

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2013 年第 2 季度报告

2013 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一三年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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、准确性和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 2013 年 7 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏沪深 300ETF
基金主代码	510330
交易代码	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
报告期末基金份额总额	8,474,649,828 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。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性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	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	170,446,519.34
2.本期利润	-2,133,242,065.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2826
4.期末基金资产净值	18,895,697,754.47
5.期末基金份额净值	2.2297

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。

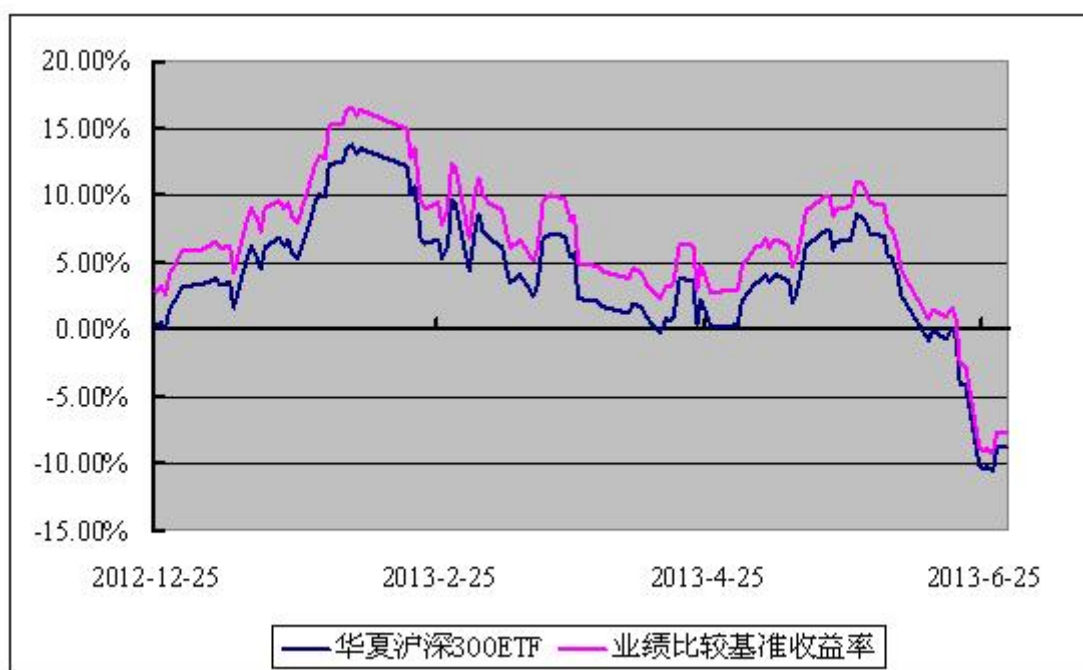
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-10.66%	1.44%	-11.80%	1.45%	1.14%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
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图
(2012 年 12 月 25 日至 2013 年 6 月 30 日)



注：①本基金合同于 2012 年 12 月 25 日生效。

②根据华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同规定，本基金自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合同第十三条(二)投资范围、(七)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任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	本基金的 基 金 经 理、数量 投资部副 总经理	2012-12-25	-	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证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金出现 1 次涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度，国际方面，美国经济继续复苏态势，货币政策维持宽松，然而美联储即将退出量化宽松政策的预期导致市场出现较大波动；欧洲经济在减赤的压力下依然复苏乏力；日本继续维持宽松货币政策，但效果有所减弱。国内方面，虽

然经济运行总体平稳，但投资、消费、出口等数据出现了一定程度放缓；通货膨胀仍然维持在较低水平；受外汇占款增幅大幅下降等因素影响，市场资金面趋紧，6 月中下旬短期利率大幅飙升。

在经济基本面不及预期，流动性逐渐紧张的背景下，国内证券市场总体呈现震荡下跌走势。报告期内，沪深 300 指数下跌 11.80%。

报告期内，本基金积极应对日常的申购赎回等工作，努力控制交易成本和汇率风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.2297 元，本报告期份额净值增长率为-10.66%，同期沪深 300 指数增长率为-11.80%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度，我们认为，国内经济存在进一步放缓的可能，且通货膨胀维持低位，宏观政策可能会一定程度的微调，但大幅超预期调整的可能性不大。

基于上述判断，市场方面，沪深 300 指数以震荡走势为主。如果出现经济基本面或者宏观经济政策的超预期，沪深 300 指数可能有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	18,754,935,927.52	99.00
	其中：股票	18,754,935,927.52	99.00
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	103,757,842.19	0.55
6	其他各项资产	84,763,954.62	0.45
7	合计	18,943,457,724.33	100.00

注: 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	107,291,640.68	0.57
B	采矿业	1,413,523,881.77	7.48
C	制造业	6,729,999,372.07	35.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	581,011,830.33	3.07
E	建筑业	740,071,581.96	3.92
F	批发和零售业	488,237,321.31	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	402,945,051.70	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	378,482,114.57	2.00
J	金融业	6,292,894,837.21	33.30
K	房地产业	1,074,982,514.10	5.69
L	租赁和商务服务业	123,209,685.71	0.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	112,182,953.55	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	52,534,260.40	0.28
S	综合	257,398,902.16	1.36
	合计	18,754,765,947.52	99.25

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	91,306,190	782,494,048.30	4.14

2	600036	招商银行	56,959,910	660,734,956.00	3.50
3	600837	海通证券	56,970,990	534,387,886.20	2.83
4	601318	中国平安	13,625,425	473,619,773.00	2.51
5	601166	兴业银行	31,308,195	462,422,040.15	2.45
6	600000	浦发银行	47,352,500	392,078,700.00	2.07
7	000002	万 科 A	39,023,327	384,379,770.95	2.03
8	600519	贵州茅台	1,714,445	329,807,784.65	1.75
9	601328	交通银行	63,882,800	260,002,996.00	1.38
10	000001	平安银行	25,400,791	253,245,886.27	1.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖) (单位:手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1307	沪深 300 股指期货 IF1307 合约	160	102,940,800.00	-8,064,164.07	买入股指期货多头合约的主要目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-8,064,164.07
股指期货投资本期收益					-12,171,000.00
股指期货投资本期公允价值变动					-7,221,655.69

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配

合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 2013 年 2 月 22 日贵州茅台受到贵州省物价局行政处罚。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，贵州茅台系标的指数成分股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

5.9.2 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。

5.9.3 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	19,356,608.59
2	应收证券清算款	7,104,075.99
3	应收股利	58,234,804.97
4	应收利息	23,779.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	44,685.24
8	其他	-
9	合计	84,763,954.62

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	7,355,049,828
本报告期基金总申购份额	1,540,800,000
减：本报告期基金总赎回份额	421,200,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,474,649,828

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内披露的主要事项

2013 年 5 月 25 日发布华夏基金管理有限公司公告。

7.2 其他相关信息

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管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2013 年 2 季度，A 股市场大幅波动，华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础，高度重视风险管理，同时积极把握投资机会，公司旗下所有主动管理的股票和混合型基金收益均战胜沪深 300 指数。在客户服务方面，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高服务质量：推出了直销网上交易“跨行随意取”业务、货币基金“还贷款”业务，开通了支付宝交易渠道，方便投资者进行现金管理；新增了中国建设银行储蓄卡的“快易付”功能，提高投资者的交易效率；建立了华夏基金微信公众服务平台，满足投资者咨询渠道多样化的需求。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

8.1.2 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

8.1.3 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

8.1.4 法律意见书；

8.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

8.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一三年七月十九日