

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:二〇一一年八月二十四日

中小企业板交易型开放式指数基金

2011 半年度 报告摘要

2011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
报告送出日期:二〇一一年八月二十四日

截至2011年6月30日,本基金份额净值为2.718元,本报告期份额净值增长率为-14.58%,同期中小企业板价格指数增长率为-14.83%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.25%。

展望下半年,如果货币政策紧缩的主基调没有大的改变,中小企业板指数依然面临一定的下行压力,但是考虑到部分中小企业成份股的业绩成长性比较强,指数下调空间有限,中小企业指数有可能进行区间震荡整理。

中小企业股票具有明显的成长性优势和长期投资价值,但经济形势及市场的变化也会对中小企业板产生影响,使中小企业股票的波动性相对较大,我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现对投资者获取指数投资收益及其他模式盈利机会的投资目标。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任,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。

4.6管理人对于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新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金持仓持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所担任估值委员会中独立估值专家,在估值委员会中占0.25%以上时对所采用的相关估值假设、方法及参数的适当性发表审核意见并出具报告,定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确定估值工作的顺利开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险评估负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等,其中,超过三分之二的成员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验,同时,根据基金管理人制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法律法规及基金合同的约定。

5.1报告期内本基金托管人遵守信守信情况的说明
本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金托管过程中,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应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确和完整发表意见
本托管人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,发现复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1资产负债表
会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
报告截止日:2011年6月30日

资产
附注号
2011年6月30日
2010年12月31日
银行存款 80,260,291.67 71,966,151.15
结算备付金 1,401,241.86 1,043,395.36
存出保证金 1,000,000.00 1,000,000.00
交易性金融资产 4,798,805,129.10 4,089,995,578.22
其中:股票投资 4,798,805,129.10 4,089,995,578.22
基金投资 - -
债券投资 - -
债券支持证券投资 - -
衍生金融资产 - -
买入返售金融资产 - -
应收证券清算款 - 3,254,604.13
应收利息 16,028.88 29,732.05
应收股利 - -
应收申购款 - -
递延所得税资产 - -
其他资产 - -
资产总计 4,881,482,691.51 4,167,289,460.91

负债和所有者权益
附注号
2011年6月30日
2010年12月31日
负债:
短期借款 - -
交易性金融负债 - -
衍生金融负债 - -
卖出回购金融资产款 - -
应付证券清算款 7,622,569.05 -
应付赎回款 1,427,158.86 6,838,141.86
应付管理人报酬 1,871,344.90 2,043,683.45
应付托管费 374,268.98 408,736.68
应付销售服务费 - -
应付交易费用 4,461,438.15 4,211,503.04
应交税费 - -
应付利息 - -
应付利润 - -
递延所得税负债 - -
其他负债 1,430,176.16 1,690,125.27
负债合计 17,186,956.10 15,192,190.30
所有者权益:
实收基金 1,789,488,824.04 1,304,841,514.68
未分配利润 3,074,806,911.37 2,847,255,755.93
所有者权益合计 4,864,295,735.41 4,152,097,270.61
负债和所有者权益总计 4,881,482,691.51 4,167,289,460.91

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值2.718元,基金份额总额1,789,488,824.04份。

6.2利润表
会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

一、收入 -621,195,971.37 -459,975,430.63
1.利息收入 417,337.20 364,203.53
其中:存款利息收入 417,337.20 364,203.53
债券利息收入 - -
债券支持证券利息收入 - -
买入返售金融资产收入 - -
其他利息收入 - -
2.投资收益(损失以“-”号填列) -195,521,901.06 303,771,780.33
其中:股票投资收益 -225,680,319.68 286,132,589.79
基金投资收益 - -
债券投资收益 - -
债券支持证券投资收益 - -
衍生工具投资收益 - -
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -425,922,262.25 -765,024,029.42
4.汇兑收益(损失以“-”号填列) - -
5.其他收入(损失以“-”号填列) -169,145.26 912,614.93
减:二、费用 14,322,302.27 12,258,921.64
1.管理人报酬 10,983,331.50 9,137,098.60
2.托管费 2,196,666.32 1,827,419.69
3.销售服务费 - -
4.交易费用 1,017,253.68 1,169,445.05
5.利息支出 - -
其中:卖出回购金融资产支出 - -
6.其他费用 125,050.77 124,957.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -635,518,273.64 -472,234,351.73
减:所得税费用 - -
四、净利润(净亏损以“-”号填列) -635,518,273.64 -472,234,351.73

6.3所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中小企业板交易型开放式指数基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

项目
2011年1月1日至2011年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值) 1,304,841,514.68 4,152,097,270.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) -635,518,273.64 -472,234,351.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) 484,647,309.36 863,069,420.98
1,347,716,738.44
其中:1.基金申购款 2,500,977,846.96 4,833,052,822.73
2.基金赎回款 -2,016,330,537.60 -3,969,983,393.65
-5,986,313,931.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) - -
五、期末所有者权益(基金净值) 1,789,488,824.04 3,074,806,911.37 4,864,295,735.41

注:投资资产公允价值估值包含可退偿贷款的估值增值。

7.1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 4,798,805,129.10 98.31
其中:股票 4,798,805,129.10 98.31
2 固定收益投资 - -
其中:债券 - -
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 81,661,533.53 1.67
6 其他各项资产 1,016,028.88 0.02
7 合计 4,881,482,691.51 100.00

注:股票投资的公允价值包含可退偿贷款的估值增值。

7.2期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
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、业 119,709,427.02 2.46
B 采掘业 154,211,662.94 3.17
C 制造业 2,996,694,602.18 61.61
C0 食品、饮料 246,013,948.39 5.06
C1 纺织、服装、皮毛 126,030,656.13 2.59
C2 木材、家具 - -
C3 造纸、印刷 46,170,772.08 0.95
C4 石油、化学、塑胶、塑料 518,024,676.55 10.65
C5 电子 418,935,739.06 8.61
C6 金属、非金属 156,346,836.25 3.11
C7 机械、设备、仪表 966,862,392.08 19.88
C8 医药、生物制品 444,281,857.86 9.13
C9 其他制造业 79,027,722.88 1.62
D 电力、煤气及水的生产和供应业 - -
E 建筑业 98,008,947.60 2.01
F 交通运输、仓储业 51,202,183.36 1.05
G 信息技术业 351,541,691.68 7.23
H 批发和零售贸易 634,087,653.18 13.04
I 金融、保险业 141,654,246.59 2.91
J 房地产业 88,002,691.00 1.81
K 社会服务业 111,463,694.49 2.29
L 文化传播业 52,219,185.06 1.07
M 综合类 - -
合计 4,798,795,985.10 98.65

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 000224 苏宁电器 40,990,617 525,089,803.77 10.79
2 002304 洋河股份 1,627,498 205,325,147.68 4.22
3 002202 金风科技 12,216,125 182,386,746.25 3.75
4 002073 软控股份 5,937,176 122,305,825.60 2.51
5 002142 宁波银行 11,194,858 121,800,055.04 2.50
6 002106 莱宝高科 3,582,209 108,361,822.25 2.23
7 002008 大族激光 7,831,962 97,742,885.76 2.01
8 002007 华兰生物 2,833,660 97,146,420.40 1.98
9 002155 辰州矿业 2,930,026 95,782,549.94 1.97
10 002038 双鹭药业 2,157,196 81,434,149.00 1.67

注:投资资产公允价值估值包含可退偿贷款的估值增值。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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(%)
1 000242 科伦药业 38,267,595.13 0.92
2 002304 洋河股份 37,247,888.01 0.90
3 002310 东方园林 31,540,643.19 0.76
4 002088 鲁阳股份 28,723,000.50 0.69
5 002299 圣农发展 26,984,374.34 0.65
6 002004 华邦制药 26,971,846.24 0.65
7 002408 齐翔腾达 26,916,465.32 0.65
8 002181 粤传媒 25,730,413.11 0.62
9 002168 深润智能 24,580,391.76 0.59
10 002493 爱康医疗 24,472,429.61 0.59
11 002167 东方锆业 23,934,947.62 0.58
12 002415 海康威视 22,307,885.98 0.54
13 002500 山西证券 19,665,094.35 0.47
14 002156 通富微电子 19,482,131.70 0.47
15 002299 海普瑞 18,745,848.90 0.45
16 002009 天奇股份 17,396,759.31 0.42
17 000252 同洲电子 14,699,280.18 0.35
18 002153 石基信息 14,139,029.87 0.34
19 002022 金风科技 13,966,074.69 0.34
20 002037 久联发展 13,717,695.11 0.33

注:买入金额"按买入成交金额"成交单例买入成交数量"孰列,不考虑相关交易费用。

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细
金额单位:人民币元

序号 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(%)
1 000242 苏宁电器 40,743,059.21 0.98
2 002067 华邦制药 29,291,943.40 0.71
3 002309 中利科技 22,787,925.05 0.65
4 002047 成发股份 22,909,740.69 0.55
5 002133 广誉集团 21,834,207.96 0.53
6 002267 陕西燃气 20,671,787.45 0.50
7 002252 上海露笑 20,136,139.54 0.48
8 002062 密建建设 19,162,766.08 0.46
9 002251 步步高 18,449,339.00 0.44
10 002069 獐子岛 16,553,615.81 0.40
11 002155 辰州矿业 15,631,318.62 0.38
12 002142 宁波银行 12,156,563.45 0.29
13 002269 美邦服饰 12,145,353.24 0.29
14 002399 海普瑞 11,527,723.53 0.28
15 002233 塔牌集团 10,861,922.68 0.26
16 002001 新和成 9,614,819.85 0.23
17 002362 汉王科技 9,207,832.87 0.22
18 002128 露天煤业 9,049,964.89 0.22
19 002415 海康威视 9,047,336.14 0.22
20 002007 华兰生物 8,722,137.33 0.21

注:卖出金额"按卖出成交金额"成交单例卖出成交数量"孰列,不考虑相关交易费用。

7.5买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额"成交单例买入成交数量"孰列,不考虑相关交易费用。

7.6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
本基金本报告期末持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.8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。

7.9投资组合报告附注
7.9.1 2010年9月6日大族激光受到深交所通报批评。本基金为指数型基金,采取完全复制策略,大族激光系标的指数成份股,该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成
金额单位:人民币元

序号 名称 金额
1 存出保证金 1,000,000.00
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 16,028.88
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 1,016,028.88

7.9.4 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。

7.9.5 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。

7.9.6 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。

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

持有人户数(户数) 户均持有的基金份额 持有人结构
机构投资者 个人投资者
持有份额 占总份额比例 持有份额 占总份额比例
88,787 20,154.85 657,772,185.03 36.76% 1,131,716,639.01 63.24%

8.2期末上市基金前十名持有人
份额单位:份

序号 持有人名称 持有份额(份) 占上市总份额比例
1 太平人寿保险股份有限公司 304,238,264.00 27.37%
2 幸福人寿保险股份有限公司-分红 52,232,464.00 4.70%
3 幸福人寿保险股份有限公司-自有资金 18,504,701.00 1.66%
4 国君资管-交行-国泰君安君安得二号优选基金集合资产管理计划 15,020,000.00 1.35%
5 浙江大鹏石化有限公司 13,740,109.00 1.24%
6 JF资产管理(有限合伙)-JF中国先融A股基金 11,799,998.00 1.06%
7 广宇集团财务有限责任公司 11,311,100.00 1.02%
8 中安人寿保险股份有限公司 10,500,000.00 0.94%
9 江西国际信托股份有限公司资金信托合同(金额1825) 10,000,000.00 0.90%
10 方正证券-交行-方正金泉友2号集合资产管理计划 9,879,159.00 0.89%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
项目 持有基金份额总数(份) 占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金 101,455.63 0.01%

8.4开放式基金份额变动
单位:份
基金合同生效日(2006年6月8日)基金份额总额 3,965,067,258.69
本报告期初基金份额总额 1,304,841,514.68
本报告期基金总申购份额 2,500,977,846.96
减:本报告期基金总赎回份额 2,016,330,537.60
本报告期基金拆分变动份额 -
本报告期末基金份额总额 1,789,488,824.04

8.5重大事件揭示
10.1基金份额持有人大会决议
报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。

2011年2月9日,本基金管理人发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资管理部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准。证监会许可(2011)145号《解聘李信中国建设银行投资管理部总经理职务》,2011年1月31日,本基金托管人发布任免通知,解聘李信中国建设银行投资管理部副总经理职务。

10.3涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变
本基金本报告期投资策略未发生变更。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期内本基金所聘请的会计师事务所均未发生变更。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况
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到任何处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1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 占当期股票成交总额的比例 佣金 占当期佣金总额的比例 备注
申银万国证券 1 1,015,910,762.85 77.68% 12,703,440 5.08% -
国泰君安证券 1 290,327,824.01 22.20% 23,892,885 94.38% -
光大证券 1 1,575,102.04 0.12% 1,335,864 5.04% -

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)经营行为规范,在最近一年内无重大违规行为;
ii)公司财务状况良好;
iii)有良好的内部控制,在业内有良好的声誉;
iv)有较雄厚的研究力量,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、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,提供专门的研究报告。

v)建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。
2)券商专用交易单元选择程序:
i)对交易单元候选券商的研究服务进行评估;
ii)本基金管理人组织相关人员在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研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商;
iii)协议签署及通知托管人;
iv)本基金管理人、被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人;
v)除本表列示外,本基金还选择了中国银河证券的交易单元作为基金交易单元,本报告期无股票交易及佣金支出。

10.7.2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 交易单元数量 债券交易 占当期债券成交总额的比例 成交金额 占当期回购成交总额的比例
申银万国证券 - - - - -
国泰君安证券 - - - - -
光大证券 - - - - -