

华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金管理人

[2015] 第一季度报告

注：股票投资的公允价值包括可追偿款的估值增值。

5.1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理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、完整性承担个别及连带责任。基金托管人对本基金合同约定，于2015年4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，保证复核内容不存在虚假记载、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。基金过往业绩并不代表基金未来表现。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。本报告所引用的数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华夏沪港通恒生ETF

场内简称 恒生ETF

基金主代码 513660

基金次代码 513660

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2014年12月23日

报告期末基金份额总额 282,000,095份

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。

投资范围 本基金主要采取完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指

投资比例 例，实现紧密跟踪标的指数的投资收益。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为恒生综合指数（调整后）。

风险收益特征 本基金是一只股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场

基金类型 基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 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(2015年1月1日-2015年3月31日) 5,769,532.21

1.本期已实现收益 23,507,531.28

2.本期利润 4,034,405.03

3.期末基金份额净值 558,461,474.60

4.期末基金资产净值 1,980.44

注：(1)本基金业绩报酬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)基金的业绩报酬按每日计提、按季支付，投资人买入（不含公允价值变动收益）和赎回相关费用的余额，本

期间利得或损失直接冲减上本期的业绩报酬。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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(%) 净值增长率偏离度(%) 标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.74% 0.61% 5.34% -0.72% -2.60% -0.11%

3.2.2 基金合同生效以来基金的定期报告中披露的基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比

率表 本基金的定期报告中披露的基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比

率表 例：(2014年1月1日至2014年3月31日)

注：(1)本基金于2014年12月23日生效。

(2)根据华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金管理人基金合同规定，本基金基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金第三部分(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 在本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

任职日期 离任日期

张弘弢 基金经理、数量投资部总监兼量化投资组 经理 2014-12-23 - 15年 博士，2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部研究员、数量投资部总监助理等。

王路 基金经理、数量投资部总监兼量化投资组 经理 2014-12-23 - 17年 博士，曾任美国国民养老保险公司的基金经理及数量投资部总监助理，2008年11月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部总监助理。

徐猛 基金经理、数量投资部总监兼量化投资组 经理 2015-03-12 - 12年 清华大学工学硕士，博士，曾在财富管理部工作，2006年1月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部总监助理。

注：上述基金经理，正在履行本基金对外披露的任期内职责。

2)证券从业的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3)基金经理的任职时间，指代该基金经理开始担任基金经理的日期。

4)基金的“封闭期”指基金合同规定的基金募集期。

5)基金的“开放期”指基金合同规定的基金的可赎回日。

6)基金的“定期报告”指基金的半年度报告、年度报告、季度报告。

7)基金的“临时报告”指除年度报告和中期报告外，以公告形式披露的重大信息。

8)基金的“上市报告书”指基金上市交易时，基金管理人应当向深圳证券交易所提交的报告。

9)基金的“清算报告”指基金合同终止时，基金管理人向中国证监会提交的报告。

10)基金的“基金份额净值”指基金单位资产净值。

11)基金的“基金份额总额”指基金的总份额。

12)基金的“基金资产”指基金的净资产。

13)基金的“基金资产净值”指基金资产减去负债后的金额。

14)基金的“基金资产估值”指计算基金份额净资产价值的方法。

15)基金的“基金资产净值比例”指基金资产净值占基金资产总额的比例。

16)基金的“基金资产净值比例上限”指基金资产净值占基金资产总额的比例上限。

17)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

18)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

19)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

20)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

21)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

22)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

23)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

24)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

25)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

26)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

27)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

28)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

29)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

30)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

31)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

32)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

33)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

34)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

35)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

36)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

37)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

38)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

39)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

40)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

41)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

42)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

43)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

44)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

45)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

46)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

47)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

48)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

49)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

50)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

51)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

52)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

53)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

54)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

55)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

56)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

57)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

58)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

59)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

60)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

61)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

62)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

63)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

64)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

65)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

66)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

67)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

68)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

69)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

70)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

71)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

72)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

73)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

74)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

75)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

76)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

77)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

78)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

79)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

80)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

81)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

82)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

83)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

84)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

85)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

86)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

87)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

88)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

89)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

90)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

91)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

92)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

93)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

94)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

95)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。

96)基金的“基金资产净值比例下限”指基金资产净值占基金资产总额的比例下限。