

华安深证300指数证券投资基金 LOF)

2012】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十八日

§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。

基金的基金经理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。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:华安深证300指数(LOF)

基金主代码:160415

交易代码:160415

基金运作方式:上市契约型开放式

基金合同生效日:2011年9月2日

报告期末基金份额总额:337,513,094.28份

投资目标:本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金为被动的股票指数基金，采用完全复制法的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的构成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。

业绩比较基准:95%×深证300价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率

风险收益特征:本基金属于高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 826,747.02

2.本期利润 10,674,712.77

3.加权平均基金份额本期利润 0.0299

4.期末基金份额净值 303,221,985.30

5.期末基金份额总额 0.898%

注:1.所列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:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购费用、红利再投资、基金转换费用等),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

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.基金净值表现

3.2.1 本基金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(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率(④) ①-③ ②-④

过去三个月 2.63% 1.14% 2.10% 1.14% 0.53% 0.00%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安深证300指数证券投资基金 LOF 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2011年9月2日至2012年6月30日)

华安深证300指数证券投资基金 LOF 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2011年9月2日至2012年6月30日)