

# 华夏成长证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010 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：二〇一一年三月二十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 3 月 21 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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华夏成长混合	
基金主代码	000001	
交易代码	000001	000002
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 12 月 18 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	
报告期末基金份额总额	8,946,552,582.16 份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属成长型基金，主要通过投资于具有良好成长性的上市公司的股票，在保持基金资产安全性和流动性的前提下，实现基金的长期资本增值。
投资策略	“追求成长性”和“研究创造价值”。
业绩比较基准	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67595096
传真	010-63136700	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### §3 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	745,033,331.22	2,824,397,326.35	-1,828,833,123.02
本期利润	347,088,660.07	5,132,099,422.53	-6,053,622,410.46
加权平均基金份额本期利润	0.0415	0.6331	-0.7963
本期基金份额净值增长率	3.56%	67.37%	-44.02%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0639	0.2988	-0.0569
期末基金资产净值	10,609,542,861.70	11,762,587,070.08	6,922,473,047.59
期末基金份额净值	1.186	1.476	0.943

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.37%	1.33%	-	-	-	-
过去六个月	20.26%	1.08%	-	-	-	-
过去一年	3.56%	1.08%	-	-	-	-
过去三年	-2.98%	1.63%	-	-	-	-
过去五年	388.14%	1.61%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	426.23%	1.32%	-	-	-	-

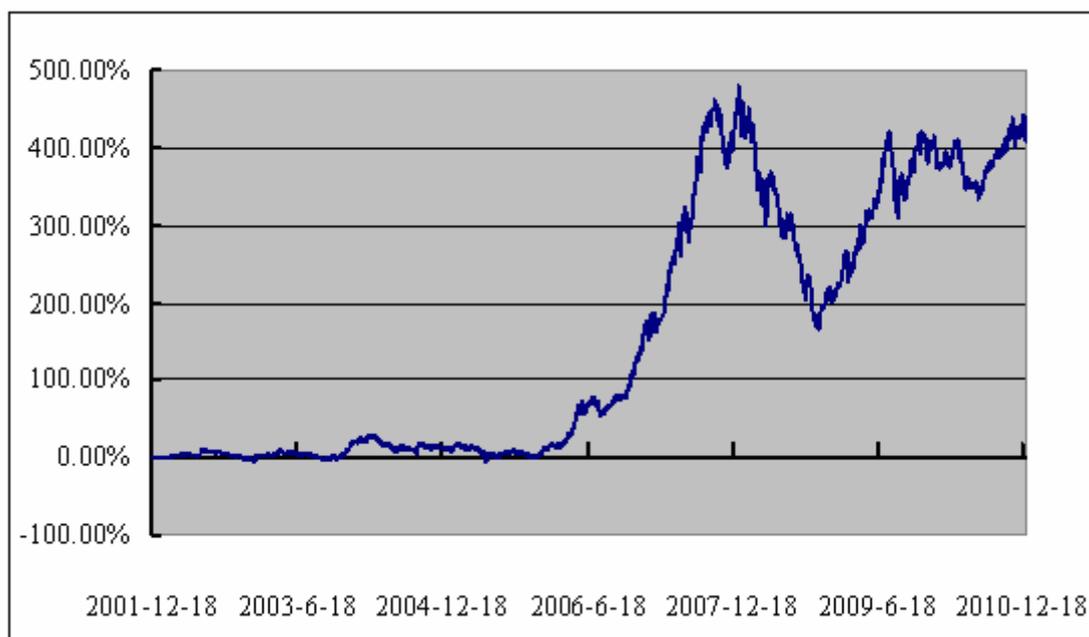
注：本基金未规定业绩比较基准。

##### 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

华夏成长证券投资基金

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

（2001年12月18日至2010年12月31日）

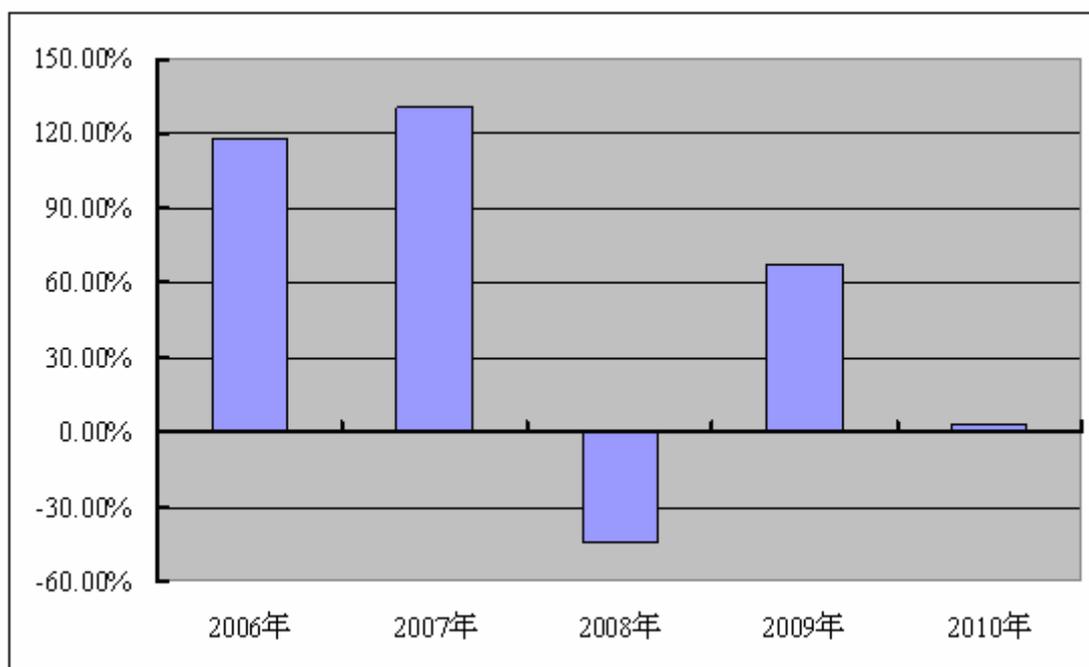


注：本基金未规定业绩比较基准。

### 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

华夏成长证券投资基金

过去五年净值增长率图



注：本基金未规定业绩比较基准。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	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
2010年	3.200	1,060,426,469.51	1,494,011,092.11	2,554,437,561.62	-
2009年	1.000	335,320,408.05	430,421,994.07	765,742,402.12	-
2008年	5.000	1,291,469,237.70	1,781,331,830.57	3,072,801,068.27	-
合计	9.200	2,687,216,115.26	3,705,764,916.75	6,392,981,032.01	-

## §4 管理人报告

### 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、南京和杭州设有分公司，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2010 年，在市场大幅震荡的情况下，华夏基金加强风险控制，坚持稳健的投资风格，主动管理的股票型基金与混合型基金根据自身投资目标及投资策略，谨慎运作，整体业绩表现良好；固定收益类基金持续创造正回报；指数型基金继续紧密跟踪标的指数。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在 2010 年基金分类排名中，华夏优势增长股票在 166 只标准股票型基金中排名第 3；华夏大盘精选混合在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 1；华夏策略混合在 40 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 1。2010 年华夏基金为投资人实现分红逾 275 亿元，累计分红已超过 700 亿元。

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，2010 年，华夏基金继续加强投资者教育与服务工作。公司广泛收集 800 多个基金投资常见问题，编著出版了《做一个理性的投资者——中国基金投资指南》一书，分发给投资者。公司继续举办各类巡回报告会以及理财讲座，在媒体开设投资者教育专栏，参展北京、上海等地金融博览会，向投资者提供理财咨询服务。

2010 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：2010 年 5 月，在《中国证券报》主办的“中国基

金业金牛奖”评选活动中，华夏基金荣获“2009 年年度金牛基金公司奖”；2010 年 6 月，在《上海证券报》主办的“第七届中国金基金奖”评选活动中，华夏基金荣获“2009 年度金基金·TOP 公司奖”。

在客户服务方面，2010 年，华夏基金继续以客户需求为导向，持续提高服务质量：举办多场客户见面会，加强与客户的沟通；根据客户建议，不断改进服务系统及业务规则。

在践行企业社会责任方面，青海省玉树县发生地震灾害后，华夏基金及全体员工通过华夏人慈善基金会向灾区捐款 100 余万元，华夏基金香港公司向中联办捐款专户捐赠港币 10 万元整，并于 10 月采购优质燃煤 200 吨捐赠给玉树灾区，用于保障 9 所学校、总计 11239 名学生和教职工的冬季取暖。2010 年 8 月，甘肃舟曲地区发生特大山洪泥石流灾害，华夏基金员工通过华夏人慈善基金会踊跃捐款，并组织志愿者亲赴甘肃舟曲灾区，为 8 个村、402 户、总计 1061 位灾民送上援助物资。此外，华夏人慈善基金会还组织实施了山西天镇唐八里村机井援建项目、贵州新塘小学助学项目等由华夏基金公司及其员工个人捐助的指定项目。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
童汀	本基金的基金经理	2010-01-16	-	9 年	中国人民银行总行研究生部经济学硕士。曾任南方基金管理有限公司基金经理助理、策略研究员、行业研究员。2007 年加入华夏基金管理有限公司，历任兴和证券投资基金基金经理（2007 年 4 月 18 日至 2009 年 1 月 1 日期间）、华夏复兴股票型证券投资基金基金经理（2007 年 9 月 10 日至 2009 年 1 月 1 日期间）。
巩怀志	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2005-10-29	2010-01-16	9 年	清华大学 MBA。曾任鹏华基金管理有限公司基金经理助理、社保股票组合基金经理。2005 年加入华夏基金管理有限公司，历任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 5 月 9 日至 2009

					年 1 月 1 日期间)。
--	--	--	--	--	---------------

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。

③根据本基金管理人于 2010 年 1 月 16 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》，聘任童汀先生为本基金基金经理，巩怀志先生不再担任本基金基金经理。

#### 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

##### 4.3.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年，受国内外政策与经济因素影响，A 股市场整体表现为震荡格局。年初在经济复苏预期下，周期股出现了阶段性的行情；4 月份以后，随着房地产调控新政的出台，投资者开始担心经济二次探底，市场大幅下挫；7 月份流动性偏紧的环境得到缓解，市场出现了一个估值修复的过程；10 月份，由于美国二次定量宽松，热钱流入趋势明显，周期股再次出现阶段性的行情；11 月份，随着 CPI 数据的发布，国内通胀率显著超出预期，投资者开始担心政府出台紧缩政策，市场迅速调整；之后，国家持续出台控制通胀的政策，中央经济工作会议对

2011 年货币政策的定调也重归“稳健”，市场进入盘整期。在结构上，A 股市场全年呈现明显的结构性分化特征，中小市值的成长性股票持续跑赢大市值周期性股票。在行业上，战略新兴产业、消费、医药、电子等代表经济转型方向的板块，以及供求关系较好的工程机械、煤炭等周期性行业表现良好，银行、地产、钢铁、石化等大盘蓝筹股表现一般。

报告期内，本基金维持均衡布局的策略，“自下而上”精选个股进行投资。年初，基金布局较为均衡，在 4 月中旬国家出台房地产紧缩政策后及时降低了组合仓位，减持了银行、地产、煤炭等强周期行业；7 月份在市场大幅下跌后逐步增加仓位，集中增持了一批估值合理的持续成长型股票；11 月份 CPI 超预期以后，再次大幅降低仓位，并在市场下跌到位后重点增持了高端装备制造业股票。总体而言，上述投资运作取得了一定的效果，但从全年来看，也存在一些不足，一是对全年大小盘风格分化的方向把握不够到位，年初周期性股票的配置仍然过重；二是 7 月份市场见底后增持力度不够大，没有更好地把握住这次绝对收益的机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.186 元，本报告期份额净值增长率为 3.56%，同期上证综指下跌 14.31%，深证成指下跌 9.06%。

#### 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 2011 年，我国仍然面临复杂的经济形势，如经济转型迫切，通胀压力加剧，房地产调控难度加大，国际经济复苏不确定等等。在这样的经济环境下，要实现国内经济较高的增长率，政府可能会继续维持积极的财政政策以及合理的信贷规模。同时，由于金融危机拯救政策的后续影响，以及国内经济所处发展阶段的特点，经济面临着资产价格和通胀的巨大压力，因此又需要对总量进行相对严格的控制，并大力推动经济结构调整，引导社会资源由资产领域进入能促进经济长期增长的新兴产业领域。

就股票市场而言，在房地产调控和通胀形势明朗之前，预计市场仍将呈现宽幅震荡的走势；如果通胀得到有效控制，市场可能产生系统性机会。另外，在国家持续出台的转型政策刺激下，受政策扶持的板块有望获得一定的超额收益。

本基金将继续坚持宏观判断和成长型投资相结合的投资理念，采取“远望”

和“守拙”的策略，从中国经济中长期发展的角度去寻找投资对象，争取获得长期稳健回报。具体来看，本基金将继续贯彻适度均衡配置和精选个股的策略，并重点关注以下三类投资机会：（1）战略新兴产业中的投资机会，2011年是“十二五”规划的开局之年，“十二五”的主题是转型，国家将配套出台一系列的财政税收政策予以支持，提高整体经济的生产效率，提升国家长期竞争力，未来在战略新兴产业中将涌现出一批具有较高技术水平，且业绩能够快速增长的公司；（2）周期性行业中的成长性投资机会，虽然周期性行业整体面临资产泡沫和通胀的双重压力，但中国经济总量的增速仍然较高，因此周期性行业中供求关系改善的行业和其中的优质企业有望保持较高的业绩增速；（3）积极关注其他具有长期增长潜力的行业中优质个股的投资机会，如消费、军工、农田水利、环保、商业、医药等。

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。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，重点加强了对基金投资交易的风险控制及合规检查。在监察稽核工作中加大了投资研究、销售等业务的合规培训和考试力度，针对投研人员多次开展合规培训，强化合规考试内容及频率，增强员工合规意识；同时加大了日常业务检查的范围及频率，及时开展了员工行为合规检查及对公司投研、营销、运作等业务的专项检查，促进了公司业务的合规运作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相

关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 2,554,437,561.62 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

安永华明（2011）审字第 60739337\_B02 号

华夏成长证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏成长证券投资基金财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表和 2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏成长证券投资基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所 注册会计师 徐艳 蒋燕华

北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

2011-03-18

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华夏成长证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,056,698,028.87	164,104,598.10
结算备付金		26,727,330.00	11,119,809.89
存出保证金		4,270,242.26	10,769,843.22
交易性金融资产		9,604,704,103.08	11,392,280,142.39
其中：股票投资		7,415,361,879.68	8,879,969,571.84
基金投资		-	-
债券投资		2,189,342,223.40	2,512,310,570.55
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		6,011,710.80	545,359,194.14
应收利息		21,637,942.00	22,755,952.58
应收股利		-	-
应收申购款		10,738,405.93	11,422,296.09
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		10,730,787,762.94	12,157,811,836.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	280,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,973,791.90	29,020,961.90
应付管理人报酬		13,434,114.55	15,253,198.93
应付托管费		2,239,019.08	2,542,199.81

应付销售服务费		-	-
应付交易费用		93,190,297.71	64,376,129.34
应交税费		2,773,127.11	2,555,127.51
应付利息		-	11,197.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,634,550.89	1,465,951.34
负债合计		121,244,901.24	395,224,766.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		8,946,552,582.16	7,967,056,716.67
未分配利润		1,662,990,279.54	3,795,530,353.41
所有者权益合计		10,609,542,861.70	11,762,587,070.08
负债和所有者权益总计		10,730,787,762.94	12,157,811,836.41

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.186 元，基金份额总额 8,946,552,582.16 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
<b>一、收入</b>		614,042,164.76	5,397,884,714.87
1.利息收入		96,896,771.57	62,783,455.35
其中：存款利息收入		8,803,578.39	4,449,051.13
债券利息收入		87,539,534.37	58,334,404.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		553,658.81	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		910,607,155.37	3,017,874,918.47
其中：股票投资收益		892,893,842.52	2,928,902,483.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-31,399,144.58	23,397,605.01
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	435,348.25
股利收益		49,112,457.43	65,139,481.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-397,944,671.15	2,307,702,096.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		4,482,908.97	9,524,244.87

减：二、费用		266,953,504.69	265,785,292.34
1.管理人报酬		163,723,953.91	161,611,370.98
2.托管费		27,287,325.76	26,935,228.49
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		71,601,069.14	73,117,265.24
5.利息支出		3,923,830.02	3,719,918.38
其中：卖出回购金融资产支出		3,923,830.02	3,719,918.38
6.其他费用		417,325.86	401,509.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		347,088,660.07	5,132,099,422.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		347,088,660.07	5,132,099,422.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,967,056,716.67	3,795,530,353.41	11,762,587,070.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	347,088,660.07	347,088,660.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	979,495,865.49	74,808,827.68	1,054,304,693.17
其中：1.基金申购款	3,763,458,874.55	873,563,988.01	4,637,022,862.56
2.基金赎回款	-2,783,963,009.06	-798,755,160.33	-3,582,718,169.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,554,437,561.62	-2,554,437,561.62
五、期末所有者权益（基金净值）	8,946,552,582.16	1,662,990,279.54	10,609,542,861.70
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,339,970,038.58	-417,496,990.99	6,922,473,047.59

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,132,099,422.53	5,132,099,422.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	627,086,678.09	-153,329,676.01	473,757,002.08
其中：1.基金申购款	6,161,088,265.01	1,929,570,432.73	8,090,658,697.74
2.基金赎回款	-5,534,001,586.92	-2,082,900,108.74	-7,616,901,695.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-765,742,402.12	-765,742,402.12
五、期末所有者权益（基金净值）	7,967,056,716.67	3,795,530,353.41	11,762,587,070.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

范勇宏                      崔雁巍                      崔雁巍  
 基金管理公司负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信建投证券有限责任公司(“中信建投证券”)	基金管理人股东原控股的公司、基金销售机构

注：①中信证券股份有限公司分别于 2010 年 11 月 17 日和 2010 年 12 月 24 日发布公告，

经中国证监会批准，已转让其持有的 53% 中信建投证券有限责任公司股权。

② 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总 额的比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
中信证券	2,323,557,591.42	4.91%	-	-

###### 7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总 额的比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例
中信证券	558,564,415.90	5.86%	-	-

###### 7.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
中信证券	1,975,015.97	5.25%	1,975,015.97	2.12%
中信建投证券	-	-	1,735,061.53	1.86%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
中信证券	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	1,735,061.53	2.70%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	163,723,953.91	161,611,370.98
其中：支付销售机构的客户维护费	18,557,437.75	14,392,381.56

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	27,287,325.76	26,935,228.49

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	130,244,044.47	-	-	-	999,200,000.00	527,594.96
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	34,864,059.65	1,389,127.98
期间申购/买入总份额	-	33,474,931.67
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	34,864,059.65	-
期末持有的基金份额	-	34,864,059.65
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.44%

注：①本基金管理人于本报告期经代销机构赎回本基金，适用费率为 0.5%。

②上年度可比期间“期间申购/买入总份额”包含申购和红利再投资所获得的基金份额，本基金管理人于上年度可比期间经代销机构申购本基金，执行优惠费率 0.6%。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,056,698,028.87	8,449,452.51	164,104,598.10	4,174,860.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	113002	工行转债	可转换公司债券公开发 行	1,109,160	110,916,000.00
中信证券	601166	兴业银行	配股发行	1,200,000	21,600,000.00
中信建投证券	601328	交通银行	配股发行	776,683	3,495,073.50
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-

#### 7.4.5 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	新发流通受限	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	-
600157	永泰能源	2010-07-15	2011-07-13	非公开发行流通受限	16.05	19.44	3,000,000	48,150,000.00	58,320,000.00	-

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末	复牌日期	复牌	数量(股)	期末成本	期末估值	备
----	----	----	----	----	------	----	-------	------	------	---

代码	名称	日期	原因	估值 单价		开盘 单价		总额	总额	注
000903	云内动力	2010-12-08	因重大不 确定事项 停牌	17.60	2011-01-07	18.80	5,999,881	77,571,275.90	105,597,905.60	-

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	7,415,361,879.68	69.10
	其中：股票	7,415,361,879.68	69.10
2	固定收益投资	2,189,342,223.40	20.40
	其中：债券	2,189,342,223.40	20.40
	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	1,083,425,358.87	10.10
6	其他各项资产	42,658,300.99	0.40
7	合计	10,730,787,762.94	100.00

### 8.2 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	74,937,538.75	0.71
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,714,296,043.99	44.43
C0	食品、饮料	717,013,388.64	6.76
C1	纺织、服装、皮毛	163,122,683.11	1.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	490,959,012.00	4.63
C5	电子	447,993,145.60	4.22
C6	金属、非金属	654,041,546.72	6.16
C7	机械、设备、仪表	2,158,151,195.78	20.34
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	83,015,072.14	0.78
D	电力、煤气及水的生产和供应业	94,236,427.64	0.89
E	建筑业	194,751,065.54	1.84
F	交通运输、仓储业	741,721,359.62	6.99
G	信息技术业	333,322,264.03	3.14
H	批发和零售贸易	474,291,250.22	4.47
I	金融、保险业	224,640,000.00	2.12
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	253,319,632.20	2.39
L	传播与文化产业	210,336,407.53	1.98
M	综合类	99,509,890.16	0.94
	合计	7,415,361,879.68	69.89

### 8.3 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	002008	大族激光	19,999,694	447,993,145.60	4.22
2	600887	伊利股份	10,938,854	418,520,554.04	3.94
3	000581	威孚高科	9,765,521	362,789,105.15	3.42
4	600221	海南航空	37,928,924	340,222,448.28	3.21
5	600125	铁龙物流	20,929,519	301,803,663.98	2.84

6	000876	新 希 望	14,247,868	298,492,834.60	2.81
7	601989	中国重工	24,006,902	283,041,374.58	2.67
8	601106	中国一重	41,999,811	249,478,877.34	2.35
9	000061	农 产 品	14,095,710	248,225,453.10	2.34
10	600498	烽火通信	5,859,525	242,349,954.00	2.28

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	538,149,128.52	4.58
2	600585	海螺水泥	511,658,096.03	4.35
3	002008	大族激光	444,533,703.99	3.78
4	600000	浦发银行	427,832,774.09	3.64
5	600221	海南航空	416,631,912.32	3.54
6	600489	中金黄金	384,084,673.83	3.27
7	000061	农 产 品	376,493,289.70	3.20
8	601766	中国南车	353,479,100.54	3.01
9	601166	兴业银行	325,600,682.01	2.77
10	601111	中国国航	315,706,091.99	2.68
11	600598	北 大 荒	308,213,770.93	2.62
12	600115	东方航空	282,174,393.19	2.40
13	601106	中国一重	276,827,273.35	2.35
14	601989	中国重工	268,336,952.57	2.28
15	000876	新 希 望	268,105,914.73	2.28
16	600546	山煤国际	266,860,152.42	2.27
17	000401	冀东水泥	258,371,413.09	2.20
18	000826	桑德环境	258,362,360.16	2.20
19	601009	南京银行	256,168,291.99	2.18
20	601398	工商银行	248,742,106.40	2.11

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	658,028,930.59	5.59
2	601328	交通银行	504,606,202.97	4.29
3	601398	工商银行	386,390,442.80	3.28
4	000423	东阿阿胶	385,012,816.53	3.27
5	600489	中金黄金	379,017,443.75	3.22
6	000858	五 粮 液	374,493,183.46	3.18
7	600000	浦发银行	367,423,533.31	3.12
8	600585	海螺水泥	364,028,191.98	3.09
9	601169	北京银行	350,467,420.01	2.98
10	601111	中国国航	348,667,024.83	2.96
11	600739	辽宁成大	335,246,292.44	2.85
12	600115	东方航空	327,368,751.41	2.78
13	600598	北 大 荒	315,766,865.45	2.68
14	000550	江铃汽车	302,816,119.68	2.57
15	600837	海通证券	290,158,843.33	2.47
16	600016	民生银行	278,323,812.55	2.37
17	601766	中国南车	276,498,390.19	2.35
18	601601	中国太保	266,231,709.87	2.26
19	600123	兰花科创	261,615,982.87	2.22
20	601009	南京银行	252,246,525.41	2.14
21	600546	山煤国际	252,132,268.38	2.14
22	600176	中国玻纤	243,256,676.42	2.07
23	601166	兴业银行	238,807,597.06	2.03
24	000422	湖北宜化	237,587,781.57	2.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	22,817,925,685.52
卖出股票的收入（成交）总额	24,847,564,994.72

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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	221,279,000.00	2.09
2	央行票据	417,419,000.00	3.93
3	金融债券	10,057,000.00	0.09
	其中：政策性金融债	10,057,000.00	0.09
4	企业债券	252,725,138.00	2.38
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,287,862,085.40	12.14
7	其他	-	-
8	合计	2,189,342,223.40	20.64

### 8.6 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	113002	工行转债	7,000,000	826,980,000.00	7.79
2	113001	中行转债	4,183,730	459,624,577.80	4.33
3	0801017	08 央行票据 17	1,700,000	170,204,000.00	1.60
4	1001021	10 央行票据 21	1,500,000	146,715,000.00	1.38
5	020033	10 贴债 07	1,100,000	108,394,000.00	1.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 8.8 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。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 2010 年 9 月 6 日大族激光受到深交所通报批评。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。

8.9.2 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。

### 8.9.3 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	4,270,242.26

2	应收证券清算款	6,011,710.80
3	应收股利	-
4	应收利息	21,637,942.00
5	应收申购款	10,738,405.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,658,300.99

#### 8.9.4 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	113001	中行转债	459,624,577.80	4.33

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
484,901	18,450.27	485,331,994.77	5.42%	8,461,220,587.39	94.58%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	3,816,098.27	0.04%

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2001 年 12 月 18 日)基金份额总额	3,236,830,105.93
本报告期期初基金份额总额	7,967,056,716.67
本报告期基金总申购份额	3,763,458,874.55
减: 本报告期基金总赎回份额	2,783,963,009.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,946,552,582.16

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2011 年 2 月 9 日，本基金托管人发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。2011 年 1 月 31 日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所的报酬为 100,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人收到中国证监会基金监管部《关于督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]17 号）、《关于进一步督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]166 号）、《关于进一步督促规范华夏基金管理公司股权的函》（基金部函[2010]448 号）及《关于进一步督促规范华夏基金

管理公司股权的函》(基金部函[2010]600 号), 督促本基金管理人股东所持华夏基金股权比例符合相关法律法规和监管要求。本基金管理人将按照中国证监会规定积极配合有关方面做好工作。本基金管理人已分别于 2010 年 1 月 16 日、2010 年 4 月 8 日、2010 年 7 月 20 日及 2010 年 10 月 13 日刊登有关临时公告。

本报告期内, 本基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受到任何处分。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券	1	9,958,293,174.13	21.05%	8,464,490.43	22.49%	-
长城证券	2	6,373,589,794.97	13.47%	5,256,984.18	13.97%	-
国泰君安证券	1	6,122,804,201.16	12.94%	4,974,820.85	13.22%	-
招商证券	2	6,056,332,880.22	12.80%	5,045,175.83	13.41%	-
国信证券	1	5,249,494,397.49	11.09%	4,462,039.61	11.86%	-
民族证券	1	2,885,144,980.76	6.10%	1,009,786.39	2.68%	-
中信证券	1	2,323,557,591.42	4.91%	1,975,015.97	5.25%	-
高华证券	1	2,007,137,865.43	4.24%	1,706,045.91	4.53%	-
华泰证券	1	1,741,888,799.98	3.68%	1,480,602.72	3.93%	-
信达证券	1	1,474,824,267.30	3.12%	1,198,304.76	3.18%	-
财富证券	1	1,008,529,985.92	2.13%	315,171.04	0.84%	-
中金公司	1	883,286,721.09	1.87%	717,679.86	1.91%	-
平安证券	1	447,203,824.35	0.95%	363,356.03	0.97%	-
华泰联合证券	1	431,397,281.81	0.91%	366,686.59	0.97%	-
海通证券	1	327,668,709.75	0.69%	278,515.27	0.74%	-
万联证券	1	25,841,787.36	0.05%	20,996.64	0.06%	-

注: ①为了贯彻中国证监会的有关规定, 我公司制定了选择券商的标准, 即:

i 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场

场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东莞证券、宏源证券、华创证券、上海证券、中国银河证券、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，财富证券、东莞证券、华创证券、民族证券、信达证券、招商证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，航天证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
申银万国证券	2,209,836,654.80	23.18%	5,430,000,000.00	60.33%
长城证券	222,187,407.10	2.33%	1,220,000,000.00	13.56%
国泰君安证券	326,519,535.61	3.43%	-	-
招商证券	1,956,084,051.80	20.52%	830,000,000.00	9.22%
国信证券	1,719,465,801.30	18.04%	370,000,000.00	4.11%
民族证券	689,434,788.20	7.23%	700,000,000.00	7.78%
中信证券	558,564,415.90	5.86%	-	-
高华证券	188,943,822.10	1.98%	200,000,000.00	2.22%
华泰证券	1,553,210,253.65	16.29%	-	-
平安证券	26,950,999.52	0.28%	-	-
华泰联合证券	-	-	150,000,000.00	1.67%
海通证券	39,686,436.70	0.42%	100,000,000.00	1.11%
万联证券	40,950,507.20	0.43%	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2010 年 1 月 29 日，中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任副行长。

2、2010 年 5 月 12 日，中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生辞去副行长的职务。

3、2010 年 6 月 21 日，中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

4、2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

5、2010 年 9 月 15 日，中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任监事长，谢渡扬先生辞去监事、监事长职务。

6、2010 年 11 月 2 日，中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

华夏基金管理有限公司

二〇一一年三月二十八日