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 半年度 报告摘要

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。

基金托管人交通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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

原安顺证券投资基金本报告期自2014年1月1日起至5月11日止，华安安顺灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2014年5月12日（基金合同生效日）起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

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	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	3,748,357,091.15	
基金合同存续期	不定期	
安顺证券投资基金		
基金简称	华安安顺封闭	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	3,000,000,000	
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	1999-06-22	

2.2基金产品说明

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	
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。 在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量模型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。 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。 个股投资方面，本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选择选个股。
业绩比较基准	50%×中证800指数收益率＋50%×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。
安顺证券投资基金	
投资目标	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。
投资策略	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，在基金投资者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。
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱帼	王涛
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4信息披露方式

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、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

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2014年5月12日-2014年6月30日
本期已实现收益	20,875,424.37
本期利润	190,056,970.25
加权平均基金份额本期利润	0.0553
本期基金份额净值增长率	3.32%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末2014年6月30日
期末可供分配基金份额利润	0.0763
期末基金资产净值	3,844,089,481.57
期末基金份额净值	1.026

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.原安顺证券投资基金于2014年5月12日转型为安顺灵活配置混合型证券投资基金，截止本报告期末，安顺灵活配置混合型证券投资基金成立未满一年。

5.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。

3.1.2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
自基金合同生效起至今	3.32%	1.08%	0.01%	0.41%	3.31%	0.67%

注：本基金业绩比较基准：50%×中证800指数收益率＋50%×中国债券总指数收益率

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。

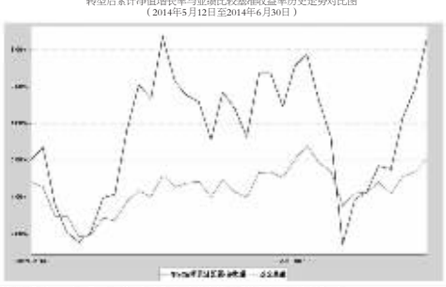
基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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 安顺证券投资基金

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	2014年1月1日-2014年5月11日
本期已实现收益	219,510,732.78
本期利润	-126,818,663.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0423
本期基金份额净值增长率	-4.05%
3.2.1.2 期末数据和指标	2014年5月11日
期末可供分配基金份额利润	0.0576
期末基金资产净值	3,172,904,977.06
期末基金份额净值	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，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	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
2014.4.11-2014.5.11	-6.37%	1.72%	-	-	-	-
2014.2.11-2014.5.11	-8.89%	2.02%	-	-	-	-
2013.11.11-2014.5.11	3.54%	2.21%	-	-	-	-
2013.5.11-2014.5.11	2.87%	2.07%	-	-	-	-
2011.5.11-2014.5.11	1.98%	2.05%	-	-	-	-
自基金成立-2014.5.11	741.99%	2.45%	-	-	-	-

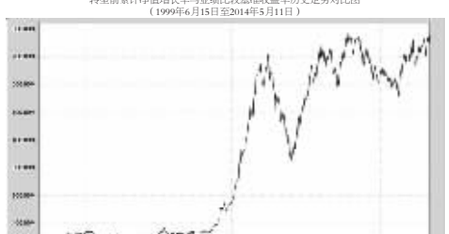
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

安顺证券投资基金

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

（1999年6月15日至2014年5月11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、华安可转换债券、华安沪深300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、华安中证细分城产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：1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《安顺证券投资基金基金合同》、《安顺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、交易执行等方面全面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，使用最会发言、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，独立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，超过授权范围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wind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、进行场外的非公开定向融资、参与股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合间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以股票的数量较小，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

今年上半年，A股市场走出了结构性分化行情，上证指数上半年下跌3.20%，中小板指数下跌3.72%，而创业板指数涨幅达到7.69%。行业涨幅差距巨大，涨幅最大的计算机行业和跌幅最大的采掘行业差距超过26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3.31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，报告期内，本基金由封闭式基金转型为开放式基金，转型前（2014.1.1-2014.5.11 ）增长率-4.05%，转型后（2014-5.12-2014.6.30）增长率+3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期公布的各项经济数据显示经济下行有所趋缓，但地产销售和投资数据持续下降，将给政府稳增长目标带来压力。管理层多次强调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，由于在上证指数与沪深300指数中，传统经济个股占据较大权重，这些指数持续走强的可能性较小，经济转型背景下成长股依然有较大的投资机会，从目前A股市场中消费、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，未来成长股的表现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进行配置。

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。

俞启扬，基金投资部董事全球投资总监，工业工程学硕士，曾在台湾IP证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008年4月加入华安基金管理有限公司，现任安香港精选、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。

倪鸿，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、债券投资决策委员会委员、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(国际衍数量金融工程师)，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、华安沪深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信息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序

本基金的基金经理高志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

本报告期内共实施一次分红，分红方案为：0.8元/10份，权益登记日：2014年4月10日，除息日：2014年4月11日(场内)，现金红利发放日：2014年4月17日。

§ 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

2014年上半年度，基金托管人在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）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014年上半年度，华安基金管理有限公司在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）投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配，分配金额为240,000,000元。

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

2014年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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）的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容，投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 安顺证券投资基金

6.1.1资产负债表

会计主体：安顺证券投资基金

报告截止日：2014年5月11日

单位：人民币元

资 产	2014年5月11日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	308,658.59	5,181,240.53
结算备付金	100,506,922.72	8,869,629.31
存出保证金	1,023,590.42	1,247,988.35
交易性金融资产	3,153,858,148.85	3,510,493,044.16
其中：股票投资	2,500,843,338.85	2,794,000,389.76
基金投资	-	-
债券投资	653,014,810.00	716,492,654.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	22,782,106.76
应收利息	21,220,082.51	16,135,578.45
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,276,917,403.09	3,564,709,587.56
负债和所有者权益	2014年5月11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	-	-
卖出回购金融资产款	96,999,734.50	16,208,732.65
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,463,297.43	4,408,545.28
应付托管费	243,882.91	734,757.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,263,269.35	2,393,011.98
应交税费	58,900.00	58,900.00
应付利息	25,671.63	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	957,670.21	1,181,999.20
负债合计	104,012,426.03	24,985,946.62
所有者权益：		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	172,904,977.06	539,723,640.94
所有者权益合计	3,172,904,977.06	3,539,723,640.94
负债和所有者权益总计	3,276,917,403.09	3,564,709,587.56

注：报告截止日2014年5月11日，基金份额净值1.0576元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.1.2利润表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月11日

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-95,889,365.28	125,874,699.70
1.利息收入	9,424,195.67	10,102,361.89
其中：存款利息收入	443,203.35	962,095.98
债券利息收入	8,980,992.32	9,140,265.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	240,906,836.51	225,338,325.41
其中：股票投资收益	232,459,443.31	198,778,004.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,968,079.20	673,599.10
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,479,314.00	25,886,721.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-346,329,396.66	-109,565,987.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	108,999.20	-
减：二、费用	30,929,298.60	35,329,816.10
1. 管理人报酬	18,938,310.48	23,921,672.67
2. 托管费	3,156,385.16	3,986,945.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,231,690.65	7,184,434.43
5. 利息支出	684,025.10	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	918,887.21	236,763.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-126,818,663.88	90,544,883.60
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列	-126,818,663.88	90,544,883.60

6.1.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年5月11日

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11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）	3,000,000,000.00	539,723,640.94	3,539,723,640.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-126,818,663.88	-126,818,663.88
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）	-	-240,000,000.00	-240,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	172,904,977.06	3,172,904,977.06

项目	上年度可比期间 2013年1月1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）	3,000,000,000.00	27,869,355.04	3,027,869,355.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,544,883.60	90,544,883.60
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）	3,000,000,000.00	118,414,238.64	3,118,414,238.64

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：李勋，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

安顺证券投资基金（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）和浙江证券有限责任公司（后更名为方正证券有限责任公司）四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》（后更名为《安顺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[1999]15号文批准，于1999年6月15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30亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1999)第36号文审核同意，于1999年6月22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(1999)15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、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%。

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。

6.1.4.2 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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金会计核算业务指引》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金会计科目及财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及华安基金公司有关会计实务操作编制。

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2014年上半年度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5月11日(基金合同失效前日)的财务状况以及2014年1月1日至2014年5月11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 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。

6.1.4.5 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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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 关联方关系

6.1.4.7.1 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。

6.1.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金发起人、基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
方正证券有限责任公司（“方正证券”）	基金发起人
上海国际信托有限公司（“上海国际信托”）	基金发起人、基金管理人的股东

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。

6.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.8.1.1股票交易

无。

6.1.4.8.1.2权证交易

无。

6.1.4.8.1.3债券回购交易

无。

6.1.4.8.1.4应支付关联方的佣金

无。

6.1.4.8.2关联方报酬

6.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	2014年1月1日-2014年5月11日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,938,310.48	23,921,672.67
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%（由于表出回购证