

# 华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF） 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十八日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 审计报告.....	12
§7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	36
8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
8.3 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.....	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	44
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	44
8.9 投资组合报告附注.....	44
§9 基金份额持有人信息.....	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
§10 开放式基金份额变动.....	46
§11 重大事件揭示.....	46
§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	华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏蓝筹混合（LOF）
基金主代码	160311
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 24 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,284,199,187.34 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 5 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	裴学敏
	联系电话	400-818-6666	021-32169999
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-63136700	021-62701262
注册地址		北京市顺义区天竺空港 工业区 A 区	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		北京市西城区金融大街	上海市仙霞路 18 号

	33 号通泰大厦 B 座 12 层	
邮政编码	100033	200120
法定代表人	王东明	胡怀邦

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-886,019,700.24	-981,507,290.82	2,028,143,520.56
本期利润	564,435,520.83	-2,922,093,368.72	-347,525,036.75
加权平均基金份额本期利润	0.0487	-0.2412	-0.0280
本期加权平均净值利润率	6.87%	-28.37%	-2.54%
本期基金份额净值增长率	7.10%	-26.20%	-1.07%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	2,908,872,953.92	3,086,403,911.30	5,295,592,872.54
期末可供分配基金份额利润	0.2578	0.2614	0.4173
期末基金资产净值	8,338,955,164.94	8,148,311,793.14	11,865,650,482.00
期末基金份额净值	0.739	0.690	0.935
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	9.01%	1.79%	37.93%

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
过去三个月	7.26%	0.98%	6.33%	0.77%	0.93%	0.21%
过去六个月	2.07%	0.96%	2.35%	0.74%	-0.28%	0.22%
过去一年	7.10%	1.03%	6.36%	0.77%	0.74%	0.26%
过去三年	-21.81%	1.14%	-13.96%	0.83%	-7.85%	0.31%
过去五年	-27.98%	1.50%	-26.67%	1.18%	-1.31%	0.32%
自基金转型以来至今	9.01%	1.49%	-3.44%	1.21%	12.45%	0.28%

#### 3.2.2 自基金转型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

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

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

（2007 年 4 月 24 日至 2012 年 12 月 31 日）

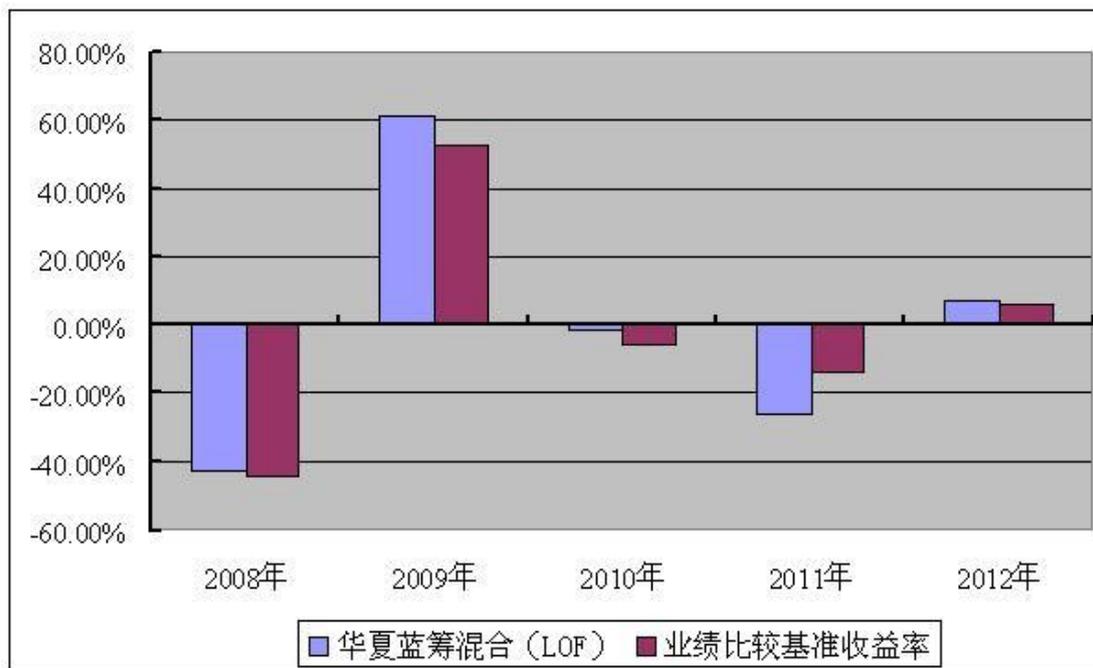


注：自 2007 年 4 月 24 日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：自 2007 年 4 月 24 日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	3.400	2,535,881,821.69	1,561,771,623.26	4,097,653,444.95	-
合计	3.400	2,535,881,821.69	1,561,771,623.26	4,097,653,444.95	-

## §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、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。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、保险资金投资管理人，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，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，旗下主动管理的股票型、混合型基金表现稳健，部分基金业绩表现良好；固定收益类基金均实现了正收益，总体表现优于行业平均水平。凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉，华夏基金荣获多家机构评选的多个奖项，主要奖项包括：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。

在客户服务方面，2012 年，华夏基金继续以客户需求为导向，持续提高服务质量：推出华夏基金活期通账户服务，客户可通过活期通账户办理华夏现金增利证券投资基金的快速取现、余额理财、信用卡还款等业务，客户资金使用效率大幅提高；推出移动客户端基金交易功能，客户可通过 iPhone、iPad 以及 Android 版移动客户端办理基金开户、申购、赎回、转换、定期定额投资等业务；推出关联账户查询服务，客户可通过网上查询系统一站式查询指定关联人的基金投资情况。

#### 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		
王怡欢	本基金的基金经理	2011-02-22	-	8 年	北京大学经济学硕士。2004 年 6 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、基金经理助理等。

陈兵	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2012-02-29	-	12 年	美国芝加哥大学 MBA。曾任 JP 摩根投资银行部业务经理，鹏华基金、易方达基金、中金公司社保基金基金经理等。2008 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任社保基金基金经理等。
杨泽辉	本基金的基金经理	2009-01-01	2012-02-29	8 年	会计学硕士。2004 年 2 月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究主管、行业研究员等。
刘文动	本基金的基金经理、公司副总经理	2007-06-12	2012-02-29	15 年	硕士。曾任鹏华基金投资总部副总经理兼机构理财部总监，平安保险集团投资管理中心组合经理助理、平安证券研究员等。2006 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任兴安证券投资基金基金经理（2006 年 5 月 24 日至 2007 年 11 月 21 日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007 年 2 月 14 日至 2008 年 2 月 27 日期间）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。

③根据本基金管理人于 2012 年 3 月 2 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告》，增聘陈兵先生为本基金基金经理，刘文动先生、杨泽辉先生不再担任本基金基金经理。

④根据本基金管理人于 2013 年 3 月 12 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告》，增聘董阳阳先生为本基金基金经理，陈兵先生不再担任本基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

#### 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，国内经济无论从短期还是中期视角，都开始显现诸多问题。短期来看，由于欧美经济仍未强劲复苏，外需乏力，而以往粗放的、主要靠基建和房地产拉动的内需增长也面临多方掣肘，经济增长短期动力明显不足。中期来看，

中国经济从较低水平起步，强劲增长多年之后，能否找到未来的竞争力、增长点，能否克服已经日益凸显的资源、人才、市场的制约，能否化解成长中的各种矛盾，也成为各方激烈争论的焦点。对于宏观政策，我们也并未看到以往一减速就大力刺激模式的简单重复，货币政策和财政政策都较为稳健。A 股市场在疲弱的经济和中性偏紧的货币政策下，于年初经历了一波反弹，之后持续下跌，并在 12 月初创下 3 年来的低点，此后，由于货币环境逐渐趋于宽松，且多数权重板块的估值水平已经具备很强吸引力，市场在年底开始强劲反弹。

报告期内，本基金大部分时间保持了中性偏低的股票仓位，并始终避开了与固定资产投资密切相关的强周期行业，坚持持有低估值的银行股，并精选食品、电子、医药等行业的股票集中投资，取得了较好的效果。但由于对政策冲击估计不足，未能在第 4 季度更为坚决地减持组合中的白酒类个股，也未能在银行股股价的低点及时加大增持力度，这些都是今年投资中较为遗憾的地方。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.739 元，本报告期份额净值增长率为 7.10%，同期业绩比较基准增长率为 6.36%。

#### 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 2013 年，我们认为，市场整体的机会大于风险。中国经济固然很难继续高歌猛进，但在投资者不理性悲观的时候，我们也应看到中国巨大的国内市场、不平衡的区域经济所能带来的持续增长潜力和惯性。投资策略上，我们仍将不断寻找低估值行业的价值股以及持续增长的股票，并始终将其作为本基金的核心资产，同时还将不断加深我们的研究深度，拓宽选股范围，力争优化投资决策，为投资者实现良好的收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在监察稽核工作中加大了对日常业务的检查范围及频率，及时对公司投研、营销等业务开展合规检查，重点开展了对分公司、理财中心业务的专项检查和员工行为合规的专项检查；加大了对各项业务的合规培训

和考试力度，针对公司员工尤其是投研人员组织了多次合规培训和合规考试，提高了员工的风险意识与合规意识；进一步完善内部相关规章制度，促进了公司业务合规运作。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

2012 年度，基金托管人在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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 年度，华夏基金管理有限公司在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2012 年度，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 21137 号

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“华夏蓝筹核心基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华夏蓝筹核心基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

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

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报

表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述华夏蓝筹核心基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏蓝筹核心基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 许康玮 洪磊

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2013-03-26

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	-	-
结算备付金		343,277,405.01	979,827,864.14
存出保证金		2,000,000.00	2,944,566.66
交易性金融资产	7.4.7.2	7,246,838,927.58	7,164,963,125.32
其中：股票投资		6,725,538,454.69	6,619,469,627.02
基金投资		-	-
债券投资		521,300,472.89	545,493,498.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	129,600,634.40	99,000,268.50

应收证券清算款		653,848,710.32	18,180,501.08
应收利息	7.4.7.5	8,618,931.03	9,456,728.26
应收股利		-	-
应收申购款		357,777.81	432,063.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,384,542,386.15	8,274,805,117.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,875,108.16	24,713,269.37
应付赎回款		5,627,673.59	2,764,146.70
应付管理人报酬		9,870,397.44	10,835,801.14
应付托管费		1,645,066.25	1,805,966.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	24,135,563.75	84,191,521.16
应交税费		166,385.89	166,385.89
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,267,026.13	2,016,233.61
负债合计		45,587,221.21	126,493,324.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	4,837,364,979.61	5,061,907,881.84
未分配利润	7.4.7.10	3,501,590,185.33	3,086,403,911.30
所有者权益合计		8,338,955,164.94	8,148,311,793.14
负债和所有者权益总计		8,384,542,386.15	8,274,805,117.88

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.739 元，基金份额总额 11,284,199,187.34 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
<b>一、收入</b>		728,432,587.25	-2,707,600,822.73
1.利息收入		38,406,468.07	29,779,031.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,512,644.25	12,319,226.93
债券利息收入		14,584,122.57	16,297,000.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,309,701.25	1,162,804.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-761,103,235.26	-798,469,522.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-876,500,161.00	-870,434,250.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	701,270.80	2,024,847.40
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	114,695,654.94	69,939,880.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,450,455,221.07	-1,940,586,077.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	674,133.37	1,675,746.28
<b>减：二、费用</b>		163,997,066.42	214,492,545.99
1.管理人报酬		123,362,832.97	154,808,285.73
2.托管费		20,560,472.15	25,801,381.04
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	19,622,491.78	33,427,131.65
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	451,269.52	455,747.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		564,435,520.83	-2,922,093,368.72
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		564,435,520.83	-2,922,093,368.72

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,061,907,881.84	3,086,403,911.30	8,148,311,793.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	564,435,520.83	564,435,520.83
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）	-224,542,902.23	-149,249,246.80	-373,792,149.03
其中：1.基金申购款	99,567,141.04	65,944,994.60	165,512,135.64
2.基金赎回款	-324,110,043.27	-215,194,241.40	-539,304,284.67
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）	4,837,364,979.61	3,501,590,185.33	8,338,955,164.94
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,439,435,510.14	6,426,214,971.86	11,865,650,482.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,922,093,368.72	-2,922,093,368.72
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）	-377,527,628.30	-417,717,691.84	-795,245,320.14
其中：1.基金申购款	255,245,959.10	260,975,315.99	516,221,275.09
2.基金赎回款	-632,773,587.40	-678,693,007.83	-1,311,466,595.23
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）	5,061,907,881.84	3,086,403,911.30	8,148,311,793.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王东明

崔雁巍

崔雁巍

基金管理公司负责人      主管会计工作负责人      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

根据原兴科证券投资基金（以下简称“原基金兴科”）基金份额持有人大会审议通过的《关于兴科证券投资基金转型有关事项的议案》，并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[2007]107号《关于核准兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由原兴科证券投资基金转型而来。根据中国证监会批复及深圳证券交易所深证复[2007]24号《关于同意兴科证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意，原基金兴科于2007年4月23日进行终止上市权利登记，2007年4月24日起终止上市。原《兴科证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于同日起生效，同时原基金兴科更名为华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）。原基金兴科于基金合同失效前一日经审计的基金资产净值为1,397,999,526.25元，于本基金基金合同生效日转入本基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》和《关于原兴科证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，基金管理人华夏基金管理有限公司确定2007年5月10日为基金份额折算基准日。折算前基金资产净值为1,165,930,905.62元，基金份额总额为500,000,000份。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为1:2.331861811，折算后基金份额净值为1.000元，基金份额总额为1,165,930,905份。华夏基金管理有限公司已根据上述折算比例向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提出基金份额的变更登记申请，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司已于2007年5月11日对各基金份额持有人持有的基金份额进行了变更登记。

本基金在基金合同生效后于2007年4月27日开放集中申购，共募集9,964,660,076.62元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计902,304.53元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（07）第B003号审验

报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 5 月 10 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 9,964,660,076.62 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 902,304.53 份基金份额，并于 2007 年 5 月 11 日进行了确认登记。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2007]第 79 号文审核同意，本基金 1,165,930,905 份基金份额于 2007 年 5 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）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，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 7.4.2 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”)、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

## 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- 1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

本基金本报告期末及上年度末均无银行存款余额。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,489,056,795.01	6,725,538,454.69	236,481,659.68
债券	交易所市场	184,297,577.43	191,835,472.89	7,537,895.46
	银行间市场	330,014,600.00	329,465,000.00	-549,600.00
	合计	514,312,177.43	521,300,472.89	6,988,295.46
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,003,368,972.44	7,246,838,927.58	243,469,955.14
项目		上年度末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,832,642,503.82	6,619,469,627.02	-1,213,172,876.80
债券	交易所市场	149,528,777.43	154,834,498.30	5,305,720.87
	银行间市场	389,777,110.00	390,659,000.00	881,890.00
	合计	539,305,887.43	545,493,498.30	6,187,610.87
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,371,948,391.25	7,164,963,125.32	-1,206,985,265.93

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 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	129,600,634.40	-
合计	129,600,634.40	-
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 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	99,000,268.50	-
合计	99,000,268.50	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	-	1,192.09
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	424,563.38	617,392.64
应收债券利息	8,103,254.31	8,807,790.69
应收买入返售证券利息	91,113.34	30,301.36
应收申购款利息	-	-
其他	-	51.48
合计	8,618,931.03	9,456,728.26

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	24,129,155.40	84,188,186.98
银行间市场应付交易费用	6,408.35	3,334.18
合计	24,135,563.75	84,191,521.16

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00	1,750,000.00
应付赎回费	21,209.95	10,417.43
预提费用	354,500.00	114,500.00
其他	141,316.18	141,316.18
合计	2,267,026.13	2,016,233.61

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,807,968,148.59	5,061,907,881.84
本期申购	232,259,582.17	99,567,141.04
本期赎回（以“-”号填列）	-756,028,543.42	-324,110,043.27
本期末	11,284,199,187.34	4,837,364,979.61

#### 7.4.7.10 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	3,946,350,548.74	-859,946,637.44	3,086,403,911.30
本期利润	-886,019,700.24	1,450,455,221.07	564,435,520.83
本期基金份额交易产生的变动数	-151,457,894.58	2,208,647.78	-149,249,246.80
其中：基金申购款	69,567,074.33	-3,622,079.73	65,944,994.60
基金赎回款	-221,024,968.91	5,830,727.51	-215,194,241.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,908,872,953.92	592,717,231.41	3,501,590,185.33

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	26,317.82	33,679.55
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	18,485,777.31	12,283,230.82
其他	549.12	2,316.56
合计	18,512,644.25	12,319,226.93

#### 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,771,314,036.46	11,276,154,455.95
减：卖出股票成本总额	7,647,814,197.46	12,146,588,706.19
买卖股票差价收入	-876,500,161.00	-870,434,250.24

#### 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	507,015,188.56	961,427,147.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	494,123,310.00	939,189,150.00
减：应收利息总额	12,190,607.76	20,213,149.70
债券投资收益	701,270.80	2,024,847.40

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	114,695,654.94	69,939,880.41
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	114,695,654.94	69,939,880.41
----	----------------	---------------

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	1,450,455,221.07	-1,940,586,077.90
——股票投资	1,449,654,536.48	-1,927,209,614.71
——债券投资	800,684.59	-13,376,463.19
——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	1,450,455,221.07	-1,940,586,077.90

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	674,133.37	1,639,338.82
印花税返还	-	36,407.46
合计	674,133.37	1,675,746.28

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	19,621,291.78	33,413,356.65
银行间市场交易费用	1,200.00	13,775.00
合计	19,622,491.78	33,427,131.65

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

审计费用	110,000.00	110,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行费用	23,269.52	27,447.57
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	-	300.00
合计	451,269.52	455,747.57

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
无锡市国联发展（集团）有限公司	基金管理人的股东

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	123,362,832.97	154,808,285.73
其中：支付销售机构的客户维护费	25,980,692.92	32,914,398.83

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

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

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,560,472.15	25,801,381.04

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 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

#### 7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	50,000,000.00	50,000,000.00
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	-	-
期末持有的基金份额	50,000,000.00	50,000,000.00
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	0.44%	0.42%

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	-	26,317.82	-	33,679.55

注：①本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

②除此之外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2012 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2011 年 12 月 31 日：同）。

7.4.10.6 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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/ 张）	总金额

中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	601336	新华保险	新股发行	3,000	69,750.00

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	2013-03-21	非公开发行流通受限	7.76	7.50	7,000,000	54,320,000.00	52,500,000.00	-
000562	宏源证券	2012-06-28	2013-06-29	非公开发行流通受限	13.22	16.16	3,000,000	39,660,000.00	48,480,000.00	-
000826	桑德环境	2012-12-31	2013-01-09	增发流通受限	12.71	22.99	278,503	3,539,773.13	6,402,783.97	-

##### 7.4.12.2 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
000002	万科 A	2012-12-26	筹划重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	21,593,521	193,522,834.98	218,526,432.52	-
600780	通宝能源	2012-01-18	筹划战略重组重大事项	6.70	-	-	9,693,667	71,728,521.87	64,947,568.90	-
000669	*ST 领先	2012-12-31	筹划非公开发行股票事项	29.05	2013-01-14	31.50	2,115,611	60,155,433.03	61,458,499.55	-
000527	美的电器	2012-08-27	筹划重	9.69	-	-	3,756,080	71,022,452.01	36,396,415.20	-

			大资产 重组事 项							
000973	佛塑科技	2012-12-28	筹划重 大事项	4.15	2013-01-18	4.57	4,564,682	42,569,652.35	18,943,430.30	-
300315	掌趣科技	2012-12-04	筹划重 大资产 重组事 项	27.32	2013-02-05	25.15	547,266	13,659,514.90	14,951,307.12	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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之内。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	343,277,405.01	-	-	343,277,405.01
权证保证金	-	-	-	-
债券投资	521,299,504.89	968.00	-	521,300,472.89
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	129,600,634.40	-	-	129,600,634.40
应收直销申购款	36,859.03	-	-	36,859.03
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计

2011 年 12 月 31 日				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	979,827,864.14	-	-	979,827,864.14
权证保证金	103,913.63	-	-	103,913.63
债券投资	545,492,533.40	-	964.90	545,493,498.30
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	99,000,268.50	-	-	99,000,268.50
应收直销申购款	107,708.80	-	-	107,708.80
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 （2012 年 12 月 31 日）	上年度末 （2011 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	1,231,463.55	1,413,608.73
	利率上升 25 个基点	-1,221,515.83	-1,399,501.24

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	6,725,538,454.69	80.65	6,619,469,627.02	81.24
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	6,725,538,454.69	80.65	6,619,469,627.02	81.24

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	+5%	324,305,464.29	327,630,649.19
	-5%	-324,305,464.29	-327,630,649.19

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

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

##### 7.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至 2012 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为 6,765,046,205.26 元，第二层级的余额为 481,792,722.32 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 6,673,987,248.32 元，第二层级的余额为 490,975,877.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

#### 7.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

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

#### 7.4.14.4 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,725,538,454.69	80.21
	其中：股票	6,725,538,454.69	80.21
2	固定收益投资	521,300,472.89	6.22
	其中：债券	521,300,472.89	6.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	129,600,634.40	1.55
	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	343,277,405.01	4.09
6	其他各项资产	664,825,419.16	7.93
7	合计	8,384,542,386.15	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	34,780,690.92	0.42

B	采掘业	254,469,557.18	3.05
C	制造业	2,499,585,756.43	29.97
C0	食品、饮料	763,791,005.35	9.16
C1	纺织、服装、皮毛	43,417,183.12	0.52
C2	木材、家具	27,331,700.00	0.33
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	64,167,676.74	0.77
C5	电子	401,202,555.50	4.81
C6	金属、非金属	267,807,055.50	3.21
C7	机械、设备、仪表	540,877,643.63	6.49
C8	医药、生物制品	374,440,536.59	4.49
C99	其他制造业	16,550,400.00	0.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	351,877,201.48	4.22
E	建筑业	317,914,512.00	3.81
F	交通运输、仓储业	33,799,445.68	0.41
G	信息技术业	374,751,591.31	4.49
H	批发和零售贸易	166,583,530.50	2.00
I	金融、保险业	1,576,258,957.91	18.90
J	房地产业	740,285,014.98	8.88
K	社会服务业	145,809,399.75	1.75
L	传播与文化产业	104,990,096.85	1.26
M	综合类	124,432,699.70	1.49
	合计	6,725,538,454.69	80.65

### 8.3 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	600016	民生银行	76,999,917	605,219,347.62	7.26
2	601166	兴业银行	18,216,077	304,026,325.13	3.65
3	600887	伊利股份	11,374,204	250,005,003.92	3.00
4	000002	万科 A	21,593,521	218,526,432.52	2.62
5	600519	贵州茅台	1,026,755	214,612,330.10	2.57
6	600048	保利地产	13,441,352	182,802,387.20	2.19
7	600036	招商银行	12,796,705	175,954,693.75	2.11
8	600837	海通证券	10,614,468	108,798,297.00	1.30
9	600805	悦达投资	8,252,756	98,207,796.40	1.18
10	000776	广发证券	6,049,872	93,289,026.24	1.12

11	601601	中国太保	4,063,327	91,424,857.50	1.10
12	600348	阳泉煤业	6,099,899	88,631,532.47	1.06
13	600863	内蒙华电	11,661,399	87,460,492.50	1.05
14	601886	江河幕墙	3,606,575	78,623,335.00	0.94
15	600582	天地科技	6,469,443	73,428,178.05	0.88
16	601800	中国交建	13,820,870	73,250,611.00	0.88
17	000625	长安汽车	10,870,850	72,291,152.50	0.87
18	002415	海康威视	2,319,390	72,156,222.90	0.87
19	600208	新湖中宝	16,484,669	71,048,923.39	0.85
20	002475	立讯精密	2,551,082	70,613,949.76	0.85
21	600079	人福医药	2,858,432	66,858,724.48	0.80
22	600256	广汇能源	4,000,000	65,560,000.00	0.79
23	600780	通宝能源	9,693,667	64,947,568.90	0.78
24	600406	国电南瑞	4,038,705	64,740,441.15	0.78
25	002385	大北农	2,849,384	61,546,694.40	0.74
26	000669	*ST 领先	2,115,611	61,458,499.55	0.74
27	000100	TCL 集团	27,750,206	60,772,951.14	0.73
28	000651	格力电器	2,382,934	60,764,817.00	0.73
29	000562	宏源证券	3,600,000	59,790,000.00	0.72
30	300146	汤臣倍健	1,027,119	59,778,325.80	0.72
31	000783	长江证券	6,299,838	59,218,477.20	0.71
32	002431	棕榈园林	2,568,025	59,064,575.00	0.71
33	601669	中国水电	15,189,350	58,023,317.00	0.70
34	002236	大华股份	1,233,107	57,154,509.45	0.69
35	000895	双汇发展	964,793	55,861,514.70	0.67
36	600547	山东黄金	1,399,871	53,419,077.36	0.64
37	600549	厦门钨业	1,361,328	53,064,565.44	0.64
38	600572	康恩贝	5,400,912	52,658,892.00	0.63
39	002304	洋河股份	538,893	50,316,439.41	0.60
40	600557	康缘药业	2,413,554	50,201,923.20	0.60
41	300027	华谊兄弟	3,459,635	49,299,798.75	0.59
42	600011	华能国际	6,701,215	47,846,675.10	0.57
43	600509	天富热电	5,820,401	47,028,840.08	0.56
44	002344	海宁皮城	1,707,997	45,398,560.26	0.54
45	002219	独一味	3,186,344	45,246,084.80	0.54
46	000581	威孚高科	1,319,100	42,079,290.00	0.50
47	600886	国投电力	7,076,003	40,757,777.28	0.49

48	000718	苏宁环球	5,132,672	40,702,088.96	0.49
49	600060	海信电器	3,998,764	40,427,504.04	0.48
50	000789	江西水泥	3,102,501	38,315,887.35	0.46
51	600157	永泰能源	3,999,856	37,638,644.96	0.45
52	000069	华侨城 A	5,000,000	37,500,000.00	0.45
53	000402	金融街	5,499,976	37,124,838.00	0.45
54	600585	海螺水泥	1,999,927	36,898,653.15	0.44
55	002378	章源钨业	1,499,843	36,536,175.48	0.44
56	002662	京威股份	4,312,806	36,443,210.70	0.44
57	000527	美的电器	3,756,080	36,396,415.20	0.44
58	600694	大商股份	1,015,400	35,813,158.00	0.43
59	002065	东华软件	2,489,782	35,006,334.92	0.42
60	002299	圣农发展	3,256,619	34,780,690.92	0.42
61	601006	大秦铁路	4,999,918	33,799,445.68	0.41
62	000728	国元证券	2,999,902	33,418,908.28	0.40
63	000800	一汽轿车	3,999,747	33,277,895.04	0.40
64	600104	上汽集团	1,869,871	32,984,524.44	0.40
65	300170	汉得信息	1,934,655	32,579,590.20	0.39
66	600239	云南城投	3,705,205	32,050,023.25	0.38
67	600809	山西汾酒	749,847	31,238,626.02	0.37
68	600880	博瑞传播	3,206,549	30,911,132.36	0.37
69	600266	北京城建	2,019,869	30,075,849.41	0.36
70	002063	远光软件	1,999,873	29,318,138.18	0.35
71	002106	莱宝高科	1,844,131	28,233,645.61	0.34
72	600479	千金药业	2,325,180	27,902,160.00	0.33
73	000826	桑德环境	1,206,847	27,745,412.53	0.33
74	002271	东方雨虹	1,799,890	27,448,322.50	0.33
75	600316	洪都航空	2,000,000	27,440,000.00	0.33
76	600188	兖州煤业	1,499,913	27,343,413.99	0.33
77	002572	索菲亚	1,093,268	27,331,700.00	0.33
78	300295	三六五网	495,162	26,689,231.80	0.32
79	000807	云铝股份	4,999,847	26,349,193.69	0.32
80	002422	科伦药业	466,251	26,119,381.02	0.31
81	601668	中国建筑	6,499,984	25,349,937.60	0.30
82	600064	南京高科	2,000,000	24,340,000.00	0.29
83	002649	博彦科技	1,515,181	24,076,226.09	0.29
84	600581	八一钢铁	3,999,953	23,719,721.29	0.28

85	600062	华润双鹤	1,033,801	23,467,282.70	0.28
86	600795	国电电力	8,119,999	21,355,597.37	0.26
87	601588	北辰实业	6,884,745	20,998,472.25	0.25
88	000417	合肥百货	2,794,631	19,534,470.69	0.23
89	002400	省广股份	840,000	19,412,400.00	0.23
90	000538	云南白药	279,994	19,039,592.00	0.23
91	000973	佛塑科技	4,564,682	18,943,430.30	0.23
92	002436	兴森科技	1,233,527	18,872,963.10	0.23
93	000888	峨眉山 A	957,813	18,485,790.90	0.22
94	300128	锦富新材	936,775	18,416,996.50	0.22
95	000430	张家界	1,974,672	18,384,196.32	0.22
96	600587	新华医疗	580,000	18,043,800.00	0.22
97	601678	滨化股份	1,799,890	17,944,903.30	0.22
98	601098	中南传媒	1,999,971	17,879,740.74	0.21
99	600643	爱建股份	2,249,854	17,841,342.22	0.21
100	000848	承德露露	1,300,000	17,823,000.00	0.21
101	000543	皖能电力	2,299,857	17,593,906.05	0.21
102	002155	辰州矿业	859,905	17,266,892.40	0.21
103	600376	首开股份	1,300,000	17,056,000.00	0.20
104	600267	海正药业	1,123,871	16,734,439.19	0.20
105	000063	中兴通讯	1,699,994	16,574,941.50	0.20
106	600612	老凤祥	768,000	16,550,400.00	0.20
107	600392	*ST 天成	1,000,000	16,470,000.00	0.20
108	600546	山煤国际	804,560	16,372,796.00	0.20
109	300258	精锻科技	999,832	15,787,347.28	0.19
110	002176	江特电机	2,000,000	15,360,000.00	0.18
111	600729	重庆百货	600,000	15,354,000.00	0.18
112	300315	掌趣科技	547,266	14,951,307.12	0.18
113	000999	华润三九	599,897	14,217,558.90	0.17
114	600123	兰花科创	680,000	13,797,200.00	0.17
115	002325	洪涛股份	899,924	13,768,837.20	0.17
116	002024	苏宁电器	2,028,307	13,488,241.55	0.16
117	600830	香溢融通	2,000,000	13,400,000.00	0.16
118	600690	青岛海尔	1,000,000	13,400,000.00	0.16
119	002108	沧州明珠	1,714,719	13,237,630.68	0.16
120	600750	江中药业	635,215	12,526,439.80	0.15
121	002635	安洁科技	265,924	12,493,109.52	0.15

122	002123	荣信股份	1,419,910	12,296,420.60	0.15
123	002008	大族激光	1,500,000	12,270,000.00	0.15
124	300229	拓尔思	873,986	12,026,047.36	0.14
125	600283	钱江水利	1,340,538	11,957,598.96	0.14
126	000869	张裕 A	249,093	11,707,371.00	0.14
127	000779	三毛派神	1,509,140	11,605,286.60	0.14
128	600498	烽火通信	500,000	11,380,000.00	0.14
129	002029	七匹狼	602,654	11,378,107.52	0.14
130	300070	碧水源	280,000	11,228,000.00	0.13
131	600739	辽宁成大	740,000	11,092,600.00	0.13
132	002376	新北洋	673,304	10,927,723.92	0.13
133	300257	开山股份	316,400	10,915,800.00	0.13
134	002033	丽江旅游	600,000	10,860,000.00	0.13
135	002104	恒宝股份	1,150,000	10,683,500.00	0.13
136	000969	安泰科技	1,000,000	10,560,000.00	0.13
137	000630	铜陵有色	549,174	10,379,388.60	0.12
138	002273	水晶光电	500,000	10,365,000.00	0.12
139	600000	浦发银行	1,000,000	9,920,000.00	0.12
140	300197	铁汉生态	299,814	9,833,899.20	0.12
141	600859	王府井	400,000	9,584,000.00	0.11
142	002138	顺络电子	747,700	9,488,313.00	0.11
143	601318	中国平安	199,993	9,057,682.97	0.11
144	002014	永新股份	896,897	9,040,721.76	0.11
145	002341	新纶科技	899,922	8,909,227.80	0.11
146	601398	工商银行	2,000,000	8,300,000.00	0.10
147	600635	大众公用	2,000,000	8,280,000.00	0.10
148	000559	万向钱潮	1,811,688	8,134,479.12	0.10
149	002327	富安娜	239,933	7,917,789.00	0.09
150	300122	智飞生物	234,803	7,795,459.60	0.09
151	002661	克明面业	226,500	7,202,700.00	0.09
152	600993	马应龙	499,905	7,008,668.10	0.08
153	002154	报喜鸟	700,000	6,986,000.00	0.08
154	300058	蓝色光标	299,975	6,899,425.00	0.08
155	600900	长江电力	999,904	6,869,340.48	0.08
156	300165	天瑞仪器	572,270	6,781,399.50	0.08
157	300298	三诺生物	109,903	6,220,509.80	0.07
158	002230	科大讯飞	200,000	6,060,000.00	0.07

159	600995	文山电力	1,089,821	6,059,404.76	0.07
160	600177	雅戈尔	700,000	5,530,000.00	0.07
161	000422	湖北宜化	487,842	5,419,924.62	0.06
162	002408	齐翔腾达	299,960	5,027,329.60	0.06
163	600594	益佰制药	233,080	4,663,930.80	0.06
164	600362	江西铜业	181,800	4,337,748.00	0.05
165	600517	置信电气	300,000	4,140,000.00	0.05
166	300115	长盈精密	150,000	4,017,000.00	0.05
167	600559	老白干酒	100,000	3,699,000.00	0.04
168	300285	国瓷材料	105,602	3,589,411.98	0.04
169	002656	卡奴迪路	65,000	2,918,500.00	0.03
170	300066	三川股份	271,570	2,422,404.40	0.03
171	601888	中国国旅	80,000	2,193,600.00	0.03
172	002444	巨星科技	20,000	197,400.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	137,670,946.37	1.69
2	000562	宏源证券	133,399,192.82	1.64
3	600805	悦达投资	118,078,978.69	1.45
4	601601	中国太保	106,541,207.08	1.31
5	600837	海通证券	105,865,874.07	1.30
6	601318	中国平安	101,394,353.58	1.24
7	000783	长江证券	98,739,010.62	1.21
8	002431	棕榈园林	90,030,698.81	1.10
9	600208	新潮中宝	86,614,758.59	1.06
10	002299	圣农发展	85,623,299.85	1.05
11	600863	内蒙华电	82,614,543.42	1.01
12	000069	华侨城 A	73,634,279.17	0.90
13	600048	保利地产	70,382,472.65	0.86
14	000858	五粮液	70,325,954.66	0.86
15	600406	国电南瑞	69,852,202.60	0.86
16	002475	立讯精密	68,629,226.06	0.84
17	002106	莱宝高科	66,986,574.92	0.82
18	600031	三一重工	64,664,856.56	0.79

19	601886	江河幕墙	64,571,736.08	0.79
20	601800	中国交建	64,386,280.98	0.79

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002304	洋河股份	374,920,407.99	4.60
2	600036	招商银行	355,160,641.37	4.36
3	000559	万向钱潮	153,910,551.68	1.89
4	000858	五粮液	134,109,143.45	1.65
5	000009	中国宝安	131,527,325.34	1.61
6	601117	中国化学	130,702,056.72	1.60
7	000540	中天城投	124,260,902.14	1.52
8	600498	烽火通信	123,653,911.16	1.52
9	000776	广发证券	111,475,582.73	1.37
10	600256	广汇能源	109,156,253.58	1.34
11	002146	荣盛发展	107,412,279.54	1.32
12	600104	上汽集团	103,907,471.20	1.28
13	000063	中兴通讯	103,258,144.63	1.27
14	000562	宏源证券	98,291,482.12	1.21
15	000718	苏宁环球	90,390,538.22	1.11
16	601318	中国平安	77,721,346.34	0.95
17	000969	安泰科技	77,371,650.61	0.95
18	000527	美的电器	77,036,665.22	0.95
19	600157	永泰能源	74,414,885.41	0.91
20	600383	金地集团	64,108,804.32	0.79

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,304,228,488.65
卖出股票收入（成交）总额	6,771,314,036.46

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	90,036,968.00	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	329,465,000.00	3.95
	其中：政策性金融债	329,465,000.00	3.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	101,798,504.89	1.22
8	其他	-	-
9	合计	521,300,472.89	6.25

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120228	12 国开 28	2,500,000	249,425,000.00	2.99
2	113002	工行转债	822,850	90,167,903.00	1.08
3	019202	12 国债 02	900,000	90,036,000.00	1.08
4	120405	12 农发 05	800,000	80,040,000.00	0.96
5	126729	燕京转债	55,133	5,614,524.19	0.07

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	2,000,000.00
2	应收证券清算款	653,848,710.32
3	应收股利	-
4	应收利息	8,618,931.03
5	应收申购款	357,777.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	664,825,419.16

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	90,167,903.00	1.08
2	126729	燕京转债	5,614,524.19	0.07
3	110011	歌华转债	5,298,376.50	0.06
4	110007	博汇转债	717,701.20	0.01

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	218,526,432.52	2.62	筹划重大事项

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
645,943	17,469.34	84,243,524.00	0.75%	11,199,955,663.34	99.25%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华夏基金管理有限公司	50,000,000	14.50%
2	陕西信托解放路证券营业部	3,696,662	1.07%
3	刘勇	1,609,707	0.47%
4	刘秀云	1,429,256	0.41%
5	何均华	1,060,500	0.31%
6	徐启英	1,049,000	0.30%
7	李萍	1,000,000	0.29%
8	张志发	997,600	0.29%
9	张平	969,717	0.28%
10	邓冶良	871,306	0.25%

## 9.3 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	46,595.36	0.00%

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 0 至 10 万份（含）；本基金的基金经理未持有本基金份额。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月24日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	11,807,968,148.59
本报告期基金总申购份额	232,259,582.17
减：本报告期基金总赎回份额	756,028,543.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,284,199,187.34

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

基金托管人交通银行，于 2012 年 5 月 28 日发布《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，谷娜莎同志不再担任交通银行资产托管部总经理职务；于 2012 年 5 月 30 日发布《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，由刘树军同志担任资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 110,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	2,625,698,739.85	20.28%	2,265,054.99	21.17%	-
东吴证券	1	1,581,542,658.57	12.21%	1,431,065.11	13.38%	-
东方证券	1	1,449,420,228.92	11.19%	1,232,004.71	11.52%	-
广发证券	1	1,695,620,647.17	13.10%	1,062,372.99	9.93%	-

中金公司	1	1,127,807,529.35	8.71%	964,313.71	9.01%	-
中信建投证券	1	1,069,867,545.42	8.26%	933,995.35	8.73%	-
光大证券	1	1,010,207,309.46	7.80%	821,792.17	7.68%	-
中国银河证券	1	1,004,487,437.11	7.76%	818,531.12	7.65%	-
华泰证券	1	642,217,614.17	4.96%	554,172.02	5.18%	-
申银万国证券	1	397,464,207.46	3.07%	322,941.91	3.02%	-
招商证券	1	225,636,275.91	1.74%	191,789.36	1.79%	-
国泰君安证券	1	117,963,098.59	0.91%	100,268.62	0.94%	-

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，本基金还选择了长江证券、国信证券、国元证券、华宝证券、民族证券、齐鲁证券和西部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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
长城证券	5,853,160.46	100.00%	-	-

东吴证券	-	-	5,590,000,000.00	39.54%
东方证券	-	-	1,323,800,000.00	9.36%
中金公司	-	-	1,650,000,000.00	11.67%
中信建投证券	-	-	4,280,000,000.00	30.27%
华泰证券	-	-	1,193,600,000.00	8.44%
招商证券	-	-	100,000,000.00	0.71%

## 11.8 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华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-02
2	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
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-23
4	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
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	2012-04-21
6	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
7	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
8	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
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-30
10	华夏基金管理有限公司关于设立上海联洋投资理财中心暨上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-07-17
11	华夏基金管理有限公司关于调整中国农业银行金穗借记卡基金电子交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-09-18
12	华夏基金管理有限公司关于设立北京朝外大街投资理财中心的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-09-25
13	华夏基金管理有限公司关于设立青岛	中国证监会指定	2012-11-08

	分公司的公告	报刊及网站	
14	华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-22
15	关于华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-24
16	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银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-11-30
17	华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-12-28
18	华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-12-31

## §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兴科转型的文件；

12.1.2 《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

12.1.3 《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）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

二〇一三年三月二十八日