

华安新活力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：招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。

基金托管人招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 1 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	5
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	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	16
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	19
6.4	报表附注	20
7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12	投资组合报告附注	43
8	基金份额持有人信息	44

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
9	开放式基金份额变动	45
10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	46
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	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
11	备查文件目录	51
11.1	备查文件目录	51
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安新活力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安新活力混合
基金主代码	000590
交易代码	000590
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月1日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,258,508,890.24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。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。
业绩比较基准	$50\% \times \text{中证800指数收益率} + 50\% \times \text{中国债券总指数收益率}$
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	张燕
	联系电话	021-38969999	95555
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	李建红

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 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	410,158,894.10

本期利润	336,387,216.75
加权平均基金份额本期利润	0.0869
本期加权平均净值利润率	7.27%
本期基金份额净值增长率	8.95%
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	791,703,852.64
期末可供分配基金份额利润	0.1859
期末基金资产净值	5,238,867,005.79
期末基金份额净值	1.230
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.00%

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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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 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	-0.32%	0.17%	-4.05%	1.75%	3.73%	-1.58%
过去三个月	3.54%	0.19%	8.05%	1.32%	-4.51%	-1.13%
过去六个月	8.95%	0.28%	18.26%	1.10%	-9.31%	-0.82%
过去一年	22.39%	0.33%	50.06%	0.88%	-27.67%	-0.55%
自基金成立起至今	23.00%	0.30%	53.04%	0.82%	-30.04%	-0.52%

注：本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中国债券总指数收益率}$

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。

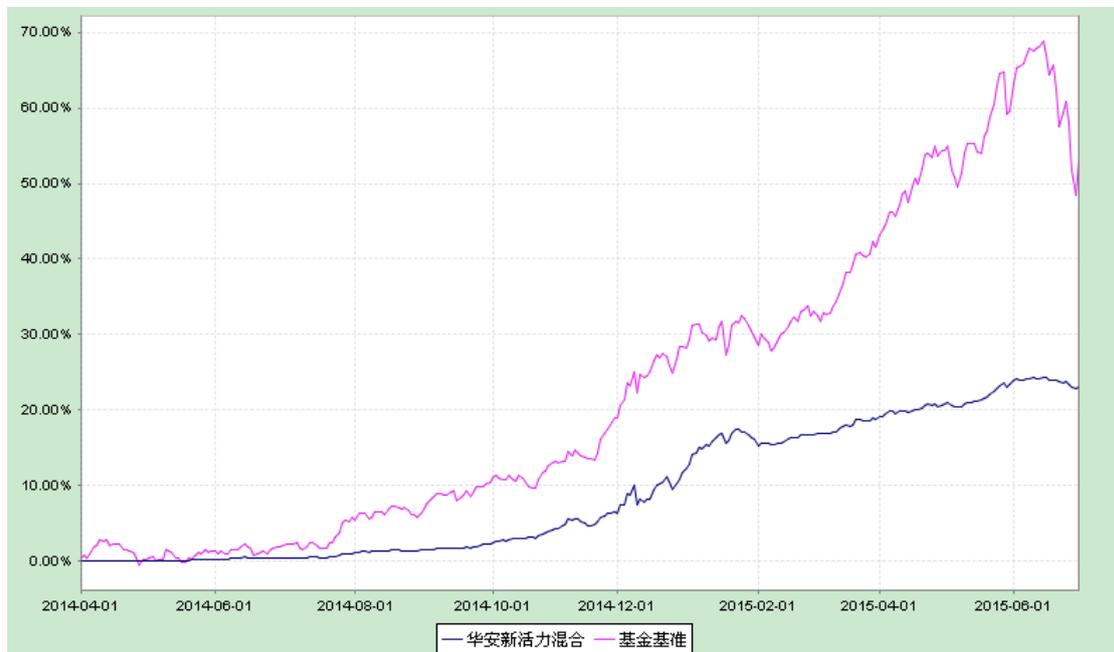
基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

3.2.2 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

华安新活力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

(2014 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：根据《华安新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人应当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。

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		
陆从珍	本基金的基金经理	2014-04-01	2015-06-18	15 年	经济学硕士，15 年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商

					局职员；京华山一证券上海公司高级研究员；中企东方资产管理公司高级研究员；东方证券研究部资深研究员等职。2008 年 3 月加入华安基金管理公司，任研究发展部高级研究员，2009 年 5 月 16 日起至 2010 年 4 月 21 日担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 4 月起担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。2012 年 8 月起同时担任华安逆向策略股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起，同时担任本基金的基金经理。2015 年 6 月离开华安基金。
苏玉平	本基金的基金经理	2014-04-01	-	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月起同时担任本基金的基金经理。2015年1月起担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《华安新活力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 1.230 元，本报告期份额净值增长率为 8.95%，同期业绩比较基准增长率为 18.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2015 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。目前时点上，股市去杠杆化的过程使得风险偏好不断下降，且流动性最好的时期已经过去，指数单边上升的概率降低，机会更多来自于结构性行情。创新和改革仍是本轮行情的基础，由于中国经济转型期的特点，中长期 A 股中更大的机会在于新兴成长股，包括服务互联网、先进制造、后市场服务等，但是个股选择中需要在估值安全边际和成长空间中进行平衡，且在风险偏好下降的背景下，对于公司的商业模式、竞争壁垒、治理结构和企业家精神的考量要胜过公司所处“赛道”。目前市场逐步归于常态，后市维持震荡看法，同时国企改革尤其是央企改革是主题配置方向。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：华安新活力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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,183,756,606.69	38,737,329.24
结算备付金		3,558,579.33	6,577,723.27
存出保证金		441,936.79	104,531.50
交易性金融资产	6.4.7.2	1,306,091,267.39	1,468,691,270.85
其中：股票投资		33,262,794.99	91,928,235.44
基金投资		-	-
债券投资		1,272,828,472.40	1,376,763,035.41
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,891,884,100.22	600,602,540.90
应收证券清算款		19,451,266.45	7,422,753.95

应收利息	6.4.7.5	21,106,931.48	19,181,862.50
应收股利		-	-
应收申购款		103,709,293.74	15,221,642.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	33,300.00	33,300.00
资产总计		5,530,033,282.09	2,156,572,954.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		96,100,000.00	20,799,998.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		186,273,892.04	4,360,993.08
应付管理人报酬		6,353,997.86	1,553,631.05
应付托管费		1,058,999.63	258,938.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	595,303.02	141,701.23
应交税费		-	-
应付利息		98,926.24	28,363.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	685,157.51	372,465.35
负债合计		291,166,276.30	27,516,090.90
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,258,508,890.24	1,884,974,260.73
未分配利润	6.4.7.10	980,358,115.55	244,082,602.87
所有者权益合计		5,238,867,005.79	2,129,056,863.60
负债和所有者权益总计		5,530,033,282.09	2,156,572,954.50

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.230 元，基金份额总额 4,258,508,890.24 份。

6.2 利润表

会计主体：华安新活力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 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1日至	上年度可比期间 2014年4月1日(基
-----	-----	------------------	------------------------

		2015 年 6 月 30 日	金合同生效日) 至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		387,272,530.81	12,630,775.09
1.利息收入		64,242,773.88	9,652,267.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,814,560.01	444,649.94
债券利息收入		31,565,422.57	3,643,259.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,862,791.30	5,564,357.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		389,474,618.50	585,152.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	314,430,988.74	198,329.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	73,791,885.99	51,527.67
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,251,743.77	335,294.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-73,771,677.35	2,056,824.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,326,815.78	336,531.62
减：二、费用		50,885,314.06	5,720,618.26
1. 管理人报酬		34,370,552.07	4,652,565.38
2. 托管费		5,728,425.38	775,427.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,360,434.70	166,819.66
5. 利息支出		8,161,665.46	-
其中：卖出回购金融资产支出		8,161,665.46	-
6. 其他费用	6.4.7.19	264,236.45	125,805.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		336,387,216.75	6,910,156.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		336,387,216.75	6,910,156.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新活力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	1,884,974,260.73	244,082,602.87	2,129,056,863.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	336,387,216.75	336,387,216.75
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）	2,373,534,629.51	399,888,295.93	2,773,422,925.44
其中：1.基金申购款	4,506,184,029.50	822,248,512.50	5,328,432,542.00
2.基金赎回款	-2,132,649,399.99	-422,360,216.57	-2,555,009,616.56
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）	4,258,508,890.24	980,358,115.55	5,238,867,005.79
项目	上年度可比期间 2014 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 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）	994,576,439.77	-	994,576,439.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,910,156.83	6,910,156.83
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）	817,482,788.68	2,234,151.46	819,716,940.14
其中：1.基金申购款	905,277,389.42	2,506,206.33	907,783,595.75
2.基金赎回款	-87,794,600.74	-272,054.87	-88,066,655.61
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)	1,812,059,228.45	9,144,308.29	1,821,203,536.74

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

华安新活力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证监许可【2014】291 号《关于核准华安新活力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2014 年 3 月 26 日到 2014 年 3 月 27 日止期间向社会公开发行募集，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（2014）验字第 60971571_B05 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 2014 年 4 月 1 日正式生效，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 994,479,848.41 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 96,591.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 994,576,439.77 元，折合 994,576,439.77 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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。

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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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 日的财务状况以及自 2015 年 1 月 1 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

除下述会计估计变更的说明以外，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。

6.4.5 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资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；

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	2,183,756,606.69
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,183,756,606.69

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	24,175,939.29	33,262,794.99	9,086,855.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	349,937,674.40	356,232,472.40	6,294,798.00
	银行间市场	913,758,659.18	916,596,000.00	2,837,340.82
	合计	1,263,696,333.58	1,272,828,472.40	9,132,138.82
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,287,872,272.87	1,306,091,267.39	18,218,994.52	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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
银行间市场	1,891,884,100.22	-
合计	1,891,884,100.22	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	413,082.00
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	1,601.30
应收债券利息	19,494,800.11
应收买入返售证券利息	1,185,439.40
应收申购款利息	11,809.77
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	198.90
合计	21,106,931.48

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
其他应收款	33,300.00
待摊费用	-
合计	33,300.00

6.4.7.7 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	563,667.71
银行间市场应付交易费用	31,635.31
合计	595,303.02

6.4.7.8 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	401,760.82
预提费用	283,396.69
合计	685,157.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,884,974,260.73	1,884,974,260.73
本期申购	4,506,184,029.50	4,506,184,029.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,132,649,399.99	-2,132,649,399.99
本期末	4,258,508,890.24	4,258,508,890.24

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	133,532,717.06	110,549,885.81	244,082,602.87
本期利润	410,158,894.10	-73,771,677.35	336,387,216.75
本期基金份额交易产生的变动数	248,012,241.48	151,876,054.45	399,888,295.93
其中：基金申购款	536,458,540.42	285,789,972.08	822,248,512.50
基金赎回款	-288,446,298.94	-133,913,917.63	-422,360,216.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	791,703,852.64	188,654,262.91	980,358,115.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,937,432.65
定期存款利息收入	2,521,277.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	234,301.37
其他	121,548.21
合计	6,814,560.01

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,079,731,157.68

减：卖出股票成本总额	765,300,168.94
买卖股票差价收入	314,430,988.74

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1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	2,495,182,512.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,391,632,758.86
减：应收利息总额	29,757,868.05
债券投资收益	73,791,885.99

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,251,743.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,251,743.77

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-73,771,677.35
——股票投资	-18,470,716.64
——债券投资	-55,300,960.71
——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	-73,771,677.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	7,326,815.78
合计	7,326,815.78

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	2,346,059.70
银行间市场交易费用	14,375.00
合计	2,360,434.70

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	52,639.76
账户维护费	18,000.00
其他费用	200.00
合计	264,236.45

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

本报告期内未发生变化。

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海电气集团财务有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司

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 权证交易

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1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年4月1日（基金合同生效 日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	34,370,552.07	4,652,565.38
其中：支付销售机构的客户维护费	6,945,911.01	1,080,013.27

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年4月1日（基金合同生效 日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,728,425.38	775,427.58

注：支付基金托管人招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 X 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

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015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
招商银行	30,037,920.00	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年4月1日（基金合同生效日）至2014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
招商银行	-	-	-	-	-	-

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

本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

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

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
上海电气集团 财务有限责任 公司	19,979,020.98	0.47%	19,979,020.98	1.06%

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年4月1日（基金合同生效日） 至2014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
招商银行股 份有限公司	2,183,756,606.69	3,937,432.65	22,269,966.70	301,943.88

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本报告期不进行收益分配。

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	-

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
002438	江苏神通	2015-05-25	重大资产重组	32.56	未知	未知	200,000	3,594,600.91	6,512,000.00	-
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	-

注：本基金截止至 2015 年 6 月 30 日止有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额 96,100,000.00 元, 于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

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, 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; 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。

6.4.13.2 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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资

格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些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。

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	上年末 2014 年 12 月 31 日
A-1	370,731,000.00	210,272,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	321,707,000.00	569,370,648.00
合计	692,438,000.00	779,642,648.00

6.4.13.2.2 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	上年末 2014 年 12 月 31 日
AAA	150,639,684.80	262,302,856.40
AAA 以下	69,889,977.10	248,208,232.71
未评级	359,860,810.50	86,609,298.30
合计	580,390,472.40	597,120,387.41

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

6.4.13.3 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发行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。

6.4.13.4 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

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。

6.4.13.4.1.1 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
资产					
银行存款	2,183,756,606.69	-	-	-	2,183,756,606.69
结算备付金	3,558,579.33	-	-	-	3,558,579.33
存出保证金	441,936.79	-	-	-	441,936.79
交易性金融资产	980,264,401.90	133,248,660.00	159,315,410.50	33,262,794.99	1,306,091,267.39
买入返售金融资产	1,891,884,100.22	-	-	-	1,891,884,100.22
应收证券清算款	-	-	-	19,451,266.45	19,451,266.45
应收利息	-	-	-	21,106,931.48	21,106,931.48
应收申购款	100,042,087.48	-	-	3,667,206.26	103,709,293.74
其他资产	-	-	-	33,300.00	33,300.00
资产总计	5,159,947,712.41	133,248,660.00	159,315,410.50	77,521,499.18	5,530,033,282.09
负债					
卖出回购金融资产款	96,100,000.00	-	-	-	96,100,000.00
应付赎回款	-	-	-	186,273,892.04	186,273,892.04

应付管理人报酬	-	-	-	6,353,997.86	6,353,997.86
应付托管费	-	-	-	1,058,999.63	1,058,999.63
应付交易费用	-	-	-	595,303.02	595,303.02
应付利息	-	-	-	98,926.24	98,926.24
其他负债	-	-	-	685,157.51	685,157.51
负债总计	96,100,000.00	-	-	195,066,276.30	291,166,276.30
利率敏感度缺口	5,063,847,712.41	133,248,660.00	159,315,410.50	-117,544,777.12	5,238,867,005.79
上年度末 2014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	38,737,329.24	-	-	-	38,737,329.24
结算备付金	6,577,723.27	-	-	-	6,577,723.27
存出保证金	104,531.50	-	-	-	104,531.50
交易性金融资产	1,137,370,359.81	113,021,788.10	126,370,887.50	91,928,235.44	1,468,691,270.85
买入返售金融资产	600,602,540.90	-	-	-	600,602,540.90
应收证券清算款	-	-	-	7,422,753.95	7,422,753.95
应收利息	-	-	-	19,181,862.50	19,181,862.50
应收申购款	4,000.00	-	-	15,217,642.29	15,221,642.29
其他资产	-	-	-	33,300.00	33,300.00
资产总计	1,783,396,484.72	113,021,788.10	126,370,887.50	133,783,794.18	2,156,572,954.50
负债					
卖出回购金融资产款	20,799,998.00	-	-	-	20,799,998.00
应付赎回款	-	-	-	4,360,993.08	4,360,993.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,553,631.05	1,553,631.05
应付托管费	-	-	-	258,938.52	258,938.52
应付交易费用	-	-	-	141,701.23	141,701.23
应付利息	-	-	-	28,363.67	28,363.67
其他负债	-	-	-	372,465.35	372,465.35
负债总计	20,799,998.00	-	-	6,716,092.90	27,516,090.90
利率敏感度缺口	1,762,596,486.72	113,021,788.10	126,370,887.50	127,067,701.28	2,129,056,863.60

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	市场利率上升25个基点	减少约359	减少约311.04
	市场利率下降25个基点	增加约364	增加约315.81

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。

6.4.13.4.3.1 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		上年度末 2014 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	33,262,794.99	0.63	91,928,235.44	4.32
交易性金融资产-债券投资	1,272,828,472.40	24.30	1,376,763,035.41	64.67
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	1,306,091,267.39	24.93	1,468,691,270.85	68.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动。			
	2.除上述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：人民币万元）		
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
		业绩比较基准减少5%	减少约4,377	减少约3,855.34
		业绩比较基准增加5%	增加约4,377	增加约3,855.34

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

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	33,262,794.99	0.60
	其中：股票	33,262,794.99	0.60
2	固定收益投资	1,272,828,472.40	23.02
	其中：债券	1,272,828,472.40	23.02
	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	1,891,884,100.22	34.21
	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	2,187,315,186.02	39.55
7	其他各项资产	144,742,728.46	2.62
8	合计	5,530,033,282.09	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,973,648.77	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,391,900.00	0.05
E	建筑业	517,786.92	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	3,605,620.68	0.07

	务业		
J	金融业	6,110,800.00	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,437,691.40	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,262,794.99	0.63

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	002438	江苏神通	200,000	6,512,000.00	0.12
2	002450	康得新	90,000	2,754,000.00	0.05
3	600509	天富能源	170,000	2,391,900.00	0.05
4	600000	浦发银行	130,000	2,204,800.00	0.04
5	000001	平安银行	150,000	2,181,000.00	0.04
6	600406	国电南瑞	100,000	2,069,000.00	0.04
7	600196	复星医药	70,000	2,025,800.00	0.04
8	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.03
9	601166	兴业银行	100,000	1,725,000.00	0.03
10	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.02
11	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.02
12	300467	迅游科技	3,726	1,107,739.80	0.02
13	600415	小商品城	50,000	764,000.00	0.01
14	002775	文科园林	19,306	517,786.92	0.01
15	300479	神思电子	9,600	434,688.00	0.01
16	002773	康弘药业	17,338	411,430.74	0.01
17	002770	科迪乳业	40,555	399,872.30	0.01
18	002768	国恩股份	14,405	362,429.80	0.01
19	002769	普路通	7,710	347,952.30	0.01
20	603117	万林股份	34,690	325,739.10	0.01
21	002152	广电运通	10,000	323,400.00	0.01
22	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.01
23	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.00

24	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00
25	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
26	600580	卧龙电气	10,000	178,300.00	0.00
27	300487	蓝晓科技	10,700	158,681.00	0.00
28	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.00
29	300481	濮阳惠成	11,296	148,542.40	0.00
30	603838	四通股份	18,119	140,059.87	0.00
31	300488	恒锋工具	6,734	135,420.74	0.00
32	300489	中飞股份	7,319	128,521.64	0.00
33	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
34	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.00
35	300480	光力科技	7,263	52,874.64	0.00
36	300478	杭州高新	22	1,087.02	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600067	冠城大通	90,655,366.64	4.26
2	603993	洛阳钼业	79,585,407.64	3.74
3	601318	中国平安	74,018,626.44	3.48
4	600875	东方电气	57,214,640.00	2.69
5	601988	中国银行	54,301,892.78	2.55
6	600023	浙能电力	54,149,108.78	2.54
7	600219	南山铝业	33,046,320.69	1.55
8	601166	兴业银行	30,424,193.99	1.43
9	002391	长青股份	29,677,290.15	1.39
10	600958	东方证券	28,132,374.69	1.32
11	600028	中国石化	20,533,331.28	0.96
12	600109	国金证券	17,095,665.00	0.80
13	600837	海通证券	15,343,426.89	0.72
14	000001	平安银行	13,598,570.80	0.64
15	601601	中国太保	11,759,934.45	0.55
16	601688	华泰证券	11,183,684.00	0.53
17	601198	东兴证券	11,138,094.00	0.52
18	600406	国电南瑞	9,042,284.00	0.42
19	601628	中国人寿	8,745,092.59	0.41
20	002405	四维图新	6,677,746.96	0.31

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。

7.4.2 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	600067	冠城大通	97,778,136.07	4.59
2	002736	国信证券	93,055,846.55	4.37
3	600958	东方证券	87,359,681.75	4.10
4	601318	中国平安	75,699,089.45	3.56
5	600023	浙能电力	73,819,524.86	3.47
6	603993	洛阳钼业	68,647,587.38	3.22
7	600875	东方电气	53,568,453.69	2.52
8	601988	中国银行	51,261,229.80	2.41
9	601166	兴业银行	41,873,293.65	1.97
10	600219	南山铝业	35,942,468.16	1.69
11	002391	长青股份	29,187,192.19	1.37
12	600959	江苏有线	28,613,176.14	1.34
13	601198	东兴证券	26,799,625.85	1.26
14	600028	中国石化	20,371,664.63	0.96
15	600109	国金证券	19,277,612.00	0.91
16	600837	海通证券	16,888,408.36	0.79
17	000001	平安银行	14,474,848.15	0.68
18	600580	卧龙电气	12,036,286.67	0.57
19	601601	中国太保	11,429,465.00	0.54
20	601688	华泰证券	11,362,535.00	0.53

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。

7.4.3 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	725,105,445.13
卖出股票的收入（成交）总额	1,079,731,157.68

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。

7.5 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	176,517,810.50	3.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	183,343,000.00	3.50
	其中：政策性金融债	183,343,000.00	3.50
4	企业债券	205,400,660.00	3.92
5	企业短期融资券	692,438,000.00	13.22
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,129,001.90	0.29
8	其他	-	-
9	合计	1,272,828,472.40	24.30

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	140223	14 国开 23	1,100,000	110,440,000.00	2.11
2	011586001	15 光明 SCP001	1,000,000	100,450,000.00	1.92
3	071504006	15 广发 CP006	1,000,000	100,030,000.00	1.91
4	071501006	15 招商 CP006	1,000,000	99,960,000.00	1.91
5	019501	15 国债 01	600,000	60,462,000.00	1.15

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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的，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	441,936.79
2	应收证券清算款	19,451,266.45
3	应收股利	-
4	应收利息	21,106,931.48
5	应收申购款	103,709,293.74
6	其他应收款	33,300.00

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,742,728.46

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110030	格力转债	8,747,678.90	0.17
2	128009	歌尔转债	6,192,420.00	0.12

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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002438	江苏神通	6,512,000.00	0.12	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
12,009	354,609.78	3,102,055,976.34	72.84%	1,156,452,913.90	27.16%

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	1,630,118.54	0.04%

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 50 万份至 100 万份（含）。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 4 月 1 日）基金份额总额	994,576,439.77
本报告期期初基金份额总额	1,884,974,260.73
本报告期基金总申购份额	4,506,184,029.50
减：本报告期基金总赎回份额	2,132,649,399.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,258,508,890.24

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。

(1) 2015 年 6 月 19 日，基金管理人发布了华安新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，陆从珍女士不再担任本基金的基金经理

(2) 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。

(3) 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	
中信证券股份有限公司	2	1,244,578,909.69	100.00%	1,126,121.47	100.00%	-

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
中信证券股份有限公司	966,895,865.67	100.00%	33,223,154,000.00	100.00%	-	-

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	华安基金管理有限公司关于调整华安新活力灵活配置混合型证券投资基金大额申购大额转换转入及大额定期定额投资上限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-14
2	华安基金管理有限公司关于调整华安新活力灵活配置混合型证券投资基金大额申购大额转换转入及大额定期定额投资上限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-16
3	华安基金管理有限公司关于调整华安新活力灵活配置混合型证券投资基金大额申购大额转换转入投资上限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-01-20
4	关于华安旗下新活力灵活配置混合型证券投资基金参加中信建投证券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	2015-02-17
5	关于旗下部分基金增加北京增财基金销售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	2015-03-06
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
8	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
9	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
10	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

11	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
12	关于华安新活力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	2015-03-20
13	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
14	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
15	关于调整华安新活力灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资上限的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-04-04
16	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
17	关于华安新活力灵活配置混合基金参加上海天天基金销售有限公司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	2015-04-09
18	华安新活力灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资上限的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2015-05-26
19	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
20	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司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	2015-05-29
21	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行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	2015-05-29

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	华安新活力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	2015-06-19
28	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2015-06-26
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 上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安新活力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安新活力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安新活力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可转换债券债券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；

11.2 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>。

11.3 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