

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
报告期起止日期：二〇一三年八月二十四日

§1 重要提示及目录

基金管理人的董事、监事、经理或重大风险控制人,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经二〇一三年八月二十一日由独立董事签字确认,并由董事长签发。
基金托管人：中国银行股份有限公司根据本基金管理规定,于二〇一三年八月二十一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,保证复核结果不存在虚假记载、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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务数据未经审计。
本报告期自二〇一三年八月一日起至六月三十日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 华安深证300指数证券投资基金(LOF)(场内简称:华安S300)
基金代码 160415
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6月2日
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
报告期基金总份额 277,372,778.89份
基金合同存续期 不定期
基金上市的证券交易所 深圳
上市日期 2011年10月18日
2.2 基金产品说明

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,追求跟踪误差度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金将被动地跟踪标的指数,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%×商业银行银行后活期存款基准利率

风险收益特征 本基金为股票型基金,属于较高风险、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。

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 中国银行股份有限公司

姓名 冯颖 唐州徵
联系电话 021-38969999 95566
电子邮箱 fengy@huauan.com.cn txgpx@bank-of-china.com

客户服务电话 4008850099 95566
传真 021-68863414 010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 www.huauan.com

基金半年度报告备置地点 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

加权平均基金份额本期利润 -0.0391

本期基金份额净值增长率 -6.71%

3.1.2 期末可供分配利润 报告期末(2013年6月30日) -0.1926

期末可供分配利润 223,956,525.74
0.807

3.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

3.2.1 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

3.3 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.4 期末基金的份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

3.5 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.6 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

3.7 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 1,055,743.64
本期利润 -11,899,815.52

3.9 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.10 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.11 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.12 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.13 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.14 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.15 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.16 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.17 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.18 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.19 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.20 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.21 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.22 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.23 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.24 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.25 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.26 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.27 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.28 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.29 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.30 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.31 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.32 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.33 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.34 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.35 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.36 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.37 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.38 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.39 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.40 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.41 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.42 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.43 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.44 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.45 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.46 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.47 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.48 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.49 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.50 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.51 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.52 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.53 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.54 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.55 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.56 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.57 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.58 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.59 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.60 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.61 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.62 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.63 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.64 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.65 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.66 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.67 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.68 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.69 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.70 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807

3.71 期末可供分配利润乘以期末基金份额净值与未分配利润中实现部分的孰低数(即期末余额,不是定期发生盈余) 0.807