华安科技动力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1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安科技动力股票
基金主代码	040025
交易代码	040025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	212,810,372.97份
投资目标	本基金重点投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业,关注其科技创新或技术突破后产生的增长动能,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略,一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择中以产业链价值结构为主要判别基准,选取以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业,同时从市场广度、技术深度、产业宽度和政策强度等方面寻找选取财务状况良好、盈利能力较强且资产质量较好的公司并作为重点投资对象。
业绩比较基准	80%×中证800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的中高风险投资品种。
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1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	25,848,271.83
2.本期利润	62,097,608.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2789
4.期末基金资产净值	306,264,727.85
5.期末基金份额净值	1.439

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

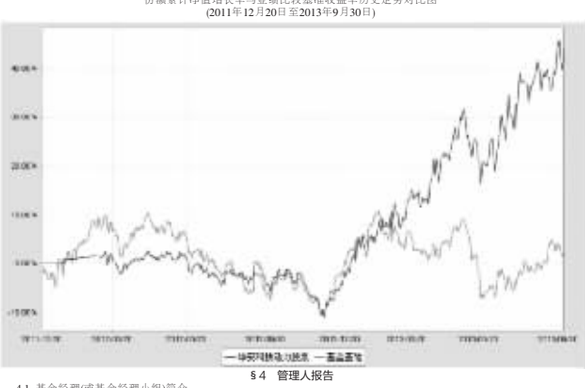
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.72%	1.63%	9.05%	1.10%	10.67%	0.53%

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

华安科技动力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

(2011年12月20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		
汪光成	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2011-12-20	-	11年	管理学博士,持有基金从业资格证书,11年证券、基金行业从业经历。2002年1月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月至2009年3月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2009年3月起担任华安创新证券投资基金的基金经理。2011年12月起担任本基金的基金经理;2013年3月起同时担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。2012年6月起担任基金投资部副总监。
李冠宇	本基金的基金经理	2013-4-8	-	5年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾在中山证券、海通证券担任研究员。2010年3月加入华安基金管理有限公司。先后担任研究发展部研究员、基金投资部基金经理助理。2013年4月起担任本基金的基金经理。2013年4月起同时担任华安动态灵活配置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获得可以公平享有信息获取机会。(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。在投资环节,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,先到先询价的投资组合经理须以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。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的投资组合经理须以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,出现同日反向交易或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,创业板不断创出新高,传媒和互联网行业成为市场关注的焦点。电子、医药等新兴产业在经历了上半年的大幅上涨之后,股价出现滞涨。传统经济以自贸区和O2O概念为先锋,走出了估值修复的行情。随着自贸区的挂牌,自贸区概念股走势趋稳。随着O2O的出现,商贸零售行业的部分子公司进入转型时期,未来市场表现值得期待。

报告期内,本基金重点配置传媒与计算机板块,减少电子行业配置,对医药行业则进行结构调整,降低药品企业配置,增加医药服务和设备配置。虽然这些行业或者个股存在一定程度的高估,但是尚在可承受范围之内。未来,我们将仍然坚持上述投资方向,通过时间换空间的方式,期待个股估值回归。

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1.439元,本报告期份额净值增长率为 19.72%,同期业绩比较基准增长率为9.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

"守住底线,加速转型"是未来半年到一年经济发展的主基调。经济增长速度将呈现紧贴底线的超低空飞行的状态。转型带来巨大的想象空间,因此我们认为机会还将集中在新兴产业中。年初至今,创业板已经有很大的涨幅,当前买入成本都不会很低,但是整个社会和经济正在发生天翻地覆的变化,需要我们认真甄别,带着批判的眼光去分析和接受这些变化。而这些变化又可能集中体现在创业板个股上,因此,未来我们仍将加大TMT、医药、消费股的配置。

§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	245,265,570.58	77.21
	其中:股票	245,265,570.58	77.21
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	35,905,564.08	11.30
6	其他各项资产	36,491,332.76	11.49
7	合计	317,662,467.42	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	173,136,399.86	56.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	43,455,384.08	14.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,945,433.96	3.25
M	科学研究和技术服务业	10,106,700.00	3.30
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	8,621,652.68	2.82
S	综合	-	-
	合计	245,265,570.58	80.08

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	600637	百视通	270,800	14,176,380.00	4.63
2	600867	通化东宝	698,731	12,318,627.53	4.02
3	600804	鹏博士	655,000	12,143,700.00	3.97
4	002368	太极股份	253,600	10,336,736.00	3.38
5	300012	华测检测	590,000	10,106,700.00	3.30
6	002214	大立科技	690,401	10,038,430.54	3.28
7	300071	华谊嘉信	247,522	9,945,433.96	3.25
8	600352	浙江龙盛	810,000	9,922,500.00	3.24
9	002064	华峰氨纶	940,000	9,653,800.00	3.15
10	002254	泰和新材	1,064,235	9,290,771.55	3.03

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的,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(元)
1	存出保证金	304,897.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,808.50
5	应收申购款	36,176,626.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,491,332.76

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的情况。

§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	305,410,823.09
本报告期基金总申购份额	347,482,801.28
减:本报告期基金总赎回份额	440,083,251.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	212,810,372.97

§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、《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安科技动力股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安科技动力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

华安信用四季红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: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	华安信用四季红债券
基金主代码	040026
交易代码	040026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月8日
报告期末基金份额总额	3,844,391,057.03份
投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象,在合理控制信用风险的基础上谨慎投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用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,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,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	中债企业债总指数收益率×65%+中债国债总指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的品种,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	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	42,234,857.02
2.本期利润	-2,054,279.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0005
4.期末基金资产净值	3,975,171,922.49
5.期末基金份额净值	1.034

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

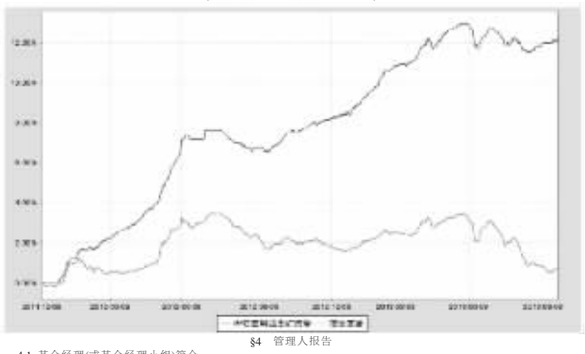
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.10%	0.07%	-2.06%	0.09%	1.96%	-0.02%

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

华安信用四季红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历史走势对比图

(2011年12月8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		
黄勤	本基金的基金经理、固定收益部总监	2011-12-8	2013-8-28	12年	经济学硕士,持有基金从业人员资格证书,17年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004年8月至2013年8月任职于华安基金管理公司,曾任固定收益部债券投资经理。2007年5月至2013年8月担任华安现金富利投资基金的基金经理。2009年4月至2012年10月担任华安强化收益债券型基金的基金经理。2011年12月至2013年8月同时担任本基金的基金经理。2012年12月至2013年8月同时担任华安7日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。
苏玉平	本基金的基金经理	2011-12-8	-	16年	货币银行硕士,16年证券、基金行业从业经历。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理;交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理;中德安联保险有限公司投资部部门经理;国联安基金管理有限公司基金经理。2011年2月加入华安基金管理有限公司。2011年7月起担任华安强化收益债券基金的基金经理;2011年12月起同时担任本基金的基金经理;2013年2月起担任华安纯债债券型发起式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日主决策,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,先到先询价的投资组合经理须以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《华安基金管理有限公司公募基金、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,出现同日反向交易或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,债市先后受到经济基本面回暖、利率一级市场发行密集和疲弱、央行"锁长放短"货币政策无放松预期以及海外QE退出预期冲击,中长期利率上60-70个基点。信用债市场收益率持续走高,各期限、品种、等级的债券收益率在3季度总体均呈现上升趋势,与利率市场走势一致。但信用利差的调整不完全相同。短期品种由于良好的流动性,调整基本与利率产品同步。而对于长期限品种,由于流动性弱,调整体现出滞后性。

本报告期内四季红基金规避了利率债下行风险,严格控制信用风险,规避了盈利大幅下滑、流动性风险上升的行业和个券,持仓集中于中高级品种;采取稳健投资策略:适度降低杠杆、缩短久期。业绩超越基准。

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1.034元,本报告期份额净值增长率为 -0.10%,同期业绩比较基准增长率为-2.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

IMF现预计2013年全球经济产出仅会扩张2.9%,低于7月时预期的3.1%,这将是2009年以来的最低增速。欧洲经济存在下行风险,复苏是"疲软、脆弱、不平衡的";美国经济数据依然差强人意、债务困境和QE的预期退出将制约经济复苏;中国领导人再次强调,为从根本上解决中国经济长远发展问题,必须坚定推动结构改革,计可将增长速度降下来一些。经济基本面依然支持债市。随着财政存款的投放以及外汇占款的恢复,四季度流动性恢复的概率比较大。

四季度宏观面和资金面仍支撑信用债市场,全球通胀压力都不大,国内四季度通胀会小幅上升,但经济基本面不支持PPI向CPI的传导。四季度的信用基本面有望迎来小喘息,市场对于微观企业财务状况恶化和信用事件冲击的担忧情绪有望阶段性平稳。短融中票收益率已经全面超过年初水平,有些高评级信用品种调整已经比较到位,具有长期配置价值。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,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	5,130,429,881.67	95.37
	其中:债券	5,097,427,881.67	94.75
	资产支持证券	33,002,000.00	0.61
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	49,835,915.36	0.93
6	其他各项资产	199,344,633.27	3.71
7	合计	5,379,610,430.30	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	189,798,995.00	4.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,987,000.00	0.25
	其中:政策性金融债	9,987,000.00	0.25
4	企业债券	2,274,087,886.67	57.21
5	企业短期融资券	939,436,000.00	23.63
6	中期票据	1,684,118,000.00	42.37
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,097,427,881.67	128.23

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	1182098	11金光MTN1	1,000,000	100,400,000.00	2.53
2	1082217	10云冶MTN1	1,000,000	100,340,000.00	2.52
3	112060	12金风01	855,328	86,297,463.23	2.17
4	071316005	13华泰证券CP005	800,000	80,032,000.00	2.01
5	019035	10国债35	800,000	79,760,000.00	2.01

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119024	侨城02	200,000	20,000,000.00	0.50
2	119023	侨城01	100,000	10,000,000.00	0.25
3	061202001	12通元1A	200,000	3,002,000.00	0.08

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(元)
1	存出保证金	245,618.35
2	应收证券清算款	66,756,259.20
3	应收股利	-
4	应收利息	132,293,356.16
5	应收申购款	49,399.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	199,344,633.27

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	3,873,852,227.06
本报告期基金总申购份额	57,186,416.61
减:本报告期基金总赎回份额	86,647,586.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,844,391,057.03

§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、《华安信用四季红债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安信用四季红债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安信用四季红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

华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)

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1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安标普全球石油指数(QDII-LOF)(场内简称:华安石油)
基金主代码	160416
交易代码	160416
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月29日
报告期末基金份额总额	70,631,509.05份
投资目标	本基金为股票指数基金,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。选择以"跟踪偏离度的绝对值"作为投资组合管理的主要标准,控制基金相对指数的偏离风险。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过6%(以美元资产计价)。
业绩比较基准	标普全球石油净总收益指数收益率 (S&P Global Oil Index Net Total Return)
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

§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	536,412.85
2.本期利润	5,462,958.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0677
4.期末基金资产净值	73,816,917.79
5.期末基金份额净值	1.045

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	6.42%	0.55%	8.78%	0.58%	-2.36%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以