

|  |   |                             |            |            |       |                   |
|--|---|-----------------------------|------------|------------|-------|-------------------|
| 基金管理人：华夏基金管理有限公司<br>基金托管人：中国工商银行股份有限公司<br>报告送出日期：二〇一三年一月二十一日   |   |                             |            |            |       |                   |
| § 1 重要提示   |   |                             |            |            |       |                   |
| 基金管理人华夏基金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本基金合同规定，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。             |   |                             |            |            |       |                   |
| 华夏基金管理有限公司关于华夏沪深300指数证券投资基金基金经理变更的公告，华夏沪深300指数证券投资基金于2012年12月25日转为华夏沪深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，也不保证基金净值不受亏损或本金损失。  |   |                             |            |            |       |                   |
| 基金的投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读基金的风险揭示书。   |   |                             |            |            |       |                   |
| 本报告中财务资料未经审计。  |   |                             |            |            |       |                   |
| 本报告自2012年10月1日起至12月31日止。   |   |                             |            |            |       |                   |
| § 2 基金产品概况   |   |                             |            |            |       |                   |
| 2.1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  |                             |            |            |       |                   |
| 投资目标   | 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似的回报及适当的其他收益。  |                             |            |            |       |                   |
| 投资策略   | 本基金主要通过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、赎回的现金流情况，本基金将综合目标ETF的流动性、标的指数的成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金可以通过买入标的指数的成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，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%（指收盘价，下同，按期间向所算）。   |                             |            |            |       |                   |
| 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目标基金基本情况  |   |                             |            |            |       |                   |
| 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  | 510303  |                             |            |            |       |                   |
| 基金运作方式   | 交易型开放式  |                             |            |            |       |                   |
| 基金合同生效日  | 2012年12月25日   |                             |            |            |       |                   |
| 基金份额上市的证券交易所   | 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目标基金产品说明  |   |                             |            |            |       |                   |
| 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   | 本基金主要采用买入复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，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，属于较高风险、较高收益的品种。   |                             |            |            |       |                   |
| § 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(2012年10月1日—2012年12月31日) |            |            |       |                   |
| 1.本期已实现收益  |   |                             |            |            |       | -3,786,745,658.20 |
| 2.本期利润   |   |                             |            |            |       | 1,879,253,077.28  |
| 3.加权平均基金份额本期利润   |   |                             |            |            |       | 0.0712            |
| 4.期末基金资产净值   |   |                             |            |            |       | 20,528,927,152.27 |
| 5.期末基金份额净值   |   |                             |            |            |       | 0.7400            |
| 注：①所述基金净值指标不包括因买入或卖出基金的各项费用，计入费用后实际收益率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）扣除相关费用后的金额，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   | 净值增长率①  | 净值增长率②                      | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率④ | ①-③   | ②-④               |
| 过去三个月  | 9.79%   | 1.23%                       | 9.77%      | 1.22%      | 0.02% | 0.01%             |
| 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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  |   |                             |            |            |       |                   |
| 华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金（自2012年12月25日成立至2012年12月31日）  |   |                             |            |            |       |                   |
| 2009年7月10日至2012年12月31日   |   |                             |            |            |       |                   |

# 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

## 2012

## 第四季度报告

§ 2 报告期末投资目标基金名称

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称       | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|------|--------|------------|-------------------|--------------|
| 1  | 华夏沪深300ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 华夏基金管理有限公司 | 15,921,962,804.58 | 77.56        |

§ 3 报告期末按行业分行的股票投资明细

金额单位：人民币元

| 代码  | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------------|------------------|--------------|
| A   | 农林、牧、渔业        | 20,954,361.72    | 0.10         |
| B   | 采掘业            | 353,838,755.63   | 1.72         |
| C   | 制造业            | 1,220,060,949.66 | 5.94         |
| C0  | 食品、饮料          | 250,275,777.93   | 1.22         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 8,602,340.60     | 0.04         |
| C2  | 木材、家具          | --               | --           |
| C3  | 造纸、印刷          | --               | --           |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 73,659,479.45    | 0.36         |
| C5  | 电子             | 81,265,812.70    | 0.40         |
| C6  | 金属、非金属         | 262,302,072.30   | 1.28         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 375,243,449.07   | 1.83         |
| C8  | 医药、生物制品        | 163,932,718.36   | 0.80         |
| C99 | 其他制造业          | 4,779,299.25     | 0.02         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 131,385,451.63   | 0.64         |
| E   | 建筑业            | 130,175,423.73   | 0.63         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 82,520,072.70    | 0.42         |
| G   | 信息技术业          | 85,459,085.46    | 0.40         |
| H   | 批发和零售贸易        | 80,405,133.83    | 0.39         |
| I   | 金融、保险业         | 1,196,608,112.11 | 5.83         |
| J   | 房地产业           | 215,116,309.16   | 1.05         |
| K   | 社会服务业          | 35,316,814.18    | 0.17         |
| L   | 传播与文化产业        | 15,963,229.52    | 0.08         |
| M   | 综合类            | 43,866,427.63    | 0.21         |
| 合计  |                | 3,611,710,126.96 | 17.59        |

§ 4 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股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 8,991,152  | 123,628,340.00 | 0.60         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 15,475,427 | 121,636,644.00 | 0.59         |
| 3  | 603118 | 中国平安 | 2,283,700  | 103,428,773.00 | 0.50         |
| 4  | 600837 | 海通证券 | 9,450,875  | 96,871,467.00  | 0.47         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 5,740,938  | 95,816,252.22  | 0.47         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 8,414,798  | 83,474,796.16  | 0.41         |
| 7  | 000002 | 万科A  | 6,656,300  | 67,361,756.00  | 0.33         |
| 8  | 000562 | 宏源证券 | 4,000,000  | 64,640,000.00  | 0.31         |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 283,004    | 59,153,496.08  | 0.29         |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 2,257,472  | 57,226,915.20  | 0.28         |

§ 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号        | 债券品种    | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|-----------|---------|----------------|--------------|
| 1         | 国家债券    | 398,035,000.00 | 1.94         |
| 2         | 央行票据    | --             | --           |
| 3         | 金融债券    | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 其中：政策性金融债 |         | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 4         | 企业债券    | --             | --           |
| 5         | 企业短期融资券 | --             | --           |
| 6         | 中期票据    | --             | --           |
| 7         | 可转债     | 35,045,756.32  | 0.17         |
| 8         | 其他      | --             | --           |
| 9         | 合计      | 682,930,756.32 | 3.33         |

§ 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五名债券投资明细

4.1 基金经理 或基金基金经理简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|-------------------|-------------|--------|---|
| 张弘弢 | 本基金的基金经理、数量投资部副经理 | 2009-07-10  | 12年    | 硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。   |
| 方军  | 本基金的基金经理、数量投资部副经理 | 2009-07-10  | 13年    | 硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和平安回报证券投资基金基金经理助理等。 |

注：1、上述人员任职日期：自其担任本基金管理人对外披露的任职日期起算。

2、上述人员的离职日期：自其不再担任本基金管理人对外披露的离职日期起算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度执行情况  
本基金管理人一贯严格贯彻各项公平交易管理制度，制定并严格执行相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内未发现本基金有异常交易行为。

报告期内，本基金运作模式及与本基金的交易对手公开竞价方式双向交易成交少的单边交易量超过该证券当日成交5%的情况，为：本基金因流动性需求，在二级市场买入或卖出部分基金份额。

4.4 报告期内基金投资运作合规情况说明  
2012年4月，美国、法国、德国、日本等发达国家，地区持续采取宽松货币政策，全球流动性进一步宽松；国内方面，货币政策继续宽松和稳健，金融体系流动性充裕，国内经济保持平稳较快发展，通胀压力可控，人民币汇率保持基本稳定，人民币汇率升值预期明显，人民币升值预期明显。

报告期内，本基金管理人严格遵守了基金合同，严格执行了基金管理人投资管理制度，严格执行了基金管理人投资管理制度，严格执行了基金管理人投资管理制度，严格执行了基金管理人投资管理制度。

4.5 报告期内基金的投资组合报告  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.79%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期资产配置情况如下：

4.5.1 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.2 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.3 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.4 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.5 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.6 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.7 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.8 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

4.5.9 基金资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产配置情况如下：

# 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

## 2012

## 第四季度报告

§ 2 报告期末投资目标基金名称

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称       | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|------|--------|------------|-------------------|--------------|
| 1  | 华夏沪深300ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 华夏基金管理有限公司 | 15,921,962,804.58 | 77.56        |

§ 3 报告期末按行业分行的股票投资明细

金额单位：人民币元

| 代码  | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------------|------------------|--------------|
| A   | 农林、牧、渔业        | 20,954,361.72    | 0.10         |
| B   | 采掘业            | 353,838,755.63   | 1.72         |
| C   | 制造业            | 1,220,060,949.66 | 5.94         |
| C0  | 食品、饮料          | 250,275,777.93   | 1.22         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 8,602,340.60     | 0.04         |
| C2  | 木材、家具          | --               | --           |
| C3  | 造纸、印刷          | --               | --           |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 73,659,479.45    | 0.36         |
| C5  | 电子             | 81,265,812.70    | 0.40         |
| C6  | 金属、非金属         | 262,302,072.30   | 1.28         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 375,243,449.07   | 1.83         |
| C8  | 医药、生物制品        | 163,932,718.36   | 0.80         |
| C99 | 其他制造业          | 4,779,299.25     | 0.02         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 131,385,451.63   | 0.64         |
| E   | 建筑业            | 130,175,423.73   | 0.63         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 82,520,072.70    | 0.42         |
| G   | 信息技术业          | 85,459,085.46    | 0.40         |
| H   | 批发和零售贸易        | 80,405,133.83    | 0.39         |
| I   | 金融、保险业         | 1,196,608,112.11 | 5.83         |
| J   | 房地产业           | 215,116,309.16   | 1.05         |
| K   | 社会服务业          | 35,316,814.18    | 0.17         |
| L   | 传播与文化产业        | 15,963,229.52    | 0.08         |
| M   | 综合类            | 43,866,427.63    | 0.21         |
| 合计  |                | 3,611,710,126.96 | 17.59        |

§ 4 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股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 8,991,152  | 123,628,340.00 | 0.60         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 15,475,427 | 121,636,644.00 | 0.59         |
| 3  | 603118 | 中国平安 | 2,283,700  | 103,428,773.00 | 0.50         |
| 4  | 600837 | 海通证券 | 9,450,875  | 96,871,466.00  | 0.47         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 5,740,938  | 95,816,252.22  | 0.47         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 8,414,798  | 83,474,796.16  | 0.41         |
| 7  | 000002 | 万科A  | 6,656,300  | 67,361,756.00  | 0.33         |
| 8  | 000562 | 宏源证券 | 4,000,000  | 64,640,000.00  | 0.31         |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 283,004    | 59,153,496.08  | 0.29         |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 2,257,472  | 57,226,915.20  | 0.28         |

§ 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号        | 债券品种    | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|-----------|---------|----------------|--------------|
| 1         | 国家债券    | 398,035,000.00 | 1.94         |
| 2         | 央行票据    | --             | --           |
| 3         | 金融债券    | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 其中：政策性金融债 |         | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 4         | 企业债券    | --             | --           |
| 5         | 企业短期融资券 | --             | --           |
| 6         | 中期票据    | --             | --           |
| 7         | 可转债     | 35,045,756.32  | 0.17         |
| 8         | 其他      | --             | --           |
| 9         | 合计      | 682,930,756.32 | 3.33         |

§ 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五名债券投资明细

4.1 基金经理 或基金基金经理简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|-------------------|-------------|--------|---|
| 张弘弢 | 本基金的基金经理、数量投资部副经理 | 2009-07-10  | 12年    | 硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。   |
| 方军  | 本基金的基金经理、数量投资部副经理 | 2009-07-10  | 13年    | 硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和平安回报证券投资基金基金经理助理等。 |

注：上述人员任职时间，自其担任本基金管理人对外披露的任职日期起算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度执行情况  
本基金管理人一贯严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》和《证券投资基金运作管理办法》等法律法规，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易专项说明

报告期内未发现本基金有异常交易行为。  
报告期内，本基金未发现存在与本基金的交易对手方成交同日反向交易且成交金额超过证券当日成交5%的情况，为本基金管理人主动管理投资行为的正常交易。

4.4 报告期内基金投资运作合规性说明  
2012年4月，美国、法国、德国、日本等发达国家，地区持续采取宽松货币政策，全球流动性进一步膨胀；国内方面，货币政策继续宽松和稳健，金融体系多层次，国内经济保持平稳较快发展，通胀压力可控，人民币汇率保持基本稳定，人民币汇率升值预期明显，人民币升值预期明显。

报告期内，本基金管理人严格遵守了《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，严格执行了《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，严格执行了《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，严格执行了《基金合同》和《招募说明书》的有关规定。

4.5 报告期内基金的投资组合报告  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期资产配置情况如下：

4.5.1 资产配置情况  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期资产配置情况如下：

4.5.2 股票投资情况  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期股票投资情况如下：

4.5.3 债券投资情况  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期债券投资情况如下：

4.5.4 货币市场基金投资情况  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期货币市场基金投资情况如下：

4.5.5 其他资产情况  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期其他资产情况如下：

4.5.6 基金资产净值及基金份额净值  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期基金资产净值及基金份额净值如下：

4.5.7 基金资产净值及基金份额净值  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期基金资产净值及基金份额净值如下：

4.5.8 基金资产净值及基金份额净值  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期基金资产净值及基金份额净值如下：

4.5.9 基金资产净值及基金份额净值  
截至2012年12月31日，本基金资产净值为740.0元，本报告期份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期基金资产净值及基金份额净值如下：

# 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

## 2012

## 第四季度报告

§ 2 报告期末投资目标基金名称

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称       | 基金类型 | 运作方式   | 管理人        | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|------|--------|------------|-------------------|--------------|
| 1  | 华夏沪深300ETF | 股票型  | 交易型开放式 | 华夏基金管理有限公司 | 15,921,962,804.58 | 77.56        |

§ 3 报告期末按行业分行的股票投资明细

金额单位：人民币元

| 代码  | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|-----|----------------|------------------|--------------|
| A   | 农林、牧、渔业        | 20,954,361.72    | 0.10         |
| B   | 采掘业            | 353,838,755.63   | 1.72         |
| C   | 制造业            | 1,220,060,949.66 | 5.94         |
| C0  | 食品、饮料          | 250,275,777.93   | 1.22         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 8,602,340.60     | 0.04         |
| C2  | 木材、家具          | --               | --           |
| C3  | 造纸、印刷          | --               | --           |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 73,659,479.45    | 0.36         |
| C5  | 电子             | 81,265,812.70    | 0.40         |
| C6  | 金属、非金属         | 262,302,072.30   | 1.28         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 375,243,449.07   | 1.83         |
| C8  | 医药、生物制品        | 163,932,718.36   | 0.80         |
| C99 | 其他制造业          | 4,779,299.25     | 0.02         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 131,385,451.63   | 0.64         |
| E   | 建筑业            | 130,175,423.73   | 0.63         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 82,520,072.70    | 0.42         |
| G   | 信息技术业          | 85,459,085.46    | 0.40         |
| H   | 批发和零售贸易        | 80,405,133.83    | 0.39         |
| I   | 金融、保险业         | 1,196,608,112.11 | 5.83         |
| J   | 房地产业           | 215,116,309.16   | 1.05         |
| K   | 社会服务业          | 35,316,814.18    | 0.17         |
| L   | 传播与文化产业        | 15,963,229.52    | 0.08         |
| M   | 综合类            | 43,866,427.63    | 0.21         |
| 合计  |                | 3,611,710,126.96 | 17.59        |

§ 4 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股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 8,991,152  | 123,628,340.00 | 0.60         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 15,475,427 | 121,636,644.00 | 0.59         |
| 3  | 603118 | 中国平安 | 2,283,700  | 103,428,773.00 | 0.50         |
| 4  | 600837 | 海通证券 | 9,450,875  | 96,871,466.00  | 0.47         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 5,740,938  | 95,816,252.22  | 0.47         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 8,414,798  | 83,474,796.16  | 0.41         |
| 7  | 000002 | 万科A  | 6,656,300  | 67,361,756.00  | 0.33         |
| 8  | 000562 | 宏源证券 | 4,000,000  | 64,640,000.00  | 0.31         |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 283,004    | 59,153,496.08  | 0.29         |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 2,257,472  | 57,226,915.20  | 0.28         |

§ 5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号        | 债券品种    | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|-----------|---------|----------------|--------------|
| 1         | 国家债券    | 398,035,000.00 | 1.94         |
| 2         | 央行票据    | --             | --           |
| 3         | 金融债券    | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 其中：政策性金融债 |         | 249,850,000.00 | 1.22         |
| 4         | 企业债券    | --             | --           |
| 5         | 企业短期融资券 | --             | --           |
| 6         | 中期票据    | --             | --           |
| 7         | 可转债     | 35,045,756.32  | 0.17         |
| 8         | 其他      | --             | --           |
| 9         | 合计      | 682,930,756.32 | 3.33         |

§ 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五名债券投资明细

4.1 基金经理 或基金基金经理简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------|-------------|--------|-----|
| 张弘弢 | 本基金的基金经理、数量投资部副总经理 | 2009-07-10  | -      | 12年 |
| 方军  | 本基金的基金经理、数量投资部副总经理 | 2009-07-10  | -      | 13年 |

注：1、上述人员任职日期：自任职以来本基金管理人对外披露的任职日期为准。  
2、上述人员的学历及专业：张弘弢，中央财经大学工商管理专业在职研究生；方军，中国人民大学工商管理专业在职研究生。  
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明  
本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认识控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。  
4.3 公平交易专项说明  
4.3.1 公平交易制度执行情况  
本基金管理人严格执行《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》和《证券投资基金运作管理办法》等法律法规，通过系统和人工等方式在各环节严格控制基金公平交易，报告期内，本基金严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度细则》的规定。  
4.3.2 异常交易行为的专项说明  
报告期内未发现本基金有异常交易行为。  
报告期内，本基金运作模式为按本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，为本基金固有交易和对手方执行的交易为反向交易。  
4.4 报告期内基金投资运作投资风格说明  
2012年4季度，国内、国际、欧洲、日本等发达国家、地区经济采取宽松货币政策，全球流动性进一步宽松；国内方面，货币政策继续宽松和稳健，金融和煤炭行业景气度提升，国内经济保持温和复苏态势，大宗商品价格有所回升，人民币汇率升值。  
报告期内，本基金保持了原有的投资风格，10月及12月，在投资仓位保持稳定的基础上，上市公司盈利改善，中央企业重组的持续推进，A股市场活跃度提升，12月14日上证综合指数收盘于1949.21点，创下3年来的新高；其后国际经济基本面保持良好，境外投资市场看好RQDII，10月及12月本基金保持了稳健投资，A股市场活跃度大幅提升，沪深300指数4季度上涨了10.02%。  
报告期内，本基金在保持策略和投资风格的基础上，密切关注宏观经济政策、市场投资热点和个股机会，努力发掘具备长期成长潜力的优质标的。  
4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.7400元，本报告期份额净值增长率为7.79%，同期业绩比较基准增长率为9.77%。本基金本报告期份额净值为0.7400元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
报告期内，国内、国际、欧洲、日本等发达国家、地区经济保持温和复苏的可能性较大，通胀数据仍然在可控范围内，宏观政策方面不会发生较大的调整，市场方面，如果全球宏观经济不发生大的变化，主要发达国家的经济保持稳定，国内经济继续保持复苏态势，目前处于经济复苏的早期阶段，本基金将保持原有的投资风格，密切关注宏观经济政策、市场投资热点和个股机会，努力发掘具备长期成长潜力的优质标的。  
本基金已于2012年12月25日将华夏沪深300ETF联接基金，我们将继续秉承基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作，努力为基金份额持有人谋求长期资本增值和持续回报。  
本基金管理人将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期资本增值，回报信任。

§ 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                | 占基金总资产的比例(%) |
|-------------------|--------------|-------------------|--------------|
| 1                 | 权益投资         | 3,611,710,126.96  | 17.52        |
| 其中：股票             |              | 3,611,710,126.96  | 17.52        |
| 2                 | 基金投资         | 15,921,962,804.58 | 77.25        |
| 3                 | 固定收益投资       | 682,930,756.32    | 3.31         |
| 其中：债券             |              | 682,930,756.32    | 3.31         |
| 资产支持证券            |              | --                | --           |
| 4                 | 金融衍生品投资      | --                | --           |
| 5                 | 买入返售金融资产     | --                | --           |
| 其中：买断式回购的买入返售金融资产 |              | --                | --           |
| 6                 | 银行存款和结算备付金合计 | 365,090,244.60    | 1.77         |
| 7                 | 其他各项资产       | 30,405,575.29     | 0.15         |
| 8                 | 合计           | 20,612,099,507.75 | 100.00       |

| 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 |                |                  |              |                |                   |              |
|--|----------------|------------------|--------------|----------------|-------------------|--------------|
| 2012 第四 季度 报 告                             |                |                  |              |                |                   |              |
| 5.2 报告期末投资目标基金明细                           |                |                  |              |                |                   |              |
| 金额单位:人民币元                                  |                |                  |              |                |                   |              |
| 序号   | 基金名称           | 基金类型             | 运作方式         | 管理人            | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
| 1  | 华夏沪深300ETF     | 股票型              | 交易型开放式       | 华夏基金管理有限公司     | 15,921,962,804.58 | 77.56        |
| 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合                       |                |                  |              |                |                   |              |
| 金额单位:人民币元                                  |                |                  |              |                |                   |              |
| 代码   | 行业类别           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |                |                   |              |
| A  | 农林、牧、渔业        | 20,954,361.72    | 0.10         |                |                   |              |
| B  | 采掘业            | 353,838,755.63   | 1.72         |                |                   |              |
| C  | 制造业            | 1,220,060,949.66 | 5.94         |                |                   |              |
| C0   | 食品、饮料          | 250,275,777.93   | 1.22         |                |                   |              |
| C1   | 纺织、服装、皮毛       | 8,602,340.60     | 0.04         |                |                   |              |
| C2   | 木材、家具          | --               | --           |                |                   |              |
| C3   | 造纸、印刷          | --               | --           |                |                   |              |
| C4   | 石油、化学、塑胶、塑料    | 73,659,479.45    | 0.36         |                |                   |              |
| C5   | 电子             | 81,265,812.70    | 0.40         |                |                   |              |
| C6   | 金属、非金属         | 262,302,072.30   | 1.28         |                |                   |              |
| C7   | 机械、设备、仪表       | 375,243,449.07   | 1.83         |                |                   |              |
| C8   | 医药、生物制品        | 163,932,718.36   | 0.80         |                |                   |              |
| C99  | 其他制造业          | 4,779,299.25     | 0.02         |                |                   |              |
| D  | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 131,385,451.63   | 0.64         |                |                   |              |
| E  | 建筑业            | 130,175,423.73   | 0.63         |                |                   |              |
| F  | 交通运输、仓储业       | 82,520,072.70    | 0.42         |                |                   |              |
| G  | 信息技术业          | 85,459,085.46    | 0.40         |                |                   |              |
| H  | 批发和零售贸易        | 80,405,133.83    | 0.39         |                |                   |              |
| I  | 金融、保险业         | 1,196,608,112.11 | 5.83         |                |                   |              |
| J  | 房地产业           | 215,116,309.16   | 1.05         |                |                   |              |
| K  | 社会服务业          | 35,316,814.18    | 0.17         |                |                   |              |
| L  | 传播与文化产业        | 15,963,229.52    | 0.08         |                |                   |              |
| M  | 综合类            | 43,866,427.63    | 0.21         |                |                   |              |
| 合计   |                | 3,611,710,126.96 | 17.59        |                |                   |              |
| 5.4 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股票投资组合明细     |                |                  |              |                |                   |              |
| 金额单位:人民币元                                  |                |                  |              |                |                   |              |
| 序号   | 股票代码           | 股票名称             | 数量(股)        | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%)      |              |
| 1  | 600036         | 招商银行             | 8,991,152    | 123,628,340.00 | 0.60              |              |
| 2  | 600016         | 民生银行             | 15,475,427   | 121,636,644.00 | 0.59              |              |
| 3  | 603118         | 中国平安             | 2,283,700    | 103,428,773.00 | 0.50              |              |
| 4  | 600837         | 海通证券             | 9,450,875    | 96,871,467.00  | 0.47              |              |
| 5  | 601166         | 兴业银行             | 5,740,938    | 95,816,252.22  | 0.47              |              |
| 6  | 600000         | 浦发银行             | 8,414,798    | 83,474,796.16  | 0.41              |              |
| 7  | 000002         | 万科A              | 6,656,300    | 67,361,756.00  | 0.33              |              |
| 8  | 000562         | 宏源证券             | 4,000,000    | 64,640,000.00  | 0.31              |              |
| 9  | 600519         | 贵州茅台             | 283,004      | 59,153,496.08  | 0.29              |              |
| 10   | 601088         | 中国神华             | 2,257,472    | 57,226,915.20  | 0.28              |              |
| 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合                     |                |                  |              |                |                   |              |
| 金额单位:人民币元                                  |                |                  |              |                |                   |              |
| 序号   | 债券品种           | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |                |                   |              |
| 1  | 国家债券           | 398,035,000.00   | 1.94         |                |                   |              |
| 2  | 央行票据           | --               | --           |                |                   |              |
| 3  | 金融债券           | 249,850,000.00   | 1.22         |                |                   |              |
| 其中:政策性金融债                                  |                | 249,850,000.00   | 1.22         |                |                   |              |
| 4  | 企业债券           | --               | --           |                |                   |              |
| 5  | 企业短期融资券        | --               | --           |                |                   |              |
| 6  | 中期票据           | --               | --           |                |                   |              |
| 7  | 可转债            | 35,045,756.32    | 0.17         |                |                   |              |
| 8  | 其他             | --               | --           |                |                   |              |
| 9  | 合计             | 682,930,756.32   | 3.33         |                |                   |              |
| 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五名债券投资组合       |                |                  |              |                |                   |              |