

华夏沪深 300 指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要

2011 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：二〇一二年三月三十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 27 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，普华永道中天会计师事务所有限公司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 2011 年 1 月 1 日起至 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	华夏沪深 300 指数
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
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
报告期末基金份额总额	25,970,707,526.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798

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	2011 年	2010 年	2009 年 7 月 10 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-585,041,034.75	-214,373,937.73	-652,479,484.86
本期利润	-5,164,455,122.65	-2,859,647,829.71	236,210,112.65
加权平均基金份额本期利润	-0.2043	-0.1043	0.0089
本期基金份额净值增长率	-23.44%	-11.52%	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3240	-0.1168	-0.0234
期末基金资产净值	17,555,602,879.14	22,730,050,578.37	26,179,138,106.94
期末基金份额净值	0.676	0.883	0.998

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	-8.77%	1.34%	-8.42%	1.34%	-0.35%	0.00%
过去六个月	-21.94%	1.29%	-21.29%	1.29%	-0.65%	0.00%
过去一年	-23.44%	1.24%	-22.76%	1.23%	-0.68%	0.01%
自基金合同生效起至今	-32.40%	1.42%	-26.91%	1.53%	-5.49%	-0.11%

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

华夏沪深 300 指数证券投资基金

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

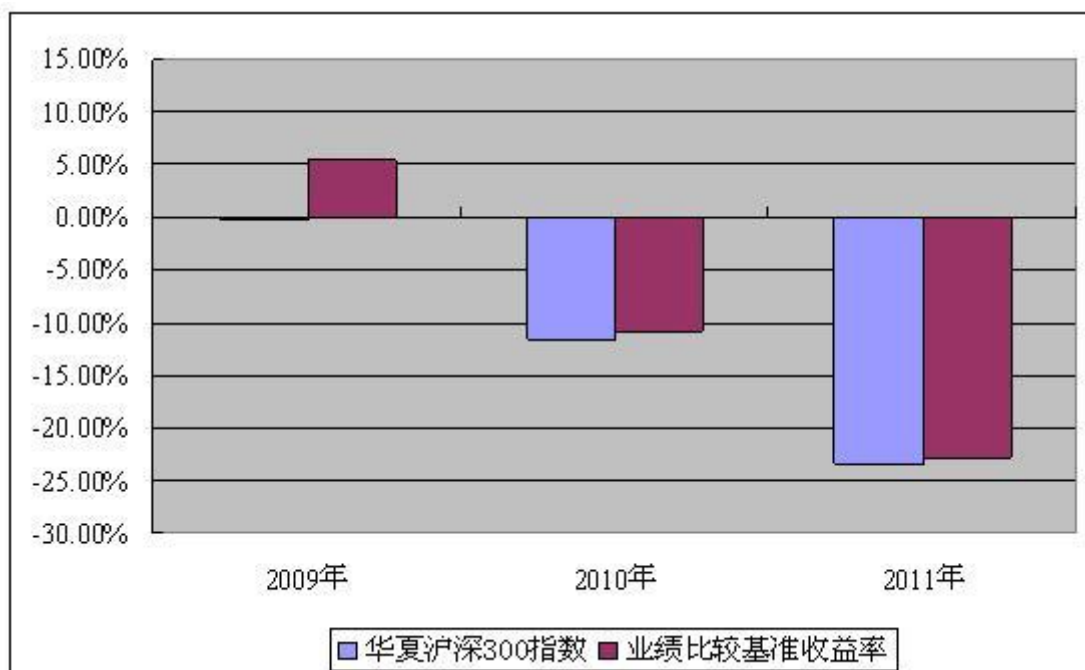
（2009 年 7 月 10 日至 2011 年 12 月 31 日）



3.2.3 自基金合同生效以来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

华夏沪深 300 指数证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2009 年 7 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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、杭州和广州设有分公司，在香港设有子公司。公司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、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，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。

2011 年，在市场持续下跌的情况下，华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础，高度重视风险管理，努力为投资人规避风险。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金年度分类排名中（截至 2011 年 12 月 30 日数据），华夏收入股票在 217 只标准股票型基金中排名第 5；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 4；华夏策略混合在 48 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 5；华夏兴和封闭及华夏兴华封闭在 25 只封闭式普通股票型基金中分别排名第 3 和第 4。

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，2011 年，华夏基金继续举办理财 365、理财直通车等巡回报告会以及理财讲座，主动向投资者提示风险，为投资者提供理财咨询服务。

2011 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：2011 年 3 月，在《证券时报》主办的“第七届中国基金业明星奖颁奖仪式暨中国明星基金论坛”中，华夏基金荣获“长期回报明星基金公司奖”；2011 年 4 月，在《上海证券报》主办的中国“金基金”奖颁奖典礼中，华夏基金第六次荣获“金基金 TOP 公司奖”；在《中国证券报》、中央电视台主办的“中国基金业金牛奖”评选活动中，华夏基金第六次荣获年度“金牛基金管理公司奖”。

在客户服务方面，2011 年，华夏基金继续以客户需求为导向，持续提高服务质量：恢复办理华夏收入等四只基金的转换业务；调整了在本公司进行登记结算基金的分红方式变更规则，使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金可以分别设置不同的分红方式；优化了网上交易定期定额功能，缩短了密码重置、银行卡变更、特殊退款等业务处理周期；推出了针对直销网上交易客户的赎回款划出短信提示等服务。

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		
张弘弢	本基金的基金经理	2009-07-10	-	11 年	硕士。2000 年 4 月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	本基金的基金经理	2009-07-10	-	12 年	硕士。1999 年 7 月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。

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 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

2011 年，国际方面，美国主权信用评级下调，欧洲债务危机持续恶化，日本遭遇福岛大地震，中东及北非局势动荡，主要经济体复苏缓慢。国内方面，经济运行总体平稳，但增速持续放缓，CPI 在 7 月份创下过去 37 个月新高后逐步回落；政府在前 3 季度将控制通货膨胀放在了更加重要的位置，采用利率、存款准备金率、汇率等多项政策回收流动性，并在房地产领域实施较为严厉的限购政策，之后，随着通货膨胀压力的回落，宏观政策虽有所微调，但总体基调未发生实质性改变；货币供应 M1、M2 增速持续下滑，实体经济流动性明显收紧，民间借贷利率显著上行；投资者从担忧通货膨胀逐渐转向担忧经济衰退及企业盈利下滑。受上述因素影响，A 股市场全年总体呈现震荡下跌走势，沪深 300 指数下跌了 25.01%。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，研究并认真应对成份股调整、限制投资股票替代投资等工作，努力为投资者带来更好的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.676 元，本报告期份额净值增长率为-23.44%，同期业绩比较基准增长率为-22.76%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.68%。

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 2012 年，国际方面，欧洲债务危机的演变，主要经济体的复苏情况仍存在着较大不确定性。国内宏观经济放缓趋势仍将持续，通货膨胀可能仍有反复，但压力相对较小。国内宏观政策可能会继续微调，“稳中求进”是 2012 年的主基调。

市场方面，如果国内宏观政策微调超过预期，且国内经济表现保持平稳，则目前处于历史较低估值水平的沪深 300 指数会出现系统性机会。反之，则会继续

保持震荡整理的走势。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好成份股研究和调整工作，并力争和业绩基准保持一致。

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。

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，本基金管理人在监察稽核工作中加大了对各项业务的合规培训和考试力度，针对投研人员组织了多次合规培训，提高了员工的风险意识与合规意识；进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化了对基金投资交易的风险控制及合规检查；加大对日常业务的检查范围及频率，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。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，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、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、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，估值工作决策机构的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

本基金本报告期未进行利润分配，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

2011 年，本基金托管人在对华夏沪深 300 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2011 年，华夏沪深 300 指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏沪深 300 指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 指数证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字（2012）第 20603 号

华夏沪深 300 指数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沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“华夏沪深 300 基金”）的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 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华夏沪深 300 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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管理层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，上述华夏沪深 300 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏沪深 300 基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪棣 单峰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2012-03-07

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款		154,136,893.75	111,629,073.46
结算备付金		4,056,584.45	10,940,031.22
存出保证金		1,122,396.83	1,128,134.11
交易性金融资产		17,403,999,818.88	22,542,446,098.50
其中：股票投资		16,664,832,291.98	21,394,793,947.60
基金投资		-	-
债券投资		739,167,526.90	1,147,652,150.90
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		22,736,411.32	91,110,061.56
应收利息		15,745,664.29	15,548,483.34
应收股利		-	-
应收申购款		4,689,821.30	31,312,640.96
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		17,606,487,590.82	22,804,114,523.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,838,562.29	15,285,995.87
应付管理人报酬		7,688,716.52	9,776,706.30
应付托管费		1,537,743.33	1,955,341.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		29,924,500.60	46,147,094.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		895,188.94	898,806.56
负债合计		50,884,711.68	74,063,944.78
所有者权益：			
实收基金		25,970,707,526.21	25,736,288,433.15
未分配利润		-8,415,104,647.07	-3,006,237,854.78
所有者权益合计		17,555,602,879.14	22,730,050,578.37
负债和所有者权益总计		17,606,487,590.82	22,804,114,523.15

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.676 元，基金份额总额 25,970,707,526.21 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
一、收入		-5,028,981,542.27	-2,693,034,711.08
1.利息收入		26,365,087.15	21,211,045.95
其中：存款利息收入		1,888,174.14	2,822,054.44
债券利息收入		24,476,913.01	18,355,655.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	33,335.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-478,867,330.44	-77,692,124.76
其中：股票投资收益		-706,916,878.22	-319,433,768.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-4,020,539.21	4,625,707.90
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		232,070,086.99	237,115,935.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-4,579,414,087.90	-2,645,273,891.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,934,788.92	8,720,259.71
减：二、费用		135,473,580.38	166,613,118.63
1.管理人报酬		105,287,485.32	118,846,108.77
2.托管费		21,057,497.11	23,769,221.66
3.销售服务费		-	-

4.交易费用		7,634,924.50	19,557,079.88
5.利息支出		1,090,407.53	4,025,229.43
其中：卖出回购金融资产支出		1,090,407.53	4,025,229.43
6.其他费用		403,265.92	415,478.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,164,455,122.65	-2,859,647,829.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,164,455,122.65	-2,859,647,829.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	25,736,288,433.15	-3,006,237,854.78	22,730,050,578.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,164,455,122.65	-5,164,455,122.65
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）	234,419,093.06	-244,411,669.64	-9,992,576.58
其中：1.基金申购款	6,006,888,116.90	-973,420,078.83	5,033,468,038.07
2.基金赎回款	-5,772,469,023.84	729,008,409.19	-5,043,460,614.65
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,970,707,526.21	-8,415,104,647.07	17,555,602,879.14
项目	上年度可比期间 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）	26,241,515,057.61	-62,376,950.67	26,179,138,106.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,859,647,829.71	-2,859,647,829.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-505,226,624.46	-84,213,074.40	-589,439,698.86

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	10,538,437,270.85	-1,173,103,297.54	9,365,333,973.31
2.基金赎回款	-11,043,663,895.31	1,088,890,223.14	-9,954,773,672.17
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,736,288,433.15	-3,006,237,854.78	22,730,050,578.37

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：

王东明 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
山东海丰国际航运集团有限公司	基金管理人的股东
无锡市国联发展（集团）有限公司	基金管理人的股东
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
中信证券（浙江）有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2011 年 12 月 24 日发布的公告，经中国证监会核准，华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司（出资比例 49%）、南方工业

资产管理有限责任公司（出资比例 11%）、山东省农村经济开发投资公司（出资比例 10%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例 10%）、山东海丰国际航运集团有限公司（出资比例 10%）、无锡市国联发展（集团）有限公司（出资比例 10%）。

②中信金通证券有限责任公司于 2011 年 12 月 28 日发布公告，经中国证监会浙江监管局批复核准，其公司名称变更为“中信证券（浙江）有限责任公司”。

③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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	-	-	1,573,038,638.35	10.16%

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

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债券交易。

7.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	150,000,000.00	1.95%

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 2011年1月1日至2011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	-	-	1,337,080.04	4.47%
关联方名称	上年度可比期间			

	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	1,337,080.04	16.49%	1,337,080.04	2.90%

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 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	105,287,485.32	118,846,108.77
其中：支付销售机构的客户维护费	27,640,970.74	34,504,266.39

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 0.5% 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 × 0.5% / 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 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,057,497.11	23,769,221.66

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 0.1% 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 × 0.1% / 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
中国工商银行	-	-	-	-	545,200,000.00	193,919.13

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	82,190,022.96
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	82,190,022.96
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金管理人于上年度可比期间经代销机构赎回本基金，其中持有期满一年的，适用费率为 0%，持有期未满一年的，适用费率为 0.5%。

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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
中国工商银行	154,136,893.75	1,770,163.31	111,629,073.46	2,678,613.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	601336	新华保险	新股发行	52,464	1,219,788.00
中信证券	601558	华锐风电	新股发行	2,000	180,000.00
中信证券	125089	深机转债	可转换公司 债券公开发 行	13,410	1,341,000.00
上年度可比期间 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	601166	兴业银行	配股发行	3,407,646	61,337,628.00
中信证券	601939	建设银行	配股发行	6,020,000	22,695,400.00
中信证券	601009	南京银行	配股发行	1,762,500	14,752,125.00
中信证券	600036	招商银行	配股发行	6,370,000	56,374,500.00

7.4.5 期末（2011 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
000776	广发证券	2011-08-25	2012-08-26	非公 开发 行流 通受 限	26.91	21.00	6,000,000	161,460,000.00	126,000,000.00	-
601028	玉龙股份	2011-10-31	2012-02-07	新发	10.80	8.43	1,187,675	12,826,890.00	10,012,100.25	-

				流通受限						
601928	凤凰传媒	2011-11-24	2012-02-29	新发流通受限	8.80	8.36	997,300	8,776,240.00	8,337,428.00	-
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	新发流通受限	23.25	27.87	52,464	1,219,788.00	1,462,171.68	-
002650	加加食品	2011-12-28	2012-01-06	新发流通受限	30.00	30.00	1,500	45,000.00	45,000.00	-
002651	利君股份	2011-12-28	2012-01-06	新发流通受限	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	-

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000768	西飞国际	2011-12-28	中国证监会并购重组委审核公司重大资产重组事项	7.26	2012-01-04	7.61	4,386,000	63,870,822.81	31,842,360.00	-
600132	重庆啤酒	2011-12-23	乙肝疫苗项目统计分析结果初稿待审阅	28.45	2012-01-10	25.61	894,000	22,789,605.89	25,434,300.00	-

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 2011 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 2011 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

7.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以或相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2 各层级金融工具公允价值

截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为 16,756,135,818.88 元，第二层级的余额为 647,864,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2010 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 21,877,358,098.50 元，第二层级的余额为 665,088,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

7.4.6.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于复牌并恢复市价估值之日起从第二层级或第三层级转入第一层级。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层级转入第一层级。

7.4.6.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金本期净转入/(转出)第三层级 0 元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动 0 元(2010 年度：无)，涉及河南双汇投资发展股份有限公司(“双汇发展”)发行的股票。

§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	16,664,832,291.98	94.65
	其中：股票	16,664,832,291.98	94.65
2	固定收益投资	739,167,526.90	4.20
	其中：债券	739,167,526.90	4.20
	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	158,193,478.20	0.90
6	其他各项资产	44,294,293.74	0.25
7	合计	17,606,487,590.82	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	129,673,832.72	0.74
B	采掘业	1,850,964,352.64	10.54
C	制造业	5,846,532,402.19	33.30
C0	食品、饮料	1,229,616,816.02	7.00
C1	纺织、服装、皮毛	78,908,174.87	0.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	332,893,837.88	1.90
C5	电子	160,485,700.45	0.91
C6	金属、非金属	1,284,281,039.12	7.32
C7	机械、设备、仪表	2,011,524,197.14	11.46
C8	医药、生物制品	741,593,782.71	4.22
C99	其他制造业	7,228,854.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	404,982,696.23	2.31

E	建筑业	453,528,151.22	2.58
F	交通运输、仓储业	554,829,030.42	3.16
G	信息技术业	578,395,947.18	3.29
H	批发和零售贸易	469,600,155.44	2.67
I	金融、保险业	4,972,364,462.33	28.32
J	房地产业	869,473,710.30	4.95
K	社会服务业	132,840,105.72	0.76
L	传播与文化产业	53,121,858.80	0.30
M	综合类	348,525,586.79	1.99
	合计	16,664,832,291.98	94.93

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	600036	招商银行	45,687,334	542,308,654.58	3.09
2	600016	民生银行	84,812,900	499,547,981.00	2.85
3	601328	交通银行	99,420,100	445,402,048.00	2.54
4	600837	海通证券	57,607,500	426,871,575.00	2.43
5	601318	中国平安	12,323,800	424,431,672.00	2.42
6	600000	浦发银行	48,594,477	412,567,109.73	2.35
7	601166	兴业银行	32,381,496	405,416,329.92	2.31
8	601088	中国神华	12,269,954	310,797,934.82	1.77
9	600519	贵州茅台	1,493,667	288,725,831.10	1.64
10	000002	万科 A	34,910,000	260,777,700.00	1.49

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	600481	双良节能	287,983,768.13	1.27
2	000776	广发证券	216,739,511.25	0.95
3	600837	海通证券	182,849,045.19	0.80
4	601988	中国银行	104,988,187.87	0.46

5	600881	亚泰集团	96,851,077.47	0.43
6	601288	农业银行	83,101,744.44	0.37
7	000630	铜陵有色	78,587,415.26	0.35
8	601166	兴业银行	76,170,813.76	0.34
9	600585	海螺水泥	75,185,116.25	0.33
10	002304	洋河股份	74,907,329.08	0.33
11	600000	浦发银行	72,629,194.52	0.32
12	600406	国电南瑞	71,718,012.28	0.32
13	002073	软控股份	68,695,540.41	0.30
14	601101	昊华能源	68,680,769.85	0.30
15	600115	东方航空	65,594,758.04	0.29
16	600887	伊利股份	64,719,008.72	0.28
17	600276	恒瑞医药	61,661,744.33	0.27
18	600703	三安光电	59,341,620.58	0.26
19	000157	中联重科	58,103,063.00	0.26
20	601318	中国平安	53,675,291.37	0.24

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	601939	建设银行	316,452,923.70	1.39
2	600016	民生银行	135,454,232.45	0.60
3	600481	双良节能	104,394,229.81	0.46
4	601318	中国平安	101,394,260.54	0.45
5	600036	招商银行	80,799,713.43	0.36
6	600018	上港集团	76,818,057.95	0.34
7	601166	兴业银行	68,402,560.14	0.30
8	600631	百联股份	65,608,270.36	0.29
9	000776	广发证券	62,093,912.62	0.27
10	600585	海螺水泥	62,065,490.02	0.27
11	601088	中国神华	60,927,835.70	0.27
12	600837	海通证券	58,261,979.26	0.26
13	600196	复星医药	55,688,394.32	0.24

14	601328	交通银行	51,534,000.00	0.23
15	601601	中国太保	48,557,139.30	0.21
16	000002	万科 A	47,415,417.06	0.21
17	601006	大秦铁路	41,569,665.18	0.18
18	600881	亚泰集团	39,556,262.62	0.17
19	000709	河北钢铁	38,896,847.04	0.17
20	000001	深发展 A	37,181,765.70	0.16

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	5,696,568,420.04
卖出股票的收入（成交）总额	5,151,494,749.83

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	200,270,000.00	1.14
2	央行票据	242,050,000.00	1.38
3	金融债券	279,814,000.00	1.59
	其中：政策性金融债	279,814,000.00	1.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	17,033,526.90	0.10
8	其他	-	-
9	合计	739,167,526.90	4.21

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	1101018	11 央行票据 18	2,500,000	242,050,000.00	1.38
2	110414	11 农发 14	1,000,000	100,310,000.00	0.57

3	019101	11 国债 01	1,000,000	100,190,000.00	0.57
4	019109	11 国债 09	1,000,000	100,080,000.00	0.57
5	090405	09 农发 05	1,000,000	99,560,000.00	0.57

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 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。

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	1,122,396.83
2	应收证券清算款	22,736,411.32
3	应收股利	-
4	应收利息	15,745,664.29
5	应收申购款	4,689,821.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,294,293.74

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	6,620,600.00	0.04

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
628,061	41,350.61	1,327,284,958.20	5.11%	24,643,422,568.01	94.89%

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	10,278,154.38	0.04%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年7月10日)基金份额总额	24,771,957,170.09
本报告期期初基金份额总额	25,736,288,433.15
本报告期基金总申购份额	6,006,888,116.90
减：本报告期基金总赎回份额	5,772,469,023.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,970,707,526.21

§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

本基金管理人于 2011 年 9 月 24 日发布公告，聘任刘文动先生、吴志军先生为华夏基金管理有限公司副总经理。

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。

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普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 120,000 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

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

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	
海通证券	1	5,140,914,986.70	49.24%	257,036.13	61.24%	-
中银国际证券	1	2,726,860,305.33	26.12%	34,087.42	8.12%	-
国金证券	1	2,308,665,027.31	22.11%	115,430.72	27.50%	-
华泰联合证券	1	263,498,232.35	2.52%	13,174.29	3.14%	-

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，本基金还选择了光大证券、广发证券、中投证券、中信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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
海通证券	233,188,893.60	53.80%	1,670,000,000.00	34.25%
中银国际证券	4,443,525.58	1.03%	-	-
国金证券	195,808,645.60	45.18%	2,710,000,000.00	55.57%
华泰联合证券	-	-	496,600,000.00	10.18%

华夏基金管理有限公司

二〇一二年三月三十日