

华夏沪深 300 指数

基金代码
000051

晨星分类
股票型基金

晨星投资风格箱


晨星三年评级
未予评级

报告截至日期为 2011 年 01 月 31 日

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。

基金经理

张弘弢, 硕士。2000 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究发展部总经理、金融工程部副总经理。

方军, 硕士。1999 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。

评级与风险 2010-12-31

评级	回报	晨星风险	晨星评级
三年	--	--	未予评级
五年	--	--	未予评级

MPT (二年)

收益均值	--
标准差	--
夏普比率	--
阿尔法	--
贝塔	--
拟合优度	--

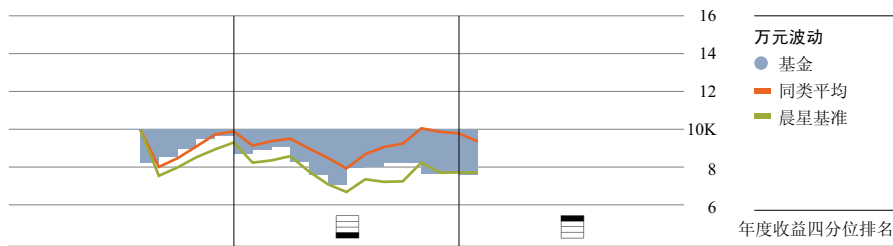
注：业绩基准为晨星大盘指数

基金经理观点

展望未来，宏观经济政策的重点是更加积极稳妥地处理好保持经济平稳较快发展、调整经济结构、管理通胀预期之间的关系。2011 年 1 季度，预计通胀压力依然较大，政府可能会出台进一步的紧缩政策。在上述因素的影响下，沪深 300 指数继续震荡整理的可能性较大。

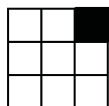
本基金将会根据基金合同及相关法律法规要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，力争和业绩基准保持一致。

基金表现 2011-01-31



	2009	2010	2011	年度
基金回报	--	-6.41	--	一季度
	--	-22.16	--	二季度
	--	14.72	--	三季度
	13.28	5.88	--	四季度
基金回报		总回报率	+/- 基准	+/- 同类
今年以来		-1.59%	-1.37%	2.73%
6 个月		6.76%	2.01%	-1.02%
1 年		-3.12%	3.34%	-6.08%
2 年年度化		--	--	--
3 年年度化		--	--	--
成立以来		-13.10%	--	--

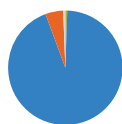
晨星投资风格箱 2010-06-30



风格箱

风格：成长型
规模：大盘

资产配置 2010-12-31



资产分布	比重
股票	93.82%
债券	5.03%
现金	0.54%
其他	0.61%

单位净值 (2011-01-31):	0.8690 (元)	最高销售费用	
累计净值 (2011-01-31):	0.8690 (元)	申购费	1.20%
净资产 (2010-12-31):	227.30 (亿元)	赎回费	0.50%
基本货币:	人民币	最低投资	
基金成立日期:	2009-07-10	最低投资额	1,000 (元)
基金经理:	张弘弢, 方军	追加投资额	1,000 (元)
基金管理人:	华夏基金管理有限公司	营运费用	
客服电话:	+86-400 818 6666	管理费	0.50%
公司网站:	www.chinaamc.com	托管费	0.10%

持仓摘要 2010-12-31

十大股票	晨星行业	P/E	P/B	占净资产
中国平安	金融服务	27.10	3.64	3.24%
招商银行	金融服务	10.85	2.10	2.80%
民生银行	金融服务	9.14	1.36	2.27%
交通银行	金融服务	8.91	1.52	2.26%
海通证券	金融服务	19.80	1.70	1.82%
兴业银行	金融服务	8.01	1.56	1.81%
建设银行	金融服务	8.20	1.73	1.79%
浦发银行	金融服务	8.37	1.82	1.71%
中国神华	能源	13.85	2.49	1.43%
万科 A	金融服务	16.36	2.29	1.40%

五大债券	到期日	当前利率	占净资产
10 央行票据 17	2011-03-10	--	1.42%
10 国债 04	2011-03-04	1.44%	1.14%
08 央行票据 44	2011-04-18	4.56%	0.66%
10 国债 02	2011-01-10	--	0.61%
08 国债 22	2011-12-12	2.15%	0.43%

行业分布 2010-06-30

晨星行业	占股票投资	占净资产
信息业	4.35%	4.12%
软件	0.75%	0.71%
硬件	1.60%	1.51%
传媒	0.93%	0.88%
通信	1.08%	1.02%
服务业	53.09%	50.18%
医疗保健	3.97%	3.75%
消费者服务	2.39%	2.26%
商业服务	10.01%	9.46%
金融服务	36.72%	34.70%
制造业	42.37%	40.05%
消费品	9.25%	8.74%
工业材料	21.45%	20.28%
能源	8.06%	7.62%
公用事业	3.61%	3.41%