

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：二〇一三年三月二十七日
§ 1 重要提示及目录

重要提示
基金管理人和基金托管人承诺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的法律责任。本公司未将本基金登记为三分之一以上独立董事签字同意，并由其董事长签章。

基金管理人和基金托管人根据有关法律法规的规定，结合《基金合同》约定，于2013年3月22日对报告了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金过往的业绩并不代表其未来表现。投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称	华安上证龙头ETF
基金代码	510190
交易场所	上海证券交易所
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年1月18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
报告期末基金份额总额	303,650,796份
基金合同存续期	不定期
基金类别	股票型
上市地	上海证券交易所
报告期	2011年1月10日

2.2 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。
本基金主要投资于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额，通过投资于该基金，使基金资产在尽可能的范围内实现与标的指数的表现最为紧密的跟踪。
投资策略 本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重，结合宏观经济形势、行业政策、市场环境、资金流动性和估值水平等，综合分析后确定投资组合，并根据标的指数成份股的构成及其权重定期调整投资组合，以期在一定程度上降低跟踪误差。

业绩比较基准 上证龙头企业指数

风险收益特征 本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，低于股票型基金，风险较高，适合追求较高收益的投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名 马钢 联系电话 021-38969999 电子邮箱 fengying@huaxian.com.cn

客户服务电话 021-66105799

传真 021-68863414

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的管理人互连网址 www.huaxian.com

联网网址 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

基金年度报告备置地点 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2012年 2011年 2010年1月1日至2010年12月31日

本期末所有者权益 -30,505,789.51 -32,697,536.21 -1,905,241.96

本期末总资产 107,296,564.05 -166,977,915.67 -24,770,879.85

本期末净资产收益率 0.3026% -0.5346% -0.0572%

3.1.2 利润数据和指标 2012年 2011年 2010年

期初可供分配基金份额 -0.2817% -0.5917% -0.0572%

期末可供分配基金份额净值 706,870,678.94 774,154,002.21 1,105,574,983.35

现金分红金额 2,328 2,018 2,552

注：1.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；例如：开放式基金的申购赎回费用、赎回费用、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列示的数字。
2.本基金在每季度第一个自然日起至下一季度的第一个自然日止，不计算收益。
3.期末可供分配利润即为基金利润减去必要的费用后的余额，不扣除当前应收的红利款，期末余额不包含当期发生的收入。
4.合同生效当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算，不按整个自然年度进行折算。
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长率 份额净值增长率标准差 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差 (%)

过去三个月 1.76% 1.13% 6.80% 1.13% 0.98% 0.09%

过去一年 15.36% 1.19% 13.16% 1.18% 2.20% 0.01%

期初基金份额净值 -10.80% 1.19% -12.25% 1.20% 1.45% -0.01%

至今 2.328 2,018 2,552

注：1.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；例如：开放式基金的申购赎回费用、赎回费用、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列示的数字。
2.本基金在每季度第一个自然日起至下一季度的第一个自然日止，不计算收益。
3.期末可供分配利润即为基金利润减去必要的费用后的余额，不扣除当前应收的红利款，期末余额不包含当期发生的收入。
4.合同生效当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

单位：人民币元

年度 每份基金净值增长 分红金额 现金分红方式 前一日基金资产净值 单利年均回报率 备注

2012年 - - - - -

2010年11月18日(基金合同生效日) - - - - -

2010年12月31日(基金合同终止日) - - - - -

注：合同生效当年按实际存续期间计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 每份基金净值增长 分红金额 现金分红方式 前一日基金资产净值 单利年均回报率 备注

2012年 - - - - -

2011年 - - - - -

2010年11月18日(基金合同生效日) - - - - -

2010年12月31日(基金合同终止日) - - - - -

注：1.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；例如：开放式基金的申购赎回费用、赎回费用、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列示的数字。
2.本基金在每季度第一个自然日起至下一季度的第一个自然日止，不计算收益。
3.期末可供分配利润即为基金利润减去必要的费用后的余额，不扣除当前应收的红利款，期末余额不包含当期发生的收入。
4.合同生效当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期间计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2.4 管理人报告

3.2.4.1 基金管理人及基金经理情况

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]6号文批准于1998年6月设立，是国务院直管的全国性基金公司，注册资本1亿元人民币，公司总部设在上海浦东陆家嘴金融贸易区，目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信息有限公司、上海实业（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海君安投资管理有限公司。

许之彦担任公司总经理，王伟担任公司副总经理，王伟同时兼任华安基金管理有限公司督察长。

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]6号文批准于1998年6月设立，是国务院直管的全国性基金公司，注册资本1亿元人民币，公司总部设在上海浦东陆家嘴金融贸易区，目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信息有限公司、上海实业（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海君安投资管理有限公司。

截至2012年12月31日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭2只封闭式证券投资基金、华安龙头交易型开放式指数证券投资基金的托管人，严格按照法律法规的规定，履行了基金托管人的职责。

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]6号文批准于1998年6月设立，是国务院直管的全国性基金公司，注册资本1亿元人民币，公司总部设在上海浦东陆家嘴金融贸易区，目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信息有限公司、上海实业（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海君安投资管理有限公司。

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1998]6号文批准于1998年6月设立，是国务院直管的全国性基金公司，注册资本1亿元人民币，公司总部设在上海浦东陆家嘴金融贸易区，目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信息有限公司、上海实业（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海君安投资管理有限公司。