

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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
报告日期:二〇一五年七月十八日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会及监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2015年7月15日核对了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和基金管理人报告等内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金销售机构在销售基金时，应向投资人说明有关基金的法律文件，包括招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，投资人购买基金后，应及时阅读基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:	华安上证龙头企业ETF
基金代码:	510109
交易代码:	510109
基金份额净值:	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:	50,150,796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:	本基金主要通过完全复制法,即完全按照标的指数的构成及其权重来构建股票投资组合,并定期根据标的指数的调整情况相应地进行调整。在一般情况下,本基金将严格按照标的指数的构成及权重投资于股票,其风险收益特征与标的指数所示的风险收益特征一致。本基金将定期对标的指数的构成及权重进行调整,并将根据调整结果相应地进行调整。对于因标的指数成份股发生分红派息、增发、配股等情况而进行的成份股调整,本基金将根据调整方案对股票投资组合进行相应的调整,并同时根据调整方案对股票投资组合的构成及权重进行相应的调整,以使股票投资组合的构成及权重符合标的指数的调整方案。本基金可能适当运用其他投资方法,但不保证一定盈利。
基金运作费用:	基金管理费率为每年0.50%,基金托管费率为每年0.15%。本基金将根据法律法规的规定,在不违反基金合同约定的前提下,可以调整基金管理费和基金托管费,基金管理人应当在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
报告期利润:	无
投资组合:	本基金的投资对象为上证龙头企业指数所包含的股票,以及经基金管理人同意的其他金融工具。
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型基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人:	华安基金管理有限公司
基金托管人:	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 175,224.92

2.本期利润 56,402,219.65

3.期初基金份额总额 50,150,796.00

4.期末基金份额净值 261,401.294

5.期末基金份额总值 13,601,553.05

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,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、债券投资收益、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.基金净值增长率=基金净值增长额/基金净值期初值。
4.报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 率	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	①-③	②-④
过去三个月	15.90%	1.85%	18.20%	2.64%	-2.27%	-0.01%
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,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、债券投资收益、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.基金净值增长率=基金净值增长额/基金净值期初值。 4.报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较						

5.期末基金份额净值 261,401.294

6.期末基金份额总值 13,601,553.05

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,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、债券投资收益、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.基金净值增长率=基金净值增长额/基金净值期初值。
4.报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

5.期末基金份额净值 261,401.294

6.期末基金份额总值 13,601,553.05

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,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、债券投资收益、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.基金净值增长率=基金净值增长额/基金净值期初值。
4.报告期基金份额净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较