华安香港精选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: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。

基金托管人中国工商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	华安香港精选股票(QDII)
基金主代码	040018
交易代码	040018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月19日
报告期末基金份额总额	182,453,666.08份
投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上,追求中长期资本增值,力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金以价值和成长投资理念为导向,采用"自上而下"和"自下而上"相结合的选股策略。通过对于经济周期的跟踪和研究,以及对于地区资源禀赋比较,对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期,选择优势行业作为主要投资目标。同时通过对香港市场和具有中国概念的股票基本面的分析和研究,考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平,挖掘具备中长期持续增长或阶段性高速成长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。
业绩比较基准	MSCI中华指数(MSCI Zhong Hua Index)
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金和债券型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。
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
境外资产托管人英文名称	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
境外资产托管人中文名称	香港上海汇丰银行有限公司

§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	-4,001,220.13
2.本期利润	12,654,092.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0661
4.期末基金资产净值	169,799,334.88
5.期末基金份额净值	0.931

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。

3.2 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

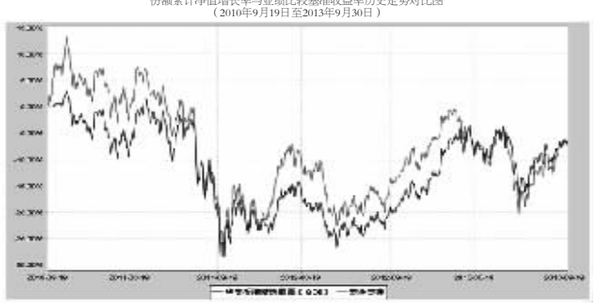
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.63%	0.95%	9.76%	1.02%	-2.13%	-0.07%

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

华安香港精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年9月19日至2013年9月30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		
翁启森	本基金的基金经理,基金投资部兼全球投资部总监	2010-9-19	-	17年	工业工程学硕士,17年证券、基金行业从业经历,具有中国大陆基金从业资格,曾在台湾JF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,任全球投资部总监,2010年9月起担任本基金的基金经理,2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理,2013年6月起担任基金投资部兼全球投资部总监。
苏圻涵	本基金的基金经理	2010-9-19	-	9年	博士研究生,9年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书,2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务,目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起担任本基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。

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遵规守信情况说明

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。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

2013年三季度,前期由于QE退出预期大幅调整的风险资产价格出现较大幅度反弹,大宗商品、黄金、股票、发达国家国债均显著上升。

在欧元区经济触底反弹预期推动下,欧元区股票显著跑赢全球股市,同时QE退出延期,也推升新兴市场股票,期内Stoxx50指数累计上涨11.16%,MSCI新兴市场指数上涨5.01%,而标普500指数累计上涨4.68%。

在QE退出延迟,以及3季度中国经济企稳回升的推动下,香港市场显著跑赢亚太新兴市场,期内恒生指数上涨9.88%,恒生国企指数上涨10.79%。

报告期内,基金超配盈利增长确定,估值合理,受益于中国经济结构转型和消费升级的,医药、必选消费、可选消费,低配银行、地产、电信、能源、原材料和公用事业板块。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.931元,本报告期份额净值增长率为7.63%,同期业绩比较基准增长率为9.76%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	152,648,618.49	87.86
	其中:普通股	151,993,979.45	87.49
	存托凭证	654,639.04	0.38
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,175,816.12	11.61
8	其他各项资产	910,479.81	0.52
9	合计	173,734,914.42	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	144,837,360.55	85.30
中国台湾	7,156,618.90	4.21
美国	654,639.04	0.39
合计	152,648,618.49	89.90

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	37,767,711.32	22.24
信息技术	23,362,762.77	13.76
非必需消费品	21,504,632.00	12.66
工业	19,038,719.51	11.21
能源	10,931,008.50	6.44
公共事业	10,602,321.06	6.24
必需消费品	10,332,773.03	6.09
保健	9,374,974.17	5.52
电信服务	6,900,922.44	4.06
材料	2,832,793.69	1.67
合计	152,648,618.49	89.90

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港	中国香港	34,000	10,966,343.54	6.46
2	China Singyes Solar Technologies Holdings Limited	中国兴业太阳能技术控股有限公司	750 HK	香港	中国香港	752,000	5,145,536.01	3.03
3	China Petroleum And Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港	中国香港	962,200	4,630,800.05	2.73
4	Hisense Kelon Electrical Holdings Company Limited	海信科龙电器股份有限公司	921 HK	香港	中国香港	999,000	4,498,998.10	2.65
5	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港	中国香港	92,500	4,228,078.38	2.49
6	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港	中国香港	574,000	4,218,845.41	2.48
7	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港	中国香港	1,502,000	4,215,753.22	2.48
8	China Mengniu Dairy Company Limited	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港	中国香港	144,000	3,967,521.48	2.34
9	Haitong Securities CO.,LTD.	海通证券股份有限公司	6837 HK	香港	中国香港	425,600	3,907,618.57	2.30
10	Goodbaby International Holdings Limited	好孩子国际控股有限公司	1086 HK	香港	中国香港	1,221,000	3,775,567.65	2.22

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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,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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	686,113.87
3	应收股利	215,701.71
4	应收利息	529.79
5	应收申购款	8,134.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	910,479.81

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	196,977,418.03
本报告期基金总申购份额	847,646.11
减:本报告期基金总赎回份额	15,371,398.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	182,453,666.08

§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、《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安香港精选股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安香港精选股票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

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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	华安上证龙头ETF
基金主代码	510190
交易代码	510190
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年11月18日
报告期末基金份额总额	257,650,796份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,即完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证龙头企业指数
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。
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

§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	1,665,471.74
2.本期利润	35,578,219.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1336
4.期末基金资产净值	534,962,010.63
5.期末基金份额净值	2.076

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。

3.2 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

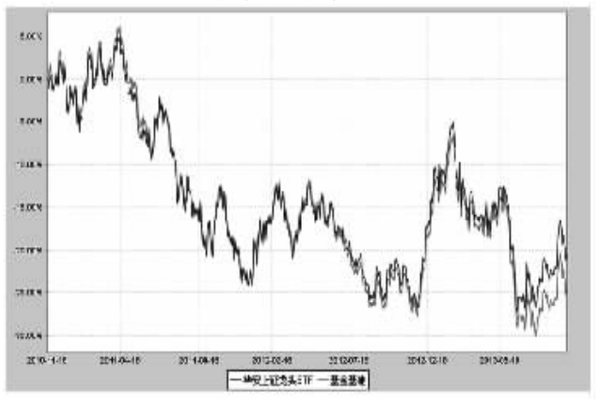
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.79%	1.32%	4.41%	1.29%	2.38%	0.03%

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

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年11月18日至2013年9月30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		
牛勇	本基金的基金经理	2010-11-18	-	9年	复旦大学经济学硕士,FRM(金融风险管理师),9年证券金融从业经历,曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师,2009年7月至2010年8月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理助理,2010年6月至2012年12月担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010年9月起同时担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理,2010年11月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。2012年6月起同时担任华安沪深300指数分级证券投资基金的基金经理。

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。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

三季度宏观经济增速有所恢复,资金面恢复正常,大盘指数底部回升,市场表现结构分化显著,新兴行业与题材板块表现突出,包括传媒、软件信息、自贸区等板块涨幅居前。在报告期内,本基金操作以跟踪标的指数为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为2.076元,本报告期份额净值增长率为6.79%,同期业绩比较基准增长率为4.41%,日均跟踪误差为0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计四季度国内宏观经济将继续企稳,三中全会将对国内经济发展与改革方向定调,但美国量化宽松何时退出仍具有不确定性,就市场而言其结构性机会仍大于整体性机会,而创业板为代表的成长股短期风险大于收益。作为上证龙头ETF基金的管理人,我们继续坚持拟合指数,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

§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	530,333,459.32	99.01
	其中:股票	530,333,459.32	99.01
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	5,073,023.76	0.95
6	其他各项资产	220,529.60	0.04
7	合计	535,627,012.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

5.2.2 指数投资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	56,858,960.90	10.63
C	制造业	111,605,244.61	20.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,113,416.20	3.95
E	建筑业	58,386,899.26	10.91
F	批发和零售业	22,361,364.14	4.18
G	交通运输、仓储和邮政业	22,676,502.86	4.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,782,901.16	3.51
J	金融业	185,774,043.58	34.73
K	房地产业	23,963,859.61	4.48
L	租赁和商务服务业	5,128,417.62	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,148,617.58	0.21
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	2,533,231.80	0.47
S	综合	-	-
	合计	530,333,459.32	99.13

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	600036	招商银行	7,052,640	77,014,828.80	14.40
2	601668	中国建筑	15,365,933	49,478,304.26	9.25
3	601318	中国平安	1,356,398	48,423,408.60	9.05
4	600104	上汽集团	2,183,526	29,543,106.78	5.52
5	601288	农业银行	11,006,000	27,515,000.00	5.14
6	600028	中国石化	5,853,166	25,988,057.04	4.86
7	601088	中国神华	1,094,994	18,253,549.98	3.41
8	600050	中国联通	4,641,082	15,222,748.96	2.85
9	601601	中国太保	795,511	13,977,128.27	2.61
10	600048	保利地产	1,340,825	13,247,351.00	2.48

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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 本基金投资的中国平安(601318)因子公司平安证券有限责任公司在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中存在违规行为,平安证券有限责任公司被中国证监会处以人民币5,110万元的罚款,并暂停其保荐机构资格3个月。报告期内,基金投资的前十名其他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	28,956.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	190,651.63
4	应收利息	921.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	220,529.60

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 报告期末按股票存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	272,150,796
本报告期基金总申购份额	500,000
减:本报告期基金总赎回份额	15,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	257,650,796

§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、《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金合同》

2、《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

3、《上证龙头企业交易型开放式指数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

华安行业轮动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:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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	华安行业轮动股票
基金主代码	040016
交易代码	040016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月11日
报告期末基金份额总额	508,075,542.27份
投资目标	本基金注重把握行业轮动规律,力求通过行业优化配置,对强势行业的龙头企业和具有估值优势、成长潜力的股票进行重点投资,获取超额收益,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法优化行业配置,构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的多因子模型等数量工具进行支持,使其更为科学和客观。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
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较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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	-20,435,757.10
2.本期利润	30,669,616.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0568
4.期末基金资产净值	468,445,524.87
5.期末基金份额净值	0.9220

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

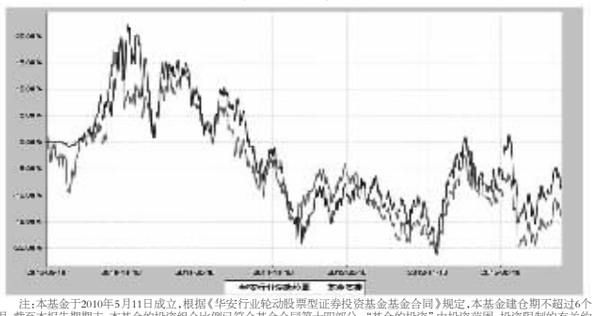
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.44%	1.27%	7.04%	1.15%	-0.60%	0.12%

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

华安行业轮动股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年5月11日至2013年9月30日)



注:本基金于2010年5月11日成立,根据《华安行业轮动股票型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期不超过6个月,截至本报告期期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十四部分"基金的投资"中投资范围、投资限制的有关约定。

§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		
吴丰树	本基金的基金经理	2012-10-15	-	10年	硕士研究生,10年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员、华宏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基金的基金经理。2012年10月起同时担任本基金的基金经理。2013年2月起同时担任华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理。2013年5月起担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。

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