

# 华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

## 2011 年第 4 季度报告

2011 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

报告送出日期：二〇一二年一月二十日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 1 月 11 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、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和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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	399,097,935.44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。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其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。
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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-13,093,197.43
2.本期利润	-54,516,092.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1072
4.期末基金资产净值	333,102,606.76
5.期末基金份额净值	0.835

注: 1. 所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、红利再投资费、基金转换费等),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、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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本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	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	长率①	长率标 准差②	较基准 收益率 ③	较基准 收益率 标准差 ④		
过去三个月	-13.74%	1.48%	-13.51%	1.49%	-0.23%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率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对比图

(2011 年 9 月 2 日至 2011 年 12 月 31 日)



注：1.本基金于 2011 年 9 月 2 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。  
 2.根据《华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、指数投资部总监	2011-9-2	-	8年	理学博士，8年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008年4月起担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009年9月起同时担任华安上证180ETF及180ETF联接基金的基金经理。2010年11月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任本基金的基金经理。
章海默	本基金的基金经理	2011-9-2	-	7年	复旦大学管理学院工商管理硕士，复旦大学经济学学士，7年基金从业经历。曾在安永华明会计师事务所工作，2003年9月加入华安基金管理有限公司，任基金运营部基金核算主管，2009年12月起担任180ETF联接基金的基金经理助理。2011年9月起同时担任本基金的基金经理。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照本基金的基金合同规定，本基金的投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，虽然通胀数据见顶回落，央行也下调准备金，但由于市场的担心转向了经济增长。欧债危机还没有找到较好的途径，美国经济依然处在较为缓慢的复苏过程，国内经济可能从高增长阶段逐步转型，经济增速将有所放缓。四季度，国内市场出现了一定下跌，深证市场跌幅较大，上证蓝筹股为代表的上证 180 指数跌幅为 6.87%，而深证市场的代表指数深 300 的跌幅为 14.23%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.835 元，本报告期份额净值增长率为 -13.74%，同期业绩比较基准增长率为 -13.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年，国内经济将面临较为复杂的国内外环境，经济增长将略微放缓，美国经济也将延续缓慢的复苏过程，欧债问题导致欧洲经济出现衰退的可能性较低。国内 A 股估值已经创近年来的新低，我们认为国内 A 股市场已经具备长期投资价值。作为深证 300 的管理人，我们将继续秉承既定的投资目标与策略，规范运作、勤勉尽责，充分拟合指数，减少跟踪误差，为投资者提供优质的深证 300 指数投资工具。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	316,383,479.61	90.25
	其中：股票	316,383,479.61	90.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	31,591,603.25	9.01
6	其他各项资产	2,569,289.41	0.73
7	合计	350,544,372.27	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

### 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,105,699.01	1.53
B	采掘业	15,405,846.18	4.62
C	制造业	183,107,711.04	54.97
C0	食品、饮料	25,947,874.42	7.79
C1	纺织、服装、皮毛	3,407,724.56	1.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,871,842.59	0.56
C4	石油、化学、塑胶、塑料	21,060,037.15	6.32
C5	电子	13,558,194.55	4.07
C6	金属、非金属	33,527,523.88	10.07
C7	机械、设备、仪表	60,569,085.98	18.18
C8	医药、生物制品	22,296,229.90	6.69

C99	其他制造业	869,198.01	0.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,743,995.48	1.12
E	建筑业	3,228,333.07	0.97
F	交通运输、仓储业	3,554,328.17	1.07
G	信息技术业	11,868,217.99	3.56
H	批发和零售贸易	18,307,116.29	5.50
I	金融、保险业	26,676,832.41	8.01
J	房地产业	26,251,591.46	7.88
K	社会服务业	8,148,410.72	2.45
L	传播与文化产业	3,860,008.20	1.16
M	综合类	7,125,389.59	2.14
	合计	316,383,479.61	94.98

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	1,738,736	12,988,357.92	3.90
2	000001	深发展A	730,652	11,390,864.68	3.42
3	002024	苏宁电器	1,270,950	10,726,818.00	3.22
4	000858	五粮液	269,337	8,834,253.60	2.65
5	000157	中联重科	993,466	7,639,753.54	2.29
6	000651	格力电器	425,049	7,349,097.21	2.21
7	000776	广发证券	297,435	6,246,135.00	1.88

8	000527	美的电器	431,330	5,279,479.20	1.58
9	000983	西山煤电	339,875	4,962,175.00	1.49
10	000422	湖北宜化	253,140	4,467,921.00	1.34

### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2011年5月27日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	747,877.72
2	应收证券清算款	1,702,783.54
3	应收股利	-
4	应收利息	4,588.92
5	应收申购款	114,039.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,569,289.41

#### 5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	608,040,554.70
本报告期基金总申购份额	56,368,493.05
减：本报告期基金总赎回份额	265,311,112.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	399,097,935.44

## § 7 备查文件目录

## 7.1 备查文件目录

- 1、《华安深证 300 证券指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 2、《华安深证 300 证券指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 3、《华安深证 300 证券指数证券投资基金（LOF）托管协议》

## 7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.huaan.com.cn>。

## 7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一二年一月二十日