46
8	002001	新和成	16,666,690	206,500,289.10	5.37
9	300133	华策影视	5,999,958	191,698,658.10	4.99
10	002285	世联行	23,238,497	186,140,360.97	4.84
11	600770	综艺股份	18,199,968	168,531,703.68	4.38
12	000002	万科A	17,990,000	148,777,300.00	3.87
13	002250	联化科技	9,990,000	141,858,000.00	3.69
14	600196	复星医药	6,990,000	141,128,100.00	3.67
15	601166	兴业银行	13,999,965	140,419,648.95	3.65
16	300070	碧水源	4,699,000	137,445,750.00	3.58
17	002376	新北洋	10,000,000	110,000,000.00	2.86
18	600153	建发股份	18,000,000	98,100,000.00	2.55
19	002456	欧菲光	2,000,000	42,860,000.00	1.11

20	600183	生益科技	6,699,995	41,271,969.20	1.07
21	601965	中国汽研	2,585,709	31,985,220.33	0.83
22	002059	云南旅游	1,689,930	15,091,074.90	0.39
23	002444	巨星科技	329,967	3,134,686.50	0.08
24	600309	万华化学	80,000	1,212,800.00	0.03
25	300145	南方泵业	50,000	944,000.00	0.02
26	002410	广联达	30,000	793,200.00	0.02
27	600323	瀚蓝环境	50,000	642,500.00	0.02
28	300146	汤臣倍健	10,000	246,500.00	0.01

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	278,715,839.56	7.25%
2	002241	歌尔声学	192,404,182.55	5.01%
3	002415	海康威视	116,909,454.57	3.04%
4	601166	兴业银行	108,902,332.41	2.83%
5	000002	万科A	90,318,246.18	2.35%
6	600770	综艺股份	90,264,015.21	2.35%
7	002375	亚厦股份	86,568,047.65	2.25%
8	002450	康得新	55,427,307.63	1.44%
9	300070	碧水源	54,810,281.26	1.43%
10	600585	海螺水泥	52,534,404.02	1.37%
11	600028	中国石化	50,769,534.78	1.32%
12	600406	国电南瑞	47,494,662.43	1.24%
13	002285	世联行	42,932,525.08	1.12%
14	300133	华策影视	40,965,828.81	1.07%
15	600352	浙江龙盛	38,543,574.01	1.00%
16	600183	生益科技	36,649,582.51	0.95%
17	002001	新和成	31,194,270.20	0.81%
18	600196	复星医药	29,398,927.63	0.76%
19	002456	欧菲光	26,637,957.96	0.69%
20	601965	中国汽研	26,604,637.72	0.69%

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	121,486,862.68	3.16%
2	600309	万华化学	104,411,800.87	2.72%
3	002335	科华恒盛	76,566,285.38	1.99%
4	600028	中国石化	52,133,770.40	1.36%
5	600585	海螺水泥	51,967,024.79	1.35%
6	600406	国电南瑞	49,098,647.05	1.28%
7	002241	歌尔声学	39,793,679.26	1.04%
8	002410	广联达	35,605,240.76	0.93%
9	002439	启明星辰	33,666,186.75	0.88%
10	002456	欧菲光	30,475,028.13	0.79%
11	600352	浙江龙盛	17,444,852.90	0.45%
12	600153	建发股份	17,251,075.03	0.45%
13	300271	华宇软件	13,589,411.06	0.35%
14	002250	联化科技	12,256,094.13	0.32%
15	601965	中国汽研	8,473,709.43	0.22%
16	002450	康得新	4,470,116.77	0.12%
17	002001	新和成	3,962,293.07	0.10%
18	601318	中国平安	3,957,924.46	0.10%
19	300070	碧水源	2,962,929.56	0.08%
20	002285	世联行	1,401,156.02	0.04%

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,587,618,131.43
卖出股票的收入（成交）总额	681,042,583.54

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期没有投资股指期货。

7.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.3 投资组合报告附注

7.3.1 报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.3.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.3.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,048,549.72
2	应收证券清算款	80,140,435.89
3	应收股利	-
4	应收利息	85,508.63
5	应收申购款	42,836.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,317,330.25

7.3.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.3.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
41,861	89,542.94	2,173,750,029.57	57.99%	1,574,607,061.58	42.01%

8.1.2 安顺证券投资基金

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
37,513	79,972.28	1,871,048,602.00	62.37%	1,128,951,398.00	37.63%

8.2 期末上市基金前十名持有人

8.2.1 安顺证券投资基金（2014年5月11日）

序号	持有人名称	持有份额	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	323,353,020.00	10.78%
2	中国人寿保险股份有限公司	296,035,154.00	9.87%
3	新华人寿保险股份有限公司	102,557,370.00	3.42%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	93,110,028.00	3.10%
5	申银万国证券股份有限公司	85,822,537.00	2.86%
6	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	71,769,904.00	2.39%
7	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	69,532,543.00	2.32%
8	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	64,000,000.00	2.13%
9	幸福人寿保险股份有限公司—分红	62,078,250.00	2.07%
10	中国太平洋保险(集团)股份有限公司—集团本级—自有资金—012G—ZY001 沪	53,526,009.00	1.78%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.3.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,087,681.02	0.03%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 5 月 12 日）基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期基金总申购份额	1,099,146,875.45
减：本报告期基金总赎回份额	607,408,597.30
本报告期基金拆分变动份额	256,618,813.00
本报告期期末基金份额总额	3,748,357,091.15

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2014 年 3 月 12 日至 2014 年 4 月 7 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于安顺证券投资基金转型有关事项的议案》，经证券基金机构监管部部函[2014]66 号《关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》备案，本基金基金份额持有人大会决议生效，安顺证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金并更名为华安安顺灵活配置混合型证券投资基金。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内无基金管理人重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼事项。报告期内无涉及本基金财产的诉讼事项。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	745,518,968.40	32.86%	678,721.86	32.86%	
东方证券股份有限公司	2	655,598,494.39	28.90%	596,858.25	28.90%	
中国国际金融有限公司	1	314,740,336.18	13.87%	286,538.91	13.87%	
北京高华证券有限责任公司	1	301,237,868.84	13.28%	274,247.29	13.28%	
中信建投证券有限责任公司	2	240,285,365.46	10.59%	218,756.21	10.59%	
海通证券股份有限公司	1	11,279,681.70	0.50%	10,269.10	0.50%	
申银万国证券股份	2					

有限公司						
招商证券股份有限公司	1					
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1、基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调调整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

11.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	9,885,200.00	75.05%	-	-	-	
中信建投证券有限	-	-	-	-	-	

责任公司						
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3,285,427.00	24.95%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.7.2 安顺证券投资基金

10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	998,591,665.63	21.34%	909,119.69	21.34%	-
中国国际金融有限公司	1	884,833,057.78	18.91%	805,553.84	18.91%	-
海通证券股份有限公司	1	780,306,995.03	16.67%	710,394.29	16.67%	-

东方证券股份有限公司	2	773,967,269.57	16.54%	704,620.49	16.54%	-
中信建投证券有限责任公司	2	609,555,301.07	13.03%	554,939.77	13.03%	-
申银万国证券股份有限公司	2	516,163,096.07	11.03%	469,916.00	11.03%	-
招商证券股份有限公司	1	116,111,702.45	2.48%	105,708.22	2.48%	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1、基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易
------	------	------	------

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
东方证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证 券有 限责 任公 司	11,329,805.00	51.72%	-	-	-	-
中信证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
申银万 国证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
北京高 华证 券有 限责 任公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金 融有 限公 司	10,575,591.30	48.28%	-	-	-	-
海通证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-02-12

2	关于以通讯方式召开安顺证券投资基金基金份额持有人大会公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-02-28
3	关于以通讯方式召开安顺证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-03-03
4	关于以通讯方式召开安顺证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-03-04
5	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-03-13
6	关于安顺证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-04-04
7	关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-04-09
8	关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-04-26
9	关于安顺证券投资基金复牌的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-04-28
10	关于安顺证券投资基金终止上市的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-05-07
11	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-05-12
12	关于华安安顺灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-05-15

13	关于华安安顺灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-05-19
14	关于华安安顺灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-05-21
15	关于电子直销平台“微钱宝”账户转换交易费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-10
16	关于原安顺证券投资基金基金份额拆分结果的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-11
17	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-11
18	关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-12
19	关于华安安顺混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-12
20	关于华安安顺灵活配置混合基金参加交通银行定投及网银申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-13
21	关于新增华安安顺灵活配置混合基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-13
22	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-13

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》

和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》
- 2、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安顺灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、《安顺证券投资基金基金合同》
- 6、《安顺证券投资基金招募说明书》
- 7、《安顺证券投资基金托管协议》
- 8、中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件；
- 9、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 10、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 11、基金托管人业务资格批件和营业执照；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一四年八月二十九日