

中小创业板交易型开放式指数基金 2010 年年度报告摘要

2010年12月31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
报告送出日期:二〇一一年三月二十八日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月21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本基金的财务资料摘要。

本报告自2010年1月1日起至2010年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 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	华夏中小板ETF
基金代码	159902
交易代码	159902
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年6月8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
报告期末基金份额总额	1,304,841,514.68份
基金合同存续期限	不定期
基金份额上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年9月5日

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投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当因特殊原因(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将根据合理原则进行调整,以确保本基金投资组合的平均收益与市场基准收益保持一致。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为被动型基金,采用完全复制策略,跟踪反映中小板市场价格的走势,跟踪误差中风险等级产品。

2.3 基金管理人及基金托管人		
项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
办公地址	北京	北京
负责人姓名	魏庆华	尹洪业
联系电话	400-818-6666	010-67593043
电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yhongyeb@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67593066
传真	010-63133700	010-66278318

2.4 信息披露方式	
登载基金年度报告正文的互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	1,174,052,777.98	666,087,174.35	-440,770,609.41
本期利润	787,547,454.35	1,795,365,303.49	-2,709,930,010.82
加权平均基金份额本期利润	0.5643	1.3008	-1.6574
本期基金份额净值增长率	20.71%	44.39%	-32.62%
1.1.2 期间数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	2.1310	1.3154	0.4105
期末基金资产净值	4,152,097,270.61	3,761,095,193.30	2,176,801,667.99
期末基金份额净值	3.182	2.936	1.410

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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去三个月	7.83%	1.93%	5.78%	-0.01%
过去六个月	30.71%	1.73%	29.92%	-0.03%
过去一年	20.71%	1.72%	21.20%	-0.04%
过去三年	11.06%	2.27%	9.31%	-0.09%
自基金合同生效起至	220.51%	21.4%	235.07%	-0.11%

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

中小企业板交易型开放式指数基金
份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2006年6月8日至2010年12月31日

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。

3.3 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

中小企业板交易型开放式指数基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

注:本基金合同于2006年6月8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。

3.3.1 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

中小企业板交易型开放式指数基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

注:本基金合同于2006年6月8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。

3.3.2 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

中小企业板交易型开放式指数基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

注:本基金合同于2006年6月8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。

3.3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10基金份额分红	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	1.000	150,365,925.26	-	150,365,925.26	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	1.000	150,365,925.26	-	150,365,925.26	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金业绩情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况

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、南京和杭州设有分公司,在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内唯一的双货币中国基金投资管理人和以特定客户资产管理人,是业务领域最广的基金管理公司之一。

2010年,在证券市场震荡的环境下,华夏基金加强风险控制,坚持稳健的投资风格,主动管理的股票型基金与混合基金业绩保持良好,投资策略、资产配置、风险控制、业绩表现良好;固定收益基金保持创新正回报;指数基金保持策略优势的领先地位。根据中国证券基金研究中心基金业绩统计报告,在2010年基金分类排名中,华夏债券投资回报在166只标准股票型基金中排名第34,华夏大盘精选排在43只偏股型基金股票上限95%冲排名第1;华夏策略回报在40只灵活配置型基金股票上限80%冲排名第1;2010年华夏基金为投资人实现分红达275亿元,累计分红已超过700亿元。

为引导投资者树立正确的基金投资理念,增进与投资者之间的交流,2010年,华夏基金继续加强投资者教育与客户服务工作。公司广泛征集800多个基金投资者意见,给投资者提供了一个理性的投资者教育中国基金投资指南一书,分发投资者教育。公司继续举办各类投资者报告会以及理财培训,在媒体开展投资者教育专栏,参观北京、上海等地金融博览会,向投资者提供理财咨询服务。

2010年,华夏基金凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉,荣获多家机构评选的多个奖项,主要奖项有:2010年8月,在《中国证券报》主办的“中国基金业金牛奖”评选活动中,华夏基金荣获2009年度“中国基金业金牛奖”、“2010年6月,在《中国证券报》主办的“第七届中国基金奖”评选活动中,华夏基金荣获2009年度“金牛基金”、“TOP公司”奖。

在客户服务方面,2010年,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提升服务质量,举办多场客户见面会,加强与投资者的沟通,根据客户建议,不断改进服务体系及业务规则。

在践行社会责任方面,青海玉树地震发生地灾后,华夏基金及全体员工通过华夏人慈善基金会向灾区捐款100余万元,华夏基金香港公司向中联办捐款支持捐赠港币10万元整;并于10月采购抗震救灾物资200吨捐赠给玉树灾区,用于保障9所学校,总计11239名学生和教职员工的冬季取暖。2010年8月,甘肃舟曲地区发生特大山洪泥石流灾害,华夏基金员工主动参加华夏人慈善基金会赈灾捐款,并组织志愿者亲赴甘肃舟曲灾区,为8个村402户,总计1061户灾民送去生活物资。此外,华夏人慈善基金会还组织实施了山西天镇镇八里村帮扶项目、贵州安顺小学帮扶项目等华夏基金公益及员工个人捐助的帮扶项目。

4.1.2 基金经理、基金经理助理及基金经理助理

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
方军	本基金的基金经理	2006-06-08	11年	硕士,1999年毕业于华夏基金管理有限公司,历任研究员,华夏基金上证50ETF基金基金经理助理,华夏基金上证50ETF基金基金经理助理,华夏基金上证50ETF基金基金经理助理。

注:①上述任职日期,离职日期根据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。
③根据本基金管理人于2011年2月24日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘中小企业板交易型开放式指数基金基金经理的公告》,增聘唐树松先生为基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,始终秉持诚实信用、勤勉尽责、安全合规的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 基金管理人代表基金投资于股指期货的情况

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产净值中股指期货持仓市值为0.00%,占基金资产净值的比例为0.00%。

报告期内,本基金管理人代表基金投资于股指期货的情况如下:

截至2010年12月31日,本基金资产