华安日日鑫货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十九日

§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2014年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安日日鑫货币	
基金主代码	040038	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月26日	
报告期末基金份额总额	470,966,513.95份	
投资目标	为满足投资人现金管理和日常理财需求,本基金在力求本金安全、确保基金资产流动性的基础上,追求稳定的当期收益,谋求资产的稳定增值。	
投资策略	本基金将根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的投资组合管理,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
下属两级基金的交易代码	040038	040039
报告期末下属两级基金的份额总额	378,840,621.75份	92,125,892.2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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
1.本期已实现收益	3,804,553.21	2,033,516.17
2.本期利润	3,804,553.21	2,033,516.17
3.期末基金资产净值	378,840,621.75	92,125,892.20

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.华安日日鑫货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1025%	0.0042%	0.2693%	0.0000%	0.8332%	0.0042%

2.华安日日鑫货币B:

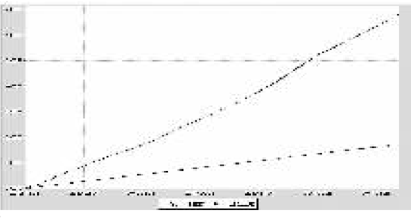
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1627%	0.0042%	0.2693%	0.0000%	0.8934%	0.0042%

注:本基金收益分配按月结转份额。

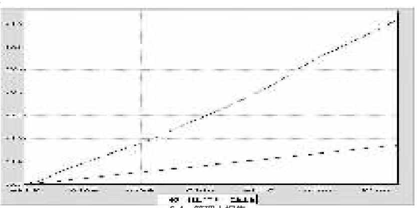
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安日日鑫货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年11月26日至2014年6月30日)

1、 华安日日鑫货币A



2、华安日日鑫货币B



§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		
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监	2012-11-26	-	12年	硕士研究生,12年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在国发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。 2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月起同时担任本基金的基金经理。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。
张晟刚	本基金的基金经理	2013-1-25	-	15年	硕士研究生,15年银行、证券行业从业经验。曾在中国银行上海分行、伦敦分行、总行交易中心担任高级交易员、高级经理等职务。2012年11月加入华安基金管理有限公司。2013年1月起担任本基金及华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理;2013年3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。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。2013年10月起同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2013年11月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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 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1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

回顾上半年,一季度经济增速下行至7.4%,其中房地产是增长面临的最大下行风险。二季度以来,政府在保持定力的基础上,陆续出台17项微刺激稳增长措施。随着政策的落实和显效,6月基本面出现边际改善的迹象(发电量、制造业PMI反弹),经济短期内企稳。年初以来央行货币政策态度转为"总量稳定,结构优化",通过定向降准和国开行再贷款支持"三农"和小微,并且尽量熨平资金面的季节性波动。

货币市场利率的全面回落,银行间的隔夜和7天回购利率中枢继续下移,接近去年一季度末的利率低点,6月底在银行体系流动性充裕的情况下安然度过。5月,五部委联合发布127号文,配合此前的99号文,标志着监管升级重拳治理影子银行和非标资产。债市在"宽货币"和"严监管"的双重驱动下继续演绎牛市行情。中长端利率大幅走低,10年金融债收益今年以来首度降至5.0%以下。信用债市场,中高等级的短融和有政府信用背书的城投债依然是市场的交投热点,利率中枢较一季度下移70BPS和50BPS。

本报告期内,本基金降低了短期存款和逆回购的比例,适当增加了短融的配置,并加大了债券交易性操作,积极赚取二级市场差价。通过审慎和积极的管理,在把握流动性的基础上,积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

华安日日鑫货币A:

投资回报:1.1025% 比较基准:0.2693%

华安日日鑫货币B:

投资回报:1.1627% 比较基准:0.2693%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,宏观经济增速下行压力仍然较大。定向刺激下,基建投资抵御房地产周期的下滑效果有限,出口在全球经济新常态下亦难以全面发力。通胀短期将不构成压力。

但另一方面,保增长政策将为短期经济托底。央行着力化解货币堆积,引导银行增加信贷支持实体经济。定向刺激、基建投资、结构性减税将推动短期内经济反弹。大额CD推出,长远看将提升银行的负债成本。财税体制改革深化,地方债发行规模增加,都将带来利率债收益率上行压力。还需要关注IPO带来的资金扰动,流动性有可能将结构性和阶段性失衡。债市短期内将面临反复,需警惕基本面和配置力量边际上的变化。

操作方面,我们将继续把握基金的流动性和收益性的平衡,关注中高评级短融的配置和交易性机会,由于收益率曲线较平坦,关注短期限品种的投资机会。同时把握月末和IPO时机锁定较高收益。在控制组合风险的基础上,为投资者积极赚取高收益。

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	固定收益投资	240,059,895.24	42.83
	其中:债券	240,059,895.24	42.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	98,700,624.55	17.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	202,690,927.85	36.16
4	其他资产	19,046,500.54	3.40
5	合计	560,497,948.18	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.03	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	84,819,317.97	18.01
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过90天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过90天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	23.65	18.01
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	21.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.13	-
3	60天(含)—90天	57.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.12	-
4	90天(含)—180天	2.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	10.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	114.96	18.01

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	摊余成本(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	19,994,316.29	4.25
	其中:政策性金融债	19,994,316.29	4.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	220,065,578.95	46.73
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	240,059,895.24	50.97
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,994,316.29	4.25

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071403006	14中信CP006	300,000	29,994,765.72	6.37
2	071416007	14华泰证券CP007	300,000	29,988,016.90	6.37
3	071425002	14国都证券CP002	200,000	19,997,160.58	4.25
4	071404007	14广发CP007	200,000	19,996,384.33	4.25
5	041456014	14中铝业CP002	100,000	10,075,279.41	2.14
6	041464042	14健康元CP001	100,000	10,014,377.11	2.13
7	130211	13国开11	100,000	10,008,437.18	2.13
8	071430003	14财通证券CP003	100,000	10,004,960.36	2.12
9	041457002	14渝保税CP001	100,000	10,001,055.76	2.12
10	041454027	14南产控CP001	100,000	10,000,411.42	2.12

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1451%
报告期内偏离度的最低值	0.0206%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0879%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在1.00元。

5.8.2 本报告期内本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,732,940.17
4	应收申购款	16,309,810.37
5	其他应收款	3,750.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,046,500.54

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安日日鑫货币A	华安日日鑫货币B
报告期期初基金份额总额	324,471,812.55	161,868,773.23
报告期基金总申购份额	557,362,495.56	213,784,065.11
减:报告期基金总赎回份额	502,993,686.36	283,526,946.14
报告期期末基金份额总额	378,840,621.75	92,125,892.20

§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、《华安日日鑫货币市场基金基金合同》
2、《华安日日鑫货币市场基金基金招募说明书》
3、《华安日日鑫货币市场基金托管协议》

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
二〇一四年七月十九日

上证180交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十九日

§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2014年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安上证180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年4月13日
报告期末基金份额总额	6,370,557,679.00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	采取抽样复制的指数跟踪方法,即根据定量化的选股指标,选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合,并通过优化模型确定投资组合中个股的权重,以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	上证180指数
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。
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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-44,611,222.39
2.本期利润	206,324,625.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0333
4.期末基金资产净值	12,170,323,338.65
5.期末基金份额净值	1.910

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。

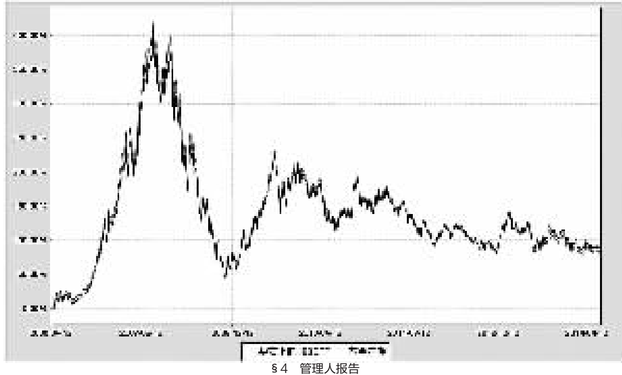
3.2 基金净值表现

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	1.70%	0.89%	0.74%	0.89%	0.96%	0.00%

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180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
(2006年4月13日至2014年6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		
许之彦	本基金的基金经理,指数投资部高级总监	2009-9-5	-	10年	理学博士,10年证券、基金从业经验,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,2008年4月至2012年12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,2009年9月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。
章海默	本基金的基金经理、指数投资部助理总监	2012-12-22	-	10年	复旦大学管理学院工商管理硕士,复旦大学经济学学士,10年基金从业经历。曾在安永华明会计师事务所工作,2003年9月加入华安基金管理有限公司,任基金运营部基金核算主管,2009年12月至2012年12月担任华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2011年9月至2012年12月担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2012年12月起担任本基金及其联接基金的基金经理。2013年6月起担任指数投资部助理总监。2013年12月起同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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《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1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

二季度,美国经济继续温和复苏并如期逐步退出量化宽松,欧洲经济复苏相对较弱。国内宏观经济开始出现企稳迹象,政府加大了微刺激的力度,央行也通过定向降准调整资金的结构,银行间利率市场继续下滑。国内A股市场呈现震荡,上证180指数也出现了微涨。在此期间,基金平稳完成了成分股调整工作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.910元,本报告期份额净值增长率为 1.70%,同期业绩比较基准增长率为0.74%。基金超越基准0.96%的主要原因是个股分红造成的。日跟踪误差为0.04%,年化为0.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,我们认为国内宏观经济保持相对平稳增长的可能性较大。政府不会推出比较积极的经济短期刺激政策,但在基础建设、棚户区改造、信息化、医疗服务、农村等领域将加大支持力度,微刺激的范围和力度都将加大。央行也将保持货币的相对宽松,利率水平的降低也将逐步传递到实体经济,我们认为年内保持较为平稳经济增长态势的可能性较大。我们对下半年的市场相对乐观。作为上证180ETF的管理人,我们将继续秉承既定的投资目标与策略,规范运作、勤勉尽责,充分拟合指数,减少跟踪误差,为投资者提供优质的上证180指数投资工具。

§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	12,149,404,423.60	99.59
	其中:股票	12,149,404,423.60	99.59
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	49,453,883.62	0.41
7	其他资产	93,285.45	0.00
8	合计	12,198,951,592.67	100.00

注:此处股票投资含可退替代款估值增值7,992.00元。

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	55,323,265.11	0.45
B	采矿业	798,505,056.80	6.56
C	制造业	3,217,235,266.41	26.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	394,269,150.22	3.24
E	建筑业	377,501,264.48	3.10
F	批发和零售业	218,000,213.21	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	300,595,912.61	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	425,050,183.66	3.49
J	金融业	5,385,930,349.73	44.25
K	房地产业	633,374,174.53	5.20
L	租赁和商务服务业	57,644,226.62	0.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	60,374,573.10	0.50
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	122,102,439.72	1.00
S	综合	103,490,355.40	0.85
	合计	12,149,396,431.60	99.83

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	16,701,634	657,042,281.56	5.40
2	600036	招商银行	57,585,941	589,680,035.84	4.85
3	600016	民生银行	94,583,244	587,361,945.24	4.83
4	601166	兴业银行	39,888,726	400,083,921.78	3.29
5	600000	浦发银行	39,053,267	353,432,066.35	2.90
6	600030	中信证券	27,464,220	314,739,961.20	2.59
7	600837	海通证券	28,221,197	258,223,952.55	2.12
8	601288	农业银行	90,618,605	228,358,884.60	1.88
9	600519	贵州茅台	1,594,104	226,330,885.92	1.86
10	601328	交通银行	54,784,580	212,564,170.40	1.75

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有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	81,188.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,096.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,285.45

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不存在流通受限的情况。

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	6,219,557,679.00
报告期基金总申购份额	1,000,500,000.00
减:报告期基金总赎回份额	849,500,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,370,557,679.00

§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180交易型开放式指数证券投资基金合同》
2、《上证180交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
3、《上证180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
二〇一四年七月十九日

华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第二季度 报告

2014年6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: 二〇一四年七月十九日

§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2014年7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华安上证180ETF联接
基金主代码	040180
交易代码	040180
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	770,481,838.90份
投资目标	通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,并在谋求基金资产长期增值的基础上择机实现一定的收益和分配。
投资策略	本基金主要通过投资于华安上证180ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和买卖华安上证180ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。本基金对标的指数的跟踪目标是:在正常情况下,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	95%×上证180指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	基金为华安上证180ETF的联接基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合基金、债券型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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华安上证180交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年4月13日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2006年5月18日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的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。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证180指数
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。

§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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	404,445.04
2.本期利润	9,542,325.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0124
4.期末基金资产净值	572,357,882.64
5.期末基金份额净值	0.743

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。

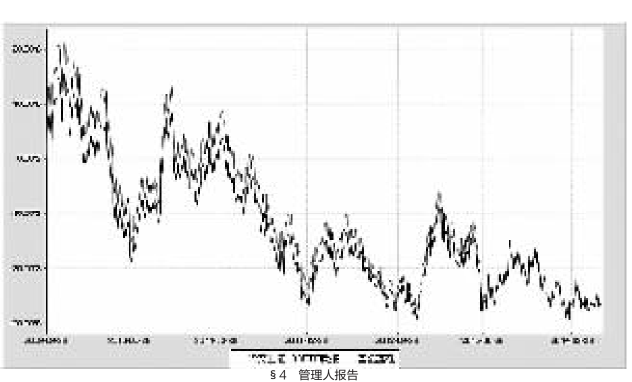
3.2 基金净值表现

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	1.78%	0.86%	0.71%	0.85%	1.07%	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

华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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
(2009年9月29日至2014年6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		
许之彦	本基金的基金经理,指数投资部高级总监	2009-9-29	-	10年	理学博士,10年证券、基金从业经验,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,2008年4月至2012年12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,2009年9月起同时担任上证180ETF及本基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。
章海默	本基金的基金经理、指数投资部助理总监	2012-12-22	-	10年	复旦大学管理学院工商管理硕士,复旦大学经济学学士,10年基金从业经历。曾在安永华明会计师事务所工作,2003年9月加入华安基金管理有限公司,任基金运营部基金核算主管,2009年12月至2012年12月担任本基金的基金经理助理。2011年9月至2012年12月担任华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2012年12月起担任上证180交易型开放式指数证券投资基金及本基金的基金经理。2013年6月起担任指数投资部助理总监。2013年12月起同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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《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1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 年二季度,上证180指数上涨0.78%,创业板指数上涨5.79%。主板指数依然波澜不惊,但创业板和小盘股在个股间,也出现了分化。主题投资的速度和节奏越来越快,热门个股的市值规模越来越小。这表明,市场仍是一个存量博弈,平行世界的格局,并在这样的格局中,等待方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为0.743元,本报告期份额净值增长率为 1.78%,同期业绩比较基准增长率为0.71%。基金本期的跟踪偏离为1.07%,日均跟踪误差为0.074%,年化跟踪误差为1.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在大类资产配置上,我们认为,当债市的牛市进入后半程时,高股息率的个股加环比好转的基本面,其特性将类似转债,成为增量资金青睐的对象,并会逐步扩散至其他低估值或具有安全边际的蓝筹或成长股。地产周期的企稳,以及后续销量前瞻指标的环比好转,将成为经济预期好转的催化剂,并与相对偏低的货币资金利率,以及增量资金投资者的低风险偏好发生共振。寻找预期差成为今年的投资主要任务,而地产以及其他供给出现问题的周期弹性品种,在我们看来,将成为最大的预期差来源。在此背景下,我们对市场保持乐观。作为上证180ETF联接基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,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	16,886,997.33	2.94
	其中:股票	16,886,997.33	2.94
2	基金投资	524,006,794.37	91.38
3	固定收益投资	10,002,000.00	1.74
	其中:债券	10,002,000.00	1.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,475,737.63	3.22
8	其他资产	4,090,011.77	0.71
9	合计	573,461,541.10	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	华安上证180交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	华安基金管理有限公司	524,006,794.37	91.55

5.3 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	786,000.00	0.14
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	-	-
J	金融业	7,321,797.33	1.28
K	房地产业	8,779,200.00	1.53
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,886,997.33	2.95

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	600048	保利地产	1,770,000	8,779,200.00	1.53
2	600705	中航投资	455,619	7,321,797.33	1.28
3	600585	海螺水泥	50,000	786,000.00	0.14

5.5 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	10,002,000.00	1.75
	其中:政策性金融债	10,002,000.00	1.75
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	10,002,000.00	1.75

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	130236	13国开36	100,000	10,002,000.00	1.75

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。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.11.2 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。

5.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,225.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	369,810.55
5	应收申购款	3,690,975.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,090,011.77

5.12.4 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。

5.12.5 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	767,227,080.50
报告期基金总申购份额	50,889,992.64
减:报告期基金总赎回份额	47,635,234.24
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	770,481,838.90

§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、《华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
2、《华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
3、《华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

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
二〇一四年七月十九日