# 华安行业轮动股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月11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2014年1月1日起至3月31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 | 462,698,232.71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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 7,134,113.97 |
| 2.本期利润 | -2,093,052.89 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0045 |
| 4.期末基金资产净值 | 429,984,782.16 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9293 |

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 | -0.52% | 1.40% | -5.99% | 0.95% | 5.47% | 0.45% |

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2014年3月31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 | - | 11年 | 硕士研究生,11年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员、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。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;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3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

2014年第一季度市场震荡下行,沪深300指数下跌近8%。中小市值板块相对表现强势,创业板指数上涨约2%。从行业上来看,信息服务、信息设备、机械设备等涨幅居前,煤炭、证券、农林牧渔等跌幅较大。市场主题投资十分活跃,新能源汽车产业链、LED、移动互联网、国企改革、京津冀一体化等主题都有十分突出的表现。此外,市场一大特点是波动加大,特别是创业板,虽然整体表现相对较强,但出现了明显的先扬后抑的走势,新股开闸、业绩欠佳、估值过高等都对指数产生了较大的影响。市场风格因此也出现一定的转换,特别是一季度后期,以白酒和地产为代表的传统行业获得市场青睐,出现一定程度的估值修复。从基本面来看,一季度宏观经济偏弱是导致传统行业表现欠佳重要原因,而腾讯、阿里等互联网巨头向传统行业的渗透和对其盈利模式的巨大冲击更是雪上加霜。不过,它也激起了市场对触网公司的高度关注,产生了主题性投资机会。

本基金净值期间表现尚可。对以地产为代表的价值股的超配给基金净值带来了较大的正面贡献。与此同时,基金加大了对主题板块的投资力度,特别是在LED和冷链上的把握较好。此外,基金加大了对看好个股的持仓力度,如浙江龙盛、荣盛发展、阳光城、九阳股份等,这些个股对基金净值的期间贡献相对较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为0.9293元,本报告期份额净值增长率为-0.52%,同期业绩比较基准增长率为-5.99%。

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2季度,我们对整体市场依然保持乐观态度。宏观经济层面,我们相信政府不会无所作为,增长底线依然存在,在经济下行的过程中,政府应该会出台一些措施来对冲,甚至不排除在货币政策上也有松动的可能。我们注意到,今年以来货币市场资金利率水平也已经从高位回落,我们判断无风险利率大幅攀升的阶段或已经过去。这对于估值水平已经跌至历史低位的传统行业而言,估值回归的可能性非常大。从长远来看,传统行业的龙头公司并不会消亡。此外,随着国企改革的渐次展开,国有企业效率有望从根本上得到改善,我们并不担心中国经济的可持续发展前景。我们认为,业绩和供给因素可能仍会制约到高估值的中小市值股票的整体表现,成长股的投资仍需精挑细选个股。

§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 | 391,951,506.62 | 88.87 |
| | 其中:股票 | 391,951,506.62 | 88.87 |
| 2 | 固定收益投资 | 20,000,000.00 | 4.53 |
| | 其中:债券 | 20,000,000.00 | 4.53 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 19,721,099.77 | 4.47 |
| 7 | 其他资产 | 9,386,595.92 | 2.13 |
| 8 | 合计 | 441,059,202.31 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,119,200.50 | 0.73 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 203,384,567.33 | 47.30 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 17,763,057.08 | 4.13 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,458,181.71 | 3.83 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,377,000.00 | 1.02 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,902,500.00 | 2.54 |
| J | 金融业 | 36,804,000.00 | 8.56 |
| K | 房地产业 | 81,625,000.00 | 18.98 |
| 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 | 17,518,000.00 | 4.07 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 391,951,506.62 | 91.15 |

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 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,800,936 | 29,283,219.36 | 6.81 |
| 2 | 000002 | 万科A | 3,000,000 | 24,270,000.00 | 5.64 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 600,000 | 22,536,000.00 | 5.24 |
| 4 | 000024 | 招商地产 | 1,000,000 | 18,860,000.00 | 4.39 |
| 5 | 002146 | 荣盛发展 | 1,500,000 | 18,525,000.00 | 4.31 |
| 6 | 000069 | 华侨城A | 3,800,000 | 17,518,000.00 | 4.07 |
| 7 | 000671 | 阳光城 | 1,800,000 | 17,010,000.00 | 3.96 |
| 8 | 600741 | 华域汽车 | 1,760,398 | 16,899,820.80 | 3.93 |
| 9 | 600761 | 安徽合力 | 1,307,143 | 15,777,216.01 | 3.67 |
| 10 | 002242 | 九阳股份 | 1,379,926 | 15,606,963.06 | 3.63 |

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 | 20,000,000.00 | 4.65 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,000,000.00 | 4.65 |
| 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 | 20,000,000.00 | 4.65 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 130218 | 13国开18 | 200,000 | 20,000,000.00 | 4.65 |

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 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股指期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 199,446.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,888,902.58 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 617,193.66 |
| 5 | 应收申购款 | 5,681,053.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,386,595.92 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 476,539,983.22 |
| 报告期基金总申购份额 | 21,569,340.72 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 35,411,091.23 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 462,698,232.71 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 29,999,600 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 29,999,600 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 6.48 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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、《华安行业轮动股票型证券投资基金基金合同》
2、《华安行业轮动股票型证券投资基金招募说明书》及其更新招募说明书
3、《华安行业轮动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住所,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
二〇一四年四月二十二日

# 华安香港精选股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月16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2014年1月1日起至3月31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 | 111,773,475.52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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,951,053.81 |
| 2.本期利润 | 3,203,164.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0249 |
| 4.期末基金资产净值 | 121,778,404.73 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.090 |

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 | 2.06% | 1.12% | -4.32% | 0.96% | 6.38% | 0.16% |

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2014年3月31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JP证券任基金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。2014年3月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 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。(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3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

2014年一季度,美联储对于美国货币政策的指引,仍是主导全球资本市场的重要因素。耶伦时代的首次FOMC会议,联储继续缩减QE,每月资产购买金额从650亿美元降至550亿美元,同时联储主席耶伦关于加息时点的表述大大早于市场预期,联储货币政策的转向已成定局。在发达市场经济复苏预期,和资金回流发达市场的推动下,预计发达市场股票跑赢新兴市场股票的情况将延续,期内标普500指数累计上涨1.30%,纳斯达克指数累计上涨0.54%,Stoxx50指数累计上涨1.69%,而MSCI新兴市场指数下跌0.80%。

一季度国内实体经济继续大幅走弱,同时人民币在2月开始出现大幅贬值走势,在疲弱经济基本面和资金外流预期的作用下,香港市场显著跑输全球市场,期内恒生指数下跌4.96%,恒生国企指数下跌6.85%。尽管季末,在政府托市的预期下,市场出现显著的风格切换,但我们认为是周期股的反弹,源于投资者对于托底政策的预期,而非基本面的好转,难有持续性。我们认为,在结构转型的大背景下,即使有政策的放松,也只是维持稳定,而非大力刺激,因此周期股的基本面很难有所表现。低估值,需求确定,业绩增长可见性强,符合经济转型主线的类股,仍是市场的主线,结构性的行情仍将持续。自下而上,发掘估值合理的成长性个股,仍将是我们的主要策略。

在报告期内,基于我们对于市场结构性行情的判断,我们超配的环保、新能源、医药等盈利确定性高,符合经济转型方向的个股取得了显著的超额收益,同时,对于流动性敏感,经济转型受损的银行、地产、周期类个股,我们在一季度继续低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,本基金份额净值为1.090元,本报告期份额净值增长率为2.06%,同期业绩比较基准增长率为-4.32%。

§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 | 104,028,788.85 | 83.54 |
| | 其中:普通股 | 104,028,788.85 | 83.54 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 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 | 18,779,410.76 | 15.08 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,723,709.67 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 124,531,909.28 | 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 | 97,985,783.67 | 80.46 |
| 中国台湾 | 6,043,005.18 | 4.96 |
| 合计 | 104,028,788.85 | 85.42 |

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(%) |
|---|---|---|
| 工业 | 20,846,342.28 | 17.12 |
| 保健 | 18,112,363.50 | 14.87 |
| 信息技术 | 17,242,848.22 | 14.16 |
| 非必需消费品 | 12,497,397.39 | 10.26 |
| 公共事业 | 11,004,417.32 | 9.04 |
| 金融 | 8,937,198.47 | 7.34 |
| 能源 | 7,334,846.50 | 6.02 |
| 必需消费品 | 6,550,347.16 | 5.38 |
| 材料 | 1,503,028.01 | 1.23 |
| 合计 | 104,028,788.85 | 85.42 |

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 LTD | 腾讯控股有限公司 | 700 HK | 香港 | 中国香港 | 13,200 | 5,647,626.27 | 4.64 |
| 2 | CT ENVIRONMENTAL GRO | 中滔环保集团有限公司 | 1363 HK | 香港 | 中国香港 | 1,026,000 | 4,930,835.96 | 4.05 |
| 3 | CHINA HIGH SPEED TRA | 中国高速传动设备集团有限公司 | 658 HK | 香港 | 中国香港 | 960,000 | 4,408,089.12 | 3.62 |
| 4 | CHINA SINGYES SOLAR | 中国兴业太阳能技术控股有限公司 | 750 HK | 香港 | 中国香港 | 427,000 | 4,151,632.61 | 3.41 |
| 5 | PING AN INSURANCE GR | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 2318 HK | 香港 | 中国香港 | 65,000 | 3,314,552.48 | 2.72 |
| 6 | Goodbaby Internation | 好孩子国际控股有限公司 | 1086 HK | 香港 | 中国香港 | 938,000 | 3,079,666.93 | 2.53 |
| 7 | LIJUN INTL PHARMACET | 利君国际医药(控股)有限公司 | 2005 HK | 香港 | 中国香港 | 1,122,000 | 2,820,672.66 | 2.32 |
| 8 | CHINA MACHINERY ENGINEERI | 中国机械设备工程股份有限公司 | 1829 HK | 香港 | 中国香港 | 634,000 | 2,800,560.91 | 2.30 |
| 9 | CHINA OILFIELD SERVI | 中海油田服务股份有限公司 | 2883 HK | 香港 | 中国香港 | 192,000 | 2,771,233.92 | 2.28 |
| 10 | TIANJIN DEVELOPMENT | 天津发展控股有限公司 | 882 HK | 香港 | 中国香港 | 652,000 | 2,766,317.01 | 2.27 |

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 | 1,592,925.23 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,331.19 |
| 5 | 应收申购款 | 129,453.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,723,709.67 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 143,515,462.38 |
| 报告期基金总申购份额 | 12,143,523.87 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 43,885,510.73 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 111,773,475.52 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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
二〇一四年四月二十二日

# 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月16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2014年1月1日起至3月31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 | 231,650,796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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -6,090,483.76 |
| 2.本期利润 | -29,910,346.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1257 |
| 4.期末基金资产净值 | 453,358,274.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.957 |

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。

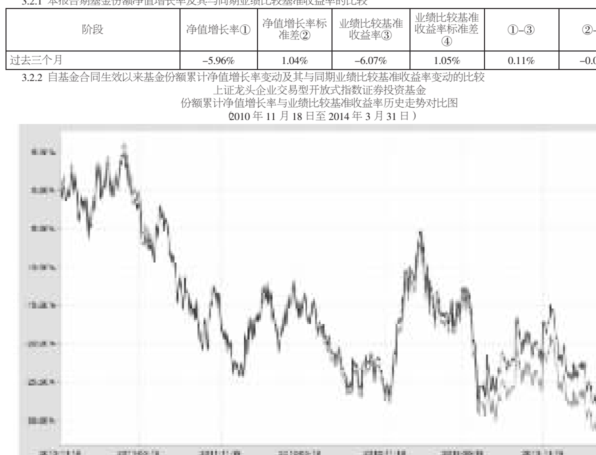
3.2 基金净值表现

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 | -5.96% | 1.04% | -6.07% | 1.05% | 0.11% | -0.01% |

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2014年3月31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。(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3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

一季度宏观经济增速仍处于下降通道,从工业增加值增速与PMI数据来看均低于市场预期,但由于季节性因素,流动性环比得到改善,加之市场对保增长等宏观调控政策的预期,市场风格出现一定变化,前期跌幅较大的周期股如地产、建材、白酒等反弹居前,而创业板为首的成长股的资金流出比较显著,市场风格的长期偏离得到一定程度纠正。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2014年3月31日,本基金份额净值为1.957元,本报告期份额净值增长率为-5.96%,同期业绩比较基准增长率为-6.07%,日均跟踪误差为0.05%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度属传统的开工旺季,但地产投资面临一定压力,保增长的宏观对冲政策出台力度与效果值得关注。但考虑到经济基本面的不确定性,以及央行整体偏紧的货币政策,认为市场仍以结构性行情为主,可能面临宽幅的波动。而估值回调到合理位置的稳定成长个股具有配置与防御价值。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 | 450,443,875.26 | 99.23 |
| | 其中:股票 | 450,443,875.26 | 99.23 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,472,545.03 | 0.76 |
| 7 | 其他资产 | 22,686.68 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 453,939,106.97 | 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 | 51,235,637.20 | 11.30 |
| C | 制造业 | 85,954,617.52 | 18.96 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,654,930.34 | 4.11 |
| E | 建筑业 | 53,525,895.03 | 11.81 |
| F | 批发和零售业 | 14,725,734.86 | 3.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,002,005.34 | 2.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,759,548.52 | 3.26 |
| J | 金融业 | 170,370,307.02 | 37.58 |
| K | 房地产业 | 22,660,829.77 | 5.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,432,986.32 | 0.76 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 849,021.18 | 0.19 |
| 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 | 1,272,362.16 | 0.28 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 450,443,875.26 | 99.36 |

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 | 601318 | 中国平安 | 1,525,955 | 57,314,869.80 | 12.64 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 5,245,540 | 51,511,202.80 | 11.36 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 13,281,433 | 38,648,970.03 | 8.53 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 4,876,766 | 24,530,132.98 | 5.41 |
| 5 | 600104 | 上汽集团 | 1,732,926 | 24,001,025.10 | 5.29 |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 5,915,095 | 20,407,077.75 | 4.50 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 7,831,700 | 18,952,714.00 | 4.18 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 1,078,594 | 14,916,955.02 | 3.29 |
| 9 | 601186 | 中国铁建 | 3,542,125 | 14,876,925.00 | 3.28 |
| 10 | 600050 | 中国联通 | 4,310,082 | 13,188,850.92 | 2.91 |

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 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。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 18,720.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 3,231.52 |
| 4 | 应收利息 | 735.04 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,686.68 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 241,650,796 |
| 报告期基金总申购份额 | 5,500,000 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 15,500,000 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 231,650,796 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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
二〇一四年四月二十二日