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:二〇一五年八月二十八日

华安中小盘成长股票型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

§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2015年8月26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。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安中小盘成长股票	
基金主代码	040007	
交易代码	040007(前端)	041007(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年4月10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	2,001,309,297.24份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。
投资策略	主要依靠基金管理人的研究优势,将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中。在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上,积极把握备选股票的投资机会,为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
业绩比较基准	40%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×中债-国债总指数
风险收益特征	本基金是积极成长型股票基金,属于证券投资基金中的较高风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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	蒋松云
	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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	3,344,812,933.86
本期利润	2,525,685,972.10
加权平均基金份额本期利润	0.7513
本期基金份额净值增长率	62.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.3181
期末基金资产净值	3,663,712,531.60
期末基金份额净值	1.8307

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、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

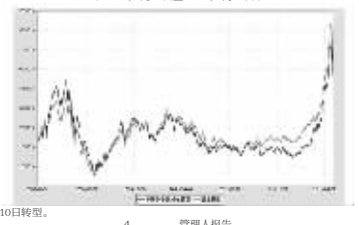
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.25%	3.31%	-12.21%	2.96%	5.96%	0.36%
过去三个月	25.91%	2.54%	18.93%	2.24%	6.98%	0.30%
过去六个月	62.79%	2.10%	58.05%	1.77%	4.74%	0.33%
过去一年	114.57%	1.68%	88.79%	1.39%	25.78%	0.29%
过去三年	95.88%	1.39%	102.68%	1.19%	-6.80%	0.20%
自基金成立起至今	99.82%	1.61%	110.18%	1.57%	-10.36%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

根据本基金合同的有关规定,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或金融衍生工具,其中,股票投资比例为基金资产的60-95%,股票资产中的80%以上投资于中国A股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票;债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为0-40%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产的比例在5%以上。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中小盘成长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
(2007年4月10日至2015年6月30日)



注:本基金于2007年4月10日转型。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2015年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金(LOF)、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安护深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克100指数、华安黄金易(ETF)、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF、华安大国新经济、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头(DAX)ETF、华安国际龙头(DAX)ETF联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药ETF联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新动力灵活配置、华安新丝路主题股票、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新回报灵活配置、华安新机遇保本、华安新优选灵活配置、华安中证银行指数分级、华安中证全指证券公司指数分级、华安添颐养老混合发起式、华安国企改革主题灵活配置等67只开放式基金。管理资产规模达到1214.76亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴丰树	本基金的基金经理	2013-02-22	-	12年	硕士研究生,12年证券、基金行业从业经历,曾在中华会计师事务所证券部任研究员、华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011年3月份加入华安基金管理有限公司,2011年7月至2013年5月担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。2012年10月起同时担任华安行业轮动股票型证券投资基金的基金经理,2013年2月起担任本基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。
陈逊	本基金的基金经理	2014-01-03	2015-06-26	13年	上海财经大学MBA,13年证券、基金行业从业经验,历任大鹏证券研究所、世纪证券研究所、平安证券研究所研究员、高级研究员。2008年3月加入华安基金管理有限公司,先后在投资研究部和基金投资部担任高级研究员及基金经理助理职务。2012年5月至2014年4月担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理;2013年3月起担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2014年1月起担任本基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年12月起同时担任华安科技动力股票型证券投资基金的基金经理。2015年5月起担任华安媒体互联网混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月离开华安基金。

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《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》、《华安中小盘成长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、邮件发送、登录在研究投资管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会;在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配,综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了1次,原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量极少,但由于个股流动性较差,交易量稀少,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,市场趋势性上行。沪深300指数期间涨幅约27%。但市场结构差异十分明显。创业板指数涨幅高达94%,相较之下,中证100指数的涨幅仅约17%。一些主题或概念性的板块涨幅更是惊人,如互联网金融、网络安全、智能汽车、卫星导航等半年涨幅超过150%。从行业来看,计算机、轻工制造、纺织服装等涨幅居前,银行、非银金融、有色等表现则相对落后。尽管经济数据和企业盈利一股,但在改革与创新的大潮下,投资者入市积极,大量的增量资金不断涌入股市,造成市场成交异常活跃,日均成交额节节攀升,最高时超过2万亿元,创造了中国股市成交量的历史记录。由于市场形成了巨大的赚钱效应,不仅场内融资余额不断攀升,较为隐蔽的场外配资也变得十分活跃,给市场带来巨大的隐患。6月份,受监管机构严查场外配资的影响,创业板率先调整,带动主板跟随下挫,短短十几个交易日,创业板指数跌幅高达30%,其跌幅之大、速度之快远超投资者预期,市场出现投资者的恐慌情绪蔓延,并引发市场出现流动性危机。高杠杆所导致的高波动率成为上半年股市的主要特征之一。

本基金期间净值表现跑赢比较基准,相对市场同类型基金表现良好。我们在前期市场上涨过程中配置了较多的成长股和中小市值股票,后期考虑到市场累积风险过高,可能会出现大幅度调整,对组合进行了调整,增加了低估值蓝筹股的持仓,大幅度降低了高估值的成长股和流动性较差的中小市值股票的配置。在6月份股市大跌中积累了较多的相对优势。我们对汽车的超配不是很成功,但对休闲服务的超配和对食品饮料的低配取得较好的正面效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.8307元,本报告期份额净值增长率为62.79%,同期业绩比较基准增长率为58.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断下半年市场难以趋势性上行,大幅下跌的风险也不大,很有可能宽幅震荡。我们坚信改革和创新需要稳定和健康的资本市场。政府的大力救市已经取得成效,市场的流动性危机已基本化解,投资者的极度悲观情绪得以消除。在经历大幅度下跌之后,中小市值股票的估值泡沫已明显缩小,市场整体估值风险并不大。我们判断,宏观经济仍将保持稳定态势,货币环境仍将维持宽松局面。利率市场化过后,居民部门存款搬家的大趋势也不会改变。市场趋势性的上行则受制于:经过刚刚去杠杆后,整体投资者的风险偏好的显著降低;救市资金的退出时机。我们认为,股市融资限制迟早会放开,下半年股市对资金的需求会持续增加。在具体投资上,我们希望重点选择那些盈利能够实质性改善的公司,回避那些故事型的伪成长股,去伪存真。与此同时,我们也会积极关注国企改革可能带来的投资机会。

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:基金投资部高级总监、研究发展部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

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

相关人员专业胜任能力及工作经历:

翁启森,基金投资部兼全球投资部高级总监,总经理助理,工业工程学硕士。曾在台湾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,现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安宏利股票、华安大国新经济股票、华安安顺灵活配置混合、华安物联网股票、华安宝利配置、华安生态优先股票的基金经理,华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

杨明,投资研究部高级总监,研究生学历,15年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任华安优选的基金经理,投资研究部高级总监。

贺涛,金融学硕士,固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安现金富利货币、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置的基金经理,固定收益部总监。

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

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

(2)托管银行

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

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对华安中小盘成长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,华安中小盘成长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中小盘成长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,华安中小盘成长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中小盘成长股票型证券投资基金2015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:华安中小盘成长股票型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	114,974,420.17	100,430,996.54
结算备付金	14,285,509.46	12,586,693.66
存出保证金	2,068,757.05	1,785,394.02
交易性金融资产	3,569,219,705.10	4,957,093,852.66
其中:股票投资	3,438,449,705.10	4,705,618,852.66
基金投资	-	-
债券投资	120,770,000.00	251,475,000.00
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	105,488,144.81	-
应收利息	1,418,088.00	6,715,934.68
应收股利	-	-
应收申购款	2,525,629.10	918,982.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,799,980,253.69	5,079,531,852.93
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	35,788,945.07
应付赎回款	116,760,210.44	22,823,630.95
应付管理人报酬	5,486,436.92	6,385,147.89
应付托管费	914,396.16	1,064,191.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,097,685.31	5,925,959.79
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,009,053.26	1,259,101.52
负债合计	136,267,722.09	73,246,976.51
所有者权益:		
实收基金	864,531,900.02	1,922,960,463.32
未分配利润	2,799,180,631.58	3,083,324,413.10
所有者权益合计	3,663,712,531.60	5,006,284,876.42
负债和所有者权益总计	3,799,980,253.69	5,079,531,852.93

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.8307元,基金份额总额2,001,309,297.24份。

6.2 利润表

会计主体:华安中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	2,601,527,597.65	-211,296,881.43
1.利息收入	5,486,436.56	8,687,993.70
其中:存款利息收入	623,114.12	976,971.38
债券利息收入	4,863,322.43	3,632,330.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	4,078,701.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,414,474,970.91	-214,426,082.64
其中:股票投资收益	3,391,627,402.28	-238,839,812.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,422,570.04	1,852,277.45
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	15,424,998.59	22,561,452.57
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-819,126,961.76	-5,691,464.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	693,151.95	133,672.19
减:二、费用	75,841,625.55	55,830,373.02
1. 管理人报酬	36,373,834.29	33,350,143.79
2. 托管费	6,062,305.73	5,558,357.27
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	32,968,653.88	16,680,326.12
5. 利息支出	214,949.55	12,835.37
其中:卖出回购金融资产支出	214,949.55	12,835.37
6. 其他费用	221,882.10	228,710.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,525,685,972.10	-267,126,254.45
减:所得税费用	-	-
四、净利润(亏损以"-"号填列)	2,525,685,972.10	-267,126,254.45

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,922,960,463.32	3,083,324,413.10	5,006,284,876.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,525,685,972.10	2,525,685,972.10
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)	-1,058,428,563.30	-2,809,829,753.62	-3,868,258,316.92
其中:1.基金申购款	147,248,590.65	416,202,149.00	563,450,739.65
2.基金赎回款	-1,205,677,153.95	-3,226,031,902.62	-4,431,709,056.57
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)	864,531,900.02	2,799,180,631.58	3,663,712,531.60
项目	上年度可比期间 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)	2,394,595,335.99	2,604,633,780.86	4,999,229,116.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-267,126,254.45	-267,126,254.45
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)	-198,779,983.69	-196,309,923.33	-395,089,907.02
其中:1.基金申购款	8,622,532.41	8,405,723.27	17,028,255.68
2.基金赎回款	-207,402,516.10	-204,715,646.60	-412,118,162.70
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)	2,196,815,352.30	2,141,197,603.08	4,337,012,955.38

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:章国富,会计机构负责人:陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中小盘成长股票型证券投资基金是根据原安瑞证券投资基金(以下简称"基金安瑞")基金份额持有人大会2007年3月1日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并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[2007]81号《于核准安瑞证券投资基金分额持有人大会决议的批复》核准,由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金,于上海证券交易所以下简称"上交所")交易上市,存续期限至2007年6月30日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字[2007]21号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》,原基金安瑞于2007年4月9日进行终止上市权利登记,自2007年4月10日起,原基金安瑞终止上市,更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时,《华安中小盘成长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。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币1,060,436,162.37元,已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于2007年4月18日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:2.314909165,并于2007年4月18日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于2007年4月16日开放集中申购,其募集人民币9,883,484,414.21元,业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第11233号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已校2007年4月18日基金份额转换后的基金份额净值1.0000元折合为9,883,484,414.21份基金份额,并于2007年4月18日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长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或金融衍生工具。其中,股票投资比例为基金资产的60%-95%,股票资产中的80%以上投资于中国A股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票;债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为0-40%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产的比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为:天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债?国债总指数×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2015年8月27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日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》各项具体会计准则及相关规定(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》、《华安中小盘成长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2015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2015年6月30日的财务状况以及2015上半年度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

除下述会计估计变更的说明以外,本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间,不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

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[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》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税;自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内未发生变化。

6.4.7.2 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	基金管理人、注册登记机构、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、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

无。

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	36,373,834.29	33,350,143.79
其中:支付销售机构的客户维护费	6,684,517.49	6,512,751.41

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,062,305.73	5,558,357.27

注:支付基金托管人中国工商银行的基金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