

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:二〇一一年八月二十四日

华夏沪深 300 指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金投资者均应承担相应的法律责任。

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。

4.7 管理人对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信守诺情况

2011年上半年,本基金托管人在对华沪深300指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金持有人利益的行为,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信守诺、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年,华夏沪深300指数证券投资基金的基金管理人—华夏基金管理有限公司在华沪深300指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中基金净值信息的真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人依据对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深300指数证券投资基金2011年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以内容真实、准确和完整。

6.1 资产负债表
会计主体:华夏沪深300指数证券投资基金
报告截止日期:2011年6月30日

资产 附注号 本期末 2011年6月30日 上年度末 2010年12月31日

货币资金 318,981,407.95 111,629,077.46
银行存款 6,098,624.17 10,940,011.21

交易性金融资产 1,514,503.90 1,128,134.11
可供出售金融资产 21,523,261,740.17 22,542,446,098.50

其中:股票投资 20,647,202,864.37 21,394,793,947.60
债券投资 876,058,875.80 1,147,652,150.90

应收利息 9,225,584.10 15,548,483.34
其他资产 21,888,406,945.54 22,804,114,523.15

负债和所有者权益 附注号 本期末 2011年6月30日 上年度末 2010年12月31日

短期借款 -- --
应付账款 -- --
预收账款 -- --

应付利息 9,225,584.10 15,548,483.34
应付股利 23,775,856.84 --
其他负债 -- --

所有者权益 967,335.05 898,806.56
其中:实收基金 25,115,986,438.07 25,736,288,435.15

未分配利润 -3,376,166,029.56 -3,006,237,854.78
所有者权益合计 21,739,820,408.51 22,730,050,578.37

注:①所有者权益合计2011年6月30日,基金份额净值0.866元,基金份额净值25,115,986,438.07份。

6.2 利润表
会计主体:华夏沪深300指数证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

项目 附注号 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

一、收入 -272,503,374.18 -7,311,399,368.46
利息收入 13,537,198.91 10,229,762.34

其中:存款利息收入 1,350,526.20 1,462,259.02
债券利息收入 12,186,672.71 8,734,167.34

资产支持证券利息收入 -- --
买入返售金融资产收入 -- --
其他利息收入 -- --

二、费用 -165,905,557.98 183,121,412.53
其中:投资运作费用 -334,794,434.20 60,326,936.56

基金管理人报酬 -- --
基金托管费 -- --
销售服务费 -- --

三、利润总额 -438,410,929.10 -7,494,660.82
所得税费用 -- --
净利润 -438,410,929.10 -7,494,660.82

6.3 所有者权益变动表
会计主体:华夏沪深300指数证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

项目 附注号 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

一、期初所有者权益(基金净值) 25,736,288,435.15 -3,006,237,854.78 22,730,050,578.37

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益) -344,545,079.53 -344,545,079.53

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(申购减少/赎回增加) -620,301,995.08 -25,383,095.25 -645,685,090.33

四、本期基金份额持有人的申购和赎回产生基金净值变动数(申购增加/赎回减少) 3,427,809,839.34 -404,502,519.41 3,023,307,320.23

五、其他所有者权益变动数(包括转公允价值变动损益) 5,841,244,196.56 -670,139,571.69 5,171,104,664.36

六、期末所有者权益(基金净值) 25,115,986,438.07 -3,376,166,029.56 21,739,820,408.51

注:①所有者权益合计2011年6月30日,基金份额净值0.866元,基金份额净值25,115,986,438.07份。

6.4 现金流量表
会计主体:华夏沪深300指数证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

项目 附注号 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

一、经营活动产生的现金流量: 26,241,515,057.61 -62,736,950.67 26,179,138,106.94

二、投资活动产生的现金流量: -7,395,585,417.70 -7,395,585,417.70

三、筹资活动产生的现金流量: 2,305,233,196.56 -330,743,515.38 1,974,489,181.11

四、汇率变动对现金及现金等价物的影响: 5,841,244,196.56 -670,139,571.69 5,171,104,664.36

五、现金及现金等价物净增加额: 16,561,382,972.97 -1,326,344,358.28 16,553,128,361.12

六、期初现金及现金等价物余额: 11,040,615,485.60 11,040,615,485.60

七、期末现金及现金等价物余额: 27,602,000,458.57 9,714,267,127.32

注:①经营活动产生的现金流量净额2011年6月30日,基金份额净值0.866元,基金份额净值25,115,986,438.07份。

6.5 公允价值变动损益
会计主体:华夏沪深300指数证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

项目 附注号 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

一、公允价值变动损益(损失以“-”号填列) -176,367,875.32 122,990,058.47

二、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) -122,258,073.23 -7,508,746,547.75

三、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 2,123,058.62 3,996,001.42

四、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 72,041,705.35 84,186,049.24

五、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 55,148,365.06 59,991,134.80

六、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 11,029,673.04 11,998,226.91

七、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 5,206,570.68 10,317,646.83

八、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 452,767.21 1,679,726.04

九、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) 20,329.36 189,314.66

十、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) -344,545,079.53 -7,395,585,417.70

十一、其他公允价值变动损益(损失以“-”号填列) -344,545,079.53 -7,395,585,417.70

6.4.4.1.5 应付关联方款项的金额

金额单位:人民币元
本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

关联方名称 当期金额 占当期期末余额的比例 期末应付账款余额 占期末应付账款总额的比例

中信证券 1,337,080.04 2.88%

6.4.4.1.6 应付关联方款项的金额
金额单位:人民币元
本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

关联方名称 当期金额 占当期期末余额的比例 期末应付账款余额 占期末应付账款总额的比例

中信证券 1,158,314.03 18.93% 1,158,314.03 2.62%

注:上述款项按市场利率计算,以除除由中国证券登记结算有限责任公司收取证券管理费、经手费和印花税等费用外,其他费用均由基金管理人承担。

6.4.4.2 关联方管理费率
6.4.4.2.1 基金管理人报酬
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的基金管理费 55,148,365.06 59,991,134.80

其中:支付给基金管理人的客户维护费 14,513,028.96 15,649,627.32

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人根据与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 债券 回购 交易
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4 与关联方进行银行间同业市场的债券 债券 回购 交易
单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.1.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.2.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4.3 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4.4 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.4.5 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.4.4.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:人民币元

项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 2010年1月1日至2010年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 11,029,673.04 11,998,226.91

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

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 600036 招商银行 45,100,000 587,202,000.00 2.70

2 601318 中国平安 11,900,000 574,413,000.00 2.64