

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：二〇一三年八月二十六日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不承担虚假记载、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金经理通过业绩比较系数代表其未来表现。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及其更新。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 华夏沪深300ETF联接

基金主代码 510330

交易代码 000051

基金运作方式 混合型开放式

基金合同生效日 2009年7月10日

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

报告期末基金份额总额 31,350,919,797.02份

基金合同存续期间 不定期

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 510330

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6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

报告期末基金份额总额 31,350,919,797.02份

基金合同存续期间 不定期

2.2 基金产品说明

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同向及适当的其他收益。

本基金主要通过交易所买卖基金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，本基金将结合流动性、折溢价率、申购赎回费用、对投资组合进行监控和调整，密切关注标的指数，基金也可以通过买入标的指数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。

5.3 投资人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金投资于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险，较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 华夏基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

信息披露义务人姓名 梁雁巍 赵会军

信息披露义务人联系电话 400-818-6666 010-66105799

信息披露义务人电子邮箱 service@chinaAMC.com custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-818-6666 95588

传真 010-63136700 010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 www.ChinaAMC.com

基金半年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 -359,482,926.50

本期利润 -2,230,035,301.95

加权平均基金份额本期利润 -0.0811

本期基金份额净值增长率 -10.95%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.3413

期末基金份额净值 20,651,680,920.70

期末基金份额净值 0.659

注：①所列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将低于所列示数据。

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 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 份额净值增长率 (%) 份额净值增长率标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) ①-④ ②-④

过去一个月 -14.08% 1.78% -14.71% 1.77% 0.63% 0.01%

过去三个月 -10.10% 1.37% -10.96% 1.38% 0.86% -0.01%

过去六个月 -10.95% 1.43% -11.64% 1.42% 0.69% 0.01%

过去一年 -8.22% 1.31% -9.07% 1.30% 0.85% 0.01%

过去三年 -9.35% 1.31% -10.43% 1.30% 1.08% 0.01%

自基金合同生效以来 -34.10% 1.38% -29.47% 1.44% -4.63% -0.06%

数据截至2013年6月30日，基金份额净值0.659元，基金份额总额31,350,919,797.02份。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值的增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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如图

(2009年7月1日至2013年6月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金管理的经验

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港设有子公司。公司是首批全国社保基金托管人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首家ETP基金管理人、以及受托管理养老金、保险资金投资管理人，香港子公司是首批QFII基金管理人。

华夏基金业务领域广泛的基金管理公司之一。

截至2013年6月30日，华夏基金管理公司管理的资产规模超过440亿元，其中ETP基金管理规模最大的基金管理公司之一，在ETP基金管理方面，华夏沪深300交易型开放式指数基金的管理规模，分别为华夏沪深300ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏行业ETF、华夏黄金ETF、华夏医药ETF等华夏恒生指数、沪深300指数、重阳股票指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品。

2013年上半年，在征询客户意见的基础上，对2012年度中国基金业明星基金奖的评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金奖”，所管理的基金荣获4个单项奖；在《上海证券报》主办的第十届中国“基金金牛奖”的评选中，华夏基金荣获“基金金牛十年·卓越公司奖”；在中国证券报主办的第十届中国“基金金牛奖”的评选中，华夏基金荣获“基金金牛奖”；所管理的基金荣获4个单项奖；在晨星（中国）举办的“基金金牛奖”评选中，华夏基金荣获“最佳基金公司奖”，所管理的基金荣获4个单项奖；在晨星（中国）举办的“中国2013年度基金金牛奖”评选中，华夏基金荣获“年度最受欢迎基金”、“年度回报最佳基金”、“年度最具潜力基金”等奖项。

在客户服务方面，上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高服务质量：①升级了货币基金的快赎赎回业务，扩充了货币基金的范围，延长了业务办理时间；②推出了货币基金“赎款”功能；③通过支付宝渠道，推出了直连银行理财产品；④提升了客户服务响应速度，提高了客户服务水平。

4.1.2 基金经理/基金经理助理简介

姓名 职务 工作本基金的基本期限/任期 证券从业年限 说明

姓名 职务 工作本基金的基本期限/任期 证券从业年限 说明

方军 基本基金的基金经理、数量投资部副总经理 2009-07-10 14年 硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任机构投资部研究员、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华夏回报证券投资基金基金经理助理。

张弘弢 基本基金的基金经理、数量投资部副总经理 2009-07-10 13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。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义从行业从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

本公司报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金销售机构公平对待客户指导意见》、《基金托管人内部控制制度指引》，基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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 管理人对报告期内基金公平交易情况的专项说明

本公司基金管理人一贯坚持旗下所有的基金和组合，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对各环节执行公平交易的原则。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金公平交易制度》，并定期对公平交易情况进行分析。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本基金跟踪的是沪深300指数，沪深300指数成分股大体上具有良好的流动性和稳定性，能够较好地反映中国经济运行情况。

本基金在报告期内跟踪标的指数的偏离度较小，且偏离度在合理范围内。

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

本基金在报告期内实现了较高的超额收益，取得了较好的投资回报。

4.6 报告期内基金的费用情况

本基金在报告期内未发生费用。

4.7 管理人对基金未来业绩的展望

本基金在报告期内实现了较高的超额收益，取得了较好的投资回报。

4.8 管理人对基金估值政策和程序的说明

本基金在报告期内未发生影响基金估值的重大事件。

4.9 管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内未进行收益分配。

4.10 管理人对中期报告前后的情况说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.11 管理人对中期报告疏忽或误导行为的说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.12 管理人对中期报告内容真实性的说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.13 管理人对中期报告信息准确性、完整性、及时性的说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.14 管理人对中期报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏的说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.15 管理人对中期报告内容的责任声明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.16 管理人对中期报告内容的法律意见

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.17 管理人对中期报告内容的复核意见

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.18 管理人对中期报告内容的监督情况

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.19 管理人对中期报告内容的其他说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.20 管理人对中期报告内容的责任声明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.21 管理人对中期报告内容的法律意见

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.22 管理人对中期报告内容的复核意见

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.23 管理人对中期报告内容的监督情况

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.24 管理人对中期报告内容的其他说明

本公司在中期报告前后未发生可能对基金资产净值产生重大影响的事件。

4.25 管理人