华夏盛世精选股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:二〇一三年一月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏盛世股票
基金主代码	000061
交易代码	000061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	9,862,381,270.64份
投资目标	紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。
投资策略	本基金以周期优选投资策略为核心,并辅以个股精选和积极债券管理策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-164,777,192.49
2.本期利润	629,341,830.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0630
4.期末基金资产净值	7,488,533,995.24
5.期末基金份额净值	0.759

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

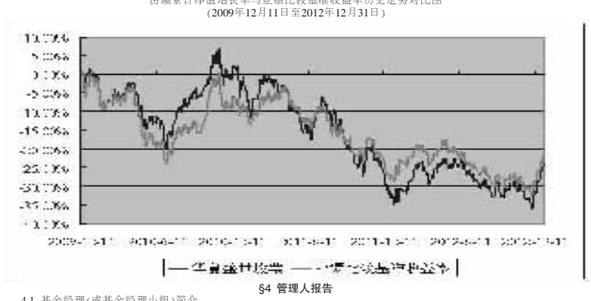
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.21%	1.23%	8.18%	1.02%	1.03%	0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华夏盛世精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年12月11日至2012年12月31日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
阳琨	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-12-18	-	17年	北京大学MBA。曾任宝盈基金基金经理助理,益民基金投资部部门经理,中国对外经济贸易信托投资公司财务部部门经理等。2006年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略研究员、兴和证券投资基金基金经理(2009年1月1日至2012年1月12日期间)等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本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。

4.2 管理人对报告期内本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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,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,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,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各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内或发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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运作分析

2012年4季度,国内宏观经济出现企稳迹象,工业企业利润延续反弹趋势;CPI继续维持低位;短期资金利率继续缓慢下行,防地产开发企业由于销售情况较好,融资压力降低,融资成本下降。A股市场先抑后扬,上证指数于12月4日盘中跌至1949点,创下3年来的新低,随后快速反弹至2100点以上,期间,白酒行业受"塑化剂事件"影响跌幅较大,带动大消费板块估值下行,而低估值的传统蓝筹类板块在季度末的反弹中表现突出,银行业板块的估值修复力度超出市场预期。

报告期内,本基金继续维持较高的股票仓位,结构上偏低估值板块。在季度前期的市场下行中,基金净值受到损失,但在季度末的反弹中表现较好,基金净值快速回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.759元,本报告期份额净值增长率为9.21%,同期业绩比较基准增长率为8.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段,我们认为,国内经济进入温和复苏的阶段,未来一两个季度上市公司的盈利可能环比止跌,但由于长期结构性问题难以在短期内得以根本性解决,经济转型任重道远,上市公司业绩呈现强劲反转的可能性并不大。基于上述判断,我们认为,市场的投资机会可能更多的来自估值体系的修复,市场可能表现为阶段性转暖,中长期走向将取决于投资者对中国下阶段经济增长空间的信心能否重新确立。股票投资进入"有可为"的阶段,即在相当大市值部分的板块中,估值风险已得到较充分的释放,投资的关键重新回到对业绩的判断上。

我们计划继续把主要精力集中在个股选择上,减少主题类投资,专注于细分行业和个股的深度研究,努力寻找适应经济转型的新兴行业及传统行业中的个股,力争为投资者实现良好的收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	6,167,894,001.93	81.83
	其中:股票	6,167,894,001.93	81.83
2	固定收益投资	438,262,734.40	5.81
	其中:债券	438,262,734.40	5.81
	资产支持证券	-	-
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	894,029,669.97	11.86
6	其他各项资产	37,481,590.92	0.50
7	合计	7,537,667,997.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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、渔业	-	-
B	采掘业	177,643,378.77	2.37
C	制造业	2,279,711,813.53	30.44
C0	食品、饮料	301,925,924.27	4.03
C1	纺织、服装、皮毛	58,166,494.40	0.78
C2	木材、家具	26,075,754.00	0.35
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,954,029.31	0.37
C5	电子	290,681,822.10	3.88
C6	金属、非金属	180,370,825.46	2.41
C7	机械、设备、仪表	851,478,032.95	11.37
C8	医药、生物制品	543,058,931.04	7.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	252,336,577.20	3.37
E	建筑业	399,942,200.45	5.34
F	交通运输、仓储业	28,165,725.20	0.38
G	信息技术业	205,354,477.34	2.74
H	批发和零售贸易	500,714,450.33	6.69
I	金融、保险业	1,349,204,377.13	18.02
J	房地产业	950,967,136.78	12.70
K	社会服务业	23,853,865.20	0.32
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,167,894,001.93	82.36

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	600048	保利地产	28,078,605	381,869,028.00	5.10
2	000002	万科A	34,999,665	354,196,609.80	4.73
3	600036	招商银行	16,720,031	229,900,426.25	3.07
4	601601	中国太保	8,565,874	192,732,165.00	2.57
5	002024	苏宁电器	28,552,542	189,874,404.30	2.54
6	600690	青岛海尔	14,038,907	188,121,353.80	2.51
7	600694	大商股份	5,195,871	183,258,370.17	2.45
8	600886	国投电力	31,723,329	182,726,375.04	2.44
9	600887	伊利股份	8,222,344	180,727,121.12	2.41
10	600015	华夏银行	14,999,917	155,249,140.95	2.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	135,399,746.60	1.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,135,000.00	3.74
	其中:政策性金融债	280,135,000.00	3.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	22,727,987.80	0.30
8	其他	-	-
9	合计	438,262,734.40	5.85

5.5 报告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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120405	12农发05	2,300,000	230,115,000.00	3.07
2	019219	12国债19	800,000	80,004,080.00	1.07
3	010107	21国债(7)	529,140	55,395,666.60	0.74
4	120216	12国开16	500,000	50,020,000.00	0.67
5	113002	工行转债	207,410	22,727,987.80	0.30

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,021,819.45
2	应收证券清算款	25,287,087.93
3	应收股利	-
4	应收利息	8,792,723.51
5	应收申购款	2,379,960.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,481,590.92

5.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	22,727,987.80	0.30

5.8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	354,196,609.80	4.73	筹划重大事项

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,104,812,333.22
本报告期基金总申购份额	4,170,207.47
减:本报告期基金总赎回份额	246,601,270.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,862,381,270.64

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内披露的主要事项

2012年11月8日发布华夏基金管理有限公司关于设立青岛分公司的公告。

2012年11月22日发布华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告。

2012年12月24日发布华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告。

2012年12月28日发布华夏基金管理有限公司关于华夏沪深300指数证券投资基金修订基金合同部分条款的公告。

2012年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告。

7.2 其他相关信息

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、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2012年4季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,积极把握市场反弹机会,旗下主动管理的股票型、混合型基金均取得了正收益,固定收益类产品也取得了稳定的回报,大部分基金表现优于市场平均水平。在客户服务方面,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提高服务质量;推出货币基金快速赎回业务,投资者可使用中国工商银行借记卡、招商银行储蓄卡、中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡等银行卡通过电子交易平台快速赎回华夏现金增利证券投资基金,资金使用效率得到提高;推出余额理财服务,使用中国工商银行借记卡的电子交易客户可通过该功能将多余资金自动申购华夏现金增利证券投资基金,资金闲置时间有效减少。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

8.1.2《华夏盛世精选股票型证券投资基金合同》;

8.1.3《华夏盛世精选股票型证券投资基金托管协议》;

8.1.4法律意见书;

8.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

8.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一三年一月二十一日

亚债中国债券指数基金

2012 第四季度 报告

2012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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏亚债中国指数	
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	
报告期末基金份额总额	2,383,900,784.93份	
投资目标	本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。	
投资策略	本基金为被动管理基金,主要采用代表性分层抽样复制策略,投资于标的指数中具有代表性的部分成份券,或选择非成份券作为替代,使得债券投资组合的总体特征(如久期、剩余期限分布和到期收益率等)与标的指数相似。此外,本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资,以弥补基金费用、增加基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为Markit指数公司(Markit Indices Limited)编制并发布的iBoxx亚债中国指数。	
风险收益特征	本基金属于债券基金,风险与收益低于股票基金、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范围包括股票、可转换公司债及普通企业债的债券基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	华夏亚债中国指数A	华夏亚债中国指数C
下属两级基金的交易代码	001021	001023
报告期末下属两级基金的份额总额	2,338,655,172.03份	45,245,612.90份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	华夏亚债中国指数A	华夏亚债中国指数C
1.本期已实现收益	21,525,374.82	414,013.48
2.本期利润	9,445,238.46	136,438.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040	0.0026
4.期末基金资产净值	2,496,834,522.24	48,014,498.59
5.期末基金份额净值	1.068	1.061

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

华夏亚债中国指数A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	0.06%	0.33%	0.06%	0.05%	0.00%

华夏亚债中国指数C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.28%	0.05%	0.33%	0.06%	-0.05%	-0.01%

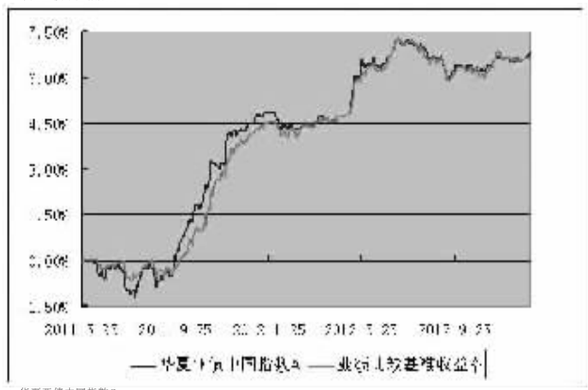
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

亚债中国债券指数基金

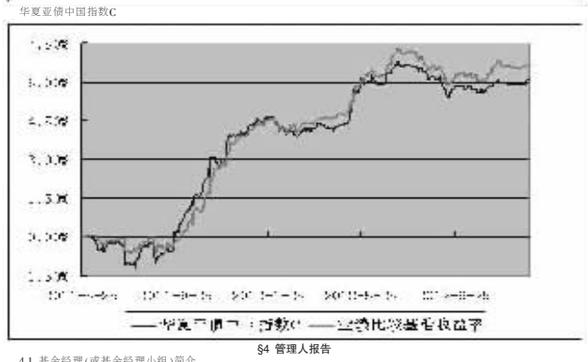
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年5月25日至2012年12月31日)

华夏亚债中国指数A



华夏亚债中国指数C



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
邓湘伟	本基金的基金经理	2012-08-01	-	9年	香港科技大学经济学硕士。曾任海通证券研究员,中银基金研究员、基金经理助理等。2007年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略分析师、固定收益部投资经理等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本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。

4.2 管理人对报告期内本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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,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,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,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各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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运作分析

4季度,国际方面,美国大选结束后,投资者关注的重心已经从如何实施宽松的货币政策转变为如何解决财政悬崖;欧洲、日本经济依然表现不佳,政府宽松的货币政策只是避免经济陷入深渊,并非"治根"良策。国内方面,经济企稳回升,多项数据确认了经济的反弹走势,投资者对明年政策放松存在一定预期。

债市方面,利率品种价格震荡回落。10月,债券市场延续了之前的调整走势,10年期国债收益率上升10BP;之后,由于公布的10月CPI数据明显低于市场预期,投资者对物价上涨的担心减弱,债市展开为期半月的反弹,10年期国债收益率回落至10月初水平;自11月中下旬以来,由于经济反弹得以确认,物价见底成为市场共识,加之资金面在年底的季节性收紧,债市又经历了一波回调,10年期国债收益率在年末上升至3.6%左右,达到年内最高水平。

报告期内,本基金组合久期与指数基准久期基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,华夏亚债中国指数A基金份额净值为1.068元,本报告期份额净值增长率为0.38%;华夏亚债中国指数C基金份额净值为1.061元,本报告期份额净值增长率为0.28%。同期业绩比较基准增长率为0.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年1季度,国际经济形势依旧严峻,财政悬崖会明显影响美欧经济,并拖累我国的出口。国内方面,投资将延续2012年以来的平稳走势,尤其是政府基建依然会起到领头羊的作用;消费依然稳定,对经济的贡献作用将提升;CPI将进一步上行。债市方面,物价的上行将成为压制债市的主要不利因素,利率品种或将会有5~10BP的上行压力。

本基金在2013年1季度将继续努力保持组合久期与指数久期一致。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,475,732,354.50	97.24
	其中:债券	2,475,732,354.50	97.24
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	36,800,000.00	1.45
	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	3,911,857.15	0.15
6	其他各项资产	29,653,219.25	1.16
7	合计	2,546,097,430.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,584,234,754.50	62.25
2	央行票据	483,325,000.00	18.99
3	金融债券	408,172,600.00	16.04
	其中:政策性金融债	408,172,600.00	16.04
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	2,475,732,354.50	97.28

5.5 报告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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120004	12附息国债04	1,900,000	189,411,000.00	7.44
2	1101032	11央行票据32	1,200,000	121,116,000.00	4.76
3	110016	11附息国债16	1,000,000	105,100,000.00	4.13
4	1101081	11央行票据81	1,000,000	101,410,000.00	3.98
5	1001042	10央行票据42	1,000,000	99,930,000.00	3.93

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.8.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,094.72
3	应收股利	-
4	应收利息	29,637,407.74
5	应收申购款	13,716.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,653,219.25

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	华夏亚债中国指数A	华夏亚债中国指数C
本报告期期初基金份额总额	2,388,450,351.17	58,424,750.80
本报告期基金总申购份额	2,509,045.18	1,213,035.27
减:本报告期基金总赎回份额	52,304,224.32	14,392,173.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,338,655,172.03	45,245,612.90

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内披露的主要事项

2012年11月8日发布华夏基金管理有限公司关于设立青岛分公司的公告。

2012年11月22日发布华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告。

2012年11月30日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告。

2012年12月28日发布华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告。

2012年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告。

7.2 其他相关信息

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、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2012年4季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,积极把握市场反弹机会,旗下主动管理的股票型、混合型基金均取得了正收益,固定收益类产品也取得了稳定的回报,大部分基金表现优于市场平均水平。在客户服务方面,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提高服务质量;推出货币基金快速赎回业务,投资者可使用中国工商银行借记卡、招商银行储蓄卡、中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡等银行卡通过电子交易平台快速赎回华夏现金增利证券投资基金,资金使用效率得到提高;推出余额理财服务,使用中国工商银行借记卡的电子交易客户可通过该功能将多余资金自动申购华夏现金增利证券投资基金,资金闲置时间有效减少。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

8.1.2《亚债中国债券指数基金基金合同》;

8.1.3《亚债中国债券指数基金托管协议》;

8.1.4法律意见书;

8.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

8.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一三年一月二十一日

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原华夏沪深300指数证券投资基金)

2012 第四季度 报告

2012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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

根据基金管理人2012年12月21日刊登的《华夏基金管理有限公司关于华夏沪深300指数证券投资基金修订基金合同部分条款的公告》,华夏沪深300指数证券投资基金自2012年12月25日转为华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金,并相应修订基金合同条款。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
报告期末基金份额总额	27,756,194,055.50份
投资目标	采用指数化投资方式,追求对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率,评价时应按期间折算)。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日) |
|---