

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:二〇一四年三月三十一日

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。本基金报告已经基金托管人进行复核，符合基金合同的规定，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财产，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当仔细阅读基金的招募说明书及其他资料。  
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2013年1月1日起至2013年12月31日止。

## § 2 基金简介

基金简称	华安上证龙头企业ETF
基金代码	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16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
基金类别	股票型
基金合同的生效日期	2014年3月21日
基金合同的终止日期	不适用
基金合同的存续日期	不适用
上市日期	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，风险控制和流动性增强指数化。
投资策略	本基金主要通过完全复制法，即按标的指数的构成及其权重构建基金资产投资组合，同时根据指数成份股的变动及时进行调整。在一般情况下，本基金管理人的指数投资组合的构成及其权重将尽可能地与标的指数的构成及其权重相一致。但因标的指数成份股的定期调整、法律规定的限制等导致无法完全复制的股票，本基金将采用适当的指数投资方法，尽可能地选择与标的指数所代表的市场的风险收益特征相一致的股票进行投资。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资组合的构成。
业绩比较基准	上证龙头企业指数
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类似，主要采用完全复制法跟踪标的指数的收益，其风险特征与标的指数所代表的市场的风险收益特征相一致。

## 2.3 基金管理人员和基金托管人

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
姓名	刘伟	赵会平
联系电话	021-38969999	010-66105799
电子邮箱	fengyong@huaxian.com	custody@icbc.com.cn

## 2.4 信息披露方式

基金份额净值公告的管理人互联网网址	www.huaxian.com
年度报告公告地地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31-32层

## 3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1.1 期间数据和指标

金额单位:人民币元

	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	-19,434,599.10	-30,505,789.51	-32,697,536.21
-65,056,530.24	107,296,564.05	-166,973,915.67	
加权平均基金份额利润	-0.2379	0.3026	-0.3546
本期基金份额总额	11,058,000.00	14,375	-14,676
基金总份额增长百分比	-10.16%	15.36%	-20.02%
3.1.2 日数据和指标	2013年1月-2012年12月	2011年1月-2012年12月	2011年1月-2012年12月
期末可供分配基金份额利润	-127,814,70.22	-85,533,287.83	-227,017,134.36
期末可供分配基金份额利润	-0.5289	-0.2617	-0.5917
期末基金资产净值	502,794,702.82	706,870,678.94	774,154,600.21
期末基金份额净值	2.081	2.338	2.018
3.1.3 累计期间指标	2013年1月-2012年12月	2012年1月-2011年12月	2011年1月-2010年12月
期末可供分配基金份额利润	-20.27%	-23.49%	-22.68%

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:开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入后实际收益水平将低于所列数字。  
2. 本期可供分配利润指本期已实现收入、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,本期利润指已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为未分配利润,不是当期发生数)。  
3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金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(%)	同期业绩比较 基准收益率(%)	净值增长率 标准差(%)	业绩比较基 准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去一个月	0.24%	1.16%	0.56%	1.16%	-0.32%	0.00%
过去3个月	7.05%	5.00%	2.35%	2.05%	0.01%	
过去一年	-10.63%	1.36%	-13.32%	1.24%	2.71%	0.02%
过去三年	-18.46%	1.25%	-21.98%	1.25%	3.52%	0.00%
自基金合同生效以来	-20.27%	1.24%	-23.49%	1.25%	3.67%	-0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 3.2.3 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.5 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.6 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.7 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.8 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.9 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.10 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.11 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.12 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.13 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.14 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.15 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.16 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.17 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.18 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.19 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.20 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.21 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.22 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.23 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.24 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.25 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.26 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图  
(2010年1月18日至2013年12月31日)

3.2.27 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

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走势图<br