# 华安双债添利债券型证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日**

### §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2013年10月18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2013年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华安双债添利债券 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年6月14日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 734,626,169.29份 | |
| 投资目标 | 在合理控制风险的前提下,通过主动管理充分捕捉可转债和信用债市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金主要捕捉可转债和信用债市场中的投资机会。基于此目标,本基金将充分发挥基金管理人的研究优势,将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整固定收益类资产配置比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上,综合考量可转债的内在价值、信用债的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。 | |
| 业绩比较基准 | 天相可转债指数收益率×40%+中债企业债总指数收益率×40%+中债国债总指数收益率×20%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中中等风险的品种,其预期的风险收益水平低于股票基金和混合基金,高于货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华安双债添利债券A | 华安双债添利债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 000149 | 000150 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 647,045,819.43份 | 87,580,349.86份 |

### §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

| 主要财务指标 | 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 华安双债添利债券A | 华安双债添利债券C |
| 1.本期已实现收益 | 7,069,104.36 | 1,052,842.11 |
| 2.本期利润 | 6,480,193.01 | 940,226.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0071 | 0.0064 |
| 4.期末基金资产净值 | 652,324,567.86 | 88,229,401.70 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.008 | 1.007 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1、华安双债添利债券A:

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.50% | 0.13% | -0.46% | 0.23% | 0.96% | -0.10% |

2、华安双债添利债券C:

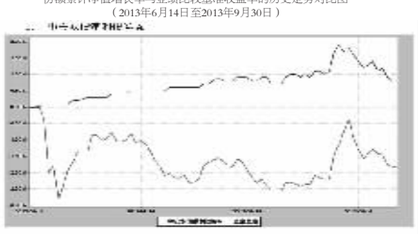
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.40% | 0.13% | -0.46% | 0.23% | 0.86% | -0.10% |

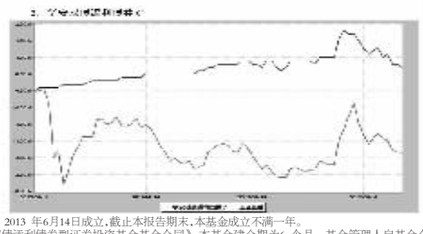
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安双债添利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年6月14日至2013年9月30日)





注:1、本基金于 2013 年6月14日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2、根据《华安双债添利债券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。

### §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 | | |
| 贺涛 | 本基金的基金经理、固定收益部副总监 | 2013-6-14 | - | 16年 | 金融学硕士(金融工程方向),16年证券、基金从业经历。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。2008年4月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月起同时担任本基金的基金经理。2013年8月起担任固定收益部副总监。 |

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 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《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。

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0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

三季度,美联储意外推迟QE退出、叠加政府关门、债务上限等问题,美债收益率回落、但仍高于二季末水平,金融市场波动率上升。日元汇率和日经指数宽幅震荡、资金持续流出新兴市场。国内,"钱慌"过后,"GDP7%下限、CPI3.5%上限"的政策基调逐渐稳定住市场预期,资金价格回落、企业回补库存,经济触底反弹。受异常高温天气影响,CPI温和回升,而PPI同比跌幅在过去几个月逐步收窄。社会融资总量一度出现明显回落,而八月数据显示其重新扩张,M2同比增速仍偏离年初预定的13%增长目标。货币政策维持中性,暂停正回购操作、重启逆回购操作,但对到期3年期央票进行续发,央行对公开市场资金进行"锁长放短"。货币市场利率在三季度初回落后,在相对上半年高的平台整理,市场对于资金面的预期依然谨慎,商业银行超储率有所提高。债市监管仍在进行中,债市交投清淡,保险、银行理财资金加大高收益率的"非标"资产配置的同时,压缩了债券投资。利率债需求疲弱,一级市场发行利率不断走高,并带动二级市场收益率抬升,信用债收益率上升,信用利差收窄。受外部评级调降、质押回购资格丧失和退市风险上升等因素影响,交易所出现了数量较多、收益率较高的中国式"垃圾债"。股票市场触底反弹,创业板指数屡创新高,主题投资盛行。可转债在三季度小幅波动,收益小胜纯债,不及股市主题性机会。

双债添利基金仍处于建仓期,通过一级市场对部分信用债进行了配置,逢低增持了可转债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,华安双债添利债券A份额净值为1.008元,C份额净值为1.007元;华安双债添利债券A份额净值增长率为0.50%,C份额净值增长率为0.40%,同期业绩比较基准增长率为-0.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,欧美经济复苏或将改善外部需求,但在投资增速继续回落、居民收入放缓对消费增速抑制以及"防风险、稳增长、促转型"政策基调的影响下,预计国内经济增速将略有回落。在"盘活存量、用好增量"的政策思路下,货币政策还将维持中性偏紧,社会融资总量增速或将放缓。受去年同期低基数影响,CPI将温和回升至3%以上。美财政问题冲击,美国QE可能从12月或明年年初才开始退出,外汇占款将延续恢复势头,此外财政存款在四季度会出现季节性投放,因此四季度国内流动性将较为平稳。四季度利率债的供给压力不会明显缓解,特别是政策性金融债品种的压力还可能增加,而利率债配置需求仍然没有明显恢复。信用债短期品种收益率随利率市场波动已基本完成了调整,但长期和低等级品种价格反映滞后。城投债待10月审计结果公布后,供给或将放量。可转债总体性机会或相对有限,但市场整体估值依然偏低,且随着新券上市,因行业和正股不同,个券表现差异将拉大。下阶段,我们将择机把握信用债收益率上升后出现的配置机会,动态调整可转债仓位。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 420,905,300.46 | 55.92 |
| | 其中:债券 | 420,905,300.46 | 55.92 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 269,380,844.07 | 35.79 |
| | 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 | 59,997,946.13 | 7.97 |
| 6 | 其他各项资产 | 2,373,877.48 | 0.32 |
| 7 | 合计 | 752,657,968.14 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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 | 10,015,000.00 | 1.35 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 55,050,241.34 | 7.43 |
| 5 | 企业短期融资券 | 80,014,000.00 | 10.80 |
| 6 | 中期票据 | 10,078,000.00 | 1.36 |
| 7 | 可转债 | 265,748,059.12 | 35.89 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 420,905,300.46 | 56.84 |

5.5 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 | 110016 | 川投转债 | 530,020 | 67,111,132.40 | 9.06 |
| 2 | 110023 | 民生转债 | 510,110 | 53,974,739.10 | 7.29 |
| 3 | 113002 | 工行转债 | 414,650 | 45,955,659.50 | 6.21 |
| 4 | 113001 | 中行转债 | 447,890 | 44,802,436.70 | 6.05 |
| 5 | 110022 | 同仁转债 | 277,710 | 37,115,941.50 | 5.01 |

5.6 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。

5.7 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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 17,288.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,335,374.13 |
| 5 | 应收申购款 | 21,215.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,373,877.48 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110016 | 川投转债 | 67,111,132.40 | 9.06 |
| 2 | 110023 | 民生转债 | 53,974,739.10 | 7.29 |
| 3 | 113002 | 工行转债 | 45,955,659.50 | 6.21 |
| 4 | 113001 | 中行转债 | 44,802,436.70 | 6.05 |
| 5 | 110022 | 同仁转债 | 37,115,941.50 | 5.01 |
| 6 | 110018 | 国电转债 | 16,579,378.00 | 2.24 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 华安双债添利债券A | 华安双债添利债券C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,127,577,329.13 | 219,468,733.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 812,189.31 | 5,182,755.87 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 481,343,699.01 | 137,071,139.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 647,045,819.43 | 87,580,349.86 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期本公司没有运用固有资金投资本基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安双债添利债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安双债添利债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安双债添利债券型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**
**二〇一三年十月二十四日**

# 景顺长城品质投资股票型证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9月30日

**基金管理人:景顺长城基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:2013年10月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月23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2013年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 景顺长城品质投资股票 | |
| 基金主代码 | 000020 | |
| 交易代码 | 000020 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年3月19日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 529,123,967.62份 | |
| 投资目标 | 通过采用品质投资(Quality investing)策略,投资于具备卓越企业品质资质的公司,分享其在中国经济增长的大背景下的可持续性增长,以实现基金资产的长期资本增值。 | |
| 投资策略 | 资产配置:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。<br>股票投资策略:本基金股票投资主要遵循"自下而上"的个股投资策略,利用基金管理人股票研究数据库(SRD)对企业进行深入细致的分析,并进一步挖掘出具有较强品质资质的公司,并辅以财务指标进行品质投资分析。<br>债券投资策略:债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。<br>股指期货投资策略:本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×80%+中证全债指数×20%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,属于风险程度较高的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。 | |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |

### §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

| 主要财务指标 | 报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 26,937,629.17 |
| 2.本期利润 | 48,864,496.51 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0738 |
| 4.期末基金资产净值 | 571,512,907.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.080 |

注:1、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。

2、上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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 5.47% | 1.31% | 7.37% | 1.15% | -1.90% | 0.16% |

3.2.2 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

注:本基金的资产配置比例为:本基金将基金资产的60%-95%投资于股票等权益类资产(其中,股票投资比例不低于基金资产的60%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%),将基金资产的5%-40%投资于债券和现金等固定收益类品种(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%)。本基金的建仓期为自2013年3月19日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合比例达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日(2013年3月19日)起至本报告期末不满一年。

### §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 | | |
| 余广 | 本基金基金经理、景顺长城能源基建股票型证券投资基金基金经理,景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金基金经理,股票投资部投资副总监 | 2013年3月19日 | - | 9 | 银行和金融工商管理硕士,中国注册会计师、曾先后担任起亚中华会计师事务所审计项目经理、杭州中融投资管理有限公司财务顾问项目经理、世纪证券综合研究所研究员、中银国际(中国)证券风险管理部高级经理等职务。2005年1月加入本公司,担任研究员等职务;自2010年5月起担任基金经理。 |

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写,"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,"任职日期"指根据公司决定聘任后的公告日期,"离任日期"指根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城品质投资股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

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

中国上半年经济处于回落态势,7、8月份经济在稳增长、海外需求回暖、特别是补库存等因素影响下出现了明显反弹;政策方面,管理层强调经济复苏的形势仍然比较复杂,在稳增长的同时积极推进改革,但不会大规模刺激经济。我们观察到的数据显示经济仍在弱复苏通道,考虑到未来房地产投资可能放缓、消费环比增速未见明显改善,预计4季度经济相对平稳,经济继续回升的幅度比较有限。从流动性来看,3季度有所改善,在央行的干预下,短端的利率水平比较稳定,季末冲击不大,但实际上整个利率中枢已经被抬高。资本市场的表现来看,三季度沪深300指数上涨9.47%,创业板指数上涨35.21%,周期股与成长股的表现进一步分化,以传媒、电子、计算机为代表经济转型方向的新兴产业继续强势上涨,上海自贸区相关的题材股也表现不俗。

本基金通过采用品质投资(Quality investing)策略,投资于具备卓越企业品质资质的公司,分享企业长期稳定的盈利增长,由此以获取投资收益,实现基金资产的长期资本增值。3季度本基金完成了建仓计划,逐步买入具有长期竞争优势、增长持续稳健、管理优秀且估值相对便宜或者合理的个股,以长期持有的方式,力争获取长期投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年3季度,本基金份额净值增长率为5.47%,低于业绩比较基准收益率1.90%。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 510,241,179.52 | 88.76 |
| | 其中:股票 | 510,241,179.52 | 88.76 |
| 2 | 固定收益投资 | 29,448,000.00 | 5.12 |
| | 其中:债券 | 29,448,000.00 | 5.12 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 34,089,651.44 | 5.93 |
| 6 | 其他资产 | 1,050,257.86 | 0.18 |
| 7 | 合计 | 574,829,088.82 | 100.00 |

5.2 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 | 276,154,230.56 | 48.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 53,542,000.00 | 9.37 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 23,810,000.00 | 4.17 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 111,416,948.96 | 19.50 |
| 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 | - | - |
| 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 | 45,318,000.00 | 7.93 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 510,241,179.52 | 89.28 |

5.3 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 | 300251 | 光线传媒 | 700,000 | 45,318,000.00 | 7.93 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 1,700,000 | 45,152,000.00 | 7.90 |
| 3 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,100,000 | 44,451,000.00 | 7.78 |
| 4 | 002572 | 索菲亚 | 2,000,944 | 39,898,823.36 | 6.98 |
| 5 | 002303 | 美盈森 | 1,000,000 | 38,780,000.00 | 6.79 |
| 6 | 000024 | 招商地产 | 1,599,922 | 38,398,128.00 | 6.72 |
| 7 | 600332 | 白云山 | 900,000 | 32,022,000.00 | 5.60 |
| 8 | 600066 | 宇通客车 | 1,700,000 | 31,280,000.00 | 5.47 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 3,000,000 | 29,640,000.00 | 5.19 |
| 10 | 002325 | 洪涛股份 | 3,000,000 | 29,430,000.00 | 5.15 |

5.4 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 29,448,000.00 | 5.15 |
| | 其中:政策性金融债 | 29,448,000.00 | 5.15 |
| 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 | 29,448,000.00 | 5.15 |

5.5 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 | 130410 | 13农发10 | 300,000 | 29,448,000.00 | 5.15 |

5.6 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。

5.7 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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。

时点选择:基金管理人在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 266,362.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 310,523.72 |
| 5 | 应收申购款 | 473,371.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,050,257.86 |

5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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在在流通受限的情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 871,979,402.81 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 74,396,136.15 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 417,251,571.34 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 529,123,967.62 |

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城品质投资股票型证券投资基金设立的文件;

2、《景顺长城品质投资股票型证券投资基金基金合同》;

3、《景顺长城品质投资股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《景顺长城品质投资股票型证券投资基金托管协议》;

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

8.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

**景顺长城基金管理有限公司**
**2013年10月24日**

# 华安易富黄金交易型开放式证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013年9月30日

**基金管理人:华安基金管理有限公司**
**基金托管人:中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一三年十月二十四日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月18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2013年7月18日(基金合同生效日)起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华安黄金易(ETF) |
| 基金主代码 | 518880 |
| 交易代码 | 518880 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2013年7月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 137,740,847份 |
| 投资目标 | 本基金的投资目标主要是紧密跟踪国内黄金现货价格的表现。 |
| 投资策略 | 本基金通过将绝大部分基金财产投资并持有上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约等黄金品种,来实现跟踪国内黄金现货价格表现的目标。若因特殊情况(如上海黄金交易所市场流动性不足、黄金现货合约存量不足、法律法规禁止或限制等)导致无法获得足够数量的黄金现货合约时,基金管理人将采用合理方法进行替代投资,以达到跟踪国内黄金现货价格的目的。<br>为更好地实现投资目标,本基金可以适当参与流动性好、交易活跃的黄金现货延期交收合约和黄金远期。在风险可控的前提下,本基金本着审慎原则,主要以提高投资效率、降低交易成本、风险管理等为目的,而非用于投机。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为国内黄金现货价格收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于黄金ETF,其风险收益特征与国内黄金现货价格的风险收益特征相似,不同于股票基金、混合基金、债券基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

### §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

| 主要财务指标 | 报告期(2013年7月18日-2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -2,543,146.31 |
| 2.本期利润 | -7,101,181.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0444 |
| 4.期末基金资产净值 | 365,405,869.37 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.653 |

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