

第二季度 报告

2012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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年六月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等内容，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预示其未来表现。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。

本报告财务数据截止自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	华夏亚洲中国指数
基金主代码	001021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月25日
报告期内基金净值增长	-2,465,583.042.09元
投资目标	本基金通过投资于除香港须项费用之外的标的指数的相关证券，跟踪该指数。
投资策略	本基金为被动管理型基金，主要通过完全复制法对标的指数复制制策略，将投资于标的指数中具有代表性的成份股、权证、期货等非成份证券作为替代，使得债券持仓比例与标的总体特征一致；同时，将根据标的指数成分股的流动性状况、交易数量限制、持仓集中度限制等因素进行适当的调整和优化，以期获得跟踪标的指数的投资收益，并力争基金净值增长率与跟踪基准且可控的跟踪误差等指标，以弥补基金费用，增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的投资业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为Markit India Index（摩根士丹利资本国际印度股市指数）。
风险收益特征	本基金属于中高风险基金，风险与收益高于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于政府债券、风险和收益低于投资组合内包括股票、可转换公司债券及固定收益类金融工具的债券的投资组合。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金投资人	交通银行股份有限公司
下属两级基金的基本情况	华夏亚洲中国指数A 华夏亚洲中国指数C
下属两级基金的代码	001023 001025
报告期末下属两级基金的份额总额	2,392,320,548.85份 71,233,114.29份

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币

基金名称	报告期 2012年4月1日至2012年6月30日				
	华夏亚洲中国指数A		华夏亚洲中国指数C		
1.本期已实现收益	49,329,893.44		612,166.60		
2.本期利润	18,497,689.27		1,566,531.87		
3.加权平均基金份额本期利润	0.0002		0.0016		
4.期末基金资产净值	2,553,171,050.97		75,700,761.86		
5.期末基金份额净值	1.007		1.003		

注：①所述基金业绩指标不包括持有买入认购或交易基金的各项费用，计入费用后对应的权益水平要低于所列数字。

②当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 基金净值增值率与率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增值率 标准差	净值增长率标准 差	业绩比较基准收益 率标准差	业绩比较基准收益 率标准差	①—③ ④—⑤
过去三年	1.91%	0.12%	2.03%	0.07%	-0.12% 0.05%

华夏亚洲中国指数C：

阶段	净值 增值率	净值增长率 标准差	业绩比较基准收 益率	业绩比 较基 准 标 差	①—③ ④—⑤
过去六个月	1.82%	0.12%	2.09%	0.07%	-0.27%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计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

华夏亚洲中国指数C：
的累积净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2011年5月25日至2012年6月30日

2.2 指数化投资并持仓分散的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	金额单位:人民币元
A	农林、牧、渔业	8,244,000.00	占基金资产净值比例 (%)
B	采矿业	95,504,455.14	0.39
C	制造业	256,437,788.60	1.00
CD	食品、饮料	99,317,450.32	2.11
C1	纺织、服装、皮毛	-	
C2	木材、家具	-	
C3	造纸、印刷	-	
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,190,505.66	0.72
C5	金属、非金属	49,409,939.93	1.76
C7	机械、设备、仪表	112,627,429.59	4.00
C8	医药、生物制品	14,816,443.20	0.53
C9	其他制造业	-	
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,882,299.05	0.56
E	交通运输、仓储业	22,697,110.72	0.81
F	信息技术业	79,060,904.85	2.79
G	其他服务业	15,577,370.92	0.58
H	批发和零售贸易	17,461,466.26	0.64
I	金融、保险业	349,945,725.55	12.41
J	房地产业	17,416,863.00	0.62
K	社会服务业	9,312,892.38	0.33
L	传播与文化产业	-	
M	综合类	-	
合计		847,662,122.92	30.00

5.3 前十名重仓股票占基金资产净值比例(买入并持有的所有股权投资项目)

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	601318	中国平安	1,363,059	62,564,318.66	2.21
2	600016	民生银行	8,947,260	53,594,074.00	1.91
3	600036	招商银行	4,556,828	49,770,501.76	1.77
4	600775	广汇股份	1,238,000	37,766,000.00	1.37
5	000895	双汇发展	499,344	40,930,364.72	1.49
6	600837	海南高速	2,901,917	27,945,407.56	1.04
7	601088	中国神华	1,181,222	26,553,870.36	0.99
8	601166	兴业银行	1,997,802	25,319,406.96	0.92
9	600000	浦发银行	3,021,688	24,566,233.44	0.87
10	000651	格力电器	1,122,550	23,485,167.50	0.83

5.3.2 股权投资项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的所有股权投资项目)

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	300136	鹏华生物	6,207,774	85,853,514.42	3.05
2	300077	国民技术	2,134,408	43,760,088.48	1.57
3	002209	汇创泰和	4,832,287	36,869,973.13	1.32
4	002138	顺络电子	2,882,262	32,886,699.49	1.18
5	600858	用友软件	2,134,325	32,569,799.50	1.16

5.4 前十大投资组合持仓占基金资产净值比例

序号	债券品种	公允价值	金额单位:人民币元
		公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	162,455,628.80	11.78
2	央行票据	319,905,000.00	23.00
3	金融债	140,622,000.00	10.22
	其中:政策性金融债	140,622,000.00	4.99
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,645,573.30	0.31
8	其他	-	-
9	合计	631,716,262.10	22.43

5.5 前十大重仓股票占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票项目)

序号	股票代码	债券名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1101096	11月19日国债096	2,500,000	242,450,000.00	8.61
2	120910	12月10日	1,500,000	100,450,000.00	3.57
3	010107	21国债07	745,780	79,156,628.80	2.83
4	120009	12月09日国债099	500,000	50,145,000.00	1.78
5	1101088	11月19日国债88	500,000	48,455,000.00	1.72

5.6 前十大重仓股票占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.1 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.2 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.3 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.4 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.5 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.6 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.7 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.8 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.9 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.10 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.11 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.12 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.13 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.14 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.15 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.16 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.17 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.18 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.19 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.20 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.21 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.22 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.23 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.24 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.25 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.26 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.27 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.28 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.29 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.30 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.31 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.32 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.33 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.34 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.35 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.36 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.37 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.38 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.39 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.40 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.41 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.42 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.43 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.44 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.45 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.46 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.47 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.48 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.49 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.50 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.51 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.52 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.53 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.54 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.55 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.56 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.57 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.58 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.59 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.60 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.61 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.62 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.63 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.64 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.65 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.66 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.67 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.68 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.69 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.70 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.71 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.72 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.73 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.74 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.75 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.76 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.77 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.78 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.79 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.80 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.81 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.82 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.83 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.84 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.85 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.86 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.87 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.88 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.89 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.90 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.91 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.92 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.93 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.94 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.95 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.96 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.97 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.98 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.99 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.100 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.101 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.102 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.103 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.104 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.105 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.106 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.107 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.108 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.109 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.110 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.111 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.112 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.113 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.114 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.115 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.116 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.117 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.118 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.119 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.120 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.121 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.122 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.123 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.124 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.125 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.126 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.127 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.128 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.129 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.130 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.131 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.132 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.133 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.134 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.135 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.136 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.137 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.138 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.139 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.140 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.141 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.142 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.143 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.144 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.145 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.146 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.147 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.148 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.149 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.150 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.151 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.152 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.153 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.154 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.155 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.156 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.157 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.158 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.159 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.160 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.161 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.162 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.163 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.164 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.165 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.166 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.167 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.168 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.169 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.170 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.171 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.172 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.173 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.174 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.175 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.176 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.177 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.178 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.179 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.180 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.181 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.182 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.183 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.184 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.185 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.186 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.187 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.188 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.189 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.190 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.191 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.192 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.193 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.194 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.195 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.196 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.197 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.198 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.199 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.200 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.201 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.202 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.203 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.204 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.205 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.206 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.207 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.208 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.209 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.210 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.211 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.212 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.213 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.214 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.215 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.216 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.217 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.218 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.219 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.220 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.221 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.222 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.223 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.224 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.225 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.226 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.227 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.228 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.229 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.230 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.231 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.232 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.233 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.234 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.235 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.236 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.237 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.238 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.239 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.240 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.241 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.242 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.243 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.244 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.245 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.246 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.247 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.248 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.249 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.250 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.251 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.252 前十大重仓股票支持证券项目持仓占基金资产净值比例(买入并持有的前十大重仓股票支持证券投资项目)

5.6.253

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

华夏亚洲中国指数C

图注：根据亚洲中国债券指数的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十四条 C、投资范围、D、投资策略规定的有关约定。

4.1 基金经理 基金经理小组 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董元昊	本基金的基金经理	2011-05-25	-	6年	美国纽约大学 Stern 商学院金融硕士，曾任北京惠康（集团）信托之交易员等。2009年3月加入华夏基金管理有限公司。

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满两年。
② 证券投资基金的含义通过行业协会《证券投资基金运作管理办法》的相关规定。
4.2 对管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内，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》和其他有关法律法规、监管部门的规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明

第二季度 报告

2012年6月30日

[illegible]

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

基金管理人一贯对托管下管理的所有基金组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在不同估值价格期间公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金估值业务指导意见》及《中国证监会公告[2015]第6号》相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,所有交易价格均按照交易所公平交易方式同日反向交易成交较少的单边交易未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩分析

2015年,我国经济保持中高速增长,4月7月未一路走高,全球金融市场5月以来波动明显,中国经济增速下降,人民币贬值压力较大,央行于7月下调法定存款准备金率0.5个百分点,并于7月下调一年期存贷款基准利率0.25个百分点。在债券市场方面,央行多次降准,具有代表性的央行回购利率创历史新低,10年期国债收益率以及央行的利率都有明显上提。报告期内,本基金长期利率基准久期基本保持不变。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,华夏基金中国指数A基金份额净值为1.067元,本报告期基金份额净值增长率为1.91%;华夏中证中国指数A基金份额净值为1.0163元,本报告期基金份额净值增长率为1.82%,同期业绩比较基准增长率为2.03%。

4.4.3 管理人对外发布的报告,是否与报告期内基金投资运作的事实相符

报告期内,基金管理人对外发布的报告,与报告期内基金投资运作的事实相符。本基金报告期内采取进一步的货币和股票投资,中国经济在短期内的企稳有望明显复苏,通胀水平可能温和加速增长,与通胀预期较为吻合。基于上述判断,利率和商品总会上将维持有所表现。

4.4.4 报告期内基金投资的前十名证券及其公允价值

报告期内基金投资的前十名证券及其公允价值如下表所示:

持仓基金管理人持有的一人每一基金份额对应一股份,本基金将继续委托华夏基金管理有限公司为“信义奉献回报”的经营,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。	
---	--

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

姓名	项目	金额	金额单位:人民币元	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资			
	其中:股票			
2	固定收益投资	2,586,233,316.50	98.34	
	其中:债券	2,586,233,316.50	98.34	
	资产支持证券			
3	金融衍生品投资			
4	买入返售金融资产			
5	其他:买入返售金融资产			
6	银行存款和结算备付金合计	3,189,048.36	0.12	
7	其他各项资产	459,683.32	0.02	
7	合计	2,629,959,578.16	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.3 报告期末按行业分类的基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

姓名	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,616,931,516.50	57.68
2	央行票据	702,713,000.00	26.73
3	金融债券	367,126,800.00	13.97
其中:政策性金融债	367,126,800.00	13.97	
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债		
8	其他		
9	合计	2,586,233,316.50	98.38

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

2	1101001	11央行票据01	1,200,000	122,120,000.00	4.60
3	1101032	11央行票据32	1,200,000	122,280,000.00	4.65
4	110016	11附息国债16	1,000,000	107,140,000.00	4.08

[illegible]