

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

81 重要提示
基金管理人的董事、监事和高级管理人员均持有基金份额,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的法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2012年3月27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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新册。

本报告中财务数据经审计,安永华明会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告日期自2011年1月1日起至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。

82 基金简介

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期, 上市证券交易所, 基金上市日期.

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,即完全复制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进行相应调整。

业绩比较基准: 本基金的业绩比较基准为“上证50指数”。

风险收益特征: 本基金股票型基金,风险收益特征高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: 名称, 姓名, 联系电话, 电子邮箱, 客户服务电话, 传真.

2.4 信息披露方式

信息披露年度报告正文的管理人互联网网址: www.ChinaAMC.com

83 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

Table with 4 columns: 3.1.1 报告期数据和指标, 2011年, 2010年, 2009年.

3.1.2 期末基金份额和指标

Table with 4 columns: 期末可供分配基金份额总额, 期末基金份额净值, 基金份额净值增长率, 基金份额净值增长率.

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。

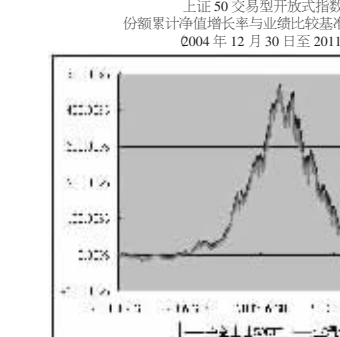
3.2 基金净值表现

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

Table with 5 columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④.

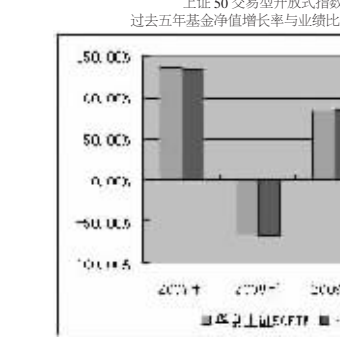
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证50交易型开放式指数证券投资基金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(2004年12月30日至2011年12月31日)



3.2.3 过去五年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

上证50交易型开放式指数证券投资基金过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

Table with 5 columns: 年度, 每10份基金份额分红, 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.

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州和广州设有分公司。

2011年,在市场持续下跌的情况下,华夏基金继续坚持以深人的投资研究为基础,高度重视风险管理,努力为客户规避风险。根据银河证券研究中心基金业绩统计报告,在基金年度分类排名中,截至2011年12月30日数据,华夏公司股票在217只个股股票型基金中排名第5,华夏大蓝筹混合在43只偏股型混合(股票)中排名第4,华夏策略混合在48只灵活配置型混合(股票)中排名第5,华夏回报混合在54只纯债型债券基金中排名第3和第4。

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,2011年,华夏基金继续举办理财财富直通车等面对面报告会以及理财讲堂,主动与投资者沟通交流,为投资者提供理财服务。

2011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:2011年3月,在《证券时报》主办的“第七届中国基金业明星颁奖盛典暨中国明星基金论坛”中,华夏基金荣获“长期回报明星基金公司奖”;2011年4月,在《上海证券报》主办的“中国金基金”颁奖典礼中,华夏基金荣获“2011年度最佳基金管理人奖”;在《中国证券报》、中央电视台主办的“中国基金金牛奖”评选活动中,华夏基金荣获“2011年度金牛奖”。

在客户服务方面,2011年,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提升服务品质,恢复主动服务华夏人等四只基金的均摊业务;调整了在本公司进行登记结算基金的分红方式变更规则,使投资者可在不同销售机构持有同一基金可以分别设置不同的分红方式;优化了网上交易定期定额功能,增加了密码管理、银行卡支付、特殊赎回等业务处理周期;推出了针对直销网上交易客户的赎回到账短信提醒等服务。

4.1.2 基金经理 魏金程 简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明.

注:①上述任职日期,离任日期指本基金管理人对外披露的任免日期。

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管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

4.2 报告期末基金的投资策略及业绩表现的说明

4.3 报告期末基金的投资策略

4.4 报告期末基金的投资策略

4.5 报告期末基金的投资策略

4.6 报告期末基金的投资策略

4.7 报告期末基金的投资策略

4.8 报告期末基金的投资策略

4.9 报告期末基金的投资策略

4.10 报告期末基金的投资策略

4.11 报告期末基金的投资策略

4.12 报告期末基金的投资策略

4.13 报告期末基金的投资策略

4.14 报告期末基金的投资策略

4.15 报告期末基金的投资策略

4.16 报告期末基金的投资策略

4.17 报告期末基金的投资策略

4.18 报告期末基金的投资策略

4.19 报告期末基金的投资策略

4.20 报告期末基金的投资策略

4.21 报告期末基金的投资策略

4.22 报告期末基金的投资策略

4.23 报告期末基金的投资策略

4.24 报告期末基金的投资策略

4.25 报告期末基金的投资策略

4.26 报告期末基金的投资策略

4.27 报告期末基金的投资策略

4.28 报告期末基金的投资策略

4.29 报告期末基金的投资策略

4.30 报告期末基金的投资策略

4.31 报告期末基金的投资策略

4.32 报告期末基金的投资策略

4.33 报告期末基金的投资策略

4.34 报告期末基金的投资策略

4.35 报告期末基金的投资策略

4.36 报告期末基金的投资策略

4.37 报告期末基金的投资策略

4.38 报告期末基金的投资策略

4.39 报告期末基金的投资策略

4.40 报告期末基金的投资策略

4.41 报告期末基金的投资策略

4.42 报告期末基金的投资策略

4.43 报告期末基金的投资策略

4.44 报告期末基金的投资策略

4.45 报告期末基金的投资策略

4.46 报告期末基金的投资策略

4.47 报告期末基金的投资策略

4.48 报告期末基金的投资策略

4.49 报告期末基金的投资策略

4.50 报告期末基金的投资策略

4.51 报告期末基金的投资策略

4.52 报告期末基金的投资策略

4.53 报告期末基金的投资策略

4.54 报告期末基金的投资策略

4.55 报告期末基金的投资策略

4.56 报告期末基金的投资策略

4.57 报告期末基金的投资策略

4.58 报告期末基金的投资策略

4.59 报告期末基金的投资策略

4.60 报告期末基金的投资策略

4.61 报告期末基金的投资策略

4.62 报告期末基金的投资策略

4.63 报告期末基金的投资策略

4.64 报告期末基金的投资策略

4.65 报告期末基金的投资策略

4.66 报告期末基金的投资策略

4.67 报告期末基金的投资策略

4.68 报告期末基金的投资策略

4.69 报告期末基金的投资策略

4.70 报告期末基金的投资策略

4.71 报告期末基金的投资策略

4.72 报告期末基金的投资策略

4.73 报告期末基金的投资策略

4.74 报告期末基金的投资策略

4.75 报告期末基金的投资策略

4.76 报告期末基金的投资策略

4.77 报告期末基金的投资策略

4.78 报告期末基金的投资策略

4.79 报告期末基金的投资策略

4.80 报告期末基金的投资策略

4.81 报告期末基金的投资策略

4.82 报告期末基金的投资策略

4.83 报告期末基金的投资策略

4.84 报告期末基金的投资策略

4.85 报告期末基金的投资策略

4.86 报告期末基金的投资策略

4.87 报告期末基金的投资策略

4.88 报告期末基金的投资策略

4.89 报告期末基金的投资策略

4.90 报告期末基金的投资策略

4.91 报告期末基金的投资策略

4.92 报告期末基金的投资策略

4.93 报告期末基金的投资策略

4.94 报告期末基金的投资策略

4.95 报告期末基金的投资策略

4.96 报告期末基金的投资策略

4.97 报告期末基金的投资策略

4.98 报告期末基金的投资策略

4.99 报告期末基金的投资策略

4.100 报告期末基金的投资策略

4.101 报告期末基金的投资策略

4.102 报告期末基金的投资策略

4.103 报告期末基金的投资策略

4.104 报告期末基金的投资策略

4.105 报告期末基金的投资策略

4.106 报告期末基金的投资策略

4.107 报告期末基金的投资策略

4.108 报告期末基金的投资策略

4.109 报告期末基金的投资策略

4.110 报告期末基金的投资策略

4.111 报告期末基金的投资策略

4.112 报告期末基金的投资策略

4.113 报告期末基金的投资策略

4.114 报告期末基金的投资策略

4.115 报告期末基金的投资策略

4.116 报告期末基金的投资策略

4.117 报告期末基金的投资策略

4.118 报告期末基金的投资策略

4.119 报告期末基金的投资策略

4.120 报告期末基金的投资策略

4.121 报告期末基金的投资策略

4.122 报告期末基金的投资策略

4.123 报告期末基金的投资策略

4.124 报告期末基金的投资策略

4.125 报告期末基金的投资策略

4.126 报告期末基金的投资策略

4.127 报告期末基金的投资策略

4.128 报告期末基金的投资策略

4.129 报告期末基金的投资策略

4.130 报告期末基金的投资策略

4.131 报告期末基金的投资策略

4.132 报告期末基金的投资策略

4.133 报告期末基金的投资策略

4.134 报告期末基金的投资策略

4.135 报告期末基金的投资策略

4.136 报告期末基金的投资策略

4.137 报告期末基金的投资策略

4.138 报告期末基金的投资策略

4.139 报告期末基金的投资策略

4.140 报告期末基金的投资策略

4.141 报告期末基金的投资策略

4.142 报告期末基金的投资策略

4.143 报告期末基金的投资策略

4.144 报告期末基金的投资策略

4.145 报告期末基金的投资策略

4.146 报告期末基金的投资策略

4.147 报告期末基金的投资策略

4.148 报告期末基金的投资策略

4.149 报告期末基金的投资策略

4.150 报告期末基金的投资策略

4.151 报告期末基金的投资策略

4.152 报告期末基金的投资策略

4.153 报告期末基金的投资策略

4.154 报告期末基金的投资策略

4.155 报告期末基金的投资策略

4.156 报告期末基金的投资策略

4.157 报告期末基金的投资策略

4.158 报告期末基金的投资策略

4.159 报告期末基金的投资策略

4.160 报告期末基金的投资策略

4.161 报告期末基金的投资策略

4.162 报告期末基金的投资策略

4.163 报告期末基金的投资策略

4.164 报告期末基金的投资策略

4.165 报告期末基金的投资策略

4.166 报告期末基金的投资策略

4.167 报告期末基金的投资策略

4.168 报告期末基金的投资策略

4.169 报告期末基金的投资策略

4.170 报告期末基金的投资策略

4.171 报告期末基金的投资策略

4.172 报告期末基金的投资策略

4.173 报告期末基金的投资策略

4.174 报告期末基金的投资策略

4.175 报告期末基金的投资策略

4.176 报告期末基金的投资策略

4.177 报告期末基金的投资策略

4.178 报告期末基金的投资策略

4.179 报告期末基金的投资策略

4.180 报告期末基金的投资策略

4.181 报告期末基金的投资策略

4.182 报告期末基金的投资策略

4.183 报告期末基金的投资策略

4.184 报告期末基金的投资策略

4.185 报告期末基金的投资策略

4.186 报告期末基金的投资策略

4.187 报告期末基金的投资策略

4.188 报告期末基金的投资策略

4.189 报告期末基金的投资策略

4.190 报告期末基金的投资策略

4.191 报告期末基金的投资策略

4.192 报告期末基金的投资策略

4.193 报告期末基金的投资策略

4.194 报告期末基金的投资策略

4.195 报告期末基金的投资策略

4.196 报告期末基金的投资策略

4.197 报告期末基金的投资策略

4.198 报告期末基金的投资策略

4.199 报告期末基金的投资策略

4.200 报告期末基金的投资策略

4.201 报告期末基金的投资策略

4.202 报告期末基金的投资策略

4.203 报告期末基金的投资策略

4.204 报告期末基金的投资策略

4.205 报告期末基金的投资策略

4.206 报告期末基金的投资策略

4.207 报告期末基金的投资策略

4.208 报告期末基金的投资策略