

## 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

## [2015]第一季度报告

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:二〇一五年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金托管人承诺以其诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩不预示其未来表现。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。

本报告期财务报告于2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安深证300指数(LOF)
场内简称	华安300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金合同生效日	2011年6月2日
报告期末基金份额总额	34,409,869.61份
投资目标	本基金通过被动式指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求长期资本增值和跑赢基准指数。
投资策略	本基金通过被动式指数化投资策略，采用完全复制法的策略跟踪标的指数，即按照标的指数的构成及其权重投资于建仓基金投资组合，并根据标的指数的变动及时进行调整。
业绩比较基准	95%×深证300指数收益率+5%银行定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金，属中高风险、较高收益的股票型基金。其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和货币基金。
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

主要财务指标		报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)			
1.本期已实现收益		9,020,318.88			
2.本期利润		10,849,010.84			
3.加权平均基金份额利润		0.2659			
4.期末基金份额净值		50,743,849.90			
5.期末基金份额净值		1.475			

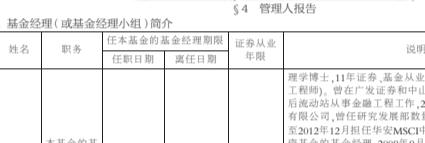
注:1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费、申购和赎回费、基金转换费、基础设施费、客户维护费等),计入费用后实际收益水平将低于列示数字。  
2)本期实现收益指基金本期利润减去所有期间费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。  
3)基金合同生效以来基金的平均净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长①	净值增长②	业绩比较基准收益差额③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去三个月	24.26%	1.38%	29.61%	1.40%	-5.35%	-0.02%

3.2.1 本基金合同生效以来基金的份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安深证300指数证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	姓名	性别	担任本基金的基金经理期间	说明
本基金管理人董事 会及监察稽核部 高级总监	许之彦	女	2011-9-2	11年 理学博士,11年证券从业经验,CQF(国际注册金融工程师)。曾在平安证券、光大证券、平安资产管理有限公司工作,2008年4月至今任华安基金管理有限公司董事兼监察稽核部高级总监。期间负责基金的合规管理及运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法或损害基金份额持有人利益的情形。
本基金的基 金经理	孙晓进	男	2015-3-20	5年 硕士研究生,5年证券从业经验,其中3年基金管理经验。2010年1月起任华安基金管理有限公司基金经理,之后担任华安基金管理有限公司基金经理,期间负责基金的合规管理及运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法或损害基金份额持有人利益的情形。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日起,即以公告为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本基金报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,招募说明书等有关基金法律文件的规定,履行诚实守信、勤勉尽责的义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法或损害基金份额持有人利益的情形。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 平等交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金评价方法指引(试行)》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易制度指引(试行)》,对投资决策、交易执行、业绩评估等环节进行规范,确保公平交易制度的执行。

4.3.2 交易行为的监控和报告

4.3.3 投资组合的公平交易情况

4.3.4 投资组合的公平交易行为的专项说明

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公平交易制度的执行情况

4.3.67 公平交易制度的执行情况

4.3.68 公平交易制度的执行情况

4.3.69 公平交易制度的执行情况

4.3.70 公平交易制度的执行情况

4.3.71 公平交易制度的执行情况

4.3.72 公平交易制度的执行情况

4.3.73 公平交易制度的执行情况

4.3.74 公平交易制度的执行情况

4.3.75 公平交易制度的执行情况

4.3.76 公平交易制度的执行情况

4.3.77 公平交易制度的执行情况

4.3.78 公平交易制度的执行情况

4.3.79 公平交易制度的执行情况

4.3.80 公平交易制度的执行情况

4.3.81 公平交易制度的执行情况

4.3.82 公平交易制度的执行情况

4.3.83 公平交易制度的执行情况

4.3.84 公平交易制度的执行情况

4.3.85 公平交易制度的执行情况

4.3.86 公平交易制度的执行情况

4.3.87 公平交易制度的执行情况

4.3.88 公平交易制度的执行情况

4.3.89 公平交易制度的执行情况

4.3.90 公平交易制度的执行情况

4.3.91 公平交易制度的执行情况

4.3.92 公平交易制度的执行情况

4.3.93 公平交易制度的执行情况

4.3.94 公平交易制度的执行情况

4.3.95 公平交易制度的执行情况

4.3.96 公平交易制度的执行情况

4.3.97 公平交易制度的执行情况

4.3.98 公平交易制度的执行情况

4.3.99 公平交易制度的执行情况