

# 华夏沪深300指数证券投资基金

【2011】 第二季度报告

<b>基金管理人：华夏基金管理有限公司</b> <b>基金托管人：中国工商银行股份有限公司</b> <b>报告送出日期：二〇一一年七月二十日</b>						
<b>§ 重要提示</b>						
基金管理人、基金托管人及基金销售机构均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法律责任。						
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合信息等内容，未发现数据存在虚假记载、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。						
本报告中所列财务数据未经审计。						
本报告自2011年4月1日起至6月30日止。						
<b>§ 2 基金产品概况</b>						
基金简称	华夏沪深300指数					
基金代码	000055					
交易代码	000055					
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	25,115,986,438.07份					
投资策略	本基金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近的回报及适当的其他收益。					
业绩比较基准	采用指数化投资方式，即按照标的指数的有效跟踪及权重构建的指数的股票投资组合，并根据标的指数的构成及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。但因特殊情形（如市场流动性不足、个别成份股停牌等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人可酌情使用其他投资工具，如加入非成份股等，进行适当的替代。					
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					
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>						
<b>单位：人民币元</b>						
<b>主要财务指标</b>						
1.本期已实现收益	-108,136,431.89					
2.本期利润	-991,649,297.01					
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0402					
4.期末基金资产净值	21,739,820,408.51					
5.期末基金份额净值	0.866					
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，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。						
<b>3.2基金净值表现</b>						
<b>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</b>						
阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.52%	1.04%	-5.03%	1.04%	0.51%	0.00%
<b>3.2.2自基金合同生效以来基金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</b>						
<b>华夏沪深300指数证券投资基金历史走势图</b> (2009年7月10日至2011年6月30日)						
<b>§ 4 基金管理人报告</b>						
<b>4.1基金经理 成基金经理小组 简介</b>						
姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明	
张弘强	本基金的基金经理	2009-7-10	-	11年	硕士，2000年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。	
方军	本基金的基金经理	2009-7-10	-	12年	硕士，1999年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。	
注：1.上述基金经理，离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
2.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
3.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
4.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
5.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
6.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
7.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
8.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
9.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
10.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
11.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
12.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
13.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
14.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
15.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
16.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
17.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
18.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
19.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
20.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
21.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
22.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
23.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
24.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
25.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
26.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
27.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
28.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
29.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
30.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
31.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
32.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
33.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
34.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
35.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
36.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
37.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
38.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
39.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
40.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
41.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
42.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
43.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
44.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
45.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
46.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
47.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
48.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
49.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
50.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
51.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
52.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
53.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
54.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
55.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
56.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
57.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
58.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
59.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
60.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
61.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
62.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
63.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
64.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
65.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
66.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
67.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
68.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
69.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
70.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
71.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
72.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
73.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
74.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
75.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
76.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
77.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
78.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
79.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
80.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
81.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
82.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
83.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
84.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
85.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
86.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
87.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
88.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
89.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
90.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
91.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
92.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
93.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
94.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
95.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
96.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
97.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
98.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
99.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
100.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						

# 华夏蓝筹核心混合型证券投资基金 (LOF)

【2011】 第二季度报告

<b>基金管理人：华夏基金管理有限公司</b> <b>基金托管人：交通银行股份有限公司</b> <b>报告送出日期：二〇一一年七月二十日</b>						
<b>§ 1 重要提示</b>						
基金管理人、基金托管人及基金销售机构均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法律责任。						
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2011年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容，未发现数据存在虚假记载、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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。						
本报告中所列财务数据未经审计。						
本报告自2011年4月1日起至6月30日止。						
<b>§ 2 基金产品概况</b>						
基金名称	华夏蓝筹核心 (LOF)					
基金代码	160311					
交易代码	160311					
基金运作方式	契约型上市开放式					
基金合同生效日	2007年4月24日					
报告期末基金份额总额	12,048,166,027.62份					
投资策略	本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。					
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+0.66%+1%的银行收益率，评价时按相应期间收益率进行。					
风险收益特征	本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。					
基金管理人	华夏基金管理有限公司					
基金托管人	交通银行股份有限公司					
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>						
<b>单位：人民币元</b>						
<b>主要财务指标</b>						
1.本期已实现收益	-6,356,108.46					
2.本期利润	-527,827,270.20					
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0436					
4.期末基金资产净值	10,418,425,547.40					
5.期末基金份额净值	0.865					
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，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。						
<b>3.2基金净值表现</b>						
<b>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</b>						
阶段	净值增长率①	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准差③	①-③	②-④	
过去三个月	-4.74%	1.02%	-3.00%	0.66%	-1.74%	0.36%
<b>3.2.2自基金合同生效以来基金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</b>						
<b>华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）</b> <b>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</b> <b>（2007年4月24日至2011年6月30日）</b>						
注：自2007年4月24日起，本基金投资于本基金合同附件1约定的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。						
<b>§ 4 管理人报告</b>						
<b>4.1基金经理 成基金经理小组 简介</b>						
姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明	
刘文迪	本基金的基金经理	2007-6-12	14年	14年	硕士，曾任华夏基金管理有限公司投资部副经理兼机构部助理，现任华夏基金管理有限公司基金经理助理。	
杨海峰	本基金的基金经理	2009-1-1	7年	7年	硕士，曾任华夏基金管理有限公司投资部副经理兼机构部助理，现任华夏基金管理有限公司基金经理助理。	
王怡欣	本基金的基金经理	2011-2-22	7年	7年	硕士，曾任华夏基金管理有限公司投资部副经理兼机构部助理，现任华夏基金管理有限公司基金经理助理。	
注：1.上述基金经理，离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
2.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
3.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
4.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
5.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
6.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
7.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
8.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
9.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
10.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
11.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
12.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
13.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
14.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
15.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
16.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
17.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
18.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
19.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
20.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
21.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
22.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
23.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
24.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
25.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
26.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
27.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
28.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
29.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
30.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
31.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
32.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
33.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
34.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
35.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
36.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
37.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
38.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
39.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
40.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
41.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
42.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
43.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
44.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
45.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
46.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
47.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
48.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
49.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
50.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
51.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
52.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
53.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
54.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
55.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
56.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
57.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
58.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
59.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
60.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
61.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
62.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
63.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
64.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
65.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
66.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
67.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
68.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
69.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
70.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
71.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
72.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
73.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
74.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
75.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
76.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
77.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
78.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
79.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
80.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
81.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
82.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
83.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
84.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
85.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
86.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
87.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
88.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
89.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
90.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
91.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
92.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						
93.基金经理的离任日期指基金经理对外披露的离任日期。						