

中小企业板交易型开放式指数基金

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: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

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金产品概况
基金名称:华夏中小盘T
基金代码:159902
基金运作方式:交易型开放式
基金合同生效日:2006年6月8日

主要财务指标
1.本期已实现收益: -166,666.0176元
2.本期利润: -28,300,293.56元
3.期末基金份额净值: 4,290.010,716元

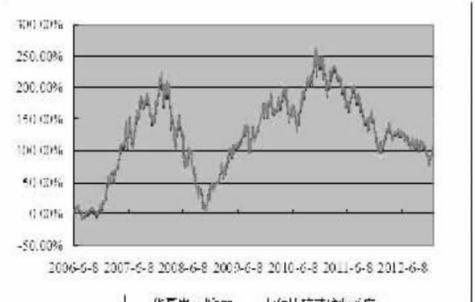


图1: 华夏中小盘T 净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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

基金名称: 华夏中小盘T
基金代码: 159902

基金运作方式: 交易型开放式

基金合同生效日: 2006年6月8日

报告期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

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,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并随着标的指数成份股及其权重进行相应调整。

业绩比较基准: 中证中小企业板价格指数

风险收益特征: 本基金为股票型基金,预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,本基金为股票型基金,预期收益高于混合基金、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: 中国建设银行股份有限公司

主要财务指标

1.本期已实现收益: -166,666.0176元

2.本期利润: -28,300,293.56元

3.期末基金份额净值: 4,290.010,716元

4.期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

5.期末基金份额持有人户数: 1,989户

6.期末基金份额持有人户数: 1,989户

7.期末基金份额持有人户数: 1,989户

8.期末基金份额持有人户数: 1,989户

9.期末基金份额持有人户数: 1,989户

10.期末基金份额持有人户数: 1,989户

11.期末基金份额持有人户数: 1,989户

12.期末基金份额持有人户数: 1,989户

13.期末基金份额持有人户数: 1,989户

14.期末基金份额持有人户数: 1,989户

15.期末基金份额持有人户数: 1,989户

16.期末基金份额持有人户数: 1,989户

17.期末基金份额持有人户数: 1,989户

18.期末基金份额持有人户数: 1,989户

19.期末基金份额持有人户数: 1,989户

20.期末基金份额持有人户数: 1,989户

21.期末基金份额持有人户数: 1,989户

22.期末基金份额持有人户数: 1,989户

23.期末基金份额持有人户数: 1,989户

24.期末基金份额持有人户数: 1,989户

25.期末基金份额持有人户数: 1,989户

26.期末基金份额持有人户数: 1,989户

27.期末基金份额持有人户数: 1,989户

28.期末基金份额持有人户数: 1,989户

29.期末基金份额持有人户数: 1,989户

30.期末基金份额持有人户数: 1,989户

31.期末基金份额持有人户数: 1,989户

32.期末基金份额持有人户数: 1,989户

33.期末基金份额持有人户数: 1,989户

34.期末基金份额持有人户数: 1,989户

35.期末基金份额持有人户数: 1,989户

36.期末基金份额持有人户数: 1,989户

37.期末基金份额持有人户数: 1,989户

38.期末基金份额持有人户数: 1,989户

39.期末基金份额持有人户数: 1,989户

40.期末基金份额持有人户数: 1,989户

41.期末基金份额持有人户数: 1,989户

42.期末基金份额持有人户数: 1,989户

43.期末基金份额持有人户数: 1,989户

44.期末基金份额持有人户数: 1,989户

投资组合报告
2 固定收益投资: 4,292,972,197.09
3 其中:债券: 4,292,972,197.09
4 买入返售金融资产: 0.00

行业资产配置
A 农林牧渔: 3.06
B 采矿业: 5.75
C 制造业: 59.98
D 食品饮料: 7.34

基金净值表现
1. 基金份额净值增长率: -0.70%
2. 业绩比较基准收益率: -0.66%

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

基金名称: 华夏中小盘T
基金代码: 159902

基金运作方式: 交易型开放式

基金合同生效日: 2006年6月8日

报告期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

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,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并随着标的指数成份股及其权重进行相应调整。

业绩比较基准: 中证中小企业板价格指数

风险收益特征: 本基金为股票型基金,预期收益高于混合基金、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: 中国建设银行股份有限公司

主要财务指标

1.本期已实现收益: -166,666.0176元

2.本期利润: -28,300,293.56元

3.期末基金份额净值: 4,290.010,716元

4.期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

5.期末基金份额持有人户数: 1,989户

6.期末基金份额持有人户数: 1,989户

7.期末基金份额持有人户数: 1,989户

8.期末基金份额持有人户数: 1,989户

9.期末基金份额持有人户数: 1,989户

10.期末基金份额持有人户数: 1,989户

11.期末基金份额持有人户数: 1,989户

12.期末基金份额持有人户数: 1,989户

13.期末基金份额持有人户数: 1,989户

14.期末基金份额持有人户数: 1,989户

15.期末基金份额持有人户数: 1,989户

16.期末基金份额持有人户数: 1,989户

17.期末基金份额持有人户数: 1,989户

18.期末基金份额持有人户数: 1,989户

19.期末基金份额持有人户数: 1,989户

20.期末基金份额持有人户数: 1,989户

21.期末基金份额持有人户数: 1,989户

22.期末基金份额持有人户数: 1,989户

23.期末基金份额持有人户数: 1,989户

24.期末基金份额持有人户数: 1,989户

25.期末基金份额持有人户数: 1,989户

26.期末基金份额持有人户数: 1,989户

27.期末基金份额持有人户数: 1,989户

28.期末基金份额持有人户数: 1,989户

29.期末基金份额持有人户数: 1,989户

30.期末基金份额持有人户数: 1,989户

31.期末基金份额持有人户数: 1,989户

32.期末基金份额持有人户数: 1,989户

33.期末基金份额持有人户数: 1,989户

34.期末基金份额持有人户数: 1,989户

35.期末基金份额持有人户数: 1,989户

36.期末基金份额持有人户数: 1,989户

37.期末基金份额持有人户数: 1,989户

38.期末基金份额持有人户数: 1,989户

39.期末基金份额持有人户数: 1,989户

40.期末基金份额持有人户数: 1,989户

41.期末基金份额持有人户数: 1,989户

42.期末基金份额持有人户数: 1,989户

43.期末基金份额持有人户数: 1,989户

44.期末基金份额持有人户数: 1,989户

45.期末基金份额持有人户数: 1,989户

46.期末基金份额持有人户数: 1,989户

47.期末基金份额持有人户数: 1,989户

48.期末基金份额持有人户数: 1,989户

49.期末基金份额持有人户数: 1,989户

50.期末基金份额持有人户数: 1,989户

51.期末基金份额持有人户数: 1,989户

52.期末基金份额持有人户数: 1,989户

53.期末基金份额持有人户数: 1,989户

54.期末基金份额持有人户数: 1,989户

55.期末基金份额持有人户数: 1,989户

中信稳定双利债券型证券投资基金

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

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金产品概况
基金名称:中信稳定双利债券
基金代码:288102
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年7月20日

主要财务指标
1.本期已实现收益: 28,141,227.63元
2.本期利润: 26,720,582.04元
3.期末基金份额净值: 1,320.342,984.67元

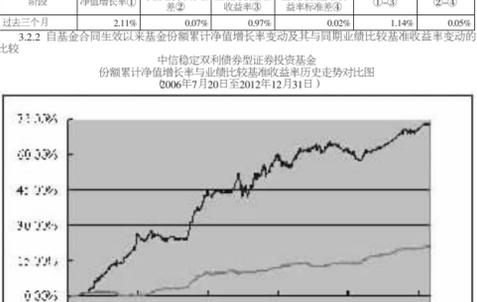


图1: 中信稳定双利债券 净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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

基金名称: 中信稳定双利债券
基金代码: 288102

基金运作方式: 契约型开放式

基金合同生效日: 2006年7月20日

报告期末基金份额总额: 1,277,932,701.71份

投资目标: 本基金主要投资于固定收益类资产,投资目标是:在追求基金资产保值增值的基础上,积极追求资产的长期稳定增值。

投资策略: 本基金采取自上而下投资策略,在宏观、中观、微观三个层面进行资产配置,并随着市场变化及时调整。

业绩比较基准: 中信标普全债指数收益率\*80%+中债综合全价指数收益率\*20%

风险收益特征: 本基金为债券型基金,预期收益低于股票型基金,高于货币市场基金。

基金管理人: 华夏基金管理有限公司

基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

主要财务指标

1.本期已实现收益: 28,141,227.63元

2.本期利润: 26,720,582.04元

3.期末基金份额净值: 1,320.342,984.67元

4.期末基金份额总额: 1,277,932,701.71份

5.期末基金份额持有人户数: 1,000户

6.期末基金份额持有人户数: 1,000户

7.期末基金份额持有人户数: 1,000户

8.期末基金份额持有人户数: 1,000户

9.期末基金份额持有人户数: 1,000户

10.期末基金份额持有人户数: 1,000户

11.期末基金份额持有人户数: 1,000户

12.期末基金份额持有人户数: 1,000户

13.期末基金份额持有人户数: 1,000户

14.期末基金份额持有人户数: 1,000户

15.期末基金份额持有人户数: 1,000户

16.期末基金份额持有人户数: 1,000户

17.期末基金份额持有人户数: 1,000户

18.期末基金份额持有人户数: 1,000户

19.期末基金份额持有人户数: 1,000户

20.期末基金份额持有人户数: 1,000户

21.期末基金份额持有人户数: 1,000户

22.期末基金份额持有人户数: 1,000户

23.期末基金份额持有人户数: 1,000户

24.期末基金份额持有人户数: 1,000户

25.期末基金份额持有人户数: 1,000户

26.期末基金份额持有人户数: 1,000户

27.期末基金份额持有人户数: 1,000户

28.期末基金份额持有人户数: 1,000户

29.期末基金份额持有人户数: 1,000户

30.期末基金份额持有人户数: 1,000户

31.期末基金份额持有人户数: 1,000户

32.期末基金份额持有人户数: 1,000户

33.期末基金份额持有人户数: 1,000户

34.期末基金份额持有人户数: 1,000户

35.期末基金份额持有人户数: 1,000户

36.期末基金份额持有人户数: 1,000户

37.期末基金份额持有人户数: 1,000户

38.期末基金份额持有人户数: 1,000户

39.期末基金份额持有人户数: 1,000户

40.期末基金份额持有人户数: 1,000户

41.期末基金份额持有人户数: 1,000户

42.期末基金份额持有人户数: 1,000户

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

重要提示
基金管理人及基金托管人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。

基金产品概况
基金名称:华夏中小盘T
基金代码:159902
基金运作方式:交易型开放式
基金合同生效日:2006年6月8日

主要财务指标
1.本期已实现收益: -166,666.0176元
2.本期利润: -28,300,293.56元
3.期末基金份额净值: 4,290.010,716元



图1: 华夏中小盘T 净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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

基金名称: 华夏中小盘T
基金代码: 159902

基金运作方式: 交易型开放式

基金合同生效日: 2006年6月8日

报告期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

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,即完全按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并随着标的指数成份股及其权重进行相应调整。

业绩比较基准: 中证中小企业板价格指数

风险收益特征: 本基金为股票型基金,预期收益高于混合基金、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: 中国建设银行股份有限公司

主要财务指标

1.本期已实现收益: -166,666.0176元

2.本期利润: -28,300,293.56元

3.期末基金份额净值: 4,290.010,716元

4.期末基金份额总额: 2,156,828,290.43份

5.期末基金份额持有人户数: 1,989户

6.期末基金份额持有人户数: 1,989户

7.期末基金份额持有人户数: 1,989户

8.期末基金份额持有人户数: 1,989户

9.期末基金份额持有人户数: 1,989户

10.期末基金份额持有人户数: 1,989户

11.期末基金份额持有人户数: 1,989户

12.期末基金份额持有人户数: 1,989户

13.期末基金份额持有人户数: 1,989户

14.期末基金份额持有人户数: 1,989户

15.期末基金份额持有人户数: 1,989户

16.期末基金份额持有人户数: 1,989户

17.期末基金份额持有人户数: 1,989户

18.期末基金份额持有人户数: 1,989户

19.期末基金份额持有人户数: 1,989户

20.期末基金份额持有人户数: 1,989户

21.期末基金份额持有人户数: 1,989户

22.期末基金份额持有人户数: 1,989户

23.期末基金份额持有人户数: 1,