

# 华夏红利混合型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 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：二〇一二年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 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.....	45
7.8 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.....	45
7.9 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏红利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏红利混合	
基金主代码	002011	
交易代码	002011	002012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年6月30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	12,763,381,621.40份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期增值。
投资策略	在资产配置层面，本基金将采取积极的资产配置策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、债券和现金上的配置比例。在个股层面，基金主要选择具备良好现金分红能力且财务健康、具备长期增长潜力、市场估值合理的上市公司进行投资。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数，债券投资的业绩比较基准为富时中国国债指数。基准收益率=富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+富时中国国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。本基金主要投资于红利股，属于中等风险的证券投资基金品种。

### 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	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	王东明	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 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	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-763,731,039.41
本期利润	616,260,602.17
加权平均基金份额本期利润	0.0485
本期加权平均净值利润率	3.37%
本期基金份额净值增长率	3.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-417,813,897.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0327
期末基金资产净值	18,050,441,635.79
期末基金份额净值	1.414
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	437.93%

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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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
过去一个月	-4.91%	0.93%	-3.97%	0.57%	-0.94%	0.36%
过去三个月	1.22%	0.94%	-1.08%	0.57%	2.30%	0.37%
过去六个月	3.59%	1.18%	1.63%	0.70%	1.96%	0.48%
过去一年	-16.06%	1.17%	-8.98%	0.73%	-7.08%	0.44%
过去三年	-4.43%	1.35%	0.89%	0.95%	-5.32%	0.40%
自基金合同生效起至今	437.93%	1.50%	167.95%	1.26%	269.98%	0.24%

#### 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

华夏红利混合型证券投资基金

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

(2005 年 6 月 30 日至 2012 年 6 月 30 日)



## §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，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 年上半年，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，同时积极把握投资机会，旗下大部分主动管理的股票型、混合型基金表现优于市场平均水平，债券型基金全部取得正收益。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告（截至 2012 年 6 月 29 日数据），今年以来，华夏盛世股票、华夏成长混合等 9 只基金净值增长率超过了 5%。

2012 年 3 月，在《中国证券报》主办的“第九届中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金第七次荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获 6 个单项奖；在《证券时报》主办的“2011 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金第四次荣获“年度十大明星基金公司奖”，并获得评委会特别颁发的“五年持续回报明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 5 个单项奖。2012 年 4 月，在《上海证券报》主办的第九届中国“金基金”评选中，华夏基金第七次荣获年度“金基金·TOP 公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖。在上述评奖中，华夏基金均为获奖最多的基金公司。

#### 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		
谭琦	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-01-01	-	9 年	工学硕士。2003 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 9 月 27 日至 2009 年 1 月 1 日期间）等。

赵航	本基金的 基金经理	2011-01-18	-	15 年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券公司资产管理中心投资经理、长城证券公司投资银行部项目经理、鹏华基金管理有限公司原普华证券投资基金基金经理（2003 年 4 月 10 日至 2005 年 5 月 21 日期间）、原中信基金中信红利精选股票型证券投资基金基金经理（2008 年 5 月 19 日至 2009 年 4 月 18 日期间）等。2009 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2009 年 8 月 7 日至 2011 年 11 月 7 日期间）等。
严鸿宴	本基金的 基金经理	2011-11-07	-	11 年	北京大学管理学硕士。曾任中国工商银行总行计划财务部主任科员，大鹏证券有限责任公司研究员，渤海证券有限责任公司投资经理，上汽集团财务公司投资部经理等。2008 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理（2010 年 2 月 4 日至 2011 年 11 月 7 日期间）、机构投资经理等。

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合规守信情况的说明



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 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，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 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

2012 年上半年，中国经济经历了从企稳到继续回落的过程，通胀压力得到缓解，资金价格有所下降。市场方面，部分周期性行业前期走势强劲，医药、食品等消费类个股表现较好，而业绩低于预期的个股则持续跑输市场。

本基金在 1 季度积极投资于地产、家电、非银行金融等行业，在 2 季度增持了医药、电力等行业，但由于对高成长消费类个股和部分表现较好的周期股配置比例较低，基金整体业绩受到拖累。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.414 元，本报告期份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准增长率为 1.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济的波动周期较为明确，经济处于“减速—企稳”交替出现的阶段，投资者的信心修复有待时机。市场方面，部分成长性板块的景气持续

性需要进一步检验。

在当前的市场条件下如何为持有人积累投资价值，是我们重点关注和思考的问题。我们认为，投资策略要适应市场条件，且应该经得起时间考验，为此，我们要积极做好两方面工作：第一，充分考虑各种投资类型，减少投资盲点；第二，在第一点的基础上，把握符合未来经济特征的投资机会，突出重点。

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,083,157,855.05	1,831,686,667.08
结算备付金		8,277,255.87	23,166,782.79
存出保证金		6,886,130.78	4,906,966.46
交易性金融资产	6.4.7.2	16,619,041,470.01	15,293,115,032.62
其中：股票投资		14,731,276,980.80	13,765,240,849.37
基金投资		-	-
债券投资		1,887,764,489.21	1,527,874,183.25
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	400,000,700.00	50,000,195.00
应收证券清算款		60,760,000.00	17,913,109.29
应收利息	6.4.7.5	22,494,467.32	16,048,603.00
应收股利		17,715,804.69	-
应收申购款		11,332,539.38	1,858,405.88
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,229,666,223.10	17,238,695,762.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011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		-	-
应付证券清算款		66,527,263.25	22,494,411.52
应付赎回款		12,888,460.72	6,914,200.53
应付管理人报酬		22,726,607.48	22,869,269.03
应付托管费		3,787,767.92	3,811,544.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	71,218,243.88	194,527,371.88
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,826,668.46	1,383,556.91
负债合计		179,224,587.31	252,249,930.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,763,381,621.40	12,440,689,053.94
未分配利润	6.4.7.10	5,287,060,014.39	4,545,756,777.86
所有者权益合计		18,050,441,635.79	16,986,445,831.80
负债和所有者权益总计		18,229,666,223.10	17,238,695,762.12

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.414 元，基金份额总额 12,763,381,621.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
一、收入		802,168,579.50	-639,846,259.89

1.利息收入		27,134,898.55	24,195,939.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,872,542.59	7,409,823.95
债券利息收入		18,573,708.46	14,376,239.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,688,647.50	2,409,875.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-606,216,937.03	1,015,223,242.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-745,480,062.57	915,652,984.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,634,318.10	-636,894.73
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	132,628,807.44	100,207,152.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,379,991,641.58	-1,681,808,373.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,258,976.40	2,542,931.09
<b>减：二、费用</b>		185,907,977.33	227,222,231.66
1.管理人报酬		136,059,366.81	156,956,941.80
2.托管费		22,676,561.10	26,159,490.30
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	26,688,625.22	42,985,374.75
5.利息支出		263,309.84	907,910.53
其中：卖出回购金融资产支出		263,309.84	907,910.53
6.其他费用	6.4.7.19	220,114.36	212,514.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		616,260,602.17	-867,068,491.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		616,260,602.17	-867,068,491.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	12,440,689,053.94	4,545,756,777.86	16,986,445,831.80

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	616,260,602.17	616,260,602.17
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）	322,692,567.46	125,042,634.36	447,735,201.82
其中：1.基金申购款	1,015,665,089.30	439,128,611.39	1,454,793,700.69
2.基金赎回款	-692,972,521.84	-314,085,977.03	-1,007,058,498.87
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）	12,763,381,621.40	5,287,060,014.39	18,050,441,635.79
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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）	11,042,962,218.67	10,489,907,638.63	21,532,869,857.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-867,068,491.55	-867,068,491.55
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）	73,374,809.01	37,550,219.78	110,925,028.79
其中：1.基金申购款	1,126,401,844.80	1,018,689,981.93	2,145,091,826.73
2.基金赎回款	-1,053,027,035.79	-981,139,762.15	-2,034,166,797.94
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）	11,116,337,027.68	9,660,389,366.86	20,776,726,394.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏红利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理

委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]68 号文《关于同意华夏红利混合型开放式证券投资基金投资募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 769,853,399.75 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（05）第 010 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 770,195,182.55 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金报告期所采用的会计政策、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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。其中，对基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。
- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- 5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	1,083,157,855.05



定期存款	-
其他存款	-
合计	1,083,157,855.05

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,834,980,291.24	14,731,276,980.80	-2,103,703,310.44
债券	交易所市场	687,092,720.48	704,191,489.21	17,098,768.73
	银行间市场	1,177,950,876.09	1,183,573,000.00	5,622,123.91
	合计	1,865,043,596.57	1,887,764,489.21	22,720,892.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		18,700,023,887.81	16,619,041,470.01	-2,080,982,417.80

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	400,000,700.00	-
合计	400,000,700.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	310,598.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	3,769.70
应收债券利息	22,074,871.99
应收买入返售证券利息	105,226.94
应收申购款利息	-
其他	-
合计	22,494,467.32

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	71,211,119.68
银行间市场应付交易费用	7,124.20
合计	71,218,243.88

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	48,597.74
预提费用	278,070.72
合计	1,826,668.46

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,440,689,053.94	12,440,689,053.94
本期申购	1,015,665,089.30	1,015,665,089.30
本期赎回（以“-”号填列）	-692,972,521.84	-692,972,521.84
本期末	12,763,381,621.40	12,763,381,621.40

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	346,469,152.14	4,199,287,625.72	4,545,756,777.86
本期利润	-763,731,039.41	1,379,991,641.58	616,260,602.17
本期基金份额交易产生的变动数	-552,010.67	125,594,645.03	125,042,634.36
其中：基金申购款	-15,682,088.09	454,810,699.48	439,128,611.39
基金赎回款	15,130,077.42	-329,216,054.45	-314,085,977.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-417,813,897.94	5,704,873,912.33	5,287,060,014.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,697,826.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	173,117.32
其他	1,599.08
合计	5,872,542.59

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,707,922,176.93
减：卖出股票成本总额	9,453,402,239.50
买卖股票差价收入	-745,480,062.57

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	806,029,117.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	787,411,170.51
减：应收利息总额	11,983,628.78
债券投资收益	6,634,318.10

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	132,628,807.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	132,628,807.44

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,379,991,641.58
——股票投资	1,363,708,531.50
——债券投资	16,283,110.08
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,379,991,641.58

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,258,976.40
合计	1,258,976.40

注：本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	26,685,500.22
银行间市场交易费用	3,125.00
合计	26,688,625.22

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	119,344.68
银行费用	32,643.64
银行间账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	220,114.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	2,282,005,406.67	13.04%	3,737,006,096.64	13.23%

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	761,947.08	1.11%	-	-

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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 总量的比例
中信证券	1,854,151.98	12.66%	1,866,151.98	2.62%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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 总量的比例
中信证券	3,036,344.69	12.87%	26,805,392.39	11.99%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	136,059,366.81	156,956,941.80
其中：支付销售机构的客户维护费	21,678,403.57	24,138,395.92

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,676,561.10	26,159,490.30

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	-	1,466,514.94
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	-	1,466,514.94
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：本基金管理人于本上年度可比区间经代销机构赎回本基金，适用费率为 0.5%。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	1,083,157,855.05	5,697,826.19	1,021,502,330.27	7,208,025.47

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600863	内蒙华电	2012-03-21	2013-03-19	非公开发行流通受限	7.76	7.80	12,000,000	93,120,000.00	93,600,000.00	-
000562	宏源证券	2012-06-28	2013-06-29	非公开发行流通受限	13.22	13.25	12,000,000	158,640,000.00	159,000,000.00	-
000776	广发证券	2011-08-25	2012-08-27	非公开	26.91	29.35	500,000	13,455,000.00	14,675,000.00	-



				发行流 通受限						
002167	东方锆业	2011-06-30	2012-07-02	非公开 发行流 通受限	30.06	18.92	2,000,000	60,120,000.00	37,840,000.00	-
002167	东方锆业	-	2012-07-02	非公开 发行转 增	-	18.92	2,000,000	-	37,840,000.00	-

注：本基金持有的非公开发行股票东方锆业，于 2012 年 6 月 5 日实施 2011 年度利润分配、转增股本方案，向全体股东按每 10 股派送现金人民币 1.00 元（含税），同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股，本基金新增 2,000,000 股。

#### 6.4.12.2 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
000059	辽通化工	2012-06-26	拟议 非公开发 行股票	7.91	2012-07-03	8.15	146,963	1,214,790.77	1,162,477.33	-
600499	科达机电	2012-06-20	证监会并 购重组委 审核公司 发行股份 购买资产 事项	10.28	2012-07-02	10.11	4,744,932	63,259,616.52	48,777,900.96	-
600780	通宝能源	2012-01-18	筹划战略 重组重大 事项	6.70	-	-	2,003,010	13,258,325.67	13,420,167.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律监察部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,083,157,855.05	-	-	1,083,157,855.05
结算备付金	8,277,255.87	-	-	8,277,255.87
权证保证金	-	-	-	-
债券投资	1,310,604,489.21	-	577,160,000.00	1,887,764,489.21
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	400,000,700.00	-	-	400,000,700.00
应收直销申购款	741,502.75	-	-	741,502.75
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,831,686,667.08	-	-	1,831,686,667.08
结算备付金	23,166,782.79	-	-	23,166,782.79
权证保证金	140,741.00	-	-	140,741.00
债券投资	1,527,874,183.25	-	-	1,527,874,183.25
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	50,000,195.00	-	-	50,000,195.00
应收直销申购款	49,598.60	-	-	49,598.60
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		(2012 年 6 月 30 日)	(2011 年 12 月 31 日)
	利率下降 25 个基点	16,990,804.82	6,738,129.02
	利率上升 25 个基点	-16,655,765.56	-6,659,799.69

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	14,731,276,980.80	81.61	13,765,240,849.37	81.04
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	14,731,276,980.80	81.61	13,765,240,849.37	81.04

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的 变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	+5%	761,091,425.21	698,998,930.33
	-5%	-761,091,425.21	-698,998,930.33

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至 2012 年 6 月 30 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 15,092,513,470.01 元，第二层级的余额为 1,526,528,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2011 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 14,836,145,832.62 元，第二层级的余额为 456,969,200.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

#### 6.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

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。

#### 6.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	14,731,276,980.80	80.81
	其中：股票	14,731,276,980.80	80.81
2	固定收益投资	1,887,764,489.21	10.36
	其中：债券	1,887,764,489.21	10.36
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,000,700.00	2.19
	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	1,091,435,110.92	5.99
6	其他各项资产	119,188,942.17	0.65
7	合计	18,229,666,223.10	100.00

## 7.2 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	39,573,537.22	0.22
B	采掘业	532,936,279.62	2.95
C	制造业	5,509,159,378.07	30.52
C0	食品、饮料	770,970,344.14	4.27
C1	纺织、服装、皮毛	87,539,494.07	0.48
C2	木材、家具	17,871,066.60	0.10
C3	造纸、印刷	41,436,976.67	0.23
C4	石油、化学、塑胶、塑料	574,094,171.47	3.18
C5	电子	92,480,135.55	0.51
C6	金属、非金属	562,994,355.79	3.12
C7	机械、设备、仪表	2,060,234,793.07	11.41
C8	医药、生物制品	1,294,243,333.07	7.17
C99	其他制造业	7,294,707.64	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	787,960,745.61	4.37
E	建筑业	327,515,247.69	1.81
F	交通运输、仓储业	627,644,298.47	3.48
G	信息技术业	530,781,189.06	2.94
H	批发和零售贸易	1,343,546,251.39	7.44
I	金融、保险业	2,768,815,586.39	15.34
J	房地产业	1,305,202,332.38	7.23

K	社会服务业	85,087,597.16	0.47
L	传播与文化产业	227,815,708.76	1.26
M	综合类	645,238,828.98	3.57
	合计	14,731,276,980.80	81.61

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	9,592,182	438,746,404.68	2.43
2	601398	工商银行	77,838,405	307,461,699.75	1.70
3	600582	天地科技	18,131,560	262,001,042.00	1.45
4	601006	大秦铁路	35,517,874	249,690,654.22	1.38
5	600050	中国联通	64,684,261	240,625,450.92	1.33
6	600750	江中药业	7,974,022	222,554,954.02	1.23
7	600036	招商银行	18,424,984	201,200,825.28	1.11
8	601688	华泰证券	18,650,969	195,835,174.50	1.08
9	601669	中国水电	43,243,592	188,974,497.04	1.05
10	600239	云南城投	21,998,020	186,763,189.80	1.03
11	600895	张江高科	21,720,753	186,146,853.21	1.03
12	600616	金枫酒业	13,009,539	185,385,930.75	1.03
13	601166	兴业银行	14,246,221	184,915,948.58	1.02
14	000527	美的电器	15,430,855	170,510,947.75	0.94
15	600739	辽宁成大	10,829,695	168,943,242.00	0.94
16	600048	保利地产	14,120,192	160,122,977.28	0.89
17	000562	宏源证券	12,000,000	159,000,000.00	0.88
18	600998	九州通	11,642,790	155,780,530.20	0.86
19	600016	民生银行	25,607,619	153,389,637.81	0.85
20	600505	西昌电力	16,485,285	149,521,534.95	0.83
21	000776	广发证券	4,812,712	143,323,198.96	0.79
22	600837	海通证券	14,496,528	139,601,564.64	0.77
23	600028	中国石化	22,125,522	139,390,788.60	0.77
24	600251	冠农股份	7,260,241	135,984,313.93	0.75
25	600887	伊利股份	6,581,315	135,443,462.70	0.75
26	601333	广深铁路	44,508,944	130,856,295.36	0.72
27	600000	浦发银行	16,039,931	130,404,639.03	0.72
28	000400	许继电气	7,763,151	121,648,576.17	0.67
29	000629	攀钢钒钛	18,297,230	120,395,773.40	0.67

30	600267	海正药业	6,838,218	119,532,050.64	0.66
31	000989	九芝堂	7,267,017	117,725,675.40	0.65
32	002167	东方锆业	6,150,428	116,366,097.76	0.64
33	002219	独一味	8,624,943	115,746,735.06	0.64
34	600266	北京城建	7,387,937	112,222,763.03	0.62
35	002024	苏宁电器	13,033,281	109,349,227.59	0.61
36	600642	申能股份	23,374,739	107,757,546.79	0.60
37	600287	江苏舜天	15,637,735	106,805,730.05	0.59
38	600635	大众公用	22,741,547	105,975,609.02	0.59
39	600376	首开股份	7,787,214	103,102,713.36	0.57
40	600056	中国医药	4,668,676	102,477,438.20	0.57
41	600783	鲁信创投	6,232,831	99,475,982.76	0.55
42	601328	交通银行	20,828,075	94,559,460.50	0.52
43	601601	中国太保	4,258,707	94,458,121.26	0.52
44	600863	内蒙华电	12,000,000	93,600,000.00	0.52
45	000800	一汽轿车	8,567,663	93,044,820.18	0.52
46	002146	荣盛发展	8,496,804	92,615,163.60	0.51
47	000783	长江证券	10,000,000	91,000,000.00	0.50
48	000009	中国宝安	9,000,000	90,000,000.00	0.50
49	600867	通化东宝	11,387,143	88,705,843.97	0.49
50	000002	万科 A	9,580,057	85,358,307.87	0.47
51	600153	建发股份	11,737,685	84,041,824.60	0.47
52	000537	广宇发展	11,415,125	82,074,748.75	0.45
53	300072	三聚环保	7,173,464	74,245,352.40	0.41
54	600823	世茂股份	6,752,169	74,138,815.62	0.41
55	000926	福星股份	7,932,947	74,093,724.98	0.41
56	600510	黑牡丹	10,166,136	73,704,486.00	0.41
57	600578	京能热电	9,200,097	73,692,776.97	0.41
58	000061	农产品	12,705,143	73,689,829.40	0.41
59	000915	山大华特	4,828,352	73,342,666.88	0.41
60	002122	天马股份	11,319,868	73,126,347.28	0.41
61	600875	东方电气	3,990,508	71,509,903.36	0.40
62	601098	中南传媒	7,155,252	68,547,314.16	0.38
63	601009	南京银行	7,982,296	68,009,161.92	0.38
64	600552	方兴科技	3,066,341	65,159,746.25	0.36
65	601618	中国中冶	26,124,217	64,788,058.16	0.36
66	000608	阳光股份	12,268,864	62,939,272.32	0.35



67	600383	金地集团	9,504,674	61,590,287.52	0.34
68	600583	海油工程	9,934,772	60,502,761.48	0.34
69	000686	东北证券	3,473,419	59,534,401.66	0.33
70	600015	华夏银行	6,188,648	58,606,496.56	0.32
71	600369	西南证券	5,179,875	58,584,386.25	0.32
72	002448	中原内配	2,401,053	58,537,672.14	0.32
73	002007	华兰生物	2,347,359	57,698,084.22	0.32
74	600027	华电国际	13,521,145	56,653,597.55	0.31
75	600519	贵州茅台	234,883	56,172,269.45	0.31
76	601857	中国石油	6,164,679	55,790,344.95	0.31
77	002534	杭锅股份	2,997,095	53,887,768.10	0.30
78	000581	威孚高科	1,936,884	53,070,621.60	0.29
79	600805	悦达投资	5,679,463	52,989,389.79	0.29
80	600316	洪都航空	4,023,343	52,424,159.29	0.29
81	002441	众业达	3,571,663	51,753,396.87	0.29
82	600831	广电网络	6,432,309	51,651,441.27	0.29
83	000538	云南白药	863,465	51,186,205.20	0.28
84	000858	五粮液	1,562,346	51,182,454.96	0.28
85	600011	华能国际	7,907,675	51,004,503.75	0.28
86	000417	合肥百货	4,000,000	50,200,000.00	0.28
87	600499	科达机电	4,744,932	48,777,900.96	0.27
88	601808	中海油服	2,951,014	48,721,241.14	0.27
89	000811	烟台冰轮	5,573,843	48,325,218.81	0.27
90	601628	中国人寿	2,628,286	48,097,633.80	0.27
91	600967	北方创业	2,643,961	48,093,650.59	0.27
92	600054	黄山旅游	3,135,754	46,816,807.22	0.26
93	600495	晋西车轴	4,380,911	46,656,702.15	0.26
94	000402	金融街	7,112,942	46,447,511.26	0.26
95	000623	吉林敖东	2,556,289	44,326,051.26	0.25
96	601369	陕鼓动力	4,755,242	44,033,540.92	0.24
97	600177	雅戈尔	5,161,536	43,821,440.64	0.24
98	000563	陕国投 A	3,191,250	43,815,862.50	0.24
99	300006	莱美药业	2,732,880	43,288,819.20	0.24
100	600060	海信电器	2,564,838	43,114,926.78	0.24
101	000540	中天城投	5,828,226	43,012,307.88	0.24
102	600067	冠城大通	7,605,448	42,362,345.36	0.23
103	002315	焦点科技	1,222,492	42,359,347.80	0.23

104	600723	首商股份	4,937,745	41,477,058.00	0.23
105	600761	安徽合力	4,810,542	41,466,872.04	0.23
106	000716	南方食品	3,843,415	40,278,989.20	0.22
107	601169	北京银行	4,116,937	40,222,474.49	0.22
108	600729	重庆百货	1,423,599	40,173,963.78	0.22
109	002221	东华能源	4,812,221	39,748,945.46	0.22
110	000792	盐湖股份	1,175,800	39,706,766.00	0.22
111	000895	双汇发展	640,754	39,649,857.52	0.22
112	601877	正泰电器	2,556,004	39,004,621.04	0.22
113	600585	海螺水泥	2,590,297	38,388,201.54	0.21
114	002123	荣信股份	3,326,374	37,820,872.38	0.21
115	600880	博瑞传播	3,767,707	37,564,038.79	0.21
116	600690	青岛海尔	3,185,616	37,335,419.52	0.21
117	600622	嘉宝集团	6,064,288	37,295,371.20	0.21
118	002440	闰土股份	2,547,141	36,984,487.32	0.20
119	600256	广汇能源	2,735,464	36,846,700.08	0.20
120	600697	欧亚集团	1,605,069	36,707,928.03	0.20
121	000779	三毛派神	4,000,000	36,680,000.00	0.20
122	002238	天威视讯	2,561,669	36,452,549.87	0.20
123	601766	中国南车	7,909,006	36,065,067.36	0.20
124	000338	潍柴动力	1,196,312	35,518,503.28	0.20
125	600557	康缘药业	2,396,739	35,423,802.42	0.20
126	000650	仁和药业	4,103,192	35,205,387.36	0.20
127	600486	扬农化工	1,933,906	35,100,393.90	0.19
128	600085	同仁堂	1,993,163	34,780,694.35	0.19
129	600141	兴发集团	1,658,400	34,312,296.00	0.19
130	600005	武钢股份	12,416,183	33,399,532.27	0.19
131	000422	湖北宜化	2,680,500	32,836,125.00	0.18
132	600795	国电电力	11,931,715	32,215,630.50	0.18
133	600269	赣粤高速	8,602,374	32,172,878.76	0.18
134	002521	齐峰股份	2,741,531	31,664,683.05	0.18
135	002317	众生药业	1,322,714	31,401,230.36	0.17
136	600436	片仔癀	343,918	30,226,953.02	0.17
137	002089	新海宜	4,088,590	30,214,680.10	0.17
138	000882	华联股份	8,138,274	30,111,613.80	0.17
139	600787	中储股份	3,387,850	30,084,108.00	0.17
140	002054	德美化工	4,059,095	29,428,438.75	0.16

141	600428	中远航运	7,192,943	29,275,278.01	0.16
142	600270	外运发展	4,093,267	29,144,061.04	0.16
143	002063	远光软件	1,999,931	29,018,998.81	0.16
144	600489	中金黄金	1,348,291	29,015,222.32	0.16
145	600509	天富热电	3,601,840	28,526,572.80	0.16
146	601588	北辰实业	9,999,950	28,499,857.50	0.16
147	000425	徐工机械	1,984,849	28,462,734.66	0.16
148	002353	杰瑞股份	582,562	28,254,257.00	0.16
149	000697	*ST 炼石	2,038,311	28,006,393.14	0.16
150	600547	山东黄金	851,597	27,966,445.48	0.15
151	002458	益生股份	1,912,894	27,794,349.82	0.15
152	600501	航天晨光	3,190,754	27,312,854.24	0.15
153	000925	众合机电	3,072,971	26,857,766.54	0.15
154	000987	广州友谊	2,016,296	26,655,433.12	0.15
155	600737	中粮屯河	4,469,106	26,635,871.76	0.15
156	600511	国药股份	1,898,221	26,575,094.00	0.15
157	600104	上汽集团	1,854,551	26,501,533.79	0.15
158	600485	中创信测	3,000,267	26,402,349.60	0.15
159	600010	包钢股份	5,407,827	26,390,195.76	0.15
160	000911	南宁糖业	2,602,988	25,535,312.28	0.14
161	000690	宝新能源	5,754,477	25,262,154.03	0.14
162	601106	中国一重	7,895,488	24,949,742.08	0.14
163	600560	金自天正	3,405,853	24,419,966.01	0.14
164	000906	南方建材	2,870,930	23,139,695.80	0.13
165	002001	新和成	1,089,734	23,026,079.42	0.13
166	600770	综艺股份	2,004,233	23,008,594.84	0.13
167	601268	二重重装	3,738,940	22,919,702.20	0.13
168	601919	中国远洋	4,936,543	22,905,559.52	0.13
169	002004	华邦制药	1,017,560	22,895,100.00	0.13
170	600335	国机汽车	1,854,377	22,400,874.16	0.12
171	600498	烽火通信	838,306	22,223,492.06	0.12
172	600674	川投能源	3,151,028	21,805,113.76	0.12
173	600125	铁龙物流	2,558,496	21,696,046.08	0.12
174	002092	中泰化学	2,809,767	21,494,717.55	0.12
175	600546	山煤国际	996,156	20,839,583.52	0.12
176	000006	深振业 A	3,610,472	20,615,795.12	0.11
177	000818	方大化工	5,284,483	20,450,949.21	0.11

178	000625	长安汽车	4,138,853	20,197,602.64	0.11
179	600348	阳泉煤业	1,311,359	20,063,792.70	0.11
180	002465	海格通信	882,803	19,951,347.80	0.11
181	002013	中航精机	1,618,267	19,742,857.40	0.11
182	600216	浙江医药	780,918	19,640,087.70	0.11
183	601901	方正证券	3,796,830	19,287,896.40	0.11
184	600406	国电南瑞	1,020,249	19,068,453.81	0.11
185	600176	中国玻纤	1,926,322	18,935,745.26	0.10
186	000789	江西水泥	1,449,893	18,892,105.79	0.10
187	000705	浙江震元	1,412,995	18,792,833.50	0.10
188	600886	国投电力	4,299,417	18,659,469.78	0.10
189	002033	丽江旅游	878,150	18,590,435.50	0.10
190	600649	城投控股	2,544,426	18,370,755.72	0.10
191	600309	烟台万华	1,368,323	18,267,112.05	0.10
192	600352	浙江龙盛	3,180,920	18,226,671.60	0.10
193	600804	鹏博士	3,063,764	18,198,758.16	0.10
194	601186	中国铁建	4,056,535	18,051,580.75	0.10
195	601158	重庆水务	3,034,770	17,874,795.30	0.10
196	601996	丰林集团	2,770,708	17,871,066.60	0.10
197	000516	开元投资	4,000,000	17,840,000.00	0.10
198	300122	智飞生物	695,182	17,727,141.00	0.10
199	600098	广州控股	2,546,088	17,618,928.96	0.10
200	600115	东方航空	4,187,749	17,504,790.82	0.10
201	002384	东山精密	1,517,890	17,303,946.00	0.10
202	600549	厦门钨业	388,518	17,059,825.38	0.09
203	002547	春兴精工	1,540,080	17,017,884.00	0.09
204	000961	中南建设	1,359,209	16,935,744.14	0.09
205	600859	王府井	617,759	16,901,886.24	0.09
206	600997	开滦股份	1,597,684	16,727,751.48	0.09
207	002131	利欧股份	1,423,777	16,487,337.66	0.09
208	600327	大东方	2,728,618	16,426,280.36	0.09
209	002220	天宝股份	2,067,500	16,415,950.00	0.09
210	000027	深圳能源	2,535,927	16,407,447.69	0.09
211	002181	粤传媒	1,708,035	16,140,930.75	0.09
212	000600	建投能源	3,794,185	16,125,286.25	0.09
213	300273	和佳股份	900,000	15,984,000.00	0.09
214	600983	合肥三洋	1,993,536	15,948,288.00	0.09

215	600522	中天科技	1,847,468	15,758,902.04	0.09
216	600785	新华百货	859,540	15,746,772.80	0.09
217	002630	华西能源	949,059	14,985,641.61	0.08
218	600261	阳光照明	1,254,220	14,925,218.00	0.08
219	002251	步步高	609,823	14,879,681.20	0.08
220	600548	深高速	3,951,080	14,658,506.80	0.08
221	300053	欧比特	1,954,244	14,598,202.68	0.08
222	600031	三一重工	1,042,223	14,507,744.16	0.08
223	600009	上海机场	1,136,144	14,474,474.56	0.08
224	002278	神开股份	1,232,443	14,456,556.39	0.08
225	600100	同方股份	1,667,829	14,043,120.18	0.08
226	600188	兖州煤业	737,826	14,003,937.48	0.08
227	600873	梅花集团	2,065,400	13,941,450.00	0.08
228	600999	招商证券	1,199,934	13,931,233.74	0.08
229	000901	航天科技	1,202,755	13,639,241.70	0.08
230	600780	通宝能源	2,003,010	13,420,167.00	0.07
231	600195	中牧股份	759,119	12,950,570.14	0.07
232	000876	新希望	861,576	12,906,408.48	0.07
233	000063	中兴通讯	922,672	12,880,501.12	0.07
234	600970	中材国际	1,113,136	12,845,589.44	0.07
235	600475	华光股份	1,014,187	12,677,337.50	0.07
236	600688	S 上石化	2,184,312	12,669,009.60	0.07
237	600676	交运股份	2,758,618	12,579,298.08	0.07
238	002053	云南盐化	1,422,239	12,302,367.35	0.07
239	002133	广宇集团	2,584,632	12,173,616.72	0.07
240	002155	辰州矿业	620,000	12,003,200.00	0.07
241	000514	渝开发	2,298,439	11,745,023.29	0.07
242	600420	现代制药	863,524	11,726,655.92	0.06
243	002039	黔源电力	752,671	11,380,385.52	0.06
244	300136	信维通信	705,556	11,359,451.60	0.06
245	600827	友谊股份	999,944	11,309,366.64	0.06
246	600185	格力地产	1,878,086	11,287,296.86	0.06
247	600518	康美药业	728,625	11,235,397.50	0.06
248	600123	兰花科创	618,292	11,166,353.52	0.06
249	600396	金山股份	1,499,925	11,069,446.50	0.06
250	000731	四川美丰	1,639,116	10,932,903.72	0.06
251	600830	香溢融通	1,296,200	10,914,004.00	0.06

252	600058	五矿发展	485,698	10,845,636.34	0.06
253	601111	中国国航	1,760,878	10,829,399.70	0.06
254	000816	江淮动力	2,013,378	10,771,572.30	0.06
255	000778	新兴铸管	1,608,761	10,762,611.09	0.06
256	600572	康恩贝	999,910	10,629,043.30	0.06
257	600161	天坛生物	741,705	10,584,130.35	0.06
258	000559	万向钱潮	2,061,981	10,371,764.43	0.06
259	000888	峨眉山 A	474,142	10,137,155.96	0.06
260	000088	盐田港	2,480,028	10,118,514.24	0.06
261	300142	沃森生物	263,783	10,097,613.24	0.06
262	000401	冀东水泥	700,803	9,853,290.18	0.05
263	000592	中福实业	1,778,580	9,728,832.60	0.05
264	000568	泸州老窖	228,483	9,667,115.73	0.05
265	601668	中国建筑	2,839,032	9,482,366.88	0.05
266	000837	秦川发展	1,375,579	9,463,983.52	0.05
267	000729	燕京啤酒	1,272,210	9,287,133.00	0.05
268	002457	青龙管业	1,057,397	9,146,484.05	0.05
269	600378	天科股份	1,056,990	9,142,963.50	0.05
270	002142	宁波银行	911,278	9,094,554.44	0.05
271	600133	东湖高新	1,328,948	9,023,556.92	0.05
272	600271	航天信息	475,874	8,998,777.34	0.05
273	300228	富瑞特装	372,090	8,959,927.20	0.05
274	600088	中视传媒	785,505	8,907,626.70	0.05
275	601818	光大银行	3,047,767	8,655,658.28	0.05
276	600993	马应龙	500,000	8,625,000.00	0.05
277	000021	长城开发	1,600,000	8,608,000.00	0.05
278	600408	安泰集团	2,351,632	8,536,424.16	0.05
279	600322	天房发展	2,374,016	8,475,237.12	0.05
280	600079	人福医药	349,907	8,114,343.33	0.04
281	600055	华润万东	714,326	7,979,021.42	0.04
282	600963	岳阳林纸	1,887,404	7,927,096.80	0.04
283	600120	浙江东方	860,000	7,860,400.00	0.04
284	601299	中国北车	1,929,201	7,736,096.01	0.04
285	002275	桂林三金	541,403	7,660,852.45	0.04
286	002436	兴森科技	500,000	7,555,000.00	0.04
287	600249	两面针	1,507,171	7,294,707.64	0.04
288	600479	千金药业	612,060	7,283,514.00	0.04

289	600386	北巴传媒	948,487	7,189,531.46	0.04
290	600066	宇通客车	316,669	7,112,385.74	0.04
291	601633	长城汽车	395,831	7,045,791.80	0.04
292	000601	韶能股份	1,837,489	7,019,207.98	0.04
293	600559	老白干酒	240,150	6,853,881.00	0.04
294	600481	双良节能	948,643	6,792,283.88	0.04
295	600741	华域汽车	742,648	6,661,552.56	0.04
296	600973	宝胜股份	930,743	6,561,738.15	0.04
297	600064	南京高科	569,423	6,548,364.50	0.04
298	000898	鞍钢股份	1,673,811	6,527,862.90	0.04
299	600569	安阳钢铁	2,686,994	6,502,525.48	0.04
300	600861	北京城乡	948,943	6,500,259.55	0.04
301	600166	福田汽车	900,000	6,435,000.00	0.04
302	600461	洪城水业	834,022	6,388,608.52	0.04
303	000718	苏宁环球	785,138	6,359,617.80	0.04
304	601989	中国重工	1,223,564	6,350,297.16	0.04
305	002391	长青股份	415,251	6,311,815.20	0.03
306	300079	数码视讯	375,000	6,232,500.00	0.03
307	000801	四川九洲	892,350	5,943,051.00	0.03
308	600425	青松建化	500,500	5,920,915.00	0.03
309	600019	宝钢股份	1,364,833	5,896,078.56	0.03
310	002378	章源钨业	184,378	5,837,407.48	0.03
311	600900	长江电力	856,694	5,825,519.20	0.03
312	600248	延长化建	821,900	5,753,300.00	0.03
313	601899	紫金矿业	1,441,400	5,592,632.00	0.03
314	600068	葛洲坝	854,459	5,579,617.27	0.03
315	600581	八一钢铁	844,402	5,564,609.18	0.03
316	600660	福耀玻璃	711,354	5,562,788.28	0.03
317	600118	中国卫星	428,112	5,389,930.08	0.03
318	002254	泰和新材	477,291	5,388,615.39	0.03
319	600089	特变电工	783,962	5,307,422.74	0.03
320	600418	江淮汽车	936,331	5,065,550.71	0.03
321	600884	杉杉股份	415,007	4,934,433.23	0.03
322	300021	大禹节水	502,902	4,727,278.80	0.03
323	600601	方正科技	1,872,369	4,699,646.19	0.03
324	600075	新疆天业	655,489	4,647,417.01	0.03
325	600748	上实发展	759,369	4,563,807.69	0.03

326	000551	创元科技	854,231	4,535,966.61	0.03
327	002023	海特高新	497,921	4,421,538.48	0.02
328	600208	新潮中宝	994,497	4,107,272.61	0.02
329	002028	思源电气	368,493	4,086,587.37	0.02
330	600588	用友软件	265,657	4,053,925.82	0.02
331	600480	凌云股份	480,485	3,843,880.00	0.02
332	600236	桂冠电力	968,697	3,836,040.12	0.02
333	600742	一汽富维	194,172	3,796,062.60	0.02
334	601336	新华保险	110,000	3,766,400.00	0.02
335	300164	通源石油	251,640	3,676,460.40	0.02
336	002128	露天煤业	280,340	3,666,847.20	0.02
337	600469	风神股份	414,594	3,665,010.96	0.02
338	600879	航天电子	453,674	3,574,951.12	0.02
339	600667	太极实业	707,654	3,538,270.00	0.02
340	000042	深长城	182,687	3,421,727.51	0.02
341	601168	西部矿业	398,087	3,407,624.72	0.02
342	600832	东方明珠	600,766	3,226,113.42	0.02
343	300196	长海股份	204,697	3,172,803.50	0.02
344	600555	九龙山	797,268	3,045,563.76	0.02
345	300011	鼎汉技术	271,142	3,042,213.24	0.02
346	601600	中国铝业	452,798	2,793,763.66	0.02
347	300031	宝通带业	264,458	2,665,736.64	0.01
348	002476	宝莫股份	367,400	2,663,650.00	0.01
349	600496	精工钢构	343,515	2,662,241.25	0.01
350	600971	恒源煤电	189,793	2,643,816.49	0.01
351	000415	渤海租赁	343,532	2,624,584.48	0.01
352	000900	现代投资	180,674	2,572,797.76	0.01
353	000418	小天鹅 A	292,258	2,481,270.42	0.01
354	601872	招商轮船	756,116	2,434,693.52	0.01
355	600231	凌钢股份	514,596	2,392,871.40	0.01
356	600409	三友化工	361,518	2,360,712.54	0.01
357	001696	宗申动力	393,266	2,328,134.72	0.01
358	000550	江铃汽车	106,278	2,269,035.30	0.01
359	000572	海马汽车	675,704	2,202,795.04	0.01
360	300205	天喻信息	180,648	2,187,647.28	0.01
361	300004	南风股份	100,000	2,170,000.00	0.01
362	600684	珠江实业	324,267	2,140,162.20	0.01



363	002042	华孚色纺	444,740	2,103,620.20	0.01
364	000024	招商地产	84,222	2,065,965.66	0.01
365	600252	中恒集团	187,652	2,056,665.92	0.01
366	000651	格力电器	97,700	2,037,045.00	0.01
367	600302	标准股份	445,100	2,007,401.00	0.01
368	000521	美菱电器	434,432	1,959,288.32	0.01
369	600754	锦江股份	122,625	1,937,475.00	0.01
370	002082	栋梁新材	242,437	1,903,130.45	0.01
371	600062	华润双鹤	97,285	1,856,197.80	0.01
372	300208	恒顺电气	160,400	1,818,936.00	0.01
373	000951	中国重汽	147,261	1,787,748.54	0.01
374	600470	六国化工	185,956	1,766,582.00	0.01
375	600600	青岛啤酒	45,518	1,738,332.42	0.01
376	300210	森远股份	110,000	1,694,000.00	0.01
377	600382	广东明珠	229,331	1,683,289.54	0.01
378	002078	太阳纸业	290,270	1,674,857.90	0.01
379	600586	金晶科技	362,357	1,612,488.65	0.01
380	002266	浙富股份	214,714	1,610,355.00	0.01
381	600196	复星医药	154,933	1,597,359.23	0.01
382	000635	英力特	161,071	1,588,160.06	0.01
383	000001	深发展 A	104,746	1,587,949.36	0.01
384	600962	国投中鲁	150,237	1,562,464.80	0.01
385	000157	中联重科	151,709	1,521,641.27	0.01
386	601238	广汽集团	194,733	1,499,444.10	0.01
387	002554	惠博普	141,210	1,496,826.00	0.01
388	601390	中国中铁	575,676	1,479,487.32	0.01
389	002387	黑牛食品	118,400	1,475,264.00	0.01
390	600686	金龙汽车	222,156	1,457,343.36	0.01
391	600535	天士力	32,937	1,440,005.64	0.01
392	000039	中集集团	108,102	1,437,756.60	0.01
393	600881	亚泰集团	257,421	1,415,815.50	0.01
394	002106	莱宝高科	69,260	1,390,048.20	0.01
395	600373	中文传媒	94,866	1,362,275.76	0.01
396	600320	振华重工	320,950	1,354,409.00	0.01
397	600029	南方航空	289,183	1,333,133.63	0.01
398	002344	海宁皮城	50,899	1,327,445.92	0.01
399	600500	中化国际	191,719	1,296,020.44	0.01

400	600008	首创股份	258,223	1,262,710.47	0.01
401	600779	水井坊	51,984	1,261,651.68	0.01
402	601888	中国国旅	44,197	1,247,239.34	0.01
403	600276	恒瑞医药	43,236	1,241,305.56	0.01
404	002010	传化股份	164,835	1,236,262.50	0.01
405	600718	东软集团	143,483	1,235,388.63	0.01
406	000656	金科股份	112,512	1,209,504.00	0.01
407	600380	健康元	244,660	1,196,387.40	0.01
408	600655	豫园商城	151,085	1,190,549.80	0.01
409	600096	云天化	89,392	1,185,337.92	0.01
410	600960	渤海活塞	99,781	1,183,402.66	0.01
411	600533	栖霞建设	285,300	1,172,583.00	0.01
412	000059	辽通化工	146,963	1,162,477.33	0.01
413	600221	海南航空	236,875	1,155,950.00	0.01
414	000599	青岛双星	295,735	1,150,409.15	0.01
415	600183	生益科技	220,718	1,136,697.70	0.01
416	600893	航空动力	84,587	1,100,476.87	0.01
417	601988	中国银行	386,976	1,091,272.32	0.01
418	600169	太原重工	305,155	1,071,094.05	0.01
419	600811	东方集团	195,251	1,069,975.48	0.01
420	600151	航天机电	163,791	1,059,727.77	0.01
421	000680	山推股份	180,789	1,057,615.65	0.01
422	000667	名流置业	476,856	1,030,008.96	0.01
423	600026	中海发展	202,528	1,022,766.40	0.01
424	600839	四川长虹	483,660	1,020,522.60	0.01
425	600808	马钢股份	476,189	1,019,044.46	0.01
426	002551	尚荣医疗	65,831	1,015,114.02	0.01
427	600664	哈药股份	151,557	998,760.63	0.01
428	000825	太钢不锈	281,389	993,303.17	0.01
429	002202	金风科技	146,360	938,167.60	0.01
430	600589	广东榕泰	163,349	929,455.81	0.01
431	000913	钱江摩托	209,373	906,585.09	0.01
432	002647	宏磊股份	85,721	900,070.50	0.00
433	601992	金隅股份	131,421	873,949.65	0.00
434	002037	久联发展	37,850	855,410.00	0.00
435	002496	辉丰股份	56,428	818,206.00	0.00
436	600845	宝信软件	52,244	817,618.60	0.00

437	000090	深天健	104,375	754,631.25	0.00
438	600782	新钢股份	166,563	744,536.61	0.00
439	600809	山西汾酒	19,178	722,818.82	0.00
440	601991	大唐发电	118,103	664,919.89	0.00
441	000100	TCL 集团	313,457	636,317.71	0.00
442	601788	光大证券	48,104	633,529.68	0.00
443	002367	康力电梯	76,992	616,705.92	0.00
444	000528	柳工	47,365	587,799.65	0.00
445	000012	南玻 A	64,422	579,798.00	0.00
446	600052	浙江广厦	134,582	557,169.48	0.00
447	000919	金陵药业	61,279	515,969.18	0.00
448	002069	獐子岛	23,400	487,890.00	0.00
449	002522	浙江众成	25,803	455,680.98	0.00
450	601799	星宇股份	39,762	443,743.92	0.00
451	002208	合肥城建	70,976	432,953.60	0.00
452	000869	张裕 A	6,421	431,876.46	0.00
453	000630	铜陵有色	21,826	421,241.80	0.00
454	600018	上港集团	140,382	373,416.12	0.00
455	600575	芜湖港	47,500	367,650.00	0.00
456	000069	华侨城 A	57,296	365,548.48	0.00
457	600611	大众交通	43,838	229,711.12	0.00
458	002062	宏润建设	44,003	208,134.19	0.00
459	000060	中金岭南	24,099	207,733.38	0.00
460	600717	天津港	28,273	178,685.36	0.00
461	000539	粤电力 A	26,864	177,302.40	0.00
462	600663	陆家嘴	13,662	167,632.74	0.00
463	600143	金发科技	25,894	154,587.18	0.00
464	600675	中华企业	28,098	131,498.64	0.00
465	000488	晨鸣纸业	29,979	131,008.23	0.00
466	000897	津滨发展	43,558	124,575.88	0.00
467	600219	南山铝业	17,767	119,038.90	0.00
468	600021	上海电力	21,559	118,574.50	0.00
469	600022	山东钢铁	45,670	117,371.90	0.00
470	000959	首钢股份	39,937	113,820.45	0.00
471	600004	白云机场	15,464	105,309.84	0.00
472	000089	深圳机场	22,705	92,863.45	0.00
473	600432	吉恩镍业	6,834	90,755.52	0.00

474	000932	华菱钢铁	37,002	90,284.88	0.00
475	600961	株冶集团	8,819	86,778.96	0.00
476	000822	山东海化	18,118	86,604.04	0.00
477	600117	西宁特钢	14,982	83,599.56	0.00
478	600350	山东高速	22,772	81,068.32	0.00
479	000755	山西三维	11,006	79,133.14	0.00
480	000912	泸天化	9,775	75,951.75	0.00
481	000543	皖能电力	10,343	72,504.43	0.00
482	600007	中国国贸	6,737	70,064.80	0.00
483	600282	南钢股份	22,672	56,906.72	0.00
484	600639	浦东金桥	7,967	56,486.03	0.00
485	601003	柳钢股份	17,264	54,208.96	0.00
486	600033	福建高速	20,019	47,244.84	0.00
487	600017	日照港	16,889	46,613.64	0.00
488	600308	华泰股份	11,017	39,330.69	0.00
489	601005	重庆钢铁	12,600	35,658.00	0.00
490	000721	西安饮食	3,450	23,011.50	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	601318	中国平安	372,698,478.82	2.19
2	600783	鲁信创投	176,768,868.47	1.04
3	600616	金枫酒业	174,188,142.93	1.03
4	601688	华泰证券	169,772,684.03	1.00
5	600837	海通证券	167,976,578.41	0.99
6	000562	宏源证券	167,701,283.54	0.99
7	601628	中国人寿	149,029,971.79	0.88
8	601398	工商银行	143,911,572.82	0.85
9	600750	江中药业	142,205,868.57	0.84
10	600287	江苏舜天	136,783,080.38	0.81
11	000776	广发证券	134,496,881.97	0.79
12	600895	张江高科	130,260,202.92	0.77
13	600505	西昌电力	128,625,249.88	0.76
14	600028	中国石化	128,220,291.47	0.75
15	600635	大众公用	127,744,875.95	0.75

16	000009	中国宝安	125,086,214.88	0.74
17	002024	苏宁电器	124,196,314.24	0.73
18	000629	攀钢钒钛	113,115,825.06	0.67
19	000989	九芝堂	107,369,773.75	0.63
20	600863	内蒙华电	93,120,000.00	0.55

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。

#### 7.4.2 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	601318	中国平安	230,188,099.42	1.36
2	600804	鹏博士	150,618,961.90	0.89
3	600060	海信电器	140,872,704.81	0.83
4	300027	华谊兄弟	132,361,310.28	0.78
5	600036	招商银行	128,458,013.87	0.76
6	002167	东方锆业	125,916,103.85	0.74
7	000527	美的电器	113,994,280.22	0.67
8	600887	伊利股份	113,151,241.45	0.67
9	600739	辽宁成大	110,263,317.73	0.65
10	000858	五粮液	107,626,353.43	0.63
11	000895	双汇发展	107,563,121.14	0.63
12	601628	中国人寿	106,893,919.36	0.63
13	000002	万科 A	101,451,150.45	0.60
14	002238	天威视讯	90,195,827.93	0.53
15	600376	首开股份	87,048,455.82	0.51
16	600519	贵州茅台	87,041,173.19	0.51
17	601088	中国神华	86,191,713.49	0.51
18	600037	歌华有线	82,433,749.48	0.49
19	601601	中国太保	79,693,863.98	0.47
20	000100	TCL 集团	77,975,905.14	0.46

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。

#### 7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	9,055,729,839.43
卖出股票收入（成交）总额	8,707,922,176.93

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。

### 7.5 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	402,245,000.00	2.23
2	央行票据	155,168,000.00	0.86
3	金融债券	826,380,000.00	4.58
	其中：政策性金融债	826,380,000.00	4.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	503,971,489.21	2.79
8	其他	-	-
9	合计	1,887,764,489.21	10.46

### 7.6 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	113001	中行转债	2,811,480	273,050,937.60	1.51
2	120410	12 农发 10	2,700,000	271,215,000.00	1.50
3	019118	11 国债 18	2,000,000	200,220,000.00	1.11
4	110242	11 国开 42	2,000,000	200,120,000.00	1.11
5	1101096	11 央行票据 96	1,600,000	155,168,000.00	0.86

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	6,886,130.78
2	应收证券清算款	60,760,000.00
3	应收股利	17,715,804.69
4	应收利息	22,494,467.32
5	应收申购款	11,332,539.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,188,942.17

7.9.4 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	273,050,937.60	1.51
2	113002	工行转债	110,307,689.10	0.61
3	110018	国电转债	94,660,375.50	0.52
4	110016	川投转债	8,034,100.80	0.04
5	110007	博汇转债	6,423,112.80	0.04
6	110017	中海转债	6,363,523.40	0.04
7	125887	中鼎转债	1,490,159.11	0.01
8	125709	唐钢转债	971,457.30	0.01
9	110011	歌华转债	373,333.60	0.00

7.9.5 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。

7.9.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
1,052,176	12,130.46	440,553,708.12	3.45%	12,322,827,913.28	96.55%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	1,149,889.56	0.01%

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额；本基金的基金经理未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年6月30日）基金份额总额	770,195,182.55
本报告期期初基金份额总额	12,440,689,053.94
本报告期基金总申购份额	1,015,665,089.30
减：本报告期基金总赎回份额	692,972,521.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,763,381,621.40

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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 2012 年 4 月 21 日发布公告，聘任林浩先生为华夏基金管理有限公司（以下简称“本公司”）副总经理；于 2012 年 5 月 7 日发布公告，王亚伟先生不再担任本公司副总经理。本基金管理人于 2012 年 5 月 11 日发布公告，经本公司股东会 2012 年第一次临时会议审议通过，选举组成本公司第四届董事会；经本公司第四届董事会 2012 年第一次临时会议审议通过，选举王东明先生



为本公司董事长，范勇宏先生为本公司副董事长，同意滕天鸣先生任本公司总经理，范勇宏先生不再担任本公司总经理。根据中国证监会证监许可[2012]877 号批复，滕天鸣先生任华夏基金管理有限公司总经理已获得中国证监会核准。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
国金证券	1	2,365,136,770.94	13.52%	2,010,356.38	13.72%	-
中信证券	1	2,282,005,406.67	13.04%	1,854,151.98	12.66%	-
长江证券	1	1,638,604,234.96	9.36%	1,357,303.25	9.27%	-
海通证券	1	1,631,109,103.40	9.32%	1,390,355.86	9.49%	-
瑞银证券	1	1,511,573,712.61	8.64%	1,284,837.78	8.77%	-
高华证券	1	1,346,417,798.79	7.69%	1,155,031.66	7.89%	-
兴业证券	1	1,261,455,720.89	7.21%	1,024,941.94	7.00%	-
国泰君安证券	1	1,149,746,355.31	6.57%	935,584.64	6.39%	-
中国银河证券	1	1,087,258,266.69	6.21%	926,188.53	6.32%	-
广州证券	1	753,384,361.85	4.31%	612,130.21	4.18%	-
东北证券	1	726,976,625.56	4.15%	617,928.93	4.22%	-

齐鲁证券	2	588,759,591.22	3.36%	500,442.72	3.42%	-
中信建投证券	1	455,616,365.80	2.60%	387,273.93	2.64%	-
湘财证券	1	434,873,416.32	2.49%	371,854.23	2.54%	-
国信证券	1	266,478,341.51	1.52%	219,115.82	1.50%	-
中投证券	1	109,200.00	0.00%	95.34	0.00%	-

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、国联证券、华泰证券、民生证券、招商证券、中原证券、平安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，民生证券的券商交易单元为本基金本期新增的交易单元，本基金本期无剔除的交易单元，原华泰联合证券的交易单元更名为华泰证券交易单元。

#### 10.7.2 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
国金证券	-	-	1,000,000,000.00	23.35%
中信证券	761,947.08	1.11%	-	-
海通证券	1,477,820.50	2.16%	-	-

瑞银证券	66,127,439.50	96.52%	2,273,000,000.00	53.07%
高华证券	147,285.60	0.21%	1,000,000,000.00	23.35%
平安证券	-	-	10,000,000.00	0.23%

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于调整基金对账单服务方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-10
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-23
3	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-04-21
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-07
5	华夏基金管理有限公司公告两则	中国证监会指定报刊及网站	2012-05-11
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-30

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

### §12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏红利混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 法律意见书；
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

#### 12.2 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。

#### 12.3 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  
二〇一二年八月二十八日