

# 华安安享灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 年半年度报告

### 2015 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 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。

本报告期自 2015 年 1 月 23 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	5
3	主要财务指标和基金净值表现 .....	5
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2	基金净值表现 .....	6
4	管理人报告 .....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1	资产负债表 .....	16
6.2	利润表 .....	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4	报表附注 .....	19
7	投资组合报告 .....	39
7.1	期末基金资产组合情况 .....	39
7.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
7.3	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 .....	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	43
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	44
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	44
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	44
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	44
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12	投资组合报告附注 .....	45

8	基金份额持有人信息 .....	46
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
9	开放式基金份额变动 .....	46
10	重大事件揭示 .....	47
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4	基金投资策略的改变 .....	47
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况 .....	47
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 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8	其他重大事件 .....	53
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
12	备查文件目录 .....	56
12.1	备查文件目录 .....	56
12.2	存放地点 .....	57
12.3	查阅方式 .....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安安享灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安安享混合
基金主代码	000708
交易代码	000708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月23日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,065,272,294.92份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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。
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、固定收益类工具之间灵活配置，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。
业绩比较基准	$60\% \times \text{中证800指数收益率} + 40\% \times \text{中国债券总指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	蒋松云

	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		朱学华	姜建清

## 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
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	254,736,118.64
本期利润	284,214,247.73
加权平均基金份额本期利润	0.0575
本期加权平均净值利润率	5.54%
本期基金份额净值增长率	5.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	273,488,732.34
期末可供分配基金份额利润	0.0272
期末基金资产净值	10,622,896,069.01
期末基金份额净值	1.055
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	5.50%

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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
过去一个月	0.86%	0.06%	-5.84%	2.10%	6.70%	-2.04%
过去三个月	3.23%	0.08%	9.42%	1.58%	-6.19%	-1.50%
自基金成立起至今	5.50%	0.15%	20.05%	1.30%	-14.55%	-1.15%

注：本基金业绩比较基准： $60\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 40\% \times \text{中国债券总指数收益率}$

根据本基金合同的有关规定：本基金的投资范围为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）、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）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

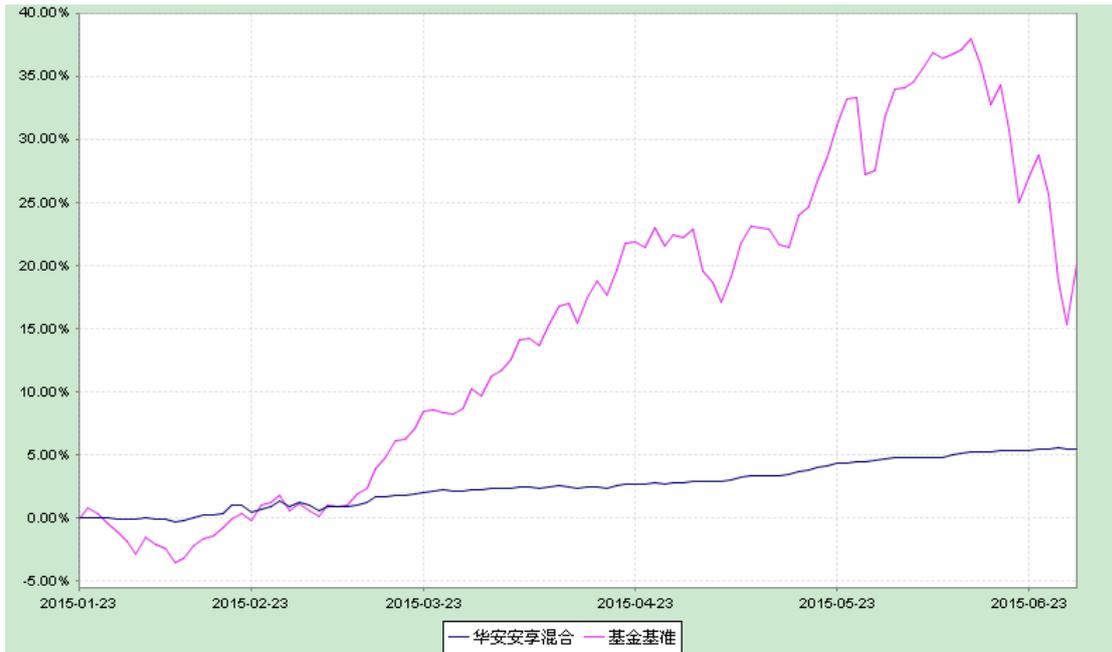
本基金的股票资产投资比例为股票占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华安安享灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 1 月 23 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2015 年 1 月 23 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。本报告截止日，本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

## 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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、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、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等 67 只开放式基金。管理资产规模达到 1214.76 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏玉平	本基金的基金经理	2015-01-23	-	18 年	货币银行硕士，18 年证券、基金行业从业经历。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理；交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理；中德安联保险有限公司投资部部门经理；国联安基金管理有限公司基金经理。2011 年 2 月加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月起担任华安强化收益债券型证券投资基金的基金经理；

					2011 年 12 月起同时担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理；2013 年 2 月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 1 月起担任本基金的基金经理。
施卫平	本基金的基金经理	2015-01-23	2015-06-26	20 年	金融硕士研究生，20 年证券、基金行业从业经验，具有证券从业资格。曾任浙江金达期货经纪有限公司研究员、浙江中大集团投资经理、东方证券股份有限公司研究员、国联安基金管理有限公司基金经理。2014 年 1 月加入华安基金管理有限公司。2014 年 4 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金及华安生态优先股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 1 月起担任本基金的基金经理。2015 年 4 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月离开华安基

					金。
--	--	--	--	--	----

## 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《华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《华安安享灵活配置混合型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、邮件发送、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，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、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，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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### **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数量极少，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**

在政策红利和流动性推动下，上半年沪指累计涨幅 32.33%，一月开始创业板进入脉冲式上涨模式，涨幅远超前于主板。主板虽然一直弱于创业板，在 4 月年报密集期，蓝筹股业绩支撑沪指涨幅达到 18.51%。近期市场的剧烈调整不仅仅是对去杠杆等因素的共振，也存在着对前期大幅上涨的自然修复和对基本面偏离度的合理回归。股市下半场将是优质股取胜。

本基金一直维持对市场乐观判断，但同时我们观察到部分个股和行业也开始呈现泡沫化的迹象。基金操作上，减持了明显高估的互联网、环保等新兴行业的配置季末的行业配置较为均衡。积极参与一级市场股票申购。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.055 元，本报告期份额净值增长率为 5.50%，同期业绩比较基准增长率为 20.05%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

进下半年，国内经济增速依然处于下降通道中，但不改股市向上趋势。可以预见的是：互联网正在深层次的改造社会、国企改革正在激发企业活力，这都使得各行各业几乎从资源消耗型的模式进入追求生产效率的时代，在此过程中，那些能有效应用管理、技术、金融三股力量来提高行业效率的优秀公司将有很大的发展潜力。因此，在告别了齐涨共跌的市场表现后，依靠专业能力的自下而上选股将带来理想的超额收益，我们对后市保持乐观。

#### **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验的描述

### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，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，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历，15 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，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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、华安现金富利货币、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接基金、华安中证高分红指数增强型、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级的基金经理,指数投资部高级总监。

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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 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**

本报告期不进行收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

### **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**

本报告期内，本基金托管人在对华安安享灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，华安安享灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安安享灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安安享灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安安享灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安安享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	5,520,380,061.34
结算备付金		996,756.48
存出保证金		113,093.51
交易性金融资产	6.4.7.2	852,832,468.16
其中：股票投资		87,582,070.16
基金投资		-
债券投资		765,250,398.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	4,134,406,809.60
应收证券清算款		23,752,354.70
应收利息	6.4.7.4	14,501,613.67
应收股利		-
应收申购款		100,889,936.52
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		10,647,873,093.98
负债和所有者权益	附注号	本期末

<b>2015 年 6 月 30 日</b>		
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		9,171,947.72
应付管理人报酬		12,850,266.26
应付托管费		2,141,711.04
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.5	620,517.11
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	192,582.84
负债合计		24,977,024.97
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.7	10,065,272,294.92
未分配利润	6.4.7.8	557,623,774.09
所有者权益合计		10,622,896,069.01
负债和所有者权益总计		10,647,873,093.98

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.055 元，基金份额总额 10,065,272,294.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>323,962,341.72</b>
1.利息收入		30,422,180.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,706,839.56
债券利息收入		4,898,204.55
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		17,817,136.09
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		261,263,287.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	263,931,775.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-3,115,830.28
资产支持证券投资		-
收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		447,342.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	29,478,129.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	2,798,745.31
<b>减：二、费用</b>		<b>39,748,093.99</b>
1. 管理人报酬		32,537,894.65
2. 托管费		5,422,982.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.15	1,144,820.18
5. 利息支出		464,968.07
其中：卖出回购金融资产支出		464,968.07
6. 其他费用	6.4.7.16	177,428.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>284,214,247.73</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>284,214,247.73</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 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)	640,650,321.58	-	640,650,321.58
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	284,214,247.73	284,214,247.73
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)	9,424,621,973.34	273,409,526.36	9,698,031,499.70
其中：1.基金申购款	10,198,542,013.20	298,980,602.79	10,497,522,615.99
2.基金赎回款	-773,920,039.86	-25,571,076.43	-799,491,116.29
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)	10,065,272,294.92	557,623,774.09	10,622,896,069.01

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安安享灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]606号《关于核准华安安享灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自2014年12月29日至2015年1月20日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571\_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年1月23日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币640,452,497.60元，在募集期间产生的存款利息为人民币197,823.98元，以上实收基金(本息)合计为人民币640,650,321.58元，折合640,650,321.58份基金份额。本基金的基金管理

人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为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）、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）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；每个交易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。 本基金业绩比较基准： $60\% \times$  中证 800 指数收益率 +  $40\% \times$  中国债券总指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）起至 2015 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资

成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

### (4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转

### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价

值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

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。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。有充足证据表明最近市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对最近市场交易价格进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合

约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的

条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本会计期间不存在会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本会计期间不存在差错更正。

#### **6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	5,520,380,061.34
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,520,380,061.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	57,851,039.00	87,582,070.16	29,731,031.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	535,551,387.50	535,128,398.00
	银行间市场	229,951,912.57	230,122,000.00
	合计	765,503,300.07	765,250,398.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	823,354,339.07	852,832,468.16	29,478,129.09

##### 6.4.7.3 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间	4,134,406,809.60	-
合计	4,134,406,809.60	-

##### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末

	2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	819,776.05
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	403.74
应收债券利息	11,573,495.94
应收买入返售证券利息	2,094,038.89
应收申购款利息	13,853.24
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	45.81
合计	14,501,613.67

#### 6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	588,634.11
银行间市场应付交易费用	31,883.00
合计	620,517.11

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21,066.36
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	171,516.48
银行手续费	-
合计	192,582.84

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	640,650,321.58	640,650,321.58
本期申购	10,198,542,013.20	10,198,542,013.20
本期赎回（以“-”号填列）	-773,920,039.86	-773,920,039.86
本期末	10,065,272,294.92	10,065,272,294.92

**6.4.7.8 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	-	-	-
本期利润	254,736,118.64	29,478,129.09	284,214,247.73
本期基金份额交易产生的变动数	18,752,613.70	254,656,912.66	273,409,526.36
其中：基金申购款	21,384,276.04	277,596,326.75	298,980,602.79
基金赎回款	-2,631,662.34	-22,939,414.09	-25,571,076.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	273,488,732.34	284,135,041.75	557,623,774.09

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,154,916.77
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	252,279.50
其他	299,643.29
合计	7,706,839.56

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	484,292,774.18
减：卖出股票成本总额	220,360,999.10
买卖股票差价收入	263,931,775.08

单位：人民币元

**6.4.7.11 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日） 至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,919,458.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,979,970.23

减：应收利息总额	55,318.18
债券投资收益	-3,115,830.28

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	447,342.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	447,342.32

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1.交易性金融资产	29,478,129.09
——股票投资	29,731,031.16
——债券投资	-252,902.07
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	29,478,129.09

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	2,791,245.31
其他收入_其他	7,500.00
合计	2,798,745.31

#### 6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,144,420.18
银行间市场交易费用	400.00
合计	1,144,820.18

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
审计费用	32,448.72
信息披露费	139,067.76
银行汇划费用	5,512.18
其他费用	400.00
合计	177,428.66

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

**6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,537,894.65
其中：支付销售机构的客户维护费	3,455,465.66

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的 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，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×1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,422,982.43

注：支付基金托管人中国工商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 ×0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金合同生效日（2015年1月23日）持有的基金份额	17,020,425.53
期间申购/买入总份额	16,608,304.50
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	33,628,730.03

期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.33%
-------------------	-------

#### 6.4.10.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2015年1月23日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,520,380,061.34	7,154,916.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	新股未上市	7.28	7.28	7,263	52,874.64	52,874.64	-
300487	蓝晓科技	2015-06-24	2015-07-02	新股未上市	14.83	14.83	10,700	158,681.00	158,681.00	-
300488	恒锋工具	2015-06-25	2015-07-01	新股未上市	20.11	20.11	6,734	135,420.74	135,420.74	-
300489	中飞股份	2015-06-24	2015-07-01	新股未上市	17.56	17.56	7,319	128,521.64	128,521.64	-
603838	四通股份	2015-06-23	2015-07-01	新股未上市	7.73	7.73	18,119	140,059.87	140,059.87	-

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15天集EB	2015-06-11	2015-07-02	新债未流通上市	100	100	11,210	1,121,000.00	1,121,000.00	-

#### 6.4.12.2 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
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项停牌	20.75	-	-	300,000	4,810,954.00	6,225,000.00	-
002276	万马股份	2015-06-30	重大事项停牌	34.15	2015-07-20	30.74	40,000	482,380.40	1,366,000.00	-
002739	万达院线	2015-05-14	重大资产重组	221.86	2015-07-03	219.68	20,000	1,977,000.00	4,437,200.00	-
300467	迅游科技	2015-06-25	重大事项停牌	297.30	2015-07-02	267.57	3,726	125,752.50	1,107,739.80	-
603885	吉祥航空	2015-06-29	非公开发行股票	68.96	2015-07-15	62.06	20,000	223,600.00	1,379,200.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金，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管理委员会，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；在管理层层面设立风险控制委员会，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。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。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。

#### 6.4.13.2 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。

本公司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中国工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日
A-1	230,122,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	230,122,000.00

注：未评级债券为国债和央行票据。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	21,265,000.00
未评级	513,020,600.00
合计	534,285,600.00

注：未评级债券为国债和央行票据。

#### 6.4.13.3 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主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	5,520,380,061.34	-	-	-	5,520,380,061.34
结算备付金	996,756.48	-	-	-	996,756.48
存出保证金	113,093.51	-	-	-	113,093.51
交易性金融资产	764,129,398.00	1,121,000.00	-	87,582,070.16	852,832,468.16
应收证券清算款	-	-	-	23,752,354.70	23,752,354.70
买入返售金融资产	4,134,406,809.60	-	-	-	4,134,406,809.60
应收利息	-	-	-	14,501,613.67	14,501,613.67
应收申购款	100,144,588.58	-	-	745,347.94	100,889,936.52
<b>资产总计</b>	<b>10,520,170,707.51</b>	<b>1,121,000.00</b>	<b>-</b>	<b>126,581,386.47</b>	<b>10,647,873,093.98</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	9,171,947.72	9,171,947.72
应付管理人报酬	-	-	-	12,850,266.26	12,850,266.26
应付托管费	-	-	-	2,141,711.04	2,141,711.04
应付交易费用	-	-	-	620,517.11	620,517.11
其他负债	-	-	-	192,582.84	192,582.84
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>24,977,024.97</b>	<b>24,977,024.97</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>10,520,170,707.51</b>	<b>1,121,000.00</b>	<b>-</b>	<b>101,604,361.50</b>	<b>10,622,896,069.01</b>

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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）
		本期末 2015 年 6 月 30 日
	市场利率下降25个基点	增加约69.00万元
	市场利率上升25个基点	减少约69.00万元

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015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	87,582,070.16	0.82
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	87,582,070.16	0.82

##### 6.4.13.4.3.2 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 2015年6月30日
	业绩比较基准上升5%	增加约2,451.00万元
	业绩比较基准下降5%	减少约2,451.00万元

#### 6.4.14 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 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	87,582,070.16	0.82
	其中：股票	87,582,070.16	0.82
2	固定收益投资	765,250,398.00	7.19
	其中：债券	765,250,398.00	7.19
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	4,134,406,809.60	38.83
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,521,376,817.82	51.85
7	其他各项资产	139,256,998.40	1.31
8	合计	10,647,873,093.98	100.00

## 7.2 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	484,279.65	0.00
B	采矿业	1,635,059.25	0.02
C	制造业	44,037,332.35	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,515,786.92	0.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,604,547.22	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,260.04	0.01
J	金融业	8,643,700.00	0.08
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,040,031.22	0.10
M	科学研究和技术服务业	823,611.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,901,261.83	0.03
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	10,662,200.00	0.10
S	综合	-	-

	合计	87,582,070.16	0.82
--	----	---------------	------

### 7.3 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

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	600580	卧龙电气	600,000	10,698,000.00	0.10
2	600196	复星医药	270,000	7,813,800.00	0.07
3	300145	南方泵业	170,000	7,471,500.00	0.07
4	000793	华闻传媒	300,000	6,225,000.00	0.06
5	002739	万达院线	20,000	4,437,200.00	0.04
6	601888	中国国旅	60,500	4,011,150.00	0.04
7	600502	安徽水利	200,000	3,998,000.00	0.04
8	002707	众信旅游	40,000	3,769,600.00	0.04
9	002444	巨星科技	200,000	3,696,000.00	0.03
10	601628	中国人寿	110,000	3,445,200.00	0.03
11	600315	上海家化	70,000	3,038,000.00	0.03
12	600436	片仔癀	37,500	2,500,125.00	0.02
13	601601	中国太保	70,000	2,112,600.00	0.02
14	603199	九华旅游	40,000	1,888,400.00	0.02
15	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.02
16	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.02
17	600415	小商品城	100,000	1,528,000.00	0.01
18	000712	锦龙股份	40,000	1,404,000.00	0.01
19	603885	吉祥航空	20,000	1,379,200.00	0.01
20	002276	万马股份	40,000	1,366,000.00	0.01
21	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.01
22	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.01
23	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.01
24	603568	伟明环保	27,501	1,012,861.83	0.01
25	601166	兴业银行	50,000	862,500.00	0.01
26	002776	柏堡龙	20,296	823,611.68	0.01
27	601318	中国平安	10,000	819,400.00	0.01
28	603022	新通联	15,492	709,533.60	0.01
29	002400	省广股份	22,557	569,789.82	0.01
30	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.00
31	603300	华铁科技	20,000	487,800.00	0.00
32	002772	众兴菌业	21,381	484,279.65	0.00
33	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.00
34	002770	科迪乳业	40,555	399,872.30	0.00

35	002768	国恩股份	14,405	362,429.80	0.00
36	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.00
37	603117	万林股份	34,690	325,739.10	0.00
38	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.00
39	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00
40	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
41	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
42	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.00
43	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	0.00
44	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
45	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.00
46	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
47	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
48	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.00
49	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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

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	601985	中国核电	32,649,100.17	0.31
2	600016	民生银行	24,217,760.01	0.23
3	600023	浙能电力	20,948,411.66	0.20
4	601628	中国人寿	13,266,817.00	0.12
5	600580	卧龙电气	12,818,460.00	0.12
6	600415	小商品城	11,439,490.00	0.11
7	601231	环旭电子	10,729,647.33	0.10
8	002405	四维图新	9,253,007.85	0.09
9	600196	复星医药	9,207,468.20	0.09
10	000712	锦龙股份	8,783,452.62	0.08
11	600958	东方证券	6,806,699.96	0.06
12	002444	巨星科技	6,546,113.15	0.06
13	300024	机器人	6,430,732.00	0.06
14	300145	南方泵业	5,714,900.70	0.05
15	600030	中信证券	5,589,994.00	0.05
16	601601	中国太保	4,945,475.00	0.05
17	000793	华闻传媒	4,810,954.00	0.05
18	300295	三六五网	4,211,926.00	0.04
19	600502	安徽水利	4,143,600.00	0.04

20	002712	思美传媒	4,040,053.91	0.04
----	--------	------	--------------	------

#### 7.4.2 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	601985	中国核电	134,038,175.85	1.26
2	600023	浙能电力	29,433,567.12	0.28
3	600959	江苏有线	28,572,592.67	0.27
4	600016	民生银行	23,691,973.12	0.22
5	600415	小商品城	21,292,766.14	0.20
6	002405	四维图新	13,475,619.00	0.13
7	601231	环旭电子	12,113,201.54	0.11
8	600580	卧龙电气	11,981,170.91	0.11
9	300024	机器人	9,312,292.76	0.09
10	600958	东方证券	9,228,904.00	0.09
11	601628	中国人寿	8,397,515.66	0.08
12	000712	锦龙股份	7,431,275.00	0.07
13	300271	华宇软件	7,098,160.80	0.07
14	002444	巨星科技	6,834,877.60	0.06
15	603567	珍宝岛	5,900,237.50	0.06
16	600030	中信证券	5,602,037.00	0.05
17	300295	三六五网	5,448,006.00	0.05
18	300463	迈克生物	5,416,669.10	0.05
19	603883	老百姓	5,405,415.20	0.05
20	300431	暴风科技	5,385,482.00	0.05

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	278,212,038.10
卖出股票的收入（成交）总额	484,292,774.18

#### 7.5 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	381,859,000.00	3.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,161,600.00	1.23
	其中：政策性金融债	131,161,600.00	1.23
4	企业债券	21,265,000.00	0.20

5	企业短期融资券	230,122,000.00	2.17
6	中期票据	-	-
7	可转债	842,798.00	0.01
8	其他	-	-
9	合计	765,250,398.00	7.20

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	018001	国开 1301	1,280,000	131,161,600.00	1.23
2	019509	15 国债 09	1,300,000	131,092,000.00	1.23
3	019028	10 国债 28	1,000,000	100,110,000.00	0.94
4	071507002	15 中信建投 CP002	1,000,000	100,080,000.00	0.94
5	071504006	15 广发 CP006	1,000,000	100,030,000.00	0.94

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期没有投资贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性

好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末没有投资国债期货。

### 7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	113,093.51
2	应收证券清算款	23,752,354.70
3	应收股利	-
4	应收利息	14,501,613.67
5	应收申购款	100,889,936.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,256,998.40

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分	占基金资	流通受限情况说明
----	------	------	--------	------	----------

			的公允价值	产净值比 例(%)	
1	000793	华闻传媒	6,225,000.00	0.06	重大事项停牌
2	002739	万达院线	4,437,200.00	0.04	重大资产重组

## 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

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
5,691	1,768,629.82	9,488,004,381.08	94.26%	577,267,913.84	5.74%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	743,981.60	0.007%

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有该只基金份额的数量区间为 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（2015 年 1 月 23 日）基金份额总额	640,650,321.58
本报告期基金总申购份额	10,198,542,013.20
减：本报告期基金总赎回份额	773,920,039.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,065,272,294.92

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2015 年 3 月 7 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2015 年 6 月 27 日，基金管理人发布了华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，施卫平先生不再担任本基金的基金经理。

(3) 2015 年 6 月 30 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(4) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：  
无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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

金额单位：人民币元

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	
招商证券股份有限公司	1	208,647,313.93	31.98%	184,632.14	31.37%	-
国信证券股份有限公司	1	206,236,856.39	31.61%	187,758.18	31.90%	-
中国银河证券股份有限公司	1	138,197,562.13	21.18%	125,813.11	21.37%	-
国金证券股份有限公司	2	60,499,928.53	9.27%	55,079.01	9.36%	-
上海证券有限责任公司	1	33,412,424.93	5.12%	30,418.82	5.17%	-
信达证券股份有限公司	1	5,418,378.98	0.83%	4,932.85	0.84%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司						
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
开源证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任	1	-	-	-	-	-

公司						
国都证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中国国 际金融有 限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
川财证 券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
上海华 信证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-
广发证 券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
中国民 族证券有 限责任公 司	2	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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 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
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	435,754,357.40	74.41%	35,628,800,000.00	91.72%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	2,161,000,000.00	5.56%	-	-
上海证券有限责任公司	149,862,500.00	25.59%	1,057,400,000.00	2.72%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司							
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-
华融证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-
开源证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-

有限责任公司						
中银国际 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融有限 公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
川财证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
上海华信 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国民族 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下华安安享混合基金增加中国银行为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-05

2	关于旗下华安安享混合基金增加国泰君安证券为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-07
3	关于华安安享灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-14
4	关于旗下华安安享混合基金增加中国建设银行为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-15
5	华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-01-24
6	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-07
7	关于华安安享灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和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	2015-03-11
8	关于基金电子交易平台延长工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	2015-03-12
9	关于旗下部分基金增加长江证券为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-12
10	关于旗下部分开放式基金调整单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-13
11	关于旗下部分基金增加好买基金销售为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-17
12	关于旗下部分基金增加中国国际金融有限公司为代销机构并参加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	2015-03-17

13	关于旗下部分基金增加太平洋证券为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-18
14	关于华安安享灵活配置混合基金新增上海农商行为代销机构并参加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	2015-03-19
15	关于华安安享灵活配置混合型证券投资基金增加天天基金为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-23
16	关于华安旗下部分基金参加好买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	2015-03-25
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-03-31
18	华安基金管理有限公司关于华安安享灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及定期定额投资公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-04-04
19	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-04-08
20	关于华安旗下部分基金新增数米基金为代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-04-29
21	关于华安旗下部分基金增加天天基金为销售机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-28
22	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、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	2015-06-02
23	关于旗下部分基金增加汇付天下为销售机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-02

24	关于旗下部分基金在官方京东店开展认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	2015-06-10
25	关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-10
26	关于基金电子交易平台延长工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	2015-06-12
27	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“招商地产”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-12
28	华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-27
29	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-29
30	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-06-30

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](http://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、《华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安享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享灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、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；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 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  
二〇一五年八月二十八日