

中小企业板交易型开放式指数基金 2009年半年度报告摘要

2009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:中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日期:二〇〇九年八月二十九日

1.1 基金基本情况
基金名称:华夏中小板ETF
交易代码:159902
基金运作方式:交易型开放式

2.1 基金管理人及基金托管人
基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明
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:本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

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
3.2.2 自基金合同生效以来本基金基金份额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

注:本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%。本基金按规定在基金合同生效之日起3个月的时间内达到这一投资比例。

4.1 基金管理人及基金投资情况
4.1.1 基金管理人及投资管理基金的经验
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。

注:本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%。本基金按规定在基金合同生效之日起3个月的时间内达到这一投资比例。

4.2 基金业绩
4.2.1 基金业绩
4.2.2 基金业绩

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人及基金托管人
4.3.2 基金管理人及基金托管人

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人及基金托管人
4.4.2 基金管理人及基金托管人

4.5 基金管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人及基金托管人
4.5.2 基金管理人及基金托管人

4.6 基金管理人及基金托管人
4.6.1 基金管理人及基金托管人
4.6.2 基金管理人及基金托管人

4.7 基金管理人及基金托管人
4.7.1 基金管理人及基金托管人
4.7.2 基金管理人及基金托管人

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人及基金托管人
4.8.2 基金管理人及基金托管人

4.6 管理人及基金托管人对报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。

5.1 报告期内本基金严格遵守情况声明
本报告期,中国建设银行股份有限公司作为本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

6.1 资产负债表
资产合计:中小企业板交易型开放式指数基金
单位:人民币元

6.2 利润表
单位:人民币元

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元

6.4 基金管理人及基金托管人
6.4.1 基金管理人及基金托管人
6.4.2 基金管理人及基金托管人

6.5 基金管理人及基金托管人
6.5.1 基金管理人及基金托管人
6.5.2 基金管理人及基金托管人

6.6 基金管理人及基金托管人
6.6.1 基金管理人及基金托管人
6.6.2 基金管理人及基金托管人

6.7 基金管理人及基金托管人
6.7.1 基金管理人及基金托管人
6.7.2 基金管理人及基金托管人

6.8 基金管理人及基金托管人
6.8.1 基金管理人及基金托管人
6.8.2 基金管理人及基金托管人

6.9 基金管理人及基金托管人
6.9.1 基金管理人及基金托管人
6.9.2 基金管理人及基金托管人

6.10 基金管理人及基金托管人
6.10.1 基金管理人及基金托管人
6.10.2 基金管理人及基金托管人

6.11 基金管理人及基金托管人
6.11.1 基金管理人及基金托管人
6.11.2 基金管理人及基金托管人

6.12 基金管理人及基金托管人
6.12.1 基金管理人及基金托管人
6.12.2 基金管理人及基金托管人

6.13 基金管理人及基金托管人
6.13.1 基金管理人及基金托管人
6.13.2 基金管理人及基金托管人

6.14 基金管理人及基金托管人
6.14.1 基金管理人及基金托管人
6.14.2 基金管理人及基金托管人

6.4.1 通过关联方交易年度进行的投资
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。
6.4.2 关联方报酬
6.4.2.1 基金管理人报酬

6.4.2.2 基金托管人报酬
单位:人民币元

6.4.3 与销售机构之间的佣金
单位:人民币元

6.4.4 与关联方进行银行间同业市场的债券交易
6.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.5 关联方为基金提供担保
6.4.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.5.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.6 基金管理人及基金托管人
6.4.6.1 基金管理人及基金托管人
6.4.6.2 基金管理人及基金托管人

6.4.7 基金管理人及基金托管人
6.4.7.1 基金管理人及基金托管人
6.4.7.2 基金管理人及基金托管人

6.4.8 基金管理人及基金托管人
6.4.8.1 基金管理人及基金托管人
6.4.8.2 基金管理人及基金托管人

6.4.9 基金管理人及基金托管人
6.4.9.1 基金管理人及基金托管人
6.4.9.2 基金管理人及基金托管人

6.4.10 基金管理人及基金托管人
6.4.10.1 基金管理人及基金托管人
6.4.10.2 基金管理人及基金托管人

6.4.11 基金管理人及基金托管人
6.4.11.1 基金管理人及基金托管人
6.4.11.2 基金管理人及基金托管人

6.4.12 基金管理人及基金托管人
6.4.12.1 基金管理人及基金托管人
6.4.12.2 基金管理人及基金托管人

6.4.13 基金管理人及基金托管人
6.4.13.1 基金管理人及基金托管人
6.4.13.2 基金管理人及基金托管人

6.4.14 基金管理人及基金托管人
6.4.14.1 基金管理人及基金托管人
6.4.14.2 基金管理人及基金托管人

6.4.15 基金管理人及基金托管人
6.4.15.1 基金管理人及基金托管人
6.4.15.2 基金管理人及基金托管人

6.4.16 基金管理人及基金托管人
6.4.16.1 基金管理人及基金托管人
6.4.16.2 基金管理人及基金托管人

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上期可比期间

Table with columns: 关联方名称, 本期, 上期, 上期可比期间

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值

Table with columns: 股票代码, 股票名称, 买入成本总额, 买入公允价值