华安安信消费服务股票型证券投资基金（原安信证券投资基金转型）2013 年半年度报告

2013 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：二〇一三年八月二十四日

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 2013 年 8 月 20 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。

原安信证券投资基金本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 5 月 22 日止，华安安信消费服务股票型证券投资基金本报告期自 2013 年 5 月 23 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 6
2.4 信息披露方式 6
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 7
3.1 华安安信消费服务股票型证券投资基金 7
3.1.2 基金净值表现 7
3.2 安信证券投资基金 9
3.2.1 主要会计数据和财务指标 9
3.2.2 基金净值表现 9
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
6 年度财务报表 17
6.1 安信证券投资基金 17
6.1.1 资产负债表 17
6.1.2 利润表 18
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
6.1.4 报表附注 20
6.2 华安安信消费服务股票型证券投资基金 32
6.2.1 资产负债表 32
6.2.2 利润表 34
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表 35
6.2.4 报表附注 35
7 投资组合报告 51
7.1 安信证券投资基金 51

7.1.1 期末基金资产组合情况 51
7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合 52
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 52
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
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 55
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 55
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 55
7.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 55
7.1.10 投资组合报告附注 56
7.2 华安安信消费服务股票型证券投资基金 56
7.2.1 期末基金资产组合情况 56
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合 57
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 57
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 60
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 60
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 60
7.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 60
7.3 投资组合报告附注 60
8 基金份额持有人信息 61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
8.2 期末上市基金前十名持有人 62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
9 开放式基金份额变动 62
10 重大事件揭示 62
11 备查文件目录 68

2 基金简介

2.1 基金基本情况

华安安信消费服务股票型证券投资基金	
基金名称	华安安信消费服务股票型证券投资基金
基金简称	华安安信消费股票
基金主代码	519002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 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	2,946,180,618.29
基金合同存续期	不定期
安信证券投资基金	
基金名称	安信证券投资基金
基金简称	华安安信封闭
基金主代码	500003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998 年 6 月 22 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	2,000,000,000
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	1998-06-26

2.2 基金产品说明

华安安信消费服务股票型证券投资基金	
投资目标	本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会、实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对消费服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要

	高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
安信证券投资基金	
投资目标	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险，确保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金为成长型基金，本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于国债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 45-80%，现金比例根据运作情况调整。在股票资产中，70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，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 增长率的上市公司股票。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@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		李勍	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 层、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 华安安信消费服务股票型证券投资基金

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（2013 年 5 月 23 日-2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	25,369,605.88
本期利润	-844,675.53
加权平均基金份额本期利润	-0.0004
本期加权平均净值利润率	-0.04%
本期基金份额净值增长率	-0.85%
3.1.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	-145,560,276.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0494
期末基金资产净值	2,997,596,886.81
期末基金份额净值	1.017
3.1.1.3 累计期末指标	**报告期末(2013 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	-0.85%

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.原安信证券投资基金于 2013 年 5 月 23 日转型为安信消费股票型证券投资基金，截止本报告期末，安信消费股票型证券投资基金成立未满一年。

5.本基金已于 2013 年 6 月 24 日对原安信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 1:1.016880461。

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	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去 1 个月	-1.97%	0.75%	-11.36%	1.70%	9.39%	-0.95%
自基金合同生效起至今	-0.85%	0.69%	-10.49%	1.52%	9.64%	-0.83%

注：本基金业绩比较基准：中证消费服务领先指数收益率。

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 A 股股票等权益类证券（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等）、债券（包括中小企业私募债券等）、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定。

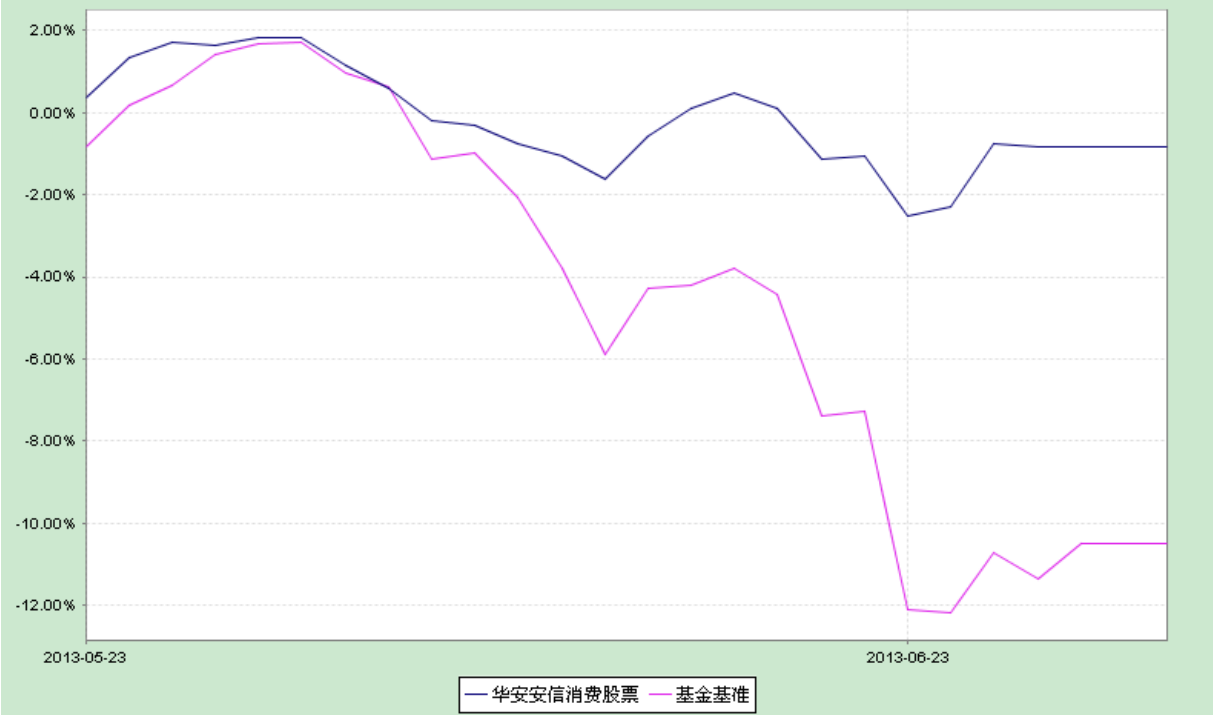
本基金各类资产的投资比例范围为：本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%－40%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

华安安信消费服务股票型证券投资基金

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

（2013 年 5 月 23 日至 2013 年 6 月 30 日）



注：1.本基金转型日期为 2013 年 5 月 23 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《华安安信消费股票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。

3.2 安信证券投资基金

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	报告期（2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 日）
本期已实现收益	119,275,964.17
本期利润	178,510,571.38
加权平均基金份额本期利润	0.0893
本期加权平均净值利润率	8.84%
本期基金份额净值增长率	9.36%
3.2.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013 年 5 月 22 日)**
期末可供分配利润	-125,416,606.82
期末可供分配基金份额利润	-0.0627
期末基金资产净值	2,085,987,601.95
期末基金份额净值	1.0430
3.2.1.3 累计期末指标	**报告期末(2013 年 5 月 22 日)**
基金份额累计净值增长率	771.71%

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	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
2013.4.1-2013.5.22	1.62%	1.19%	-	-	-	-
2013.1.1-2013.5.22	9.36%	1.35%	-	-	-	-
2012.7.1-2013.5.22	13.73%	1.82%	-	-	-	-
2010.7.1-2013.5.22	5.21%	2.10%	-	-	-	-
1998.6.22-2013.5.22	771.71%	2.54%	-	-	-	-

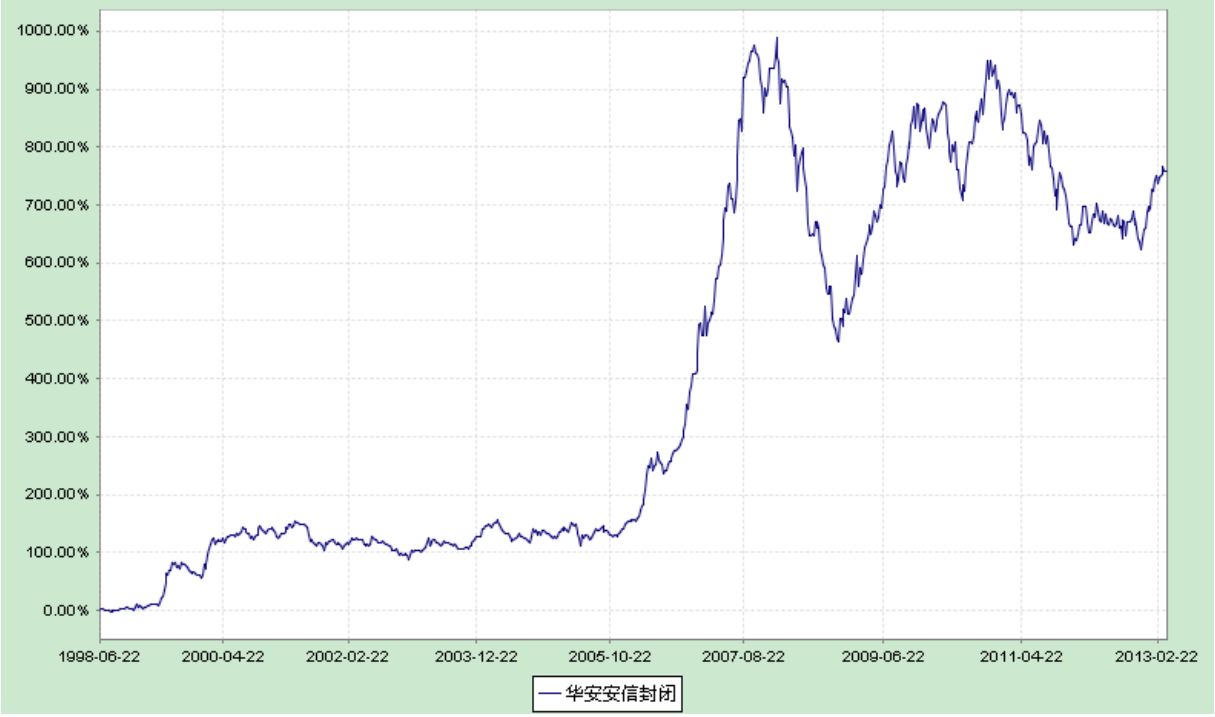
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

安信证券投资基金

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

（1998 年 6 月 22 日至 2013 年 5 月 22 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 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 只封闭式证券投资基金，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、华安双月鑫短期理财债券、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、华安安信消费等 38 只开放式基金。管理资产规模达到 782.67 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		
陈俏宇	本基金的基金经理、投资研究部副总监	2008-02-13	-	17	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，17 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理，2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理，2008 年 2 月起担任本基金的基金经理，2008 年 10 月起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 4 月起同时担任华安升级主题股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起兼任投资研究部副总监。

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《安信证券投资基金基金合同》、《安信证券投资基金招募说明书》、《华安安信消费股票型证券投资基金基金合同》、《华安安信消费股票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、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；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 2 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

我们借用《双城记》中的名言“这是最好的时代，这是最坏的时代；这是信仰的时期，这是怀疑的时期”来描述上半年的 A 股市场。传统蓝筹板块在年初有短暂表现后，投资者开始意识到中国经济将进入弱复苏和窄周期的阶段，市场随即进入以成长为主要配置方向的积极防御阶段。尽管期间部分经济数据仍低于预期，但市场并未如原先那样博弈基于流动性预期放松的周期板块，而是仍旧坚守在如传媒、电子、医药、大众消费品和环保等行业内，这种选择既是对过往经济发展模式的反思，也是基于对转型经济的向往与信心。

本基金在报告期内的主要工作是进行封闭式基金的转型，因此在期初即对强周期性行业和流动性相对较差的品种进行了减仓操作。由于市场整体对成长性板块和品种的认同度超出我们此前的判断，我们调整了操作计划，在有限的仓位中积极进行品种调整，具有稳定增长特质的医药公司成为主要投资的板块，同时我们也保留了具有较大行业空间、同时管理团队优秀的公司的投资比例，而这些重点投资的品种也符合转型后的新基金合同要求的投资方向。在基金持有人的支持下，我们在期末顺利完成了基金的转型工

作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.017 元，2013 年 5 月 23 日至 2013 年 6 月 30 日基金份额净值增长率为 -0.85%，同期业绩比较基准增长率为-10.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管我们无法预估宏观经济的短期数据，但是现实经济生活中越来越多的信号已经告诉我们既有的增长模式受到前所未有的挑战。虽然结构调整与经济增长有关联也有矛盾，但经济转型的大方向将不以任何人的意志而转移，同时我们发现观念的力量正在加速改变这个世界。面对转型经济，有很多未知的领域需要我们去发现去理解，对研究和投资都是新课题。对投资主题和趋势的把握，我们将从“美国映射”、更和谐的生活环境，更多与泛消费相关的行业等方面去寻找其中的优秀公司。

作为转型后的新基金，本基金下一阶段的操作将在基金规模相对稳定后，继续积极在消费服务相关的子行业或公司进行品种选择。伴随这一类公司的持续上涨，我们需要等待市场的调整机会，但更为重要的是需要能进一步辩识企业竞争力的持续性，寻找出其中真正能穿越周期的成长股，亦即我们要更严格地挑选公司，而非刻舟求剑地以静态估值寻求所谓的安全感。行业发展前景和竞争格局、企业家精神和执行力、核心竞争力的壁垒、客户黏性等因素都将是我们关注的重点。

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,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，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

翁启森，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。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，负责 QDII 基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金（QDII）、华安大中华升级基金(QDII)的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，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，现任华安优选基金经理、投资研究部总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券、华安 7 日鑫短期理财的基金经理、固定收益部总监。

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，华安中国 A 股增强指数。现任华安上证 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。

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信消费股票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，华安安信消费股票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信消费股票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，华安安信消费股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

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信消费股票型证券投

资基金 2013 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 年度财务报表

6.1 安信证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：安信证券投资基金

报告截止日：2013 年 5 月 22 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 5 月 22 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.1.4.7.1	263,055,434.59	45,307,365.65
结算备付金		7,385,022.84	2,541,194.41
存出保证金		395,926.95	750,000.00
交易性金融资产	6.1.4.7.2	1,231,538,899.14	1,723,620,266.29
其中：股票投资		764,573,264.14	1,341,504,802.49
基金投资		-	-
债券投资		466,965,635.00	382,115,463.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	470,000,000.00	140,000,000.00
应收证券清算款		110,087,048.80	7,074,602.26
应收利息	6.1.4.7.5	9,817,668.50	7,616,510.53
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		2,092,280,000.82	1,926,909,939.14
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2013 年 5 月 22 日**	**上年度末 2012 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		-	-
应付证券清算款		1,424,549.24	14,213,738.84

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,868,568.54	2,286,364.62
应付托管费		311,428.10	381,060.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.1.4.7.7	392,414.32	288,744.35
应交税费		163,726.03	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.1.4.7.8	2,131,712.64	2,263,000.00
负债合计		6,292,398.87	19,432,908.57
所有者权益：			
实收基金	6.1.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	6.1.4.7.10	85,987,601.95	-92,522,969.43
所有者权益合计		2,085,987,601.95	1,907,477,030.57
负债和所有者权益总计		2,092,280,000.82	1,926,909,939.14

注：报告截止日 2013 年 5 月 22 日，基金份额净值 1.0430 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.1.2 利润表

会计主体：安信证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 5 月 22 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		**195,192,087.61**	**28,883,407.58**
1.利息收入		14,590,088.58	7,745,516.30
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	212,547.98	124,283.96
债券利息收入		12,118,679.61	7,621,232.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,258,860.99	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		121,314,891.82	-114,889,209.40
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	121,221,172.15	-127,832,770.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-1,771,289.24	-177,553.18
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益	6.1.4.7.14	-	-
股利收益	6.1.4.7.15	1,865,008.91	13,121,114.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	59,234,607.21	136,027,100.68
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	52,500.00	-
减：二、费用		**16,681,516.23**	**18,415,317.04**
1．管理人报酬		11,784,164.15	13,766,539.05
2．托管费		1,964,027.41	2,294,423.16
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.1.4.7.18	2,657,280.53	2,117,519.71
5．利息支出		60,480.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		60,480.00	-
6．其他费用	6.1.4.7.19	215,564.14	236,835.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**178,510,571.38**	**10,468,090.54**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		178,510,571.38	10,468,090.54

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 5 月 22 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 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）	2,000,000,000.00	-92,522,969.43	1,907,477,030.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	178,510,571.38	178,510,571.38
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）	2,000,000,000.00	85,987,601.95	2,085,987,601.95
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	2,000,000,000.00	-176,201,375.74	1,823,798,624.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,468,090.54	10,468,090.54
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）	2,000,000,000.00	-165,733,285.20	1,834,266,714.80

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：李勍，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

安信证券投资基金(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)三家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安信证券投资基金基金契约》(后更名为《安信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(1998)22 号文批准，于 1998 年 6 月 22 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 20 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1998)第 040 号文审核同意，于 1998 年 6 月 26 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(1998)22 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，投资于股票的比例合计不超过基金资产净值的 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 2013 年 8 月 23 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》、《 安信证券投资基金 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信消费服务股票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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 5 月 22 日(基金合同失效前日)止期间的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 2012 年 5 月 22 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 5 月 22 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 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的说明

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[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。

6.1.4.7 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	本期末 2013 年 5 月 22 日
活期存款	263,055,434.59
定期存款	-
其他存款	-
合计	263,055,434.59

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 5 月 22 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		551,768,305.72	764,573,264.14	212,804,958.42
债券	交易所市场	53,269,086.70	53,850,635.00	581,548.30
	银行间市场	415,097,297.95	413,115,000.00	-1,982,297.95
	合计	468,366,384.65	466,965,635.00	-1,400,749.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,020,134,690.37	1,231,538,899.14	211,404,208.77

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 5 月 22 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	470,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	470,000,000.00	-

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	本期末 2013 年 5 月 22 日
应收活期存款利息	86,448.29
应收定期存款利息	-
应收结算备付金利息	10,319.43
应收债券利息	9,469,572.80
应收买入返售证券利息	250,342.14
其他	985.84
合计	9,817,668.50

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	本期末 2013 年 5 月 22 日
交易所市场应付交易费用	386,609.32
银行间市场应付交易费用	5,805.00
合计	392,414.32

6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 5 月 22 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00

应付赎回费	-
预提费用	381,712.64
合计	2,131,712.64

6.1.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

	本期末 2013 年 5 月 22 日	
	基金份额	帐面金额
基金合同生效日	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

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	-244,692,570.99	152,169,601.56	-92,522,969.43
本期利润	119,275,964.17	59,234,607.21	178,510,571.38
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	-	-	-
本期末	-125,416,606.82	211,404,208.77	85,987,601.95

6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 日
活期存款利息收入	181,515.88
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	29,231.06
其他	1,801.04
合计	212,547.98

6.1.4.7.12 股票投资收益

6.1.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 日
卖出股票成交总额	1,126,775,192.53
减：卖出股票成本总额	1,005,554,020.38
买卖股票差价收入	121,221,172.15

6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,081,028,671.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,062,774,653.57
减：应收利息总额	20,025,307.66
债券投资收益	-1,771,289.24

6.1.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
股票投资产生的股利收益	1,865,008.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,865,008.91

6.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
1.交易性金融资产	59,234,607.21
——股票投资	54,994,568.46
——债券投资	4,240,038.75
——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	59,234,607.21

6.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
基金赎回费收入	-

其他	52,500.00
合计	52,500.00

6.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
交易所市场交易费用	2,647,055.53
银行间市场交易费用	10,225.00
合计	2,657,280.53

6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年5月22日
审计费用	45,000.00
信息披露费	116,712.64
上市年费	25,000.00
帐户维护费	12,000.00
银行划款手续费	8,351.50
其他费用	8,500.00
合计	215,564.14

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

本报告期内未发生变化。

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”）	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

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 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	本期 2013年1月1日-2013年5月22日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,784,164.15	13,766,539.05
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	本期 2013年1月1日-2013年5月22日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,964,027.41	2,294,423.16

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 X0.25%/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

无。

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	本期 2013 年 1 月 1 日-2013 年 5 月 22 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	28,538,470.00	28,538,470.00
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	28,538,470.00	28,538,470.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.43%	1.43%

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

无。

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	本期 2013年1月1日-2013年5月22日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国工商银行	263,055,434.59	181,515.88	80,043,904.52	113,699.25

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。

6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.1.4.11 利润分配情况

无。

6.1.4.12 期末（2013 年 6 月 30 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

无。

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

无。

6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。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管理、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。

6.1.4.13.2 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中国工商银行，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 2013 年 5 月 22 日，本基金未持有信用类债券（2012 年 12 月 31 日：同）。

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约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、债券投资等。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 5 月 22 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	263,055,434.59	-	-	-	263,055,434.59
结算备付金	7,385,022.84	-	-	-	7,385,022.84
结算保证金	395,926.95	-	-	-	395,926.95
交易性金融资产	465,341,210.00	1,624,425.00		764,573,264.14	1,231,538,899.14
买入返售金融资产	470,000,000.00	-	-	-	470,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	110,087,048.80	110,087,048.80
应收利息	-	-	-	9,817,668.50	9,817,668.50
资产总计	1,206,177,594.38	1,624,425.00	-	884,477,981.44	2,092,280,000.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,424,549.24	1,424,549.24
应付管理人报酬	-	-	-	1,868,568.54	1,868,568.54
应付托管费	-	-	-	311,428.10	311,428.10
应付交易费用	-	-	-	392,414.32	392,414.32
应交税费	-	-	-	163,726.03	163,726.03
其他负债	-	-	-	2,131,712.64	2,131,712.64
负债总计	-	-	-	6,292,398.87	6,292,398.87
利率敏感度缺口	1,206,177,594.38	1,624,425.00	-	878,185,582.57	2,085,987,601.95
上年度末 2012 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	45,307,365.65	-	-	-	45,307,365.65
结算备付金	2,541,194.41	-	-	-	2,541,194.41
交易性金融资产	318,550,263.80	1,597,200.00	61,968,000.00	1,341,504,802.49	1,723,620,266.29
买入返售金融资产	140,000,000.00	-	-	-	140,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	7,074,602.26	7,074,602.26
应收利息	-	-	-	7,616,510.53	7,616,510.53
存出保证金	-	-	-	750,000.00	750,000.00
资产总计	506,398,823.86	1,597,200.00	61,968,000.00	1,356,945,915.28	1,926,909,939.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,213,738.84	14,213,738.84
应付管理人报酬	-	-	-	2,286,364.62	2,286,364.62
应付托管费	-	-	-	381,060.76	381,060.76
应付交易费用	-	-	-	288,744.35	288,744.35

其他负债	-	-	-	2,263,000.00	2,263,000.00
负债总计	-	-	-	19,432,908.57	19,432,908.57
利率敏感度缺口	506,398,823.86	1,597,200.00	61,968,000.00	1,337,513,006.71	1,907,477,030.57

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：人民币元）	
		本期末 2013 年 5 月 22 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 494.00 万元	增加约 106.15 万元
	市场利率上升 25 个基点	减少约 489.00 万元	减少约 104.88 万元

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 5 月 22 日		上年度末 2012 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	764,573,264.14	36.65	1,341,504,802.49	70.33
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	764,573,264.14	36.65	1,341,504,802.49	70.33

6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”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：人民币元）	
		本期末 2013 年 5 月 22 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”上升 5%	增加约 4,943.00 万元	增加约 9,145.00 万元
	“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”下降 5%	减少约 4,943.00 万元	减少约 9,145.00 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 华安安信消费服务股票型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：华安安信消费服务股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.2.4.7.1	17,083,520.53
结算备付金		15,115,978.25
存出保证金		29,609.63
交易性金融资产	6.2.4.7.2	1,430,361,269.32
其中：股票投资		1,005,398,824.32
基金投资		-
债券投资		424,962,445.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	1,522,321,009.60
应收证券清算款		47,622,441.98
应收利息	6.2.4.7.5	11,357,758.27
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.2.4.7.6	-
资产总计		3,043,891,587.58
负债和所有者权益		**本期末 2013 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		39,609,082.91
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,783,602.30
应付托管费		463,933.70
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.2.4.7.7	872,299.54
应交税费		484,526.03
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.2.4.7.8	2,081,256.29
负债合计		46,294,700.77
所有者权益：		

实收基金	6.2.4.7.9	2,897,307,004.05
未分配利润	6.2.4.7.10	100,289,882.76
所有者权益合计		2,997,596,886.81
负债和所有者权益总计		3,043,891,587.58

注：1.报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.017 元，基金份额总额 2,946,180,618.29 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2013 年 5 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日。

6.2.2 利润表

会计主体：华安安信消费服务股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 5 月 23 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 5 月 23 日-2013 年 6 月 30 日
一、收入		**4,102,622.71**
1.利息收入		7,057,224.74
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	149,352.58
债券利息收入		1,455,011.35
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,452,860.81
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,259,679.38
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	21,415,011.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-262,867.95
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	2,107,535.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.16	-26,214,281.41
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	-
减：二、费用		**4,947,298.24**
1．管理人报酬		3,565,077.08
2．托管费		594,179.50
3．销售服务费		-
4．交易费用	6.2.4.7.18	688,464.51
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．其他费用	6.2.4.7.19	99,577.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-844,675.53**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		-844,675.53

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安信消费服务股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 5 月 23 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 5 月 23 日-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）	2,000,000,000.00	85,987,601.95	2,085,987,601.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-844,675.53	-844,675.53
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）	897,307,004.05	15,146,956.34	912,453,960.39
其中：1.基金申购款	897,307,004.05	15,146,956.34	912,453,960.39
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）	2,897,307,004.05	100,289,882.76	2,997,596,886.81

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：李勍，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

华安安信消费服务股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由安信证券投资基金(以下简称“基金安信”)转型而成。依据中国证监会 2013 年 4 月 25 日证监许可【2013】590 号文核准的安信证券投资基金基金份额持有人大会决议，基金安信由封闭式基金转为开放式基金。根据上交所上证基字[2013]120 号《关于终止安信证券投资基金上市的决定》，自 2013 年 5 月 23 日起，原基金安信终止上市，原基金安信更名为华安安信消费服务股票型证券投资基金。《安信证券投资基金基金合同》失效的同时《华安安信消费服务股票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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

原基金安信于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,085,987,601.95 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《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安信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 2013 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.016880461，并于 2013 年 6 月 25 日进行了变更登记。

本基金自 2013 年 5 月 29 日至 2013 年 6 月 19 日期间内开放集中申购，共募集 911,286,695.29 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 459,327.86 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 358 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 6 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 911,286,695.29 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 459,327.86 份基金份额，并于 2013 年 6 月 25 日进行了确认登记。

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 2013 年 8 月 23 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》、《华安安信消费服务股票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 2013 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 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

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 2013 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 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。

6.2.4.4.4 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。

6.2.4.4.5 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	17,083,520.53
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
合计	17,083,520.53

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		817,067,825.26	1,005,398,824.32	188,330,999.06
债券	交易所市场	53,269,086.70	53,633,445.00	364,358.30
	银行间市场	374,834,430.00	371,329,000.00	-3,505,430.00
	合计	428,103,516.70	424,962,445.00	-3,141,071.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,245,171,341.96	1,430,361,269.32	185,189,927.36

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	1,522,321,009.60	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	1,522,321,009.60	-

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	43,182.11
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	6,121.89
应收债券利息	9,641,384.15
应收买入返售证券利息	1,667,058.15
应收申购款利息	-
其他	11.97
合计	11,357,758.27

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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	866,494.54
银行间市场应付交易费用	5,805.00
合计	872,299.54

6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	-

预提费用	331,256.29
合计	2,081,256.29

6.2.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额	帐面金额
基金合同生效日	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
基金份额折算调整	33,726,661.00	-
未领取红利份额折算调整	1,167,262.00	1,167,265.10
集中申购募集资金本金及利息	911,286,695.29	896,139,738.95
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,946,180,618.29	2,897,307,004.05

注：1.原基金安信于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,085,987,601.95 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《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安信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 2013 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.016880461，并于 2013 年 6 月 25 日进行了变更登记。

2.本基金自 2013 年 5 月 29 日至 2013 年 6 月 19 日期间内开放集中申购，共募集 911,286,695.29 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 459,327.86 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 358 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 6 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 911,286,695.29 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 459,327.86 份基金份额，并于 2013 年 6 月 25 日进行了确认登记。

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	-125,416,606.82	211,404,208.77	85,987,601.95
本期利润	25,369,605.88	-26,214,281.41	-844,675.53
本期基金份额交易产生的变动数	-45,513,275.34	60,660,231.68	15,146,956.34
其中：基金申购款	-45,513,275.34	60,660,231.68	15,146,956.34
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-145,560,276.28	245,850,159.04	100,289,882.76

6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 5 月 23 日-2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	127,075.68
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	22,005.78
其他	271.12
合计	149,352.58

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	本期 2013 年 5 月 23 日-2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	146,891,178.83
减：卖出股票成本总额	125,476,166.99
买卖股票差价收入	21,415,011.84

6.2.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额	41,283,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,262,867.95
减：应收利息总额	1,283,200.00
债券投资收益	-262,867.95

6.2.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,107,535.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,107,535.49

6.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
1.交易性金融资产	-26,214,281.41
——股票投资	-24,473,959.36
——债券投资	-1,740,322.05
——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	-26,214,281.41

6.2.4.7.17 其他收入

无。

6.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
交易所市场交易费用	688,464.51
银行间市场交易费用	-
合计	688,464.51

6.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
审计费用	17,488.77
信息披露费	32,054.88
持有人大会费	50,000.00
银行划款手续费	33.50
合计	99,577.15

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”）	基金发起人、基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

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 应支付关联方的佣金

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	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,565,077.08
其中：支付销售机构的客户维护费	83,703.03

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×1.5%÷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	本期 2013年5月23日-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	594,179.50

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×0.25%÷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	本期 2013 年 5 月 23 日-2013 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2013 年 5 月 23 日）持有的基金份额	28,538,470.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	481,742.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	29,020,212.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.99%

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

无。

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

关联方名称	本期 2013年5月23日-2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	17,083,520.53	127,075.68

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。

6.2.4.10.6 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（2013 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

金额单位：人民币元

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
000999	华润三九	2013-06-03	资产重组	29.60	2013-08-19	26.51	449,700	12,646,563.33	13,311,120.00	-

注：本基金截止至 2013 年 6 月 30 日止有以上因公布的资产重组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。

6.2.4.12.3 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。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管理、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。

6.2.4.13.2 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中国工商银行，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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.2.4.13.3 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约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。

6.2.4.13.4 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

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、债券投资等。

6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产				
银行存款	17,083,520.53	-	-	17,083,520.53
结算备付金	15,115,978.25	-	-	15,115,978.25
结算保证金	29,609.63	-	-	29,609.63
交易性金融资产	423,346,930.00	1,615,515.00	1,005,398,824.32	1,430,361,269.32
买入返售金融资产	1,522,321,009.60	-	-	1,522,321,009.60
应收证券清算款	-	-	47,622,441.98	47,622,441.98
应收利息	-	-	11,357,758.27	11,357,758.27

资产总计	1,977,897,048.01	1,615,515.00	1,064,379,024.57	3,043,891,587.58
负债				
应付证券清算款	-	-	39,609,082.91	39,609,082.91
应付管理人报酬	-	-	2,783,602.30	2,783,602.30
应付托管费	-	-	463,933.70	463,933.70
应付交易费用	-	-	872,299.54	872,299.54
应交税费	-	-	484,526.03	484,526.03
其他负债	-	-	2,081,256.29	2,081,256.29
负债总计	-	-	46,294,700.77	46,294,700.77
利率敏感度缺口	1,977,897,048.01	1,615,515.00	1,018,084,323.80	2,997,596,886.81

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。

6.2.4.13.4.1.2 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：人民币元）
		本期末 2013 年 6 月 30 日
	市场利率下降 25 个基点	增加 704.51 万元
	市场利率上升 25 个基点	减少 696.85 万元

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。

6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 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	1,005,398,824.32	33.54
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,005,398,824.32	33.54

6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性作定量分析。

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 安信证券投资基金

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	764,573,264.14	36.54
	其中：股票	764,573,264.14	36.54
2	固定收益投资	466,965,635.00	22.32
	其中：债券	466,965,635.00	22.32
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	470,000,000.00	22.46
	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	270,440,457.43	12.93
6	其他各项资产	120,300,644.25	5.75
7	合计	2,092,280,000.82	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	15,120,000.00	0.72
3	制造业	568,568,444.14	27.26
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
5	建筑业	-	-
6	批发和零售业	3,577,800.00	0.17
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	-	-
10	金融业	92,799,520.00	4.45
11	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
19	综合	84,507,500.00	4.05
20	合计	764,573,264.14	36.65

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	002450	康得新	6,200,000	166,656,000.00	7.99
2	600256	广汇能源	4,390,000	84,507,500.00	4.05
3	002250	联化科技	3,735,845	83,271,985.05	3.99

4	600867	通化东宝	4,655,729	75,003,794.19	3.60
5	600016	民生银行	5,608,000	59,669,120.00	2.86
6	002038	双鹭药业	755,202	50,288,901.18	2.41
7	600887	伊利股份	1,300,000	36,972,000.00	1.77
8	600594	益佰制药	807,623	23,154,551.41	1.11
9	300146	汤臣倍健	434,847	22,090,227.60	1.06
10	601166	兴业银行	1,000,000	18,730,000.00	0.90
11	002501	利源铝业	1,138,305	16,835,530.95	0.81
12	600157	永泰能源	1,800,000	15,120,000.00	0.72
13	600000	浦发银行	1,390,000	14,400,400.00	0.69
14	002008	大族激光	1,000,000	13,540,000.00	0.65
15	002185	华天科技	1,761,500	13,158,405.00	0.63
16	000999	华润三九	450,000	12,496,500.00	0.60
17	002311	海大集团	797,642	11,789,148.76	0.57
18	300273	和佳股份	630,000	11,529,000.00	0.55
19	000100	TCL 集团	3,500,000	10,115,000.00	0.48
20	600587	新华医疗	230,000	9,172,400.00	0.44
21	300057	万顺股份	500,000	6,495,000.00	0.31
22	002385	大北农	250,000	6,000,000.00	0.29
23	000963	华东医药	80,000	3,072,000.00	0.15
24	002251	步 步 高	20,000	505,800.00	0.02

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	600867	通化东宝	64,262,817.80	3.37
2	600256	广汇能源	41,446,969.14	2.17
3	002250	联化科技	31,863,268.38	1.67
4	002008	大族激光	27,950,415.51	1.47
5	600594	益佰制药	22,529,962.79	1.18
6	601166	兴业银行	18,724,000.00	0.98
7	002038	双鹭药业	16,316,723.52	0.86
8	600329	中新药业	15,681,947.50	0.82
9	600887	伊利股份	14,747,666.43	0.77
10	002185	华天科技	12,785,415.60	0.67
11	000999	华润三九	12,655,000.00	0.66
12	600016	民生银行	10,816,454.39	0.57

13	300273	和佳股份	10,670,958.63	0.56
14	002311	海大集团	10,556,992.81	0.55
15	600157	永泰能源	9,215,065.70	0.48
16	601998	中信银行	8,879,000.00	0.47
17	300057	万顺股份	8,562,933.06	0.45
18	600587	新华医疗	8,521,713.82	0.45
19	300115	长盈精密	6,664,541.25	0.35
20	002385	大北农	5,346,500.00	0.28

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	600741	华域汽车	89,773,249.82	4.71
2	600104	上汽集团	87,776,333.76	4.60
3	002250	联化科技	86,754,768.78	4.55
4	601318	中国平安	78,547,981.74	4.12
5	600570	恒生电子	61,549,507.39	3.23
6	000858	五 粮 液	58,754,769.98	3.08
7	600157	永泰能源	57,920,191.64	3.04
8	002450	康得新	48,685,107.68	2.55
9	600887	伊利股份	48,408,637.51	2.54
10	600016	民生银行	46,888,979.85	2.46
11	002001	新 和 成	34,788,109.49	1.82
12	600315	上海家化	34,449,325.07	1.81
13	600518	康美药业	31,645,382.70	1.66
14	002038	双鹭药业	30,759,041.46	1.61
15	600196	复星医药	28,652,559.16	1.50
16	600000	浦发银行	27,840,178.32	1.46
17	601088	中国神华	24,186,147.00	1.27
18	600332	广州药业	22,203,963.95	1.16
19	002376	新北洋	21,950,783.72	1.15
20	300115	长盈精密	20,051,932.42	1.05

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	373,627,913.57
卖出股票的收入（成交）总额	1,126,775,192.53

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	263,838,635.00	12.65
2	央行票据	69,960,000.00	3.35
3	金融债券	92,847,000.00	4.45
	其中：政策性金融债	92,847,000.00	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,320,000.00	1.93
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	466,965,635.00	22.39

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	120019	12 附息国债 19	1,200,000	120,060,000.00	5.76
2	130002	13 付息国债 02	700,000	69,972,000.00	3.35
3	080216	08 国开 16	600,000	62,778,000.00	3.01
4	1001060	10 央票 60	600,000	59,970,000.00	2.87
5	010308	03 国债(8)	520,700	52,226,210.00	2.50

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.9.1 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。

7.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.1.10 投资组合报告附注

7.1.10.1 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。

7.1.10.2 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。

7.1.10.3 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	395,926.95
2	应收证券清算款	110,087,048.80
3	应收股利	-
4	应收利息	9,817,668.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,300,644.25

7.1.10.4 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。

7.1.10.5 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情况。

7.2 华安安信消费服务股票型证券投资基金

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	1,005,398,824.32	33.03
	其中：股票	1,005,398,824.32	33.03
2	固定收益投资	424,962,445.00	13.96
	其中：债券	424,962,445.00	13.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,522,321,009.60	50.01

	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	32,199,498.78	1.06
6	其他各项资产	59,009,809.88	1.94
7	合计	3,043,891,587.58	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	803,539,846.47	26.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,670,980.25	0.99
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	25,402,500.00	0.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	27,589,107.60	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,526,790.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	108,669,600.00	3.63
	合计	1,005,398,824.32	33.54

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	002450	康得新	6,100,000	170,678,000.00	5.69
2	002250	联化科技	5,717,793	114,298,682.07	3.81
3	600256	广汇能源	8,385,000	108,669,600.00	3.63
4	600867	通化东宝	6,136,875	91,378,068.75	3.05
5	002038	双鹭药业	1,500,243	87,914,239.80	2.93

6	600887	伊利股份	1,680,000	52,550,400.00	1.75
7	002241	歌尔声学	1,339,369	48,605,701.01	1.62
8	300146	汤臣倍健	1,000,269	44,001,833.31	1.47
9	000963	华东医药	733,465	29,228,580.25	0.98
10	600594	益佰制药	907,623	28,054,626.93	0.94
11	300070	碧水源	732,195	27,589,107.60	0.92
12	300273	和佳股份	1,283,230	27,486,786.60	0.92
13	002570	贝因美	827,700	23,134,215.00	0.77
14	002008	大族激光	1,860,000	20,813,400.00	0.69
15	002148	北纬通信	500,000	16,320,000.00	0.54
16	002385	大北农	1,371,354	14,152,373.28	0.47
17	000999	华润三九	449,700	13,311,120.00	0.44
18	300136	信维通信	519,110	12,614,373.00	0.42
19	002185	华天科技	1,600,000	12,368,000.00	0.41
20	600587	新华医疗	281,853	11,679,988.32	0.39
21	300015	爱尔眼科	498,900	10,526,790.00	0.35
22	002255	海陆重工	573,150	9,858,180.00	0.33
23	600703	三安光电	500,000	9,820,000.00	0.33
24	300104	乐视网	350,000	9,082,500.00	0.30
25	600332	广州药业	128,790	4,412,345.40	0.15
26	002223	鱼跃医疗	200,000	3,770,000.00	0.13
27	002104	恒宝股份	204,300	2,637,513.00	0.09
28	002251	步 步 高	20,000	442,400.00	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	002241	歌尔声学	50,269,364.95	1.68
2	002250	联化科技	42,280,759.13	1.41
3	002038	双鹭药业	32,979,471.67	1.10
4	300070	碧水源	27,567,040.08	0.92
5	300146	汤臣倍健	25,635,942.96	0.86
6	000963	华东医药	25,567,893.47	0.85
7	600256	广汇能源	23,031,874.22	0.77
8	002570	贝因美	22,099,742.17	0.74
9	002148	北纬通信	16,565,170.00	0.55
10	300273	和佳股份	14,129,803.44	0.47
11	002008	大族激光	12,041,148.40	0.40

12	300136	信维通信	11,952,114.38	0.40
13	600887	伊利股份	11,832,312.75	0.39
14	002255	海陆重工	11,586,473.51	0.39
15	300015	爱尔眼科	10,694,539.00	0.36
16	002385	大北农	10,269,710.44	0.34
17	600703	三安光电	10,016,835.00	0.33
18	300104	乐视网	9,175,944.78	0.31
19	600867	通化东宝	7,396,668.80	0.25
20	600332	广州药业	4,430,954.75	0.15

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	51,726,437.26	1.73
2	601166	兴业银行	18,140,211.10	0.61
3	002501	利源铝业	15,399,441.20	0.51
4	600157	永泰能源	15,125,248.19	0.50
5	600000	浦发银行	14,167,800.00	0.47
6	002311	海大集团	10,681,212.85	0.36
7	300057	万顺股份	8,043,312.96	0.27
8	000100	TCL 集团	8,005,000.00	0.27
9	002450	康得新	3,013,000.00	0.10
10	002185	华天科技	1,290,845.42	0.04
11	002385	大北农	1,142,782.35	0.04
12	002255	海陆重工	147,262.50	0.00
13	000999	华润三九	8,625.00	0.00

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	390,775,686.53
卖出股票的收入（成交）总额	146,891,178.83

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

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	262,750,445.00	8.77

2	央行票据	69,902,000.00	2.33
3	金融债券	92,310,000.00	3.08
	其中：政策性金融债	92,310,000.00	3.08
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	424,962,445.00	14.18

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

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	120019	12 附息国债 19	1,200,000	119,568,000.00	3.99
2	130002	13 付息国债 02	700,000	69,643,000.00	2.32
3	080216	08 国开 16	600,000	62,370,000.00	2.08
4	1001060	10 央票 60	600,000	59,934,000.00	2.00
5	10308	03 国债(8)	520,700	52,017,930.00	1.74

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

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	29,609.63
2	应收证券清算款	47,622,441.98
3	应收股利	-
4	应收利息	11,357,758.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,009,809.88

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 华安安信消费服务股票型证券投资基金

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
59,779	49,284.54	1,274,554,385.54	43.26%	1,671,626,232.75	56.74%

8.1.2 安信证券投资基金（2013 年 5 月 22 日）

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
52,271	38,262.13	1,167,407,114.00	58.37%	832,592,886.00	41.63%

8.2 期末上市基金前十名持有人

8.2.1 安信证券投资基金（2013 年 5 月 22 日）

序号	持有人名称	持有份额	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	199,825,829.00	9.99%
2	中国人寿保险（集团）公司	193,616,934.00	9.68%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	83,966,956.00	4.20%
4	太平人寿保险有限公司	76,105,782.00	3.81%
5	幸福人寿保险股份有限公司－分红	75,284,708.00	3.76%
6	泰康人寿保险股份有限公司－分红－个人分红－019L－FH002 沪	71,992,948.00	3.60%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红－个人分红	55,585,352.00	2.78%
8	幸福人寿保险股份有限公司－自有资金	46,684,117.00	2.33%
9	中钢投资有限公司	37,525,947.00	1.88%
10	新华人寿保险股份有限公司	35,141,036.00	1.76%

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 华安安信消费服务股票型证券投资基金

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	-	-

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（2013 年 5 月 23 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期基金总申购份额	911,286,695.29
减：本报告期基金总赎回份额	
本报告期基金拆分变动份额	34,893,923.00
本报告期期末基金份额总额	2,946,180,618.29

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2013 年 2 月 26 日至 2013 年 3 月 26 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《关于安信证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会【2013】590 号文核准，本基金基金份额持有人大会决议生效，安信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信消费服务股票型证券投资基金。

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

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

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、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 华安安信消费服务股票型证券投资基金

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

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	
中国银河证券股份有限公司	1	321,777,756.73	59.85%	284,741.97	59.34%	-
光大证券股份有限公司	1	146,372,561.49	27.22%	133,258.15	27.77%	-
国信证券股份有限公司	2	69,516,547.14	12.93%	61,885.10	12.90%	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国建设投资证券有限责任	1	-	-	-	-	-

公司						

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.本报告期内本基金无新增交易单元。

10.7.1.2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
中国银河证券股份有限公司			527,066,000.00	9.39%		-
光大证券股份有限公司			4,615,900,000.00	82.20%		-
国信证券股份有限公司			472,173,000.00	8.41%		-
中银国际证券有限责任公司						-
国泰君安证券股份有限公司						-
海通证券股份有限公司						-

上海证券有限责任公司		-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司		-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司		-	-	-	-	-
中国建设投资证券有限责任公司		-	-	-	-	-

10.7.2 安信证券投资基金

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

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	
国信证券股份有限公司	2	560,887,684.91	37.38%	496,329.66	36.73%	-
光大证券股份有限公司	1	439,928,096.08	29.32%	400,509.57	29.64%	-
上海证券有限责任公司	1	200,056,311.40	13.33%	182,131.45	13.48%	-
海通证券股份有限公司	1	176,729,634.81	11.78%	160,894.26	11.91%	-
中国建设投资证券有限责任公司	1	109,143,790.90	7.27%	99,365.87	7.35%	-
申银万国证券股份有限公司	1	13,657,588.00	0.92%	12,085.64	0.89%	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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.本报告期内本基金无新增交易单元。

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

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
国信证券股份有限公司	9,187,050.00	82.08%	165,000,000.00	3.55%		-
光大证券股份有限公司			2,885,000,000.00	62.11%		-
上海证券有限责任公司			1,045,000,000.00	22.50%		-
海通证券股份有限公司	2,006,000.00	17.92%	50,000,000.00	1.08%		-
中国建设投资证券有限责任公司			500,000,000.00	10.76%		-
申银万国证券股份有限公司						-
中国银河证券股份有限公司		-	-	-	-	-
中银国际证券		-	-	-	-	-

有限责任公司						
国泰君安证券股份有限公司		-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司		-	-	-	-	-

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	关于安信证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-3-28
2	关于安信证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-4-27
3	关于安信证券投资基金复牌的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-2
4	安信证券投资基金终止上市公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-20
5	安信证券投资基金终止上市提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-22
6	华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-23
7	华安安信消费服务股票型证券投资基金托管协议	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-23
8	华安安信消费服务股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-23
9	华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-23
10	关于华安安信消费服务股票证券投资基金增加代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-29
11	关于华安安信消费服务股票证券投资基金增加代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-5-30
12	关于华安安信消费服务股票证券投资基金增加代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-6-3
13	关于原安信证券投资基金基金份额拆分结果的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-6-26
14	华安安信消费服务股票型证券投资基金份额“确权”登记指引	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-6-26
15	华安安信消费服务股票型证券投资基金申购确认比例和集中申购结果的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2013-6-26

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、《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》
2、《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》
3、《华安安信消费服务股票型证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会批准华安安信消费服务股票型证券投资基金设立的文件；
5、《安信证券投资基金基金合同》
6、《安信证券投资基金招募说明书》
7、《安信证券投资基金托管协议》
8、中国证监会批准安信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；

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

二〇一三年八月二十四日