

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
§ 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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2013年1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。
基金销售代理人：2012年12月10日刊登的华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金原华夏沪深300指数证券投资基金的招募说明书。
华夏沪深300指数证券投资基金于2012年1月25日转型为华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并相应修订基金合同条款。
基金管理人承诺诚守信用，勤勉尽责的按期管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金过往业绩并不代表未来表现。投资人投资需谨慎。

本报告期为2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：华夏沪深300ETF联接
基金主代码：000051
交易代码：000051
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2009年7月10日
报告期末基金份额总额：27,756,194,055.50份

采用指数化投资方式，追求对标的指数的有效跟踪、获得与标的指数收益相当的回报及适当的其他收益。

本基金主要通过在交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流量情况，本基金将综合考虑申购、赎回量、折溢价率、成份股价格指数成份股的停牌等情况，适时调整股票组合的构成和调整密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入或卖出标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适当参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的差利，以增强基金收益。

业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时点以报告期间为准）。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.1 报告期末基金基本情况

基金名称：华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码：510330
交易型开放式

基金合同生效日：2012年12月25日

基金份额上网的证券交易所：上海证券交易所

上市日期：2013年1月16日

基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司

2.1.2 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.3 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.4 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.5 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.6 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.7 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.8 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.9 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.10 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.11 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.12 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.13 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.14 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.15 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.16 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.17 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.18 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.19 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

2.1.20 报告期基金产品说明

投资目标：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：本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

业绩比较基准：本基金业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

基金管理人：华夏基金管理有限公司