

信息披露 Disclosure

B050

华夏沪深300指数证券投资基金

[2011] 第二季度报告

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

报告送出日期:二〇一一年七月二十日

S | 重要提示

基金管理人的董事及董事会成员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、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报告等内容，确认复核不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告公告后至报告期结束，未发生影响本基金投资决策的重大事项。

本报告期内无4月1日至6月30日止。

S | 2 基金产品概况

基金名称 华夏沪深300指数

基金代码 000051

基金运作方式 货币型开放式

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

投资目标 采用量化投资方式，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其他收益。

本基金采取指数化投资方法，即按照行业的指数成份股及其权重重构基金的股票投资组合，从而根据最新的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行动态调整。

投资策略 本基金将通过股票投资组合的构建，力争在扣除交易成本和必要的管理费用后，使基金的业绩表现能够代表未来表现。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。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率，评价时应按期间折算)。

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

S | 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

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.期末基金份额净值 21,739,820,408.51

5.期末基金份额净值 0.866

注:(1)本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率，评价时应按期间折算)。

(2)本期已实现收益、本期利润、本期利润与本期已实现收益之差、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额。

(3)本期利润的计算公式为：本期利润=基金本期已实现收益+本期已分配利润。

(4)加权平均基金份额本期利润的计算公式为：加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

(5)期末基金份额净值的计算公式为：

份额累计净值增长率为本期份额净值增长情况及其同期间业绩比较基准收益变动的比较

份额累计净值增长率为本期业绩比较基准收益变动的比较

份额累计净值增长率为本期业绩比较基准历史走势对比图

(2009年7月1日至2011年6月30日)

份额累计净值增长率为本期业绩比较基准历史走势对比图

份额累计净值增长率为