

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：二〇一三年八月二十四日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示  
基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
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8月20日复核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，保证复核后不存在虚假记载、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及其更新。

本半年度报告摘要除非特别说明，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。  
本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 华安上证龙头ETF联接基金

基金主代码 040190

交易代码 040190

基金运作方式 货币型开放式

基金合同生效日 2010年11月18日

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 626,317,945.42份

基金合同存续期 不定期

2.1.1 基金基本情况

基金名称 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 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

上海证券交易所

上市日期 2011年1月10日

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

2.2 基金产品说明

投资目标 通过投资于目标ETF，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 本基金将把全部资金投资于目标ETF，标的指数成份股和备选成份股对标的指数的偏离度不超过1.5%，跟踪误差不超过1.5%。

业绩比较基准 95%×上证龙头企业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相似，其风险收益特征与标的指数所代表的股票组合的风险收益特征相似，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

2.2.1 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 本基金将把全部资金投资于目标ETF，标的指数成份股和备选成份股对标的指数的偏离度不超过1.5%，跟踪误差不超过1.5%。

业绩比较基准 95%×上证龙头企业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征与股票型基金相似，其风险收益特征与标的指数所代表的股票组合的风险收益特征相似，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露负责人 冯颖

联系电话 021-38969999

电子邮箱 fengy@huama.com

客户服务电话 4008850099

传真 021-68863414

010-66105798

2.4 信息披露方式

基金年度报告书面公告的管理人及网址 www.huama.com.cn

基金年度报告备置地 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层,32层

3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 -17,478,949.33

本期利润 -88,622,590.91

期初平均基金份额本期利润 -0.1316

本期基金份额净值增长率 -15.61%

报告期末(2013年6月30日)

-0.2378

期末基金份额净值 477,373,604.10

期末基金份额净值 -0.762

注：本基金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。

2 本期基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列示金额，(不适当期生息)

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

3.2.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 -17,478,949.33

本期利润 -88,622,590.91

期初平均基金份额本期利润 -0.1316

本期基金份额净值增长率 -15.61%

报告期末(2013年6月30日)

-0.2378

期末基金份额净值 477,373,604.10

期末基金份额净值 -0.762

注：本基金的业绩比较基准：上证龙头企业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率×5%，业绩比较基准在每日交易日重新平衡。

3.2.1.2 期间数据和指标 报告期(2010年11月18日至2013年6月30日)

-17,478,949.33

-88,622,590.91

-0.1316

-15.61%

报告期末(2013年6月30日)

-0.2378

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是业内首批基金管理人之一，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，目前的股东为上海华安(集团)有限公司、上海国际信托有限公司、上海国泰国际投资管理有限公司和国泰基金投资管理有限公司。

截至2013年6月30日，公司旗下共管理10只基金，基金资产总值约78.67亿元人民币。

4.1.2 基金经理及基金经理助理的简介

4.1.2.1 公司高级管理人员、基金经理及基金经理助理的简历

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期间 证券从业年限 说明

牛勇 本基金的基本基金经理 2010-11-18 - 复旦大学经济学硕士，FRM(金融风险管理师)，8年证券从业经历，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部总监，2010年7月起任华安基金管理有限公司金融工程部总监，2010年8月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金、华安沪深300指数基金、华安沪深300指数分级基金、华安沪深300指数分级基金、华安沪深300指数分级基金基金经理。

4.1.2.2 公司高级管理人员、基金经理及基金经理助理的简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期间 证券从业年限 说明

牛勇 本基金的基本基金经理 2010-11-18 -

4.2 基金管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人遵守有关法律法规及《华安上证龙头企业ETF联接基金基金合同》、《华安上证龙头企业ETF联接基金招募说明书》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约定的义务。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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制度》，将旗下基金、特定客户资产管理计划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。控制措施包括：在研究环节，研究部门在投资决策过程中充分披露信息，使基金经理能够公平地获取信息；在投资决策过程中，由基金经理根据投资决策会议纪要可以公平地获取信息；在交易执行过程中，由基金经理根据交易执行情况，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，使基金经理能够公平地获取信息，对不同投资组合在交易时机、交易价格等方面进行公平地调整。&lt;/div