

# 华夏沪深 300 指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
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.....	26
7.1 期末基金资产组合情况.....	26
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	27
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.....	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	40
§11 备查文件目录.....	42

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深300指数证券投资基金
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	25,592,453,205.34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
注册地址		北京市顺义区天竺空港 工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大 街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12	北京市西城区复兴门内大 街 55 号

	层	
邮政编码	100033	100140
法定代表人	王东明	姜建清

## 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	-588,847,452.89
本期利润	1,118,208,333.12
加权平均基金份额本期利润	0.0430
本期加权平均净值利润率	5.84%
本期基金份额净值增长率	6.21%
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	-7,210,510,938.18
期末可供分配基金份额利润	-0.2817
期末基金资产净值	18,381,942,267.16
期末基金份额净值	0.718
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	-28.20%

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	-5.28%	1.05%	-6.07%	1.04%	0.79%	0.01%
过去三个月	1.56%	1.07%	0.51%	1.07%	1.05%	0.00%
过去六个月	6.21%	1.27%	5.19%	1.26%	1.02%	0.01%
过去一年	-17.09%	1.29%	-17.18%	1.28%	0.09%	0.01%
自基金合同生效起至今	-28.20%	1.40%	-23.17%	1.49%	-5.03%	-0.09%

#### 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 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		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	12 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	13 年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，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，国际方面，欧洲主权债务问题仍未得到有效控制，美国经济复苏迹象虽然有所显现，但力度不及预期。国内方面，经济继续放缓，通胀回落；宏观政策微调力度加大，央行两次下调法定存款准备金率，并自 2008 年底以来首次降低存贷款基准利率；投资者对政策放松力度和经济基本面企稳的预期成为影响市场表现的重要因素。受上述因素影响，A 股市场总体呈现震荡走势，沪深 300 指数上半年上涨了 4.94%。

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 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.718 元，本报告期份额净值增长率为 6.21%，同期业绩比较基准增长率为 5.19%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，在全球较弱的宏观经济背景下，国内宏观经济放缓趋势仍将持续，通货膨胀将得到有效控制，宏观政策继续以“稳中求进”方式进行微调，出现阶段性经济底部的可能性越来越大。

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，做好成份股调整、限制投资股票替代投资等工作，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

2012 年上半年，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

2012 年上半年，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 2012 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

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	370,512,316.01	154,136,893.75
结算备付金		1,293,394.20	4,056,584.45
存出保证金		1,443,590.65	1,122,396.83
交易性金融资产	6.4.7.2	18,154,530,258.70	17,403,999,818.88
其中：股票投资		17,456,790,258.70	16,664,832,291.98

基金投资		-	-
债券投资		697,740,000.00	739,167,526.90
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	-	-
应收证券清算款		38,468,515.08	22,736,411.32
应收利息	6.4.7.5	10,725,049.15	15,745,664.29
应收股利		25,049,696.40	-
应收申购款		9,896,194.38	4,689,821.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,611,919,014.57	17,606,487,590.82
<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		-	-
应付赎回款		218,178,230.42	10,838,562.29
应付管理人报酬		7,799,423.19	7,688,716.52
应付托管费		1,559,884.64	1,537,743.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,372,108.60	29,924,500.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,067,100.56	895,188.94
负债合计		229,976,747.41	50,884,711.68
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	25,592,453,205.34	25,970,707,526.21
未分配利润	6.4.7.10	-7,210,510,938.18	-8,415,104,647.07
所有者权益合计		18,381,942,267.16	17,555,602,879.14
负债和所有者权益总计		18,611,919,014.57	17,606,487,590.82

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.718 元，基金份额总额

25,592,453,205.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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
<b>一、收入</b>		1,178,964,896.56	-272,503,374.18
1.利息收入		12,424,001.17	13,537,198.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	932,892.97	1,130,526.20
债券利息收入		11,491,108.20	12,406,672.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-541,573,065.10	-165,905,557.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-755,532,279.72	-334,794,434.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,179,642.20	-7,478,999.50
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	209,779,572.42	176,367,875.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,707,055,786.01	-122,258,073.73
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	1,058,174.48	2,123,058.62
<b>减：二、费用</b>		60,756,563.44	72,041,705.35
1.管理人报酬		47,499,309.87	55,148,365.06
2.托管费		9,499,861.96	11,029,673.04
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	3,509,874.42	5,206,570.68
5.利息支出		44,587.83	452,767.21
其中：卖出回购金融资产支出		44,587.83	452,767.21
6.其他费用	6.4.7.19	202,929.36	204,329.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,118,208,333.12	-344,545,079.53
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,118,208,333.12	-344,545,079.53
-------------------	--	------------------	-----------------

6.3 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：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（基金净值）	25,970,707,526.21	-8,415,104,647.07	17,555,602,879.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,118,208,333.12	1,118,208,333.12
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）	-378,254,320.87	86,385,375.77	-291,868,945.10
其中：1.基金申购款	2,357,042,660.91	-626,896,481.99	1,730,146,178.92
2.基金赎回款	-2,735,296,981.78	713,281,857.76	-2,022,015,124.02
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）	25,592,453,205.34	-7,210,510,938.18	18,381,942,267.16
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）	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）	-	-344,545,079.53	-344,545,079.53
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）	-620,301,995.08	-25,383,095.25	-645,685,090.33
其中：1.基金申购款	3,427,809,839.34	-404,502,519.11	3,023,307,320.23
2.基金赎回款	-4,048,111,834.42	379,119,423.86	-3,668,992,410.56
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)	25,115,986,438.07	-3,376,166,029.56	21,739,820,408.51

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

华夏沪深 300 指数证券投资基金(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”)证监许可[2009]531 号《关于核准华夏沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》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》、《华夏沪深 300 指数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，存续期限为不定期。本基金自 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 8 日期间共募集 24,771,692,420.44 元（不含认购资金利息），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2009）第 718 号予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 24,771,957,170.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 264,749.65 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股、新股、固定收益产品、权证以及法律法规或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。

#### 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	370,512,316.01
定期存款	-
其他存款	-
合计	370,512,316.01

##### 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	22,088,469,655.06	17,456,790,258.70	-4,631,679,396.36	
债券	交易所市场	297,998,500.00	299,910,000.00	1,911,500.00
	银行间市场	397,004,700.00	397,830,000.00	825,300.00
	合计	695,003,200.00	697,740,000.00	2,736,800.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	22,783,472,855.06	18,154,530,258.70	-4,628,942,596.36	

##### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。



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	44,777.02
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	582.10
应收债券利息	10,679,690.03
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	10,725,049.15

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	1,371,158.60
银行间市场应付交易费用	950.00
合计	1,372,108.60

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	750,000.00
应付赎回费	13,583.54
预提费用	303,517.02
合计	1,067,100.56

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	25,970,707,526.21	25,970,707,526.21
本期申购	2,357,042,660.91	2,357,042,660.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,735,296,981.78	-2,735,296,981.78
本期末	25,592,453,205.34	25,592,453,205.34

#### 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	-1,416,822,887.21	-6,998,281,759.86	-8,415,104,647.07
本期利润	-588,847,452.89	1,707,055,786.01	1,118,208,333.12
本期基金份额交易产生的变动数	30,764,137.49	55,621,238.28	86,385,375.77
其中：基金申购款	-159,114,640.82	-467,781,841.17	-626,896,481.99
基金赎回款	189,878,778.31	523,403,079.45	713,281,857.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,974,906,202.61	-5,235,604,735.57	-7,210,510,938.18

#### 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	898,861.54
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	32,494.47
其他	1,536.96
合计	932,892.97

#### 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	2,415,885,880.52
减：卖出股票成本总额	3,171,418,160.24
买卖股票差价收入	-755,532,279.72

#### 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	824,732,830.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	799,148,700.14
减：应收利息总额	21,404,488.46
债券投资收益	4,179,642.20

#### 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	209,779,572.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	209,779,572.42

#### 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	1,707,055,786.01
——股票投资	1,705,197,466.02
——债券投资	1,858,319.99
——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	1,707,055,786.01

#### 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	1,058,174.48

合计	1,058,174.48
----	--------------

注：本基金赎回时份额持有不满 1 年的，收取 0.5% 的赎回费，持有满 1 年以上（含 1 年）的，赎回费为 0。其中，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	3,507,824.42
银行间市场交易费用	2,050.00
合计	3,509,874.42

#### 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	59,672.34
信息披露费	119,344.68
银行费用	14,912.34
银行间账户维护费	9,000.00
合计	202,929.36

#### 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

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

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股票交易。

###### 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

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。

###### 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	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	-	-
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	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	1,337,080.04	2.88%

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	47,499,309.87	55,148,365.06
其中：支付销售机构的客户维护费	12,483,620.48	14,513,028.96

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。

#### 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	9,499,861.96	11,029,673.04

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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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
中国工商银行	370,512,316.01	898,861.54	318,981,407.95	1,071,428.55

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。

6.4.10.6 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	601558	华锐风电	新股发行	2,000	180,000.00

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
000776	广发证券	2011-08-25	2012-08-27	非公开发行流通受限	26.91	29.35	6,000,000	161,460,000.00	176,100,000.00	-
000562	宏源证券	2012-06-28	2013-06-29	非公开发行流通受限	13.22	13.25	4,000,000	52,880,000.00	53,000,000.00	-
601388	怡球资源	2012-04-11	2012-07-23	新发流通受限	13.00	16.81	2,540,322	33,024,186.00	42,702,812.82	-

600863	内蒙 华电	2012-03-21	2013-03-19	非公开 发行流 通受限	7.76	7.80	5,000,000	38,800,000.00	39,000,000.00	-
--------	----------	------------	------------	-------------------	------	------	-----------	---------------	---------------	---

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	2,193,000	23,286,636.06	17,346,630.00	-
002500	山西 证券	2012-05-15	筹划发行 股份购买 资产事项	8.19	-	-	1,780,000	14,887,123.46	14,578,200.00	-

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 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。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 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。

本基金为指数基金，采用在法律法规允许范围内最大复制指数的策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

#### 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	17,456,790,258.70	94.97	16,664,832,291.98	94.93
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	17,456,790,258.70	94.97	16,664,832,291.98	94.93

#### 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%	874,410,624.06	841,074,085.78
	-5%	-874,410,624.06	-841,074,085.78

#### 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 17,488,600,258.70 元，第二层级的余额为 665,930,000.00 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 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。）

#### 6.4.14.3 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。

#### 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	17,456,790,258.70	93.79
	其中：股票	17,456,790,258.70	93.79
2	固定收益投资	697,740,000.00	3.75
	其中：债券	697,740,000.00	3.75
	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	371,805,710.21	2.00

6	其他各项资产	85,583,045.66	0.46
7	合计	18,611,919,014.57	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	104,320,688.65	0.57
B	采掘业	1,800,987,509.86	9.80
C	制造业	6,157,429,827.98	33.50
C0	食品、饮料	1,303,376,938.97	7.09
C1	纺织、服装、皮毛	67,812,395.82	0.37
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	370,294,832.96	2.01
C5	电子	257,738,176.78	1.40
C6	金属、非金属	1,452,283,006.35	7.90
C7	机械、设备、仪表	1,869,990,810.62	10.17
C8	医药、生物制品	830,153,314.18	4.52
C99	其他制造业	5,780,352.30	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	423,037,393.36	2.30
E	建筑业	565,524,658.20	3.08
F	交通运输、仓储业	507,052,832.58	2.76
G	信息技术业	502,164,951.31	2.73
H	批发和零售贸易	486,077,086.60	2.64
I	金融、保险业	5,444,226,945.26	29.62
J	房地产业	962,099,309.24	5.23
K	社会服务业	152,523,612.28	0.83
L	传播与文化产业	57,626,930.30	0.31
M	综合类	293,718,513.08	1.60
	合计	17,456,790,258.70	94.97

## 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	11,853,797	542,192,674.78	2.95
2	600837	海通证券	52,809,161	508,552,220.43	2.77
3	600016	民生银行	82,000,000	491,180,000.00	2.67

4	600036	招商银行	44,800,000	489,216,000.00	2.66
5	601328	交通银行	97,520,100	442,741,254.00	2.41
6	601166	兴业银行	30,500,000	395,890,000.00	2.15
7	600000	浦发银行	48,639,470	395,438,891.10	2.15
8	600519	贵州茅台	1,488,167	355,895,138.05	1.94
9	000002	万科 A	34,444,500	306,900,495.00	1.67
10	601088	中国神华	11,782,279	264,865,631.92	1.44
11	601601	中国太保	11,152,600	247,364,668.00	1.35
12	000858	五粮液	6,953,900	227,809,764.00	1.24
13	600111	包钢稀土	5,219,212	205,950,105.52	1.12
14	601668	中国建筑	54,877,600	183,291,184.00	1.00
15	601169	北京银行	18,700,000	182,699,000.00	0.99
16	601288	农业银行	70,097,604	181,552,794.36	0.99
17	000776	广发证券	6,000,000	176,100,000.00	0.96
18	600048	保利地产	15,200,408	172,372,626.72	0.94
19	000157	中联重科	15,623,038	156,699,071.14	0.85
20	601939	建设银行	36,594,146	153,695,413.20	0.84
21	600031	三一重工	10,954,500	152,486,640.00	0.83
22	601006	大秦铁路	21,642,500	152,146,775.00	0.83
23	002304	洋河股份	1,098,701	147,830,219.55	0.80
24	000001	深发展 A	9,500,000	144,020,000.00	0.78
25	000651	格力电器	6,418,054	133,816,425.90	0.73
26	002024	苏宁电器	14,900,000	125,011,000.00	0.68
27	600015	华夏银行	12,695,300	120,224,491.00	0.65
28	600887	伊利股份	5,803,800	119,442,204.00	0.65
29	600900	长江电力	17,560,000	119,408,000.00	0.65
30	600104	上汽集团	8,235,168	117,680,550.72	0.64
31	601818	光大银行	40,963,393	116,336,036.12	0.63
32	601857	中国石油	12,460,000	112,763,000.00	0.61
33	600050	中国联通	30,098,730	111,967,275.60	0.61
34	601899	紫金矿业	28,603,100	110,980,028.00	0.60
35	600585	海螺水泥	7,105,800	105,307,956.00	0.57
36	000568	泸州老窖	2,475,400	104,734,174.00	0.57
37	600256	广汇能源	7,749,000	104,379,030.00	0.57
38	600383	金地集团	15,676,000	101,580,480.00	0.55
39	000063	中兴通讯	7,037,076	98,237,580.96	0.53
40	601628	中国人寿	5,230,000	95,709,000.00	0.52

41	600028	中国石化	15,062,200	94,891,860.00	0.52
42	000983	西山煤电	5,640,000	87,984,000.00	0.48
43	600547	山东黄金	2,657,604	87,275,715.36	0.47
44	600518	康美药业	5,617,232	86,617,717.44	0.47
45	600999	招商证券	7,434,472	86,314,219.92	0.47
46	601989	中国重工	16,300,920	84,601,774.80	0.46
47	000069	华侨城 A	13,208,991	84,273,362.58	0.46
48	000527	美的电器	7,580,000	83,759,000.00	0.46
49	600019	宝钢股份	19,322,644	83,473,822.08	0.45
50	000338	潍柴动力	2,810,990	83,458,293.10	0.45
51	000792	盐湖股份	2,280,999	77,029,336.23	0.42
52	600739	辽宁成大	4,911,498	76,619,368.80	0.42
53	601009	南京银行	8,984,600	76,548,792.00	0.42
54	600795	国电电力	28,336,500	76,508,550.00	0.42
55	000423	东阿阿胶	1,908,000	76,339,080.00	0.42
56	601988	中国银行	26,888,139	75,824,551.98	0.41
57	600489	中金黄金	3,505,676	75,442,147.52	0.41
58	601788	光大证券	5,531,848	72,854,438.16	0.40
59	600362	江西铜业	3,003,590	71,815,836.90	0.39
60	600690	青岛海尔	5,886,615	68,991,127.80	0.38
61	601699	潞安环能	3,290,700	68,249,118.00	0.37
62	000538	云南白药	1,149,396	68,136,194.88	0.37
63	000895	双汇发展	1,093,000	67,634,840.00	0.37
64	601688	华泰证券	6,392,900	67,125,450.00	0.37
65	000629	攀钢钒钛	10,192,077	67,063,866.66	0.36
66	600348	阳泉煤业	4,360,768	66,719,750.40	0.36
67	601600	中国铝业	10,536,391	65,009,532.47	0.35
68	600276	恒瑞医药	2,255,938	64,767,979.98	0.35
69	600089	特变电工	9,436,100	63,882,397.00	0.35
70	600406	国电南瑞	3,399,710	63,540,579.90	0.35
71	000100	TCL 集团	30,290,000	61,488,700.00	0.33
72	000024	招商地产	2,500,000	61,325,000.00	0.33
73	601669	中国水电	13,699,723	59,867,789.51	0.33
74	601299	中国北车	14,692,750	58,917,927.50	0.32
75	601168	西部矿业	6,740,000	57,694,400.00	0.31
76	000728	国元证券	5,278,019	57,583,187.29	0.31
77	601766	中国南车	12,540,000	57,182,400.00	0.31

78	600029	南方航空	12,330,000	56,841,300.00	0.31
79	000402	金融街	8,610,000	56,223,300.00	0.31
80	601898	中煤能源	6,930,300	53,640,522.00	0.29
81	000562	宏源证券	4,000,000	53,000,000.00	0.29
82	600309	烟台万华	3,930,000	52,465,500.00	0.29
83	600068	葛洲坝	7,799,380	50,929,951.40	0.28
84	000783	长江证券	5,518,561	50,218,905.10	0.27
85	000630	铜陵有色	2,537,100	48,966,030.00	0.27
86	601186	中国铁建	10,975,200	48,839,640.00	0.27
87	600600	青岛啤酒	1,266,700	48,375,273.00	0.26
88	600100	同方股份	5,737,200	48,307,224.00	0.26
89	600642	申能股份	10,304,647	47,504,422.67	0.26
90	600535	天士力	1,068,621	46,720,110.12	0.25
91	600875	东方电气	2,579,500	46,224,640.00	0.25
92	600009	上海机场	3,619,298	46,109,856.52	0.25
93	600010	包钢股份	9,370,000	45,725,600.00	0.25
94	000425	徐工机械	3,179,928	45,600,167.52	0.25
95	000709	河北钢铁	16,690,464	45,564,966.72	0.25
96	000623	吉林敖东	2,624,070	45,501,373.80	0.25
97	600177	雅戈尔	5,348,003	45,404,545.47	0.25
98	000878	云南铜业	2,529,843	45,284,189.70	0.25
99	000060	中金岭南	5,238,300	45,154,146.00	0.25
100	000012	南玻 A	4,999,938	44,999,442.00	0.24
101	600150	中国船舶	1,954,804	44,901,847.88	0.24
102	600123	兰花科创	2,481,770	44,820,766.20	0.24
103	601666	平煤股份	4,386,298	44,389,335.76	0.24
104	601390	中国中铁	17,102,551	43,953,556.07	0.24
105	600583	海油工程	7,216,900	43,950,921.00	0.24
106	601958	金钼股份	3,453,000	43,749,510.00	0.24
107	000039	中集集团	3,278,766	43,607,587.80	0.24
108	600115	东方航空	10,363,301	43,318,598.18	0.24
109	600196	复星医药	4,189,900	43,197,869.00	0.24
110	601618	中国中冶	17,300,000	42,904,000.00	0.23
111	601388	怡球资源	2,540,322	42,702,812.82	0.23
112	601111	中国国航	6,940,000	42,681,000.00	0.23
113	600549	厦门钨业	968,946	42,546,418.86	0.23
114	002415	海康威视	1,529,340	41,598,048.00	0.23

115	002142	宁波银行	4,085,300	40,771,294.00	0.22
116	002422	科伦药业	873,042	40,736,139.72	0.22
117	601718	际华集团	12,886,205	40,720,407.80	0.22
118	600188	兖州煤业	2,144,430	40,701,281.40	0.22
119	600085	同仁堂	2,315,000	40,396,750.00	0.22
120	000009	中国宝安	4,029,000	40,290,000.00	0.22
121	600143	金发科技	6,697,609	39,984,725.73	0.22
122	600415	小商品城	5,070,000	39,546,000.00	0.22
123	600369	西南证券	3,448,885	39,006,889.35	0.21
124	600863	内蒙华电	5,000,000	39,000,000.00	0.21
125	601117	中国化学	6,741,706	38,899,643.62	0.21
126	601991	大唐发电	6,908,299	38,893,723.37	0.21
127	600881	亚泰集团	7,067,000	38,868,500.00	0.21
128	000581	威孚高科	1,410,111	38,637,041.40	0.21
129	600166	福田汽车	5,387,912	38,523,570.80	0.21
130	000937	冀中能源	2,488,000	37,991,760.00	0.21
131	600066	宇通客车	1,679,787	37,728,016.02	0.21
132	600005	武钢股份	14,016,400	37,704,116.00	0.21
133	600660	福耀玻璃	4,800,000	37,536,000.00	0.20
134	601919	中国远洋	8,073,300	37,460,112.00	0.20
135	600271	航天信息	1,973,900	37,326,449.00	0.20
136	002155	辰州矿业	1,901,916	36,821,093.76	0.20
137	600376	首开股份	2,759,000	36,529,160.00	0.20
138	002202	金风科技	5,650,000	36,216,500.00	0.20
139	600694	大商股份	1,078,993	36,092,315.85	0.20
140	000625	长安汽车	7,229,952	35,282,165.76	0.19
141	600153	建发股份	4,926,252	35,271,964.32	0.19
142	600058	五矿发展	1,573,800	35,142,954.00	0.19
143	600252	中恒集团	3,165,636	34,695,370.56	0.19
144	601808	中海油服	2,097,790	34,634,512.90	0.19
145	000933	神火股份	3,788,953	34,555,251.36	0.19
146	000768	西飞国际	4,386,000	34,430,100.00	0.19
147	000869	张裕 A	503,094	33,838,102.44	0.18
148	600741	华域汽车	3,754,100	33,674,277.00	0.18
149	000800	一汽轿车	3,099,977	33,665,750.22	0.18
150	600809	山西汾酒	887,762	33,459,749.78	0.18
151	600655	豫园商城	4,238,947	33,402,902.36	0.18



152	000422	湖北宜化	2,658,592	32,567,752.00	0.18
153	600497	驰宏锌锗	2,293,540	32,270,107.80	0.18
154	600395	盘江股份	1,190,000	31,987,200.00	0.17
155	600827	友谊股份	2,817,191	31,862,430.21	0.17
156	600832	东方明珠	5,930,000	31,844,100.00	0.17
157	000960	锡业股份	1,607,200	31,661,840.00	0.17
158	600315	上海家化	811,341	31,650,412.41	0.17
159	000758	中色股份	1,642,800	31,163,916.00	0.17
160	600011	华能国际	4,799,854	30,959,058.30	0.17
161	600839	四川长虹	14,600,000	30,806,000.00	0.17
162	600779	水井坊	1,263,100	30,655,437.00	0.17
163	002106	莱宝高科	1,520,017	30,506,741.19	0.17
164	601717	郑煤机	2,619,894	30,390,770.40	0.17
165	000999	华润三九	1,390,119	30,374,100.15	0.17
166	601106	中国一重	9,600,000	30,336,000.00	0.17
167	601607	上海医药	2,835,500	30,254,785.00	0.16
168	000729	燕京啤酒	4,134,600	30,182,580.00	0.16
169	000528	柳工	2,416,000	29,982,560.00	0.16
170	000876	新希望	1,967,900	29,479,142.00	0.16
171	600649	城投控股	4,080,900	29,464,098.00	0.16
172	600259	广晟有色	446,097	29,411,175.21	0.16
173	601888	中国国旅	1,040,064	29,350,606.08	0.16
174	000825	太钢不锈	8,312,200	29,342,066.00	0.16
175	600208	新潮中宝	7,090,000	29,281,700.00	0.16
176	600125	铁龙物流	3,376,000	28,628,480.00	0.16
177	601333	广深铁路	9,710,200	28,547,988.00	0.16
178	002353	杰瑞股份	586,608	28,450,488.00	0.15
179	600703	三安光电	2,088,491	28,424,362.51	0.15
180	000401	冀东水泥	2,009,000	28,246,540.00	0.15
181	600804	鹏博士	4,750,000	28,215,000.00	0.15
182	600219	南山铝业	4,155,200	27,839,840.00	0.15
183	002385	大北农	1,430,253	27,746,908.20	0.15
184	600320	振华重工	6,526,719	27,542,754.18	0.15
185	600811	东方集团	5,019,753	27,508,246.44	0.15
186	600372	中航电子	1,498,784	26,963,124.16	0.15
187	600267	海正药业	1,517,315	26,522,666.20	0.14
188	002241	歌尔声学	726,472	26,508,963.28	0.14

189	601992	金隅股份	3,981,368	26,476,097.20	0.14
190	002038	双鹭药业	819,111	26,375,374.20	0.14
191	600588	用友软件	1,720,200	26,250,252.00	0.14
192	600893	航空动力	2,017,350	26,245,723.50	0.14
193	002007	华兰生物	1,060,000	26,054,800.00	0.14
194	601179	中国西电	6,498,908	25,865,653.84	0.14
195	002092	中泰化学	3,376,334	25,828,955.10	0.14
196	000898	鞍钢股份	6,620,000	25,818,000.00	0.14
197	002001	新和成	1,209,090	25,548,071.70	0.14
198	600266	北京城建	1,679,880	25,517,377.20	0.14
199	600062	华润双鹤	1,328,426	25,346,368.08	0.14
200	000718	苏宁环球	3,119,117	25,264,847.70	0.14
201	601018	宁波港	9,911,256	25,075,477.68	0.14
202	601001	大同煤业	2,282,900	24,997,755.00	0.14
203	000725	京东方 A	12,999,980	24,829,961.80	0.14
204	002081	金螳螂	652,959	24,812,442.00	0.13
205	600895	张江高科	2,880,000	24,681,600.00	0.13
206	601101	昊华能源	1,427,900	24,445,648.00	0.13
207	601918	国投新集	1,998,312	24,399,389.52	0.13
208	002310	东方园林	412,892	24,240,889.32	0.13
209	600108	亚盛集团	4,900,000	24,157,000.00	0.13
210	600216	浙江医药	957,400	24,078,610.00	0.13
211	600664	哈药股份	3,650,970	24,059,892.30	0.13
212	000778	新兴铸管	3,554,074	23,776,755.06	0.13
213	000061	农产品	4,084,000	23,687,200.00	0.13
214	600997	开滦股份	2,259,900	23,661,153.00	0.13
215	600718	东软集团	2,742,520	23,613,097.20	0.13
216	600331	宏达股份	2,935,891	23,604,563.64	0.13
217	601118	海南橡胶	3,392,689	23,307,773.43	0.13
218	600221	海南航空	4,761,565	23,236,437.20	0.13
219	601377	兴业证券	2,212,602	23,188,068.96	0.13
220	601866	中海集运	9,093,600	23,006,808.00	0.13
221	000969	安泰科技	1,860,000	22,747,800.00	0.12
222	600971	恒源煤电	1,632,975	22,747,341.75	0.12
223	600859	王府井	828,190	22,659,278.40	0.12
224	600550	天威保变	2,548,385	22,247,401.05	0.12
225	601158	重庆水务	3,736,987	22,010,853.43	0.12

226	600132	重庆啤酒	1,017,000	21,957,030.00	0.12
227	600352	浙江龙盛	3,792,000	21,728,160.00	0.12
228	000046	泛海建设	4,856,566	21,708,850.02	0.12
229	600498	烽火通信	795,510	21,088,970.10	0.11
230	600118	中国卫星	1,672,133	21,052,154.47	0.11
231	002146	荣盛发展	1,928,114	21,016,442.60	0.11
232	600674	川投能源	3,013,852	20,855,855.84	0.11
233	600160	巨化股份	2,063,675	20,843,117.50	0.11
234	600508	上海能源	1,140,648	20,679,948.24	0.11
235	600970	中材国际	1,791,507	20,673,990.78	0.11
236	600316	洪都航空	1,556,415	20,280,087.45	0.11
237	601901	方正证券	3,990,000	20,269,200.00	0.11
238	000807	云铝股份	3,410,575	20,088,286.75	0.11
239	601336	新华保险	585,518	20,048,136.32	0.11
240	601633	长城汽车	1,119,322	19,923,931.60	0.11
241	601928	凤凰传媒	2,290,852	19,701,327.20	0.11
242	600516	方大炭素	2,288,000	19,539,520.00	0.11
243	000680	山推股份	3,327,450	19,465,582.50	0.11
244	600770	综艺股份	1,689,683	19,397,560.84	0.11
245	600432	吉恩镍业	1,460,000	19,388,800.00	0.11
246	002128	露天煤业	1,482,198	19,387,149.84	0.11
247	002069	獐子岛	928,574	19,360,767.90	0.11
248	600598	北大荒	2,598,500	19,358,825.00	0.11
249	601933	永辉超市	713,014	19,322,679.40	0.11
250	600500	中化国际	2,840,100	19,199,076.00	0.10
251	601098	中南传媒	1,999,695	19,157,078.10	0.10
252	600812	华北制药	2,983,000	18,971,880.00	0.10
253	600037	歌华有线	2,492,500	18,768,525.00	0.10
254	600169	太原重工	5,346,000	18,764,460.00	0.10
255	601558	华锐风电	2,623,184	18,388,519.84	0.10
256	600109	国金证券	1,276,669	18,371,266.91	0.10
257	000703	恒逸石化	1,099,221	18,280,045.23	0.10
258	002299	圣农发展	1,255,978	18,136,322.32	0.10
259	600170	上海建工	2,465,400	17,800,188.00	0.10
260	600873	梅花集团	2,632,986	17,772,655.50	0.10
261	002073	软控股份	2,110,000	17,681,800.00	0.10
262	601555	东吴证券	1,999,990	17,679,911.60	0.10

263	600528	中铁二局	2,570,000	17,373,200.00	0.09
264	600418	江淮汽车	3,209,089	17,361,171.49	0.09
265	000059	辽通化工	2,193,000	17,346,630.00	0.09
266	002344	海宁皮城	645,177	16,826,216.16	0.09
267	000961	中南建设	1,349,761	16,818,022.06	0.09
268	601369	陕鼓动力	1,798,137	16,650,748.62	0.09
269	000780	平庄能源	1,495,979	15,677,859.92	0.09
270	600595	中孚实业	2,780,000	15,512,400.00	0.08
271	600546	山煤国际	729,100	15,252,772.00	0.08
272	000686	东北证券	889,812	15,251,377.68	0.08
273	600456	宝钛股份	792,020	14,866,215.40	0.08
274	000559	万向钱潮	2,935,170	14,763,905.10	0.08
275	002122	天马股份	2,260,000	14,599,600.00	0.08
276	002500	山西证券	1,780,000	14,578,200.00	0.08
277	000968	煤气化	940,000	14,335,000.00	0.08
278	002431	棕榈园林	543,614	14,019,805.06	0.08
279	600183	生益科技	2,636,000	13,575,400.00	0.07
280	600783	鲁信创投	840,226	13,410,006.96	0.07
281	600096	云天化	1,010,000	13,392,600.00	0.07
282	601566	九牧王	472,251	13,152,190.35	0.07
283	002399	海普瑞	607,522	12,879,466.40	0.07
284	601099	太平洋	1,837,770	12,680,613.00	0.07
285	002493	荣盛石化	800,000	12,264,000.00	0.07
286	002405	四维图新	1,007,871	12,033,979.74	0.07
287	600307	酒钢宏兴	3,393,922	11,776,909.34	0.06
288	002603	以岭药业	403,345	11,112,154.75	0.06
289	601258	庞大集团	1,799,951	10,979,701.10	0.06
290	000021	长城开发	1,957,693	10,532,388.34	0.06
291	600022	山东钢铁	3,999,929	10,279,817.53	0.06
292	002378	章源钨业	299,909	9,495,118.94	0.05
293	601233	桐昆股份	1,059,000	9,255,660.00	0.05
294	601268	二重重装	1,300,369	7,971,261.97	0.04
295	601216	内蒙君正	991,908	6,913,598.76	0.04
296	002570	贝因美	325,743	6,563,721.45	0.04
297	002594	比亚迪	291,055	5,780,352.30	0.03
298	600582	天地科技	200,000	2,890,000.00	0.02
299	000027	深圳能源	313,953	2,031,275.91	0.01

300	600380	健康元	299,910	1,466,559.90	0.01
301	600635	大众公用	300,000	1,398,000.00	0.01
302	600879	航天电子	149,965	1,181,724.20	0.01

#### 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	000651	格力电器	104,882,365.25	0.60
2	601818	光大银行	64,184,282.30	0.37
3	000629	攀钢钒钛	63,105,721.96	0.36
4	601669	中国水电	61,998,916.36	0.35
5	601939	建设银行	56,217,810.43	0.32
6	000562	宏源证券	53,616,112.14	0.31
7	000581	威孚高科	46,384,284.57	0.26
8	600104	上汽集团	44,250,866.66	0.25
9	601288	农业银行	43,645,000.00	0.25
10	600143	金发科技	42,921,045.72	0.24
11	600863	内蒙华电	38,800,000.00	0.22
12	601991	大唐发电	38,463,680.00	0.22
13	601388	怡球资源	33,024,186.00	0.19
14	600827	友谊股份	32,666,614.86	0.19
15	600315	上海家化	31,268,001.18	0.18
16	601718	际华集团	31,190,240.05	0.18
17	600011	华能国际	30,169,407.76	0.17
18	002304	洋河股份	27,474,338.97	0.16
19	600999	招商证券	26,750,176.69	0.15
20	002353	杰瑞股份	26,410,406.24	0.15

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	600481	双良节能	138,442,723.80	0.79
2	000651	格力电器	120,607,721.92	0.69

3	600881	亚泰集团	67,323,898.56	0.38
4	000562	宏源证券	65,216,192.44	0.37
5	600837	海通证券	49,777,860.90	0.28
6	601727	上海电气	43,001,718.39	0.24
7	601166	兴业银行	40,505,341.22	0.23
8	600582	天地科技	39,691,908.85	0.23
9	000402	金融街	35,409,869.81	0.20
10	600300	维维股份	34,056,036.61	0.19
11	000961	中南建设	32,453,312.72	0.18
12	600143	金发科技	31,811,642.02	0.18
13	601318	中国平安	30,860,821.55	0.18
14	600108	亚盛集团	29,571,155.73	0.17
15	600674	川投能源	27,791,935.73	0.16
16	600008	首创股份	26,128,263.41	0.15
17	600428	中远航运	25,963,935.69	0.15
18	600000	浦发银行	25,756,306.78	0.15
19	600717	天津港	25,135,375.84	0.14
20	600635	大众公用	24,329,292.32	0.14

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	2,258,178,660.94
卖出股票收入（成交）总额	2,415,885,880.52

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	400,180,000.00	2.18
2	央行票据	96,910,000.00	0.53
3	金融债券	200,650,000.00	1.09
	其中：政策性金融债	200,650,000.00	1.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	697,740,000.00	3.80

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	019202	12 国债 02	1,500,000	151,500,000.00	0.82
2	120405	12 农发 05	1,000,000	100,470,000.00	0.55
3	120001	12 付息国债 01	1,000,000	100,270,000.00	0.55
4	110414	11 农发 14	1,000,000	100,180,000.00	0.54
5	020051	12 贴债 01	1,000,000	98,240,000.00	0.53

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	1,443,590.65
2	应收证券清算款	38,468,515.08
3	应收股利	25,049,696.40
4	应收利息	10,725,049.15
5	应收申购款	9,896,194.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	85,583,045.66

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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
619,772	41,293.34	758,089,101.42	2.96%	24,834,364,103.92	97.04%

#### 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	14,756,703.71	0.06%

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持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；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（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	25,970,707,526.21
本报告期基金总申购份额	2,357,042,660.91
减：本报告期基金总赎回份额	2,735,296,981.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	25,592,453,205.34



## §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	2,052,232,275.66	45.93%	102,608.38	49.25%	-
中银国际证券	1	1,343,435,068.02	30.07%	29,936.52	14.37%	-

海通证券	1	1,072,346,126.72	24.00%	75,786.06	36.38%	-
------	---	------------------	--------	-----------	--------	---

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、华泰证券、中投证券和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，原华泰联合证券的交易单元更名为华泰证券的交易单元。

### 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	40,490,930.10	47.51%	258,000,000.00	43.88%
中银国际证券	5,630,394.36	6.61%	-	-
海通证券	39,108,714.30	45.89%	330,000,000.00	56.12%

### 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关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-31
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	2012-04-21
5	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
6	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
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-29
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-30

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 11.1.2 《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏沪深 300 指数证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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