

华安深证300指数证券投资基金 (LOF)

2012 年度报告摘要

2012年12月31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
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1101号21楼

1.1 重要提示
基金管理人承诺, 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。本年度报告摘要为全文的摘要, 投资者欲了解详细内容, 应当仔细阅读全文。
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资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证基金份额持有人的本金不受损失, 投资者应自行承担投资风险。
本年度报告摘要自2013年1月1日起生效并适用。

1.2 基金基本情况

基金简称	华安深证300指数(LOF)
基金代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市型开放式基金
基金合同生效日	2011年09月21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
跟踪标的基金简称	沪深300指数
基金上市交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动跟踪标的指数, 力求跟踪标的指数的变动, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动投资策略, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现, 即按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合, 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, 其风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人基金托管人

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
信息披露负责人	姓名: 汪静 联系电话: 021-38699999 电子邮箱: wangjing@huaman.com.cn	姓名: 李莉 联系电话: 010-65948855 电子邮箱: wangjing@huaman.com.cn
客户服务电话	4008885999	95566
传真	021-68863414	010-65949442

2.4 信息披露方式

基金年度报告全文的备查地点	www.huaman.com.cn
基金年度报告全文的备查地点	上海市世纪大道178号华安基金中心二期3层302室

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2012年	2011年9月21日至2011年12月31日	2011年
本期已实现收益	-26,377,588.29	-11,602,550.51	-
本期利润	14,208,864.47	-73,946,301.26	-
加权平均基金份额本期利润	0.0417	-0.1387	-
本期基金份额净值增长率	3.59%	-16.50%	-

3.1.2 期末数据和指标

期末可供分配基金份额利润	-0.1349	-0.1654
期末基金资产净值	26,591,961.34	333,102,606.76
期末基金份额净值	0.865	0.835

3.1.3 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.97%	1.30%	3.90%	1.28%	0.07%	0.02%
过去六个月	-3.67%	1.33%	-3.81%	1.31%	0.14%	0.02%
过去一年	3.59%	1.37%	2.25%	1.34%	1.34%	0.06%
自基金合同生效起至今	-13.50%	1.36%	-20.56%	1.40%	7.06%	-0.04%

3.2 基金持有人结构及基金持有人集中度

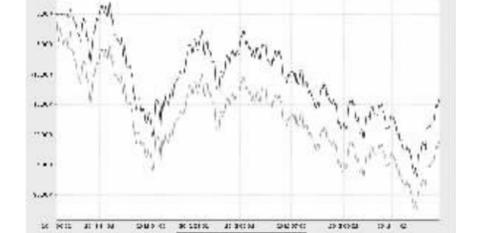
基金持有人户数(户)	1,000
基金持有人户数(户)持有基金份额比例	100%
机构投资者持有基金份额比例	0%
个人投资者持有基金份额比例	100%

3.3 基金管理人及基金托管人

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

3.4 基金管理人及基金托管人

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



3.5 基金管理人及基金托管人

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

3.6 基金管理人及基金托管人

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

3.7 基金管理人及基金托管人

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

3.8 基金管理人及基金托管人

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

3.9 基金管理人及基金托管人

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

3.10 基金管理人及基金托管人

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

3.11 基金管理人及基金托管人

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

3.12 基金管理人及基金托管人

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

3.13 基金管理人及基金托管人

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

3.14 基金管理人及基金托管人

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

3.15 基金管理人及基金托管人

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

3.16 基金管理人及基金托管人

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

3.2 基金持有人结构及基金持有人集中度

基金持有人户数(户)	1,000
基金持有人户数(户)持有基金份额比例	100%
机构投资者持有基金份额比例	0%
个人投资者持有基金份额比例	100%

3.3 基金管理人及基金托管人

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

3.4 基金管理人及基金托管人

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

3.5 基金管理人及基金托管人

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

3.6 基金管理人及基金托管人

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

3.7 基金管理人及基金托管人

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

3.8 基金管理人及基金托管人

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

3.9 基金管理人及基金托管人

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

3.10 基金管理人及基金托管人

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

3.11 基金管理人及基金托管人

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

3.12 基金管理人及基金托管人

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

3.13 基金管理人及基金托管人

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

3.14 基金管理人及基金托管人

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

3.15 基金管理人及基金托管人

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

3.16 基金管理人及基金托管人

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

3.17 基金管理人及基金托管人

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

4. 基金业绩

项目	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年9月21日至2011年12月31日	2011年
当期基金份额净值增长率	4.19%	14.12%	851.60%
当期基金份额净值增长率标准差	1.37%	1.38%	177.10%

4.1 基金业绩比较基准

95%×深证300价格指数收益率+5%×商业银行活期存款基准利率

4.2 基金业绩评价

本基金采用被动投资策略, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

4.3 基金业绩评价

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

4.4 基金业绩评价

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

4.5 基金业绩评价

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

4.6 基金业绩评价

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

4.7 基金业绩评价

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

4.8 基金业绩评价

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

4.9 基金业绩评价

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

4.10 基金业绩评价

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

4.11 基金业绩评价

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

4.12 基金业绩评价

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

4.13 基金业绩评价

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

4.14 基金业绩评价

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

4.15 基金业绩评价

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

4.16 基金业绩评价

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

4.17 基金业绩评价

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

4.18 基金业绩评价

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

5. 基金资产净值及基金份额持有人结构

基金资产净值	26,591,961.34
基金份额总额	30,511,111.11
基金份额持有人户数	1,000
基金份额持有人户数(户)持有基金份额比例	100%
机构投资者持有基金份额比例	0%
个人投资者持有基金份额比例	100%

6. 基金管理人及基金托管人

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

6.1 基金管理人及基金托管人

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

6.2 基金管理人及基金托管人

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

6.3 基金管理人及基金托管人

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

6.4 基金管理人及基金托管人

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

6.5 基金管理人及基金托管人

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

6.6 基金管理人及基金托管人

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

6.7 基金管理人及基金托管人

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

6.8 基金管理人及基金托管人

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

6.9 基金管理人及基金托管人

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

6.10 基金管理人及基金托管人

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

6.11 基金管理人及基金托管人

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

6.12 基金管理人及基金托管人

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

6.13 基金管理人及基金托管人

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

6.14 基金管理人及基金托管人

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

6.15 基金管理人及基金托管人

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

6.16 基金管理人及基金托管人

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