

# 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金 （原安顺证券投资基金转型）2014 年第 2 季度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年七月十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止

## § 2 基金产品概况

### 2.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

|             |                                                                                                                         |
|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称：       | 华安安顺灵活配置-转型后                                                                                                            |
| 交易代码：       | 519909                                                                                                                  |
| 基金运作方式：     | 契约型开放式                                                                                                                  |
| 基金合同生效日：    | 2014 年 5 月 12 日                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额： | 3,748,357,091.15                                                                                                        |
| 投资目标：       | 本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，并结合对个股、个券的精选策略，以追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。                                                    |
| 投资策略：       | 本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。<br>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： | 本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中国债券总指数收益率}$                                             |
| 风险收益特征： | 本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。                                                          |
| 基金管理人：  | 华安基金管理有限公司                                                                                                               |
| 基金托管人：  | 交通银行股份有限公司                                                                                                               |

## 2.2 原安顺证券投资基金

|             |                                                                                                                                                               |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称：       | 华安安顺封闭                                                                                                                                                        |
| 交易代码：       | 500009                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式：     | 契约型封闭式                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日：    | 1999 年 6 月 15 日                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额： | 3, 000, 000, 000                                                                                                                                              |
| 投资目标：       | <p>本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。</p> <p>本基金主要投资于成长型上市公司，并兼顾对收益型上市公司及债券的投资，从而使投资者在承受一定风险的情况下，有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。</p>                        |
| 投资策略：       | <p>本基金为平衡型基金，兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 40-80%，现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，60%左右投资于具有良好成长性的上市公司股票，40%</p> |

|         |                                                                                                                                                                                                                        |
|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         | <p>左右投资于收益型上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。</p> <p>本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 的增长率。</p> <p>本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定，具有良好分红能力，预期每股收益高于市场平均水平，预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。</p> |
| 业绩比较基准： | 无                                                                                                                                                                                                                      |
| 风险收益特征： | 无                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金管理人：  | 华安基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                             |
| 基金托管人：  | 交通银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                             |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 项目              | 2014 年第 2 季度报告                       |                                      |
|-----------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 转型后（2014 年 5 月 12 日-2014 年 6 月 30 日） | 转型前（2014 年 4 月 01 日-2014 年 5 月 11 日） |
| 1. 本期已实现收益      | 20,875,424.37                        | 63,569,962.26                        |
| 2. 本期利润         | 190,056,970.25                       | -33,689,637.63                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0553                               | -0.0112                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,844,089,481.57                     | 3,172,904,977.06                     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.026                                | 1.0576                               |

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

##### 3.2.1.1 本报告期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 | 净值增 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|-----|------|-------|-----|-----|
|----|-----|-----|------|-------|-----|-----|

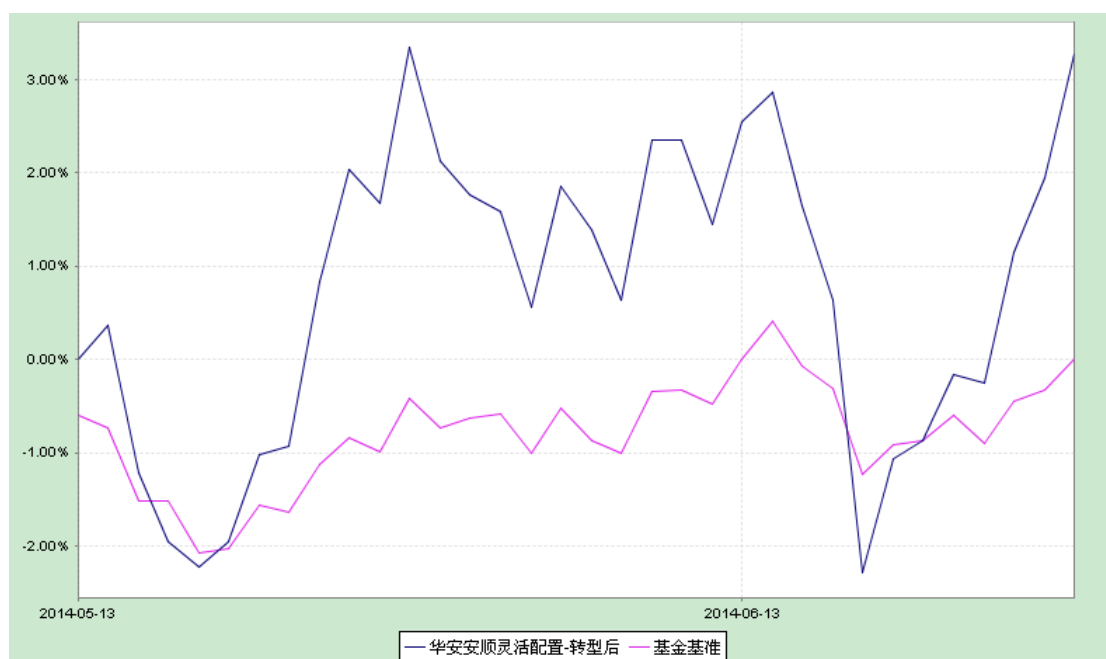
|                     | 长率①   | 长率标准<br>差② | 基准收益<br>率③ | 准收益率标<br>准差④ |       |       |
|---------------------|-------|------------|------------|--------------|-------|-------|
| 2014.5.12-2014.6.30 | 3.32% | 1.08%      | 0.01%      | 0.41%        | 3.31% | 0.67% |

### 3.2.1.2 自基金转型以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

转型后累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014年5月12日至2014年6月30日）



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

2、根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定，基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.2 安顺证券投资基金

#### 3.2.2.1 本报告期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<br>长率① | 净值增长<br>率标准<br>差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|--------------------|------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
| 2014.4.1-2014.5.11 | -1.46%     | 2.41%             | -                  | -                     | -   | -   |

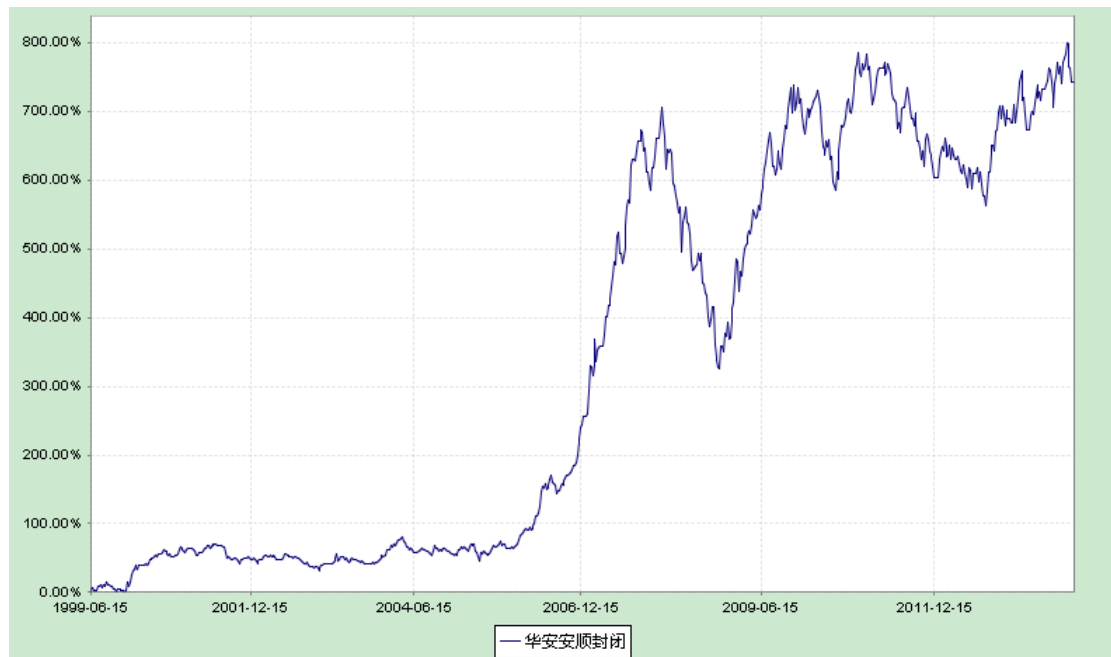
#### 3.2.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比

## 较基准收益率变动的比较

### 安顺证券投资基金

#### 转型前累计净值增长率历史走势图

（1999 年 6 月 15 日至 2014 年 5 月 11 日）



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                  | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------------------|-------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                     | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                        |
| 尚志民 | 本基金的基金经理，首席投资官，副总经理 | 2003-9-18   | -    | 17 年   | 工商管理硕士，17 年证券、基金从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，现任公司副总经理，首席投资官。1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001 年 9 月至 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 2003 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任本基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 2 月起担任华安基金副总经理兼首席投资官。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：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。

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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 公平交易专项说明

##### 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，出现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% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

### 4.4 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

二季度市场呈震荡整理格局，中小股票活跃，上证综指全季度上升 0.74%，中小板指数上升 4.35%，创业板指数上升 5.79%。各行业涨多跌少，涨幅最大的国防军工行业与跌幅最大的交通运输行业走势差距超过 15 个百分点。

报告期内，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，股票投资上限由原来的 80% 提高到 95%，本基金始终保持相对积极的仓位，操作上主要增加了电子、房地产、传媒等行业的配置，降低了建材、化工、医药等行业的配置，在转开放式运行后取得较好收益，业绩超越比较基准 3.25 个百分点。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.026 元，本报告期（2014.5.12-2014.6.30）份额净值增长率为 3.32%，同期业绩比较基准增长率为 0.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期公布的各项经济数据显示经济下行有所趋缓，但地产销售和 investment 数据持续下降，将给政府稳增长目标带来压力。李总理多次强调 7.5% 的经济增长目标，并且用多种“微刺激”手段来促进经济增长，PMI 数据回升到荣枯线之上，表明“微刺激”政策显效，预计经济增长在三季度有望进一步改善。央行连续 7 周在公开市场进行净投放操作，银监会修改存贷比规则释放信贷额度等，资金面得到改善，流动性保持较好态势，有利于行情的进一步发展。

在经济下行压力缓解、资金面得到改善的情况下，我们对后期市场持较为积极的态度，低估值蓝筹在经济基本面好转、流动性改善的情况下有反弹空间。上证指数与沪深 300 成份股中，传统经济、过剩经济中的权重行业个股占据较大权重，指数牛市的可能性较小，而经济转型背景下成长股有较大的投资机会。从目前 A 股市场消费、医药、TMT 等成长性行业占整体市场的市值比重来看，与成熟股市相比还有相当大的差距，未来成长股更有可能是以时间换取空间，我们重点选取符合转型方向、业绩有望超预期的成长股值进行配置。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014 年 5 月 12 日-2014 年 6 月 30 日）

### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 3,578,831,119.99 | 92.19        |
|    | 其中：股票             | 3,578,831,119.99 | 92.19        |
| 2  | 固定收益投资            | —                | —            |
|    | 其中：债券             | —                | —            |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 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      | 222,054,689.23   | 5.72         |
| 7  | 其他资产              | 81,317,330.25    | 2.09         |
| 8  | 合计                | 3,882,203,139.47 | 100.00       |

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —                | —            |
| B  | 采矿业              | —                | —            |
| C  | 制造业              | 1,680,091,050.75 | 43.71        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 642,500.00       | 0.02         |
| E  | 建筑业              | 225,598,172.64   | 5.87         |
| F  | 批发和零售业           | 98,100,000.00    | 2.55         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 484,167,403.68   | 12.60        |
| J  | 金融业              | 411,078,848.95   | 10.69        |
| K  | 房地产业             | 334,917,660.97   | 8.71         |
| L  | 租赁和商务服务业         | —                | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —                | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 152,536,824.90   | 3.97         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —                | —            |
| P  | 教育               | —                | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —                | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 191,698,658.10   | 4.99         |
| S  | 综合               | —                | —            |
|    | 合计               | 3,578,831,119.99 | 93.10        |

### 5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

#### 明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
|----|------|------|-------|---------|--------|

|    |        |       |            |                | 值比例（%） |
|----|--------|-------|------------|----------------|--------|
| 1  | 300002 | 神州泰岳  | 19,990,000 | 314,842,500.00 | 8.19   |
| 2  | 601318 | 中国平安  | 6,880,000  | 270,659,200.00 | 7.04   |
| 3  | 002415 | 海康威视  | 15,699,998 | 265,957,966.12 | 6.92   |
| 4  | 002241 | 歌尔声学  | 9,500,000  | 253,270,000.00 | 6.59   |
| 5  | 002450 | 康得新   | 10,099,918 | 229,773,134.50 | 5.98   |
| 6  | 002375 | 亚厦股份  | 9,999,919  | 225,598,172.64 | 5.87   |
| 7  | 600352 | 浙江龙盛  | 12,999,900 | 209,948,385.00 | 5.46   |
| 8  | 002001 | 新 和 成 | 16,666,690 | 206,500,289.10 | 5.37   |
| 9  | 300133 | 华策影视  | 5,999,958  | 191,698,658.10 | 4.99   |
| 10 | 002285 | 世联行   | 23,238,497 | 186,140,360.97 | 4.84   |

#### 5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.1.7 报告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。

#### 5.1.8 投资组合报告附注

5.1.8.1 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。

5.1.8.2 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。

#### 5.1.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）      |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,048,549.72  |
| 2  | 应收证券清算款 | 80,140,435.89 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 85,508.63     |
| 5  | 应收申购款   | 42,836.01     |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 81,317,330.25 |

#### 5.1.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5.1.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

### 5.2 原安顺证券投资基金投资组合报告

（报告期：2014年4月01日-2014年5月11日）

#### 5.2.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 2,500,843,338.85 | 76.32        |
|    | 其中：股票             | 2,500,843,338.85 | 76.32        |
| 2  | 固定收益投资            | 653,014,810.00   | 19.93        |
|    | 其中：债券             | 653,014,810.00   | 19.93        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 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      | 100,815,581.31   | 3.08         |
| 7  | 其他资产              | 22,243,672.93    | 0.68         |
| 8  | 合计                | 3,276,917,403.09 | 100.00       |

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,398,075,062.94 | 44.06        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | 129,179,784.70   | 4.07         |
| F  | 批发和零售业           | 106,533,900.00   | 3.36         |
| 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 | 353,654,507.17   | 11.15 |
| J | 金融业             | 29,903,900.00    | 0.94  |
| K | 房地产业            | 281,986,387.38   | 8.89  |
| 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   | 90,217,514.72    | 2.84  |
| 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       | 111,292,281.94   | 3.51  |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 2,500,843,338.85 | 78.82 |

### 5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

#### 明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 300002 | 神州泰岳  | 19,090,000 | 218,771,400.00 | 6.89         |
| 2  | 002001 | 新 和 成 | 9,699,909  | 193,222,187.28 | 6.09         |
| 3  | 600352 | 浙江龙盛  | 11,550,000 | 182,259,000.00 | 5.74         |
| 4  | 002415 | 海康威视  | 8,880,000  | 169,164,000.00 | 5.33         |
| 5  | 002450 | 康得新   | 7,559,918  | 156,339,104.24 | 4.93         |
| 6  | 002285 | 世联行   | 9,999,913  | 140,998,773.30 | 4.44         |
| 7  | 002250 | 联化科技  | 7,290,000  | 139,457,700.00 | 4.40         |
| 8  | 002375 | 亚厦股份  | 5,999,990  | 129,179,784.70 | 4.07         |
| 9  | 300133 | 华策影视  | 4,555,558  | 111,292,281.94 | 3.51         |
| 10 | 002241 | 歌尔声学  | 3,990,000  | 110,163,900.00 | 3.47         |

### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债 券 品 种   | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 13,178,810.00  | 0.42         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 639,836,000.00 | 20.17        |
|    | 其中：政策性金融债 | 639,836,000.00 | 20.17        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | -              | -            |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 653,014,810.00 | 20.58        |

### 5.2.5 报告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

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

#### 5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.2.7 报告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。

#### 5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 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。

5.2.8.2 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。

##### 5.2.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,023,590.42  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 21,220,082.51 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,243,672.93 |

##### 5.2.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

##### 5.2.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## § 6 基金管理人运用固有资金投资原封闭式基金情况

单位：份

|                              |               |
|------------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额           | 24,325,003.00 |
| 报告期初至转型前买入总份额                | —             |
| 报告期初至转型前卖出总份额                | —             |
| 转型前最后一日管理人持有的封闭式基金份额         | 24,325,003.00 |
| 转型前最后一日持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%） | 0.81          |

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| 合同生效日基金份额总额       | 3,000,000,000.00 |
| 合同生效日至报告期末基金总申购份额 | 1,099,146,875.45 |
| 减：合同生效日至报告期末卖出总份额 | 607,408,597.30   |
| 合同生效日至报告期末拆分份额    | 256,618,813.00   |
| 报告期期末基金份额总额       | 3,748,357,091.15 |

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》
- 2、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《安顺证券投资基金基金合同》
- 5、《安顺证券投资基金招募说明书》
- 6、《安顺证券投资基金托管协议》

### 8.2 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>。

### 8.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一四年七月十九日