

华安安信消费服务股票型证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 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	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
7	投资组合报告	32
7.1	期末基金资产组合情况	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	36
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	37
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	37
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	37
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12	投资组合报告附注	37
8	基金份额持有人信息	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	38

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
9	开放式基金份额变动	39
10	重大事件揭示	39
10.1	基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4	基金投资策略的改变	39
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	40
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	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8	其他重大事件	42
11	影响投资者决策的其他重要信息	43
12	备查文件目录	43
12.1	备查文件目录	43
12.2	存放地点	43
12.3	查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
交易代码	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	708,347,229.61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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	赵会军

	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李劼	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-7,520,591.17
本期利润	-58,025,933.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0655
本期加权平均净值利润率	-6.98%
本期基金份额净值增长率	-6.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-45,587,656.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0644

期末基金资产净值	651,061,556.03
期末基金份额净值	0.919
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.74%

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 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	2.00%	1.07%	0.65%	0.83%	1.35%	0.24%
过去三个月	3.49%	1.04%	0.03%	0.92%	3.46%	0.12%
过去六个月	-6.22%	1.20%	-7.32%	1.08%	1.10%	0.12%
过去一年	-9.64%	1.20%	5.62%	1.21%	-15.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-10.74%	1.16%	-5.46%	1.25%	-5.28%	-0.09%

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。

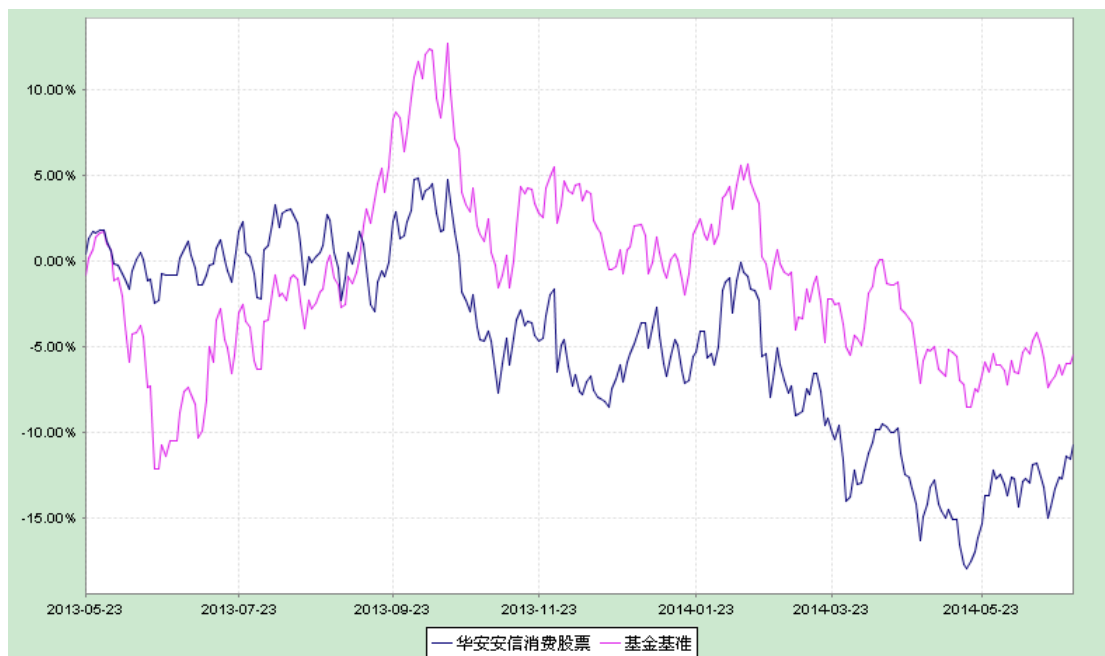
本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—40%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.2.2 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

华安安信消费服务股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 5 月 23 日至 2014 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998] 20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2014 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、

华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺混合等 49 只开放式基金。管理资产规模达到 688.13 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（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、基金投资部副总监	2008-02-13	-	18 年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，18 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。2014 年 4 月起兼任基金投资部副总监。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》、《华安安信消费服务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 1 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖单只股票的数量较小，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年沪深 300 指数跌幅为 7.08%，上证 50 指数跌幅为 5.87%，与此同时中证 500 指数的涨幅为 2.50%，创业板综指的涨幅则高达 7.69%，而本基金比较基准选取的中证消费服务领先指数跌幅则达到了 7.32%。报告期内，市场经历了对宏观经济数据的失望之后，开始对底线思维的意识重新抬头，A 股整体表现出相对两极的特征。一方面地产汽车等板块或由于低预期或由于低估值，投资偏好明显上升。而另一方面成长股则出现了阵营的分化，移动互联网、医疗服务、新能源等行业因良好的市场容量憧憬，估值水平进一步提升，同时主题投资也相对活跃。而与此形成鲜明对照的则是代表中国各行业中流砥柱的白马成长股则受到了市场的抛弃。在此背景下，市场近年来推崇的自下而上的选股策略亦受到了相当大的挑战。

本基金对宏观和中观经济的判断与现实并未出现偏差，但在坚守成长为王的投资风格上与市场的整体风格有所偏离，对组合管理最大的挑战来自于估值理解。尽管组合在医疗器械和服务、部分电子和信息技术等品种上获得了良好收益，同时期初组合就降低了更多依赖资本投入获取增长动力的品种比例，但是基于防御的策略，在医药和消费行业中，以业绩持续增长的稳定增长型公司的较高比例配置，以及基于内生良好增长性的重仓品种短期在收购重组上受阻的黑天鹅事件，均对组合构成了较大的负面影响。

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 0.919 元，本报告期份额净值增长率为-6.22%，同期业绩比较基准增长率为-7.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在经济底线思维下，政策正在持续释放微刺激的信号，其效应正在逐步累积过程中。但是我们也观察到稳增长也使债务有重新恶化的可能，去杠杆压力再现，从这方面又抑制了打破目前 A 股市场弱平衡的动能。从市场的流动性角度来观察，尽管有沪港通等有利因素，但至目前为止，仍是存量资金的游戏，因此整体风格上仍会和上半年较为相似，但局部会出现阶段性的差异分化。一方面低估值板

块仍会是较安全的避风港，但若基于流动性预期改善的角度，其上行空间亦有限。另一方面对成长股而言，由于投资者的结构年轻化，因此主题投资和新兴行业仍将受到推崇，但也在累积泡沫风险，而随着中报的披露，部分白马成长股会以数据证明其抵抗经济周期的能力，从长期看已具备一定的投资吸引力。

本基金下一阶段的操作思路仍将在消费服务相关的子行业内选择更积极的投资品种。尽管前期稳定增长型公司并未受到市场的青睐，但我们认为在经济有托底的假设下，真正使中国经济摆脱政策依赖路径，仍是一些具有核心竞争力的产业或公司，这些公司终将再次获得市场的认同，因此我们仍将坚持原先的选择，但同时我们也要对现有的市值估值体系重新反思，修正自下而上的选股思路的局限性，在沪港通、3D 打印、新能源汽车、优势传统加新兴转型等方面进行更积极的投资布局。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级

研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺混合、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利和华安大国新经济股票基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理，固定收益部副总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理，指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

（2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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服务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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华安安信消费服务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服务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，华安安信消费服务股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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服务股票型证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安安信消费服务股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	30,237,008.66	57,895,918.26
结算备付金		278,934.68	420,428.55
存出保证金		270,664.62	590,836.32
交易性金融资产	6.4.7.2	624,525,346.39	994,320,329.72
其中：股票投资		602,968,996.39	992,783,849.72
基金投资		-	-
债券投资		21,556,350.00	1,536,480.00
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	-	40,000,000.00
应收证券清算款		649,776.22	23,514,346.00
应收利息	6.4.7.5	63,277.71	36,666.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	98,817.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		656,025,008.28	1,116,877,343.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		468,366.43	-
应付赎回款		1,056,980.44	1,252,874.50
应付管理人报酬		811,186.75	1,414,800.57
应付托管费		135,197.80	235,800.10
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	324,141.28	513,252.78
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	6.4.7.8	2,167,579.55	2,313,721.81
负债合计		4,963,452.25	6,214,975.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	696,649,212.29	1,114,589,224.35
未分配利润	6.4.7.10	-45,587,656.26	-3,926,856.77
所有者权益合计		651,061,556.03	1,110,662,367.58
负债和所有者权益总计		656,025,008.28	1,116,877,343.37

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.919 元，基金份额总额 708,347,229.61 份。

6.2 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 5 月 23 日（基 金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-48,690,742.50	4,102,622.71
1.利息收入		356,686.63	7,057,224.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	255,280.04	149,352.58
债券利息收入		62,184.24	1,455,011.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,222.35	5,452,860.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		941,516.88	23,259,679.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,806,045.73	21,415,011.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-262,867.95
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	3,747,562.61	2,107,535.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-50,505,342.06	-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）	6.4.7.17	516,396.05	-
减：二、费用		9,335,190.73	4,947,298.24
1. 管理人报酬		6,212,175.98	3,565,077.08
2. 托管费		1,035,362.64	594,179.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,873,281.66	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	6.4.7.19	214,370.45	99,577.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,025,933.23	-844,675.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,025,933.23	-844,675.53

6.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 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）	1,114,589,224.35	-3,926,856.77	1,110,662,367.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-58,025,933.23	-58,025,933.23
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）	-417,940,012.06	16,365,133.74	-401,574,878.32

其中：1.基金申购款	16,604,273.07	-260,604.47	16,343,668.60
2.基金赎回款	-434,544,285.13	16,625,738.21	-417,918,546.92
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)	696,649,212.29	-45,587,656.26	651,061,556.03
项目	上年度可比期间 2013 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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 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：李勍，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安安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有关转换基金运作方

式决议》，基金安信由封闭式基金转为开放式基金。原基金安信为契约式封闭式基金，存续期限至 2013 年 5 月 22 日止。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。

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，共募集集中申购资金 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》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%。本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2014 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

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

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前, 对基

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	30,237,008.66
定期存款	-
其他存款	-
合计	30,237,008.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		509,266,449.82	602,968,996.39	93,702,546.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,623,343.10	1,582,350.00	-40,993.10
	银行间市场	19,986,460.00	19,974,000.00	-12,460.00
	合计	21,609,803.10	21,556,350.00	-53,453.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		530,876,252.92	624,525,346.39	93,649,093.47

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,688.67
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	112.95
应收债券利息	57,366.30
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.17
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	109.62
合计	63,277.71

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	323,941.28
银行间市场应付交易费用	200.00
合计	324,141.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	2,199.10
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	415,380.45
银行手续费	-
合计	2,167,579.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,133,405,165.62	1,114,589,224.35
本期申购	16,884,414.26	16,604,273.07
本期赎回（以“-”号填列）	-441,942,350.27	-434,544,285.13
本期末	708,347,229.61	696,649,212.29

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	-38,428,297.24	34,501,440.47	-3,926,856.77
本期利润	-7,520,591.17	-50,505,342.06	-58,025,933.23
本期基金份额交易产生的变动数	15,061,322.22	1,303,811.52	16,365,133.74
其中：基金申购款	-538,484.60	277,880.13	-260,604.47
基金赎回款	15,599,806.82	1,025,931.39	16,625,738.21
本期已分配利润	0.00	0.00	0.00
本期末	-30,887,566.19	-14,700,090.07	-45,587,656.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	245,596.20
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	6,591.91
其他	3,091.93
合计	255,280.04

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	734,223,752.52
减：卖出股票成本总额	737,029,798.25
买卖股票差价收入	-2,806,045.73

6.4.7.13 债券投资收益

无。

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 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,747,562.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,747,562.61

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	-50,505,342.06
——股票投资	-50,538,752.06
——债券投资	33,410.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-50,505,342.06

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	516,396.05
合计	516,396.05

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,873,081.66
银行间市场交易费用	200.00
合计	1,873,281.66

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	46,612.93
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	590.00
帐户维护费	18,000.00
其他费用	400.00
合计	214,370.45

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

本报告期关联方关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金”)	基金管理人、基金销售机构
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付	6,212,175.98	3,565,077.08

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	540,435.93	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：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年5月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,035,362.64	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：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2014 年 1 月 1 日 -2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 5 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	28,538,470.00
期初持有的基金份额	29,020,212.00	-
期间认购总份额	-	
期间申购/买入总份额	-	
期间因拆分增加的份额		481,742.00
期间赎回/卖出总份额		

期末持有的基金份额	29,020,212.00	29,020,212.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.10%	0.99%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的基金份 额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
上海国际信托有 限公司	18,303,848.00	2.58%	18,303,848.00	1.61%

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年5月23日(基金合同生效日) 至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	30,237,008.66	245,596.20	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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2014 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
300387	富邦 股份	2014-06-2 6	2014-07-0 2	新股中 签	20.48	20.48	500	10,240.00	10,240.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
----------	----------	----------	----------	----------------	----------	----------------	-----------	------------	------------	--------

300088	长信 科技	2014-0 3-13	重大资产 重组	19.49	2014-0 7-01	18.00	280,000	5,794,420.0 0	5,457,200.0 0	-
--------	----------	----------------	------------	-------	----------------	-------	---------	------------------	------------------	---

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。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。

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

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

6.4.13.2 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。

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，均能以合理价格适时变现。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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	30,237,008.66	-	-	-	30,237,008.66
结算备付金	278,934.68	-	-	-	278,934.68

结算保证金	270,664.62	-	-	-	270,664.62
交易性金融资产	19,974,000.00	1,582,350.00	-	602,968,996.39	624,525,346.39
应收证券清算款	-	-	-	649,776.22	649,776.22
应收利息	-	-	-	63,277.71	63,277.71
资产总计	50,760,607.96	1,582,350.00	-	603,682,050.32	656,025,008.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,056,980.44	1,056,980.44
应付证券清算款	-	-	-	468,366.43	468,366.43
应付管理人报酬	-	-	-	811,186.75	811,186.75
应付托管费	-	-	-	135,197.80	135,197.80
应付交易费用	-	-	-	324,141.28	324,141.28
其他负债	-	-	-	2,167,579.55	2,167,579.55
负债总计	-	-	-	4,963,452.25	4,963,452.25
利率敏感度缺口	50,760,607.96	1,582,350.00	-	598,718,598.07	651,061,556.03
上年度末 2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	57,895,918.26	-	-	-	57,895,918.26
结算备付金	420,428.55	-	-	-	420,428.55
存出保证金	590,836.32	-	-	-	590,836.32
交易性金融资产	-	1,536,480.00	-	992,783,849.72	994,320,329.72
买入返售金融资产	40,000,000.00	-	-	-	40,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	23,514,346.00	23,514,346.00
应收利息	-	-	-	36,666.78	36,666.78
应收申购款	-	-	-	98,817.74	98,817.74
资产总计	98,907,183.13	1,536,480.00	-	1,016,433,680.24	1,116,877,343.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,252,874.50	1,252,874.50
应付管理人报酬	-	-	-	1,414,800.57	1,414,800.57
应付托管费	-	-	-	235,800.10	235,800.10
应付交易费用	-	-	-	513,252.78	513,252.78
应交税费	-	-	-	484,526.03	484,526.03

其他负债	-	-	-	2,313,721.81	2,313,721.81
负债总计	-	-	-	6,214,975.79	6,214,975.79
利率敏感度缺口	98,907,183.13	1,536,480.00	-	1,010,218,704.45	1,110,662,367.58

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）	
		本期末	上年度末
		2014 年 6 月 30 日	2013 年 12 月 31 日
	市场利率下降25个基点	增加约5.73万元	-
	市场利率上升25个基点	减少约5.69万元	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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，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。本基金持有的股票资产占基金资产的 60%-95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	602,968,996.39	92.61	992,783,849.72	89.39
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	602,968,996.39	92.61	992,783,849.72	89.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约2,479.43万元	-
	2. 业绩比较基准下降5%	减少约2,479.43万元	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	602,968,996.39	91.91

	其中：股票	602,968,996.39	91.91
2	固定收益投资	21,556,350.00	3.29
	其中：债券	21,556,350.00	3.29
	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	30,515,943.34	4.65
7	其他各项资产	983,718.55	0.15
8	合计	656,025,008.28	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	431,817,646.95	66.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,143,759.80	1.25
E	建筑业	3,141,990.72	0.48
F	批发和零售业	10,646,400.00	1.64
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	89,529,913.80	13.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,760,095.08	2.88
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	21,975,190.04	3.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	18,954,000.00	2.91
	合计	602,968,996.39	92.61

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	600867	通化东宝	4,300,000	56,029,000.00	8.61
2	002250	联化科技	3,870,000	54,954,000.00	8.44
3	002450	康得新	2,390,000	54,372,500.00	8.35
4	300146	汤臣倍健	1,680,000	41,412,000.00	6.36
5	300273	和佳股份	1,250,000	38,375,000.00	5.89
6	600887	伊利股份	1,130,000	37,425,600.00	5.75
7	300017	网宿科技	460,000	29,348,000.00	4.51
8	002038	双鹭药业	637,000	28,391,090.00	4.36
9	002065	东华软件	1,050,000	21,126,000.00	3.24
10	600256	广汇能源	2,700,000	18,954,000.00	2.91
11	002400	省广股份	763,226	18,760,095.08	2.88
12	002008	大族激光	1,060,000	18,380,400.00	2.82
13	000625	长安汽车	1,490,000	18,341,900.00	2.82
14	002219	恒康医疗	800,000	17,584,000.00	2.70
15	600804	鹏博士	1,100,000	15,884,000.00	2.44
16	300244	迪安诊断	297,500	13,021,575.00	2.00
17	002271	东方雨虹	500,000	12,425,000.00	1.91
18	000661	长春高新	139,000	11,300,700.00	1.74
19	000963	华东医药	190,000	10,260,000.00	1.58
20	600571	信雅达	520,000	10,134,800.00	1.56
21	002004	华邦颖泰	496,000	9,225,600.00	1.42
22	300015	爱尔眼科	367,856	8,953,615.04	1.38
23	600587	新华医疗	111,014	8,276,093.70	1.27
24	600509	天富热电	1,009,140	8,143,759.80	1.25
25	600079	人福医药	211,275	6,306,558.75	0.97
26	002405	四维图新	350,000	5,817,000.00	0.89
27	300170	汉得信息	436,722	5,633,713.80	0.87
28	002437	誉衡药业	107,743	5,548,764.50	0.85
29	300088	长信科技	280,000	5,457,200.00	0.84
30	002491	通鼎光电	300,000	4,890,000.00	0.75
31	002081	金螳螂	221,892	3,141,990.72	0.48
32	002030	达安基因	160,000	3,112,000.00	0.48
33	002410	广联达	60,000	1,586,400.00	0.24
34	002251	步步高	30,000	386,400.00	0.06
35	300387	富邦股份	500	10,240.00	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	300002	神州泰岳	31,604,241.49	2.85
2	300017	网宿科技	24,755,690.15	2.23
3	000625	长安汽车	21,528,564.30	1.94
4	600323	瀚蓝环境	21,222,208.22	1.91
5	002400	省广股份	20,842,868.62	1.88
6	002085	万丰奥威	20,420,539.84	1.84
7	002405	四维图新	16,261,472.31	1.46
8	002439	启明星辰	16,052,115.96	1.45
9	002271	东方雨虹	13,262,850.28	1.19
10	002292	奥飞动漫	13,055,781.80	1.18
11	600187	国中水务	11,315,071.20	1.02
12	300085	银之杰	10,271,168.90	0.92
13	002450	康得新	10,045,914.59	0.90
14	002004	华邦颖泰	9,676,651.29	0.87
15	002475	立讯精密	8,901,889.39	0.80
16	600587	DR 新华医	8,894,688.54	0.80
17	000997	新大陆	8,481,363.02	0.76
18	600624	复旦复华	8,431,926.40	0.76
19	600571	信雅达	8,383,505.80	0.75
20	600509	天富能源	7,901,439.44	0.71

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	002250	联化科技	43,278,059.53	3.90
2	600518	康美药业	41,476,376.04	3.73
3	300070	碧水源	36,704,684.18	3.30
4	002236	大华股份	35,386,841.23	3.19
5	002241	歌尔声学	34,889,488.80	3.14
6	002450	康得新	32,210,207.00	2.90
7	300002	神州泰岳	28,383,213.31	2.56
8	300090	盛运股份	28,304,235.53	2.55

9	300015	爱尔眼科	25,089,704.21	2.26
10	002085	万丰奥威	20,171,704.13	1.82
11	300026	红日药业	20,007,030.96	1.80
12	600323	瀚蓝环境	18,993,930.95	1.71
13	600867	通化东宝	18,416,012.03	1.66
14	300335	迪森股份	18,329,699.84	1.65
15	000661	长春高新	17,297,687.38	1.56
16	002038	双鹭药业	16,749,874.71	1.51
17	000625	长安汽车	16,630,480.09	1.50
18	600887	伊利股份	15,210,045.05	1.37
19	600256	广汇能源	14,910,244.75	1.34
20	300273	和佳股份	14,287,520.20	1.29

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	397,753,696.98
卖出股票的收入（成交）总额	734,223,752.52

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	1,582,350.00	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,974,000.00	3.07
	其中：政策性金融债	19,974,000.00	3.07
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	21,556,350.00	3.31

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	140437	14 农发 37	200,000	19,974,000.00	3.07
2	010213	02 国债(13)	16,500	1,582,350.00	0.24

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

无。

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 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。

7.12.2 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	270,664.62
2	应收证券清算款	649,776.22
3	应收股利	-
4	应收利息	63,277.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	983,718.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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
45,096	15,707.54	94,101,049.33	13.28%	614,246,180.28	86.72%

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	-	-

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	1,133,405,165.62
本报告期基金总申购份额	16,884,414.26
减：本报告期基金总赎回份额	441,942,350.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	708,347,229.61

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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. 报告期内基金管理人的重大人事变动：无。
2. 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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 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

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	
光大证券股份有限公司	1	61,132,419.31	5.40%	55,654.87	5.52%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	351,741,268.68	31.08%	312,229.30	30.96%	-
海通证券股份有限公司	1	165,147,857.45	14.59%	150,349.75	14.91%	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	182,973,651.59	16.17%	161,913.51	16.06%	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国建设投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	370,903,612.47	32.77%	328,212.61	32.55%	-

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。

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
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国建设投资证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金开通邮储银行定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-01-06
2	关于旗下基金持有的“汤臣倍健”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-02-12
3	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-02-13
4	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-03-13
5	关于参加中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-03-28
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“和佳股份”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-04-30
7	关于电子直销平台“微钱宝”账户转换交易费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-10
8	关于公司董事、监事、高级管理人员以	《上海证券报》、《证	2014-06-12

	及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	券时报》、《中国证券报》和公司网站	
9	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2014-06-13

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安安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、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；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一四年八月二十九日