

信息披露 Disclosure

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2014】半年度报告摘要

第三层次:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2各层次金融工具公允价值

截至2014年12月31日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为82,396,755.86元,第二层次的余额为0元,第三层次的余额为0元。(截至2013年12月31日止:第一层次的余额为101,666,832.69元,第二层次的余额为0元,第三层次的余额为0元。)

7.4.6.3公允价值估值层次间的重大变动
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额
本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中:普通股	—	—
	存托凭证	—	—
2	基金投资	82,396,755.86	91.31
3	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中:远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行承兑汇票及票据资产合计	7,561,568.98	8.36
8	其他金融资产	292,336.18	0.31
9	合计	90,240,661.02	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

85.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

85.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

85.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

金额单位:人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	HANG SENG DEX FUT Jun15	—	—
2	—	—	—	—
3	—	—	—	—
4	—	—	—	—
5	—	—	—	—

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算备付金中,具体投资情况详见下页“买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示”。

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量	公允价值	公允价值变动
	HANG SENG DEX FUT Jun15	1	933,154.58	-1,341.08
	HIF5	—	—	—
	公允价值变动总额合计	—	—	-1,341.08
	股指期货持仓盈亏合计	—	—	-142,478.02
	股指期货投资未平仓持仓变动	—	—	-1,341.08

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	华夏恒生ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	82,396,755.86	92.45
2	—	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—	—

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现过被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	73,411.71
2	应收证券清算款	—
3	—	—
4	应收利息	1,284.59
5	应收申购款	207,639.88
6	其他应收款	—
7	—	—
8	—	—
9	合计	292,336.18

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

9 基金投资组合相关信息

9.1 期末基金持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者持有份额	个人投资者持有份额
3,914	21,305.36	2,939,089.17	80,450,174.00
		占份额比例	占份额比例
		96.48%	96.48%

9.2 期末基金持有人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额的数量	占基金总资产比例
基金管理人从业人员持有本基金	10,128.81	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门	持有基金份额的数量区间(万份)
占期末资产净值比例	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

510 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年8月21日)	基金总份额
本报告期初基金份额总额	854,726,243.64
本报告期间基金总申购	103,677,281.27
本报告期间基金总赎回	42,423,132.34
本报告期间基金总申购	62,711,230.44
本报告期间基金总赎回	83,389,183.17

8.11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部[司]的重大人事变动

本基金管理人于2014年8月29日发布公告,杨晓东先生担任华夏基金管理有限公司总经理,陈大鹏先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于2014年9月6日发布公告,张青岭先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于2014年9月13日发布公告,汤晓东先生担任华夏基金管理有限公司督察长,方瑞斌先生不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部[司]未发生重大人事变动。2014年2月14日中国银行股份有限公司发布公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期未涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金提供审计的会计师事务所情况

本基金本报告期审计支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为40,000元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供3年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其他高级管理人员受处罚情况等

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受处分。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易成交金额	股票交易成交金额占当期股票成交金额的比例	应支付券商佣金	应支付券商佣金占当期券商佣金总额的比例	备注
中国银河证券	2	—	—	—	—	—
UBS	—	—	—	182.13	100.00%	—

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

i 研究实力规范,有良好的内部控制,在公司内有良好的声誉。

ii 有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供高质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究服务。

iii 有良好的交易执行能力和后台支持系统,能及时处理交易指令。

iv 能够及时、准确地提供准确的信息资讯和服务。

v 能够及时、准确地提供准确的信息资讯和服务。

②券商租用交易单元选择程序

1 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关工作人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和服务水平进行评估,确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人、被选中的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

③本报告期内,本基金租用的券商交易单元未发生变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易成交金额	债券交易成交金额占当期债券成交金额的比例	债券交易成交金额占当期债券成交金额的比例	债券交易成交金额占当期债券成交金额的比例	债券交易成交金额占当期债券成交金额的比例
中国银河证券	—	—	—	—	—
UBS	—	—	—	—	—

华夏基金管理有限公司

二〇一五年三月三十一日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月三十一日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告中涉及的未来计划、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告期内2014年1月1日起至12月31日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏恒生ETF联接
基金代码	060071
交易代码	060071
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,389,183.17份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159920
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
基金合同上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年10月22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	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过恒生ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相当的回报。
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,跟踪标的指数,模拟标的指数走势。本基金将综合恒生ETF的流动性、折溢价率、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。基金还将适度参与恒生ETF基金份额投资和标的指数的组合投资,以增强基金收益。基金还可以通过买入恒生指数成份股股票和标的指数,为了更好地实现投资目标,基金还可投资于境外市场符合标的指数的股票、债券、期限不同的指数的其他基金、金融衍生品工具等,并可在法律法规允许的条件下参与证券借贷,以增加收益。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为:经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币港币汇率收益率×5%。

本基金为恒生ETF的联接基金,恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	跟踪标的指数,追求跟踪精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	本基金的业绩比较基准为:经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币港币汇率收益率×5%。
风险提示特征	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。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
注册地址	北京	北京
联系电话	400-818-6666	010-65938986
负责人	李勇	李勇
电子邮箱	service@ChinaAMC.com	64161616@china.com
客服电话	400-818-6666	95566
传真	010-63136700	010-65949442

2.4 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
注册地址	香港
办公地址	香港
邮政编码	香港

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的官方网站网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年8月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	1,763,886.88	2,863,224.78	7,489,741.39
本期利润	3,633,633.55	1,204,758.82	13,356,477.00
加权平均基金份额本期利润	0.0398	0.0074	0.0215
本期基金份额净值增长率	3.89%	-0.10%	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末基金份额净值	0.0565	0.0288	0.0143
期末基金资产净值	89,127,094.99	106,659,351.30	300,476,019.16
期末基金份额持有人数	1,069	1,029	1,030

注:①所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。

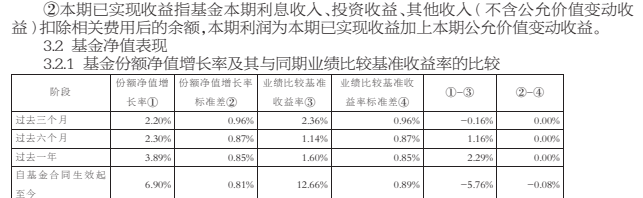
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.20%	0.96%	2.36%	0.96%	-0.16%	0.00%
过去六个月	2.30%	0.87%	1.14%	0.97%	1.16%	0.00%
过去一年	3.89%	0.85%	1.60%	0.85%	2.29%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.90%	0.81%	12.66%	0.89%	-5.76%	-0.08%

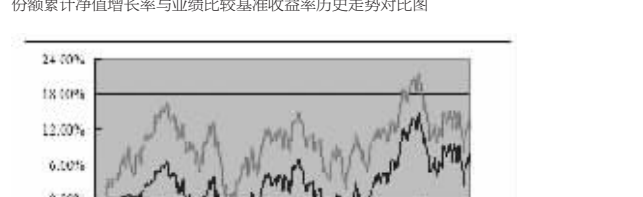
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金自基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金合同于2012年8月21日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

8 基金管理人

4.1 基金管理人及基金经理情况