

# 华夏红利混合型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 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：二〇一三年八月二十六日

## §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 2013 年 8 月 22 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 2013 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.....	10
§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.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	43
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.....	43
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.10 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
§11 备查文件目录.....	47

## §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	11,876,730,941.54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	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	234,803,527.89
本期利润	258,221,991.02
加权平均基金份额本期利润	0.0210
本期加权平均净值利润率	1.42%
本期基金份额净值增长率	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-1,417,416,067.36
期末可供分配基金份额利润	-0.1193
期末基金资产净值	16,715,949,889.47
期末基金份额净值	1.407
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	435.27%

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

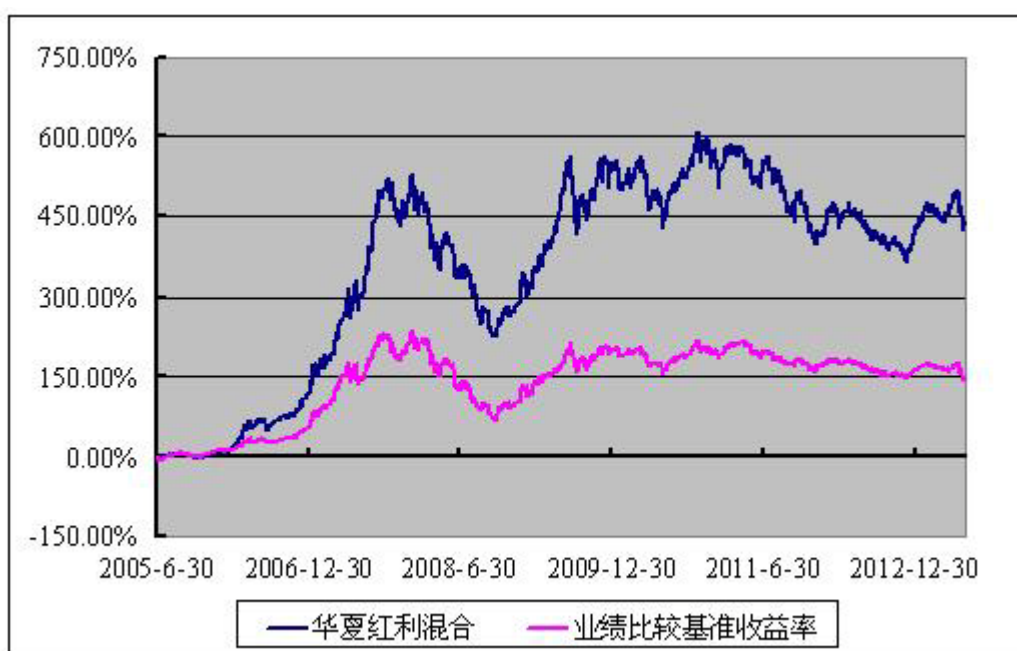
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-10.21%	1.58%	-9.82%	0.98%	-0.39%	0.60%
过去三个月	-3.10%	1.17%	-7.76%	0.76%	4.66%	0.41%
过去六个月	1.08%	1.13%	-7.76%	0.72%	8.84%	0.41%
过去一年	-0.50%	1.02%	-8.65%	0.68%	8.15%	0.34%
过去三年	-1.52%	1.14%	-4.94%	0.75%	3.42%	0.39%
自基金合同生效起至今	435.27%	1.45%	144.78%	1.20%	290.49%	0.25%

#### 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 2013 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、广州和青岛设有分公司，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、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。

2013 年上半年，市场大幅波动，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，公司旗下所有主动管理的股票和混合型基金收益均战胜沪深 300 指数，货币型基金表现持续良好。

2013 年上半年，在《证券时报》主办的“2012 年度中国基金业明星基金奖”的评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖；在《上海证券报》主办的第十届中国“金基金”奖的评选中，华夏基金荣获“金基金十年·卓越公司奖”；在《中国证券报》主办的“第十届中国基金业金牛奖”的评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司奖”，所管理的基金荣获 4 个单项奖；在晨星（中国）举办的“晨星（中国）2013 年度基金奖”评选中，华夏回报混合荣获“混合型基金奖”。

在客户服务方面，上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高服务质量：（1）升级了货币基金的快速赎回业务：扩充了支持银行卡的范围，延长了业务办理时间；（2）推出了货币基金“还贷款”及信用卡还款业务，推出了直销网上交易“跨行随意取”业务，开通了支付宝交易渠道，方便投资者进行现金管理；（3）直销网上交易新增了中国建设银行储蓄卡的“快易付”功能，并增加多家银行卡的电子交易业务，提高投资者的交易效率；（4）开通了华夏基金微信公众平台，满足投资者服务渠道多样化的需求。

#### 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	-	10 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	-	16年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券资产管理中心投资经理、长城证券投资银行部项目经理、鹏华基金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	-	12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,大鹏证券研究员,渤海证券投资经理,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。

③根据本基金管理人于 2013 年 8 月 3 日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘华夏红利混合型证券投资基金基金经理的公告》，增聘贺振华先生为本基金基金经理。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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，本基金出现 3 次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，为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和本基金发生的反向交易。

#### 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

2013 年上半年，国际方面，美国经济基本面好转，美联储延续了量化宽松政策，但退出信号越来越明确，资本开始从新兴市场向发达国家回流，发达国家股市表现强势，新兴市场则承受较大压力，黄金、铜等大宗商品价格也出现较大跌幅。国内方面，经济在经历了 2012 年 4 季度短期企稳反弹后，开始重新放缓，显示出内生动力不足，仍处于“减速—企稳”交替出现的阶段。流动性总体从宽松趋向收紧，特别是 6 月份因银行间市场监管升级、外汇占款下降等因素出现了

“紧急刹车”。市场方面，A 股整体进一步下跌，但结构分化明显，沪深 300 指数大幅下跌，创业板上涨较多，成长股明显跑赢周期股。

报告期内，本基金保持中等仓位运作，在市场反弹过程中，持续降低银行、地产等周期性行业权重，重点投资于医药、信息技术、公用事业等在经济转型时期受益的板块，取得了一定的投资效果，但对创业板、主题板块等参与有限，影响了整体业绩。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.407 元，本报告期份额净值增长率为 1.08%，同期业绩比较基准增长率为-7.76%。

#### 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，出口和房地产投资减速，制造业产能过剩并未解决，经济下行的压力仍然存在；货币政策趋紧，资本流出新兴市场的预期持续存在，下半年的流动性状况将弱于上半年。周期股已较便宜，估值收缩过程或已结束，但在经济下行趋势下，业绩受损的压力并未结束，而代表转型方向的中小盘股票估值偏贵，也存在回调压力。基于上述判断，预计下半年市场仍然缺乏系统性机会，只有结构性、个股的机会。

尽管存在诸多困难，但在经济转型和新一届政府改革的大背景下，符合改革方向、治理结构良好、管理团队优秀的企业仍会获得巨大成功。本基金将在整体谨慎的前提下，以合理价格投资此类优秀个股。

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

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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,029,116,933.11	2,148,442,075.03
结算备付金		32,918,404.76	8,423,561.29
存出保证金		3,897,779.88	1,750,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	14,642,223,525.70	15,998,951,985.82
其中：股票投资		13,369,057,310.08	13,793,057,032.75
基金投资		-	-
债券投资		1,273,166,215.62	2,205,894,953.07
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	100,000,270.00	48,500,144.25
应收证券清算款		116,022.97	26,559,051.19
应收利息	6.4.7.5	19,577,372.61	28,878,523.98
应收股利		17,209,296.55	-
应收申购款		2,648,888.91	8,838,028.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,847,708,494.49	18,270,343,370.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	400,000,000.00
应付证券清算款		12,620,474.85	92,777,618.56
应付赎回款		15,273,548.08	21,967,335.17
应付管理人报酬		21,776,483.73	21,053,997.96
应付托管费		3,629,413.96	3,508,999.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	76,223,943.29	64,036,720.11
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		-	333,015.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	1,985,165.51	2,181,789.53
负债合计		131,758,605.02	606,109,051.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	11,876,730,941.54	12,686,414,898.86
未分配利润	6.4.7.10	4,839,218,947.93	4,977,819,419.67
所有者权益合计		16,715,949,889.47	17,664,234,318.53
负债和所有者权益总计		16,847,708,494.49	18,270,343,370.13

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.407 元，基金份额总额 11,876,730,941.54 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		458,658,741.72	802,168,579.50
1.利息收入		31,114,562.87	27,134,898.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,994,424.59	5,872,542.59
债券利息收入		18,678,332.11	18,573,708.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,441,806.17	2,688,647.50
其他利息收入		-	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）		401,572,266.01	-606,216,937.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	254,207,382.34	-745,480,062.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,509,262.96	6,634,318.10
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	141,855,620.71	132,628,807.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	23,418,463.13	1,379,991,641.58
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	2,553,449.71	1,258,976.40
<b>减：二、费用</b>		200,436,750.70	185,907,977.33
1.管理人报酬		134,962,099.44	136,059,366.81

2.托管费		22,493,683.21	22,676,561.10
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	41,302,560.52	26,688,625.22
5.利息支出		1,459,010.22	263,309.84
其中：卖出回购金融资产支出		1,459,010.22	263,309.84
6.其他费用	6.4.7.19	219,397.31	220,114.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		258,221,991.02	616,260,602.17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		258,221,991.02	616,260,602.17

### 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	12,686,414,898.86	4,977,819,419.67	17,664,234,318.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	258,221,991.02	258,221,991.02
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）	-809,683,957.32	-396,822,462.76	-1,206,506,420.08
其中：1.基金申购款	568,380,615.71	267,720,232.40	836,100,848.11
2.基金赎回款	-1,378,064,573.03	-664,542,695.16	-2,042,607,268.19
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）	11,876,730,941.54	4,839,218,947.93	16,715,949,889.47
项目	上年度可比期间 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）	12,440,689,053.94	4,545,756,777.86	16,986,445,831.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	616,260,602.17	616,260,602.17

润)			
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

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：

<u>王东明</u>	<u>崔雁巍</u>	<u>崔雁巍</u>
基金管理人负责人	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 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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]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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。自 2013 年 1 月 1 日起，基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。
- 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	2,029,116,933.11
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,029,116,933.11

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	14,376,419,923.83	13,369,057,310.08	-1,007,362,613.75	
债券	交易所市场	692,714,582.64	704,280,215.62	11,565,632.98
	银行间市场	569,322,991.01	568,886,000.00	-436,991.01
	合计	1,262,037,573.65	1,273,166,215.62	11,128,641.97
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	15,638,457,497.48	14,642,223,525.70	-996,233,971.78
----	-------------------	-------------------	-----------------

#### 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 2013 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	100,000,270.00	-
合计	100,000,270.00	-

##### 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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	368,064.25
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	14,813.30
应收债券利息	18,940,479.34
应收买入返售证券利息	252,261.72
应收申购款利息	-
其他	1,754.00
合计	19,577,372.61

#### 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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	76,215,819.04
银行间市场应付交易费用	8,124.25

合计	76,223,943.29
----	---------------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00
应付赎回费	57,562.20
预提费用	177,603.31
合计	1,985,165.51

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,686,414,898.86	12,686,414,898.86
本期申购	568,380,615.71	568,380,615.71
本期赎回（以“-”号填列）	-1,378,064,573.03	-1,378,064,573.03
本期末	11,876,730,941.54	11,876,730,941.54

#### 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	-1,752,550,194.57	6,730,369,614.24	4,977,819,419.67
本期利润	234,803,527.89	23,418,463.13	258,221,991.02
本期基金份额交易产生的变动数	100,330,599.32	-497,153,062.08	-396,822,462.76
其中：基金申购款	-71,898,410.84	339,618,643.24	267,720,232.40
基金赎回款	172,229,010.16	-836,771,705.32	-664,542,695.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,417,416,067.36	6,256,635,015.29	4,839,218,947.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,729,489.38
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	241,328.77
其他	23,606.44
合计	8,994,424.59

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,563,529,295.40
减：卖出股票成本总额	14,309,321,913.06
买卖股票差价收入	254,207,382.34

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,383,979,381.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,356,072,014.27
减：应收利息总额	22,398,103.88
债券投资收益	5,509,262.96

#### 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	141,855,620.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	141,855,620.71

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	23,418,463.13
——股票投资	12,514,180.32

——债券投资	10,904,282.81
——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	23,418,463.13

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,553,449.71
合计	2,553,449.71

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	41,290,635.52
银行间市场交易费用	11,925.00
合计	41,302,560.52

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	119,014.74
银行费用	32,394.00
银行间账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	219,397.31

#### 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

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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%

##### 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 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	1,854,151.98	12.66%	1,866,151.98	2.62%

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	134,962,099.44	136,059,366.81
其中：支付销售机构的客户维护费	22,076,230.34	21,678,403.57

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 2013 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至
----	-----------------------	----------------------------

	2013 年 6 月 30 日	2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,493,683.21	22,676,561.10

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

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	2,029,116,933.11	8,729,489.38	1,083,157,855.05	5,697,826.19

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（2013 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
000562	宏源证券	2012-06-28	2013-07-04	非公开发行流通受限	13.22	8.79	12,000,000	158,640,000.00	105,480,000.00	-
000562	宏源证券	-	2013-07-04	非公开发行转增	-	8.79	12,000,000	-	105,480,000.00	-
000801	四川九洲	2012-07-19	2013-07-23	非公开发行流通受限	6.20	9.39	9,800,000	60,760,000.00	92,022,000.00	-
002106	莱宝高科	2013-03-18	2014-03-19	非公开发行流通受限	16.52	15.35	4,500,000	74,340,000.00	69,075,000.00	-

注：本基金持有的非公开发行股票宏源证券，于 2013 年 6 月 19 日实施 2012 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 6.00 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 12,000,000 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
300027	华谊兄弟	2013-06-05	拟披露重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	4,028,234	87,754,251.70	115,006,080.70	-
300086	康芝药业	2013-05-23	停牌核查媒体报道	14.73	2013-07-23	14.00	4,944,546	68,273,244.47	72,833,162.58	-
600436	片仔癀	2013-06-21	配股事项	136.82	2013-07-01	118.73	343,918	20,217,241.13	47,054,860.76	-
300056	三维丝	2013-05-10	筹划重大资产重组事项	14.60	2013-07-11	16.02	2,613,946	35,822,918.38	38,163,611.60	-
601918	国投新集	2013-05-16	控股股东筹划重大资产重组事项	7.55	2013-08-23	5.05	5,000,000	50,659,956.40	37,750,000.00	-
300166	东方国信	2013-05-20	筹划向特定对象发行股份购买资产事宜	16.45	2013-08-02	18.10	1,902,025	28,777,074.32	31,288,311.25	-
600547	山东黄金	2013-04-03	筹划重大	32.13	2013-07-01	28.77	851,597	33,748,221.05	27,361,811.61	-

			资产重组事项								
600688	S 上石化	2013-06-28	刊登重要公告	8.19	2013-08-20	4.90	2,184,312	23,805,441.37	17,889,515.28	-	
000600	建投能源	2013-05-20	筹划重大资产重组事项	4.07	2013-07-15	4.31	3,794,185	22,868,530.58	15,442,332.95	-	
600088	中视传媒	2013-05-30	筹划重大资产重组事项	14.29	-	-	785,505	10,471,779.28	11,224,866.45	-	
000665	湖北广电	2013-03-26	筹划重大资产重组事项	10.53	2013-07-12	11.58	657,700	7,998,795.85	6,925,581.00	-	
000719	大地传媒	2013-05-17	筹划重大资产重组事项	9.61	2013-08-12	10.57	710,100	7,998,078.67	6,824,061.00	-	
000999	华润三九	2013-06-03	筹划重大资产重组事项	26.55	2013-08-19	26.51	252,900	6,324,992.69	6,714,495.00	-	
601989	中国重工	2013-05-17	控股股东筹划重大事项	4.52	-	-	1,223,564	6,153,820.03	5,530,509.28	-	
002252	上海莱士	2013-03-26	筹划重大资产重组事项	21.00	2013-07-02	22.80	90,008	1,791,924.24	1,890,168.00	-	
002390	信邦制药	2013-05-31	筹划重大资产重组事项	17.13	-	-	8,900	138,710.94	152,457.00	-	

#### 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 2013 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 2013 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 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	2,029,116,933.11	-	-	2,029,116,933.11
结算备付金	32,918,404.76	-	-	32,918,404.76
结算保证金	3,897,779.88	-	-	3,897,779.88
债券投资	1,273,166,215.62	-	-	1,273,166,215.62
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	100,000,270.00
应收直销申购款	189,294.81	-	-	189,294.81
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	2,148,442,075.03	-	-	2,148,442,075.03
结算备付金	8,423,561.29	-	-	8,423,561.29
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	1,620,653,953.07	-	585,241,000.00	2,205,894,953.07
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	48,500,144.25	-	-	48,500,144.25
应收直销申购款	620,036.59	-	-	620,036.59
卖出回购金融资产款	400,000,000.00	-	-	400,000,000.00

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 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	利率下降 25 个基点	3,355,680.22	17,357,481.50

	利率上升 25 个基点	-3,326,532.67	-17,059,994.51
--	-------------	---------------	----------------

#### 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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	13,369,057,310.08	79.98	13,793,057,032.75	78.08
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	13,369,057,310.08	79.98	13,793,057,032.75	78.08

##### 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 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	+5%	537,035,032.15	663,652,939.13
	-5%	-537,035,032.15	-663,652,939.13

#### 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 2013 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 13,694,566,030.70 元，第二层级的余额为 947,657,495.00 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2012 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 14,581,894,902.71 元，第二层级的余额为 1,417,057,083.11 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。

#### 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	13,369,057,310.08	79.35

	其中：股票	13,369,057,310.08	79.35
2	固定收益投资	1,273,166,215.62	7.56
	其中：债券	1,273,166,215.62	7.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,270.00	0.59
	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	2,062,035,337.87	12.24
6	其他各项资产	43,449,360.92	0.26
7	合计	16,847,708,494.49	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	81,997,555.70	0.49
B	采矿业	269,327,484.28	1.61
C	制造业	7,709,825,058.57	46.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	636,685,890.81	3.81
E	建筑业	54,076,989.56	0.32
F	批发和零售业	569,998,586.27	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	330,171,488.08	1.98
H	住宿和餐饮业	1,541,396.25	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,322,203,963.73	7.91
J	金融业	1,360,456,716.49	8.14
K	房地产业	473,345,020.60	2.83
L	租赁和商务服务业	135,642,021.62	0.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	159,889,354.77	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	175,931,315.23	1.05
S	综合	87,964,468.12	0.53
	合计	13,369,057,310.08	79.98

### 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	600887	伊利股份	11,997,810	375,291,496.80	2.25
2	000400	许继电气	12,488,613	338,191,640.04	2.02
3	600050	中国联通	88,480,733	276,059,886.96	1.65
4	601318	中国平安	7,592,182	263,904,246.32	1.58
5	000527	美的电器	19,430,767	241,330,126.14	1.44
6	601398	工商银行	58,208,510	233,998,210.20	1.40
7	002415	海康威视	6,529,676	230,758,749.84	1.38
8	600690	青岛海尔	20,415,510	222,733,214.10	1.33
9	000562	宏源证券	24,000,000	210,960,000.00	1.26
10	000063	中兴通讯	16,015,678	204,199,894.50	1.22
11	000002	万科 A	19,311,976	190,222,963.60	1.14
12	600518	康美药业	9,744,797	187,392,446.31	1.12
13	600406	国电南瑞	12,220,236	182,448,123.48	1.09
14	600837	海通证券	18,999,910	178,219,155.80	1.07
15	600016	民生银行	19,500,000	167,115,000.00	1.00
16	002219	独一味	8,624,943	165,167,658.45	0.99
17	000100	TCL 集团	71,011,105	161,195,208.35	0.96
18	300273	和佳股份	7,500,000	160,650,000.00	0.96
19	300134	大富科技	13,053,126	159,248,137.20	0.95
20	600505	西昌电力	18,000,000	147,240,000.00	0.88
21	000915	山大华特	6,348,309	143,789,198.85	0.86
22	300137	先河环保	7,485,637	139,831,699.16	0.84
23	600750	江中药业	7,673,971	136,826,902.93	0.82
24	002241	歌尔声学	3,578,534	129,864,998.86	0.78
25	300072	三聚环保	8,024,709	128,796,579.45	0.77
26	600337	美克股份	23,353,919	125,644,084.22	0.75
27	300027	华谊兄弟	4,028,234	115,006,080.70	0.69
28	600713	南京医药	24,738,306	107,364,248.04	0.64
29	300253	卫宁软件	2,627,959	106,695,135.40	0.64
30	601333	广深铁路	44,508,944	102,370,571.20	0.61
31	600795	国电电力	44,241,654	100,870,971.12	0.60
32	000401	冀东水泥	11,398,862	93,698,645.64	0.56
33	000538	云南白药	1,103,433	92,699,406.33	0.55
34	601006	大秦铁路	15,517,874	92,176,171.56	0.55
35	000801	四川九洲	9,800,000	92,022,000.00	0.55



36	002437	誉衡药业	3,597,550	91,989,353.50	0.55
37	300057	万顺股份	6,160,827	88,407,867.45	0.53
38	601328	交通银行	20,936,477	85,211,461.39	0.51
39	600352	浙江龙盛	9,080,846	85,178,335.48	0.51
40	000661	长春高新	849,937	83,217,331.67	0.50
41	000989	九芝堂	7,267,017	80,373,208.02	0.48
42	002106	莱宝高科	4,987,880	76,563,958.00	0.46
43	002353	杰瑞股份	1,109,019	76,522,311.00	0.46
44	002480	新筑股份	4,906,501	76,050,765.50	0.45
45	600108	亚盛集团	11,599,763	75,630,454.76	0.45
46	300086	康芝药业	4,944,546	72,833,162.58	0.44
47	600028	中国石化	17,011,483	71,107,998.94	0.43
48	600998	九州通	6,132,162	71,071,757.58	0.43
49	300024	机器人	1,903,488	70,714,579.20	0.42
50	002089	新海宜	12,619,210	69,027,078.70	0.41
51	000001	平安银行	6,831,938	68,114,421.86	0.41
52	000669	金鸿能源	1,793,305	67,858,661.20	0.41
53	000551	创元科技	10,019,948	67,835,047.96	0.41
54	002194	武汉凡谷	10,005,555	66,837,107.40	0.40
55	600572	康恩贝	6,000,237	66,542,628.33	0.40
56	600289	亿阳信通	9,376,859	66,200,624.54	0.40
57	000895	双汇发展	1,707,142	65,622,538.48	0.39
58	002096	南岭民爆	4,599,778	64,212,900.88	0.38
59	600498	烽火通信	3,876,416	63,883,335.68	0.38
60	600557	康缘药业	2,396,739	63,633,420.45	0.38
61	600642	申能股份	16,715,739	63,519,808.20	0.38
62	600886	国投电力	18,547,322	62,689,948.36	0.38
63	300228	富瑞特装	781,482	62,518,560.00	0.37
64	300312	邦讯技术	3,624,970	61,080,744.50	0.37
65	600582	天地科技	9,428,999	60,534,173.58	0.36
66	600640	号百控股	7,506,803	60,429,764.15	0.36
67	000792	盐湖股份	3,488,170	59,089,599.80	0.35
68	000608	阳光股份	11,568,864	58,654,140.48	0.35
69	002499	科林环保	3,526,215	58,605,693.30	0.35
70	002573	国电清新	3,599,805	58,604,825.40	0.35
71	600287	江苏舜天	9,757,364	56,690,284.84	0.34
72	600705	中航投资	4,000,000	56,040,000.00	0.34

73	002005	德豪润达	5,844,499	54,353,840.70	0.33
74	600967	北方创业	5,287,922	54,042,562.84	0.32
75	300113	顺网科技	1,259,985	53,612,361.75	0.32
76	300105	龙源技术	2,001,786	53,047,329.00	0.32
77	300025	华星创业	7,639,328	52,329,396.80	0.31
78	600251	冠农股份	3,772,043	52,129,634.26	0.31
79	000716	南方食品	4,197,792	51,632,841.60	0.31
80	300287	飞利信	2,273,963	51,550,741.21	0.31
81	600649	城投控股	7,422,206	51,361,665.52	0.31
82	600267	海正药业	4,018,389	51,113,908.08	0.31
83	600388	龙净环保	2,250,978	51,029,671.26	0.31
84	601877	正泰电器	2,556,004	50,711,119.36	0.30
85	600000	浦发银行	6,009,932	49,762,236.96	0.30
86	300038	梅泰诺	5,049,649	49,739,042.65	0.30
87	300075	数字政通	1,754,231	49,644,737.30	0.30
88	600552	方兴科技	3,008,312	49,306,233.68	0.29
89	000088	盐田港	14,737,966	49,077,426.78	0.29
90	002318	久立特材	2,858,266	48,962,096.58	0.29
91	600867	通化东宝	3,246,586	48,341,665.54	0.29
92	600048	保利地产	4,750,945	47,081,864.95	0.28
93	600436	片仔癀	343,918	47,054,860.76	0.28
94	601857	中国石油	6,164,679	46,913,207.19	0.28
95	601166	兴业银行	3,150,000	46,525,500.00	0.28
96	000800	一汽轿车	3,650,000	44,895,000.00	0.27
97	002441	众业达	3,571,663	44,752,937.39	0.27
98	601222	林洋电子	2,954,410	44,138,885.40	0.26
99	002444	巨星科技	3,359,140	43,433,680.20	0.26
100	601808	中海油服	2,951,014	41,579,787.26	0.25
101	600585	海螺水泥	3,099,852	41,476,019.76	0.25
102	600519	贵州茅台	214,883	41,337,042.71	0.25
103	300054	鼎龙股份	2,390,700	41,096,133.00	0.25
104	600875	东方电气	3,814,539	39,366,042.48	0.24
105	000921	海信科龙	5,396,877	39,181,327.02	0.23
106	600850	华东电脑	1,710,612	38,745,361.80	0.23
107	300349	金卡股份	937,554	38,261,578.74	0.23
108	300056	三维丝	2,613,946	38,163,611.60	0.23
109	600559	老白干酒	1,432,536	38,105,457.60	0.23

110	002410	广联达	1,998,272	37,887,237.12	0.23
111	601918	国投新集	5,000,000	37,750,000.00	0.23
112	600538	*ST 国发	8,850,000	36,639,000.00	0.22
113	300059	东方财富	2,672,316	36,209,881.80	0.22
114	600240	华业地产	8,413,780	35,926,840.60	0.21
115	002649	博彦科技	1,449,470	35,874,382.50	0.21
116	600499	科达机电	3,000,000	35,670,000.00	0.21
117	002315	焦点科技	1,002,492	34,886,721.60	0.21
118	600587	新华医疗	828,925	34,350,652.00	0.21
119	600831	广电网络	5,132,308	34,232,494.36	0.20
120	000069	华侨城 A	6,567,896	33,956,022.32	0.20
121	601313	江南嘉捷	4,999,970	33,899,796.60	0.20
122	600761	安徽合力	4,330,542	33,605,005.92	0.20
123	002236	大华股份	862,531	32,974,560.13	0.20
124	002570	贝因美	1,165,869	32,586,038.55	0.19
125	600054	黄山旅游	3,135,754	32,110,120.96	0.19
126	600674	川投能源	3,151,028	32,045,954.76	0.19
127	300152	燃控科技	3,509,971	31,589,739.00	0.19
128	600863	内蒙华电	5,590,000	31,583,500.00	0.19
129	300166	东方国信	1,902,025	31,288,311.25	0.19
130	300182	捷成股份	1,163,873	30,889,189.42	0.18
131	600327	大东方	8,028,590	30,508,642.00	0.18
132	600027	华电国际	9,561,145	30,117,606.75	0.18
133	002440	闰土股份	1,449,342	29,957,899.14	0.18
134	600197	伊力特	3,030,966	29,764,086.12	0.18
135	601727	上海电气	8,653,617	28,903,080.78	0.17
136	002063	远光软件	1,999,931	28,899,002.95	0.17
137	600729	重庆百货	1,448,422	28,055,934.14	0.17
138	600547	山东黄金	851,597	27,361,811.61	0.16
139	600697	欧亚集团	1,480,469	27,225,824.91	0.16
140	600511	国药股份	1,898,221	27,220,489.14	0.16
141	600332	广州药业	794,418	27,216,760.68	0.16
142	000690	宝新能源	5,754,477	26,873,407.59	0.16
143	002643	烟台万润	1,723,983	25,997,663.64	0.16
144	000917	电广传媒	2,199,924	25,893,105.48	0.15
145	300058	蓝色光标	610,602	25,462,103.40	0.15
146	600383	金地集团	3,699,866	25,381,080.76	0.15

147	600269	赣粤高速	8,602,374	25,290,979.56	0.15
148	002450	康得新	899,456	25,166,778.88	0.15
149	002521	齐峰股份	3,483,062	25,147,707.64	0.15
150	000818	方大化工	8,936,143	24,842,477.54	0.15
151	300088	长信科技	1,158,296	24,428,462.64	0.15
152	300334	津膜科技	623,003	24,409,257.54	0.15
153	002054	德美化工	4,059,095	24,192,206.20	0.14
154	600529	山东药玻	2,893,955	24,135,584.70	0.14
155	000024	招商地产	979,947	23,793,113.16	0.14
156	000826	桑德环境	721,605	23,286,193.35	0.14
157	600583	海油工程	3,594,000	23,253,180.00	0.14
158	002123	荣信股份	3,326,374	23,051,771.82	0.14
159	002080	中材科技	1,601,316	22,994,897.76	0.14
160	002148	北纬通信	699,979	22,847,314.56	0.14
161	002007	华兰生物	1,010,756	22,822,870.48	0.14
162	000581	威孚高科	668,250	22,312,867.50	0.13
163	600723	首商股份	3,547,745	22,279,838.60	0.13
164	000061	农产品	3,705,143	22,267,909.43	0.13
165	000725	京东方 A	10,000,000	22,200,000.00	0.13
166	000779	三毛派神	3,100,000	21,979,000.00	0.13
167	600978	宜华木业	4,999,876	21,949,455.64	0.13
168	600309	万华化学	1,368,323	21,920,534.46	0.13
169	002004	华邦颖泰	1,526,340	21,506,130.60	0.13
170	000418	小天鹅 A	3,019,194	21,466,469.34	0.13
171	000697	炼石有色	2,038,311	21,361,499.28	0.13
172	600859	王府井	1,282,680	20,663,974.80	0.12
173	002138	顺络电子	1,142,827	20,570,886.00	0.12
174	600256	广汇能源	1,553,196	20,129,420.16	0.12
175	002018	华星化工	2,805,420	19,273,235.40	0.12
176	600005	武钢股份	8,476,183	18,986,649.92	0.11
177	002238	天威视讯	1,741,669	18,635,858.30	0.11
178	600622	嘉宝集团	3,342,048	18,581,786.88	0.11
179	000090	深天健	2,663,832	18,540,270.72	0.11
180	300272	开能环保	2,035,974	18,405,204.96	0.11
181	000417	合肥百货	3,521,733	18,242,576.94	0.11
182	600688	S 上石化	2,184,312	17,889,515.28	0.11
183	600785	新华百货	1,626,221	17,628,235.64	0.11

184	600510	黑牡丹	3,717,409	17,583,344.57	0.11
185	002698	博实股份	972,295	17,258,236.25	0.10
186	600428	中远航运	5,712,943	17,253,087.86	0.10
187	600495	晋西车轴	1,684,290	17,247,129.60	0.10
188	600637	百视通	600,526	16,814,728.00	0.10
189	600880	博瑞传播	950,000	16,748,500.00	0.10
190	000650	仁和药业	3,403,192	16,573,545.04	0.10
191	002001	新和成	1,089,734	16,062,679.16	0.10
192	600216	浙江医药	780,918	16,024,437.36	0.10
193	002653	海思科	561,805	16,011,442.50	0.10
194	002367	康力电梯	1,392,709	15,584,413.71	0.09
195	000848	承德露露	683,736	15,527,644.56	0.09
196	600858	银座股份	1,971,256	15,474,359.60	0.09
197	002228	合兴包装	2,818,552	15,473,850.48	0.09
198	000600	建投能源	3,794,185	15,442,332.95	0.09
199	002368	太极股份	799,961	15,351,251.59	0.09
200	002551	尚荣医疗	524,015	14,284,648.90	0.09
201	600827	友谊股份	2,076,135	14,263,047.45	0.09
202	000858	五粮液	702,850	14,085,114.00	0.08
203	002496	辉丰股份	1,077,248	13,573,324.80	0.08
204	600125	铁龙物流	2,558,496	13,560,028.80	0.08
205	600315	上海家化	299,895	13,492,276.05	0.08
206	000901	航天科技	1,202,755	13,326,525.40	0.08
207	002223	鱼跃医疗	703,612	13,263,086.20	0.08
208	000961	中南建设	1,349,108	13,194,276.24	0.08
209	300259	新天科技	1,082,820	13,177,919.40	0.08
210	600098	广州发展	2,546,088	12,832,283.52	0.08
211	000027	深圳能源	2,535,927	12,755,712.81	0.08
212	002024	苏宁云商	2,516,719	12,608,762.19	0.08
213	600525	长园集团	1,999,997	12,319,981.52	0.07
214	002358	森源电气	924,065	12,206,898.65	0.07
215	300055	万邦达	298,886	11,686,442.60	0.07
216	601888	中国国旅	399,941	11,678,277.20	0.07
217	600100	同方股份	1,667,829	11,441,306.94	0.07
218	600548	深高速	3,951,080	11,339,599.60	0.07
219	600741	华域汽车	1,442,630	11,252,514.00	0.07
220	600088	中视传媒	785,505	11,224,866.45	0.07

221	000559	万向钱潮	2,061,981	10,825,400.25	0.06
222	300066	三川股份	1,042,156	10,734,206.80	0.06
223	600252	中恒集团	772,859	10,727,282.92	0.06
224	601669	中国水电	3,700,000	10,656,000.00	0.06
225	600676	交运股份	2,758,618	10,648,265.48	0.06
226	600066	宇通客车	570,004	10,448,173.32	0.06
227	600970	中材国际	1,113,136	10,240,851.20	0.06
228	002131	利欧股份	1,186,483	9,966,457.20	0.06
229	600976	武汉健民	447,012	9,655,459.20	0.06
230	300053	欧比特	904,244	9,584,986.40	0.06
231	300147	香雪制药	567,032	9,514,796.96	0.06
232	002277	友阿股份	1,260,691	9,379,541.04	0.06
233	600373	中文传媒	549,631	9,371,208.55	0.06
234	600010	包钢股份	2,274,822	9,326,770.20	0.06
235	300128	锦富新材	451,878	9,037,560.00	0.05
236	002053	云南盐化	1,422,239	8,974,328.09	0.05
237	002181	粤传媒	1,008,035	8,769,904.50	0.05
238	601231	环旭电子	559,195	8,740,217.85	0.05
239	600780	通宝能源	1,518,610	8,625,704.80	0.05
240	000501	鄂武商 A	769,200	8,615,040.00	0.05
241	000876	新希望	861,576	8,486,523.60	0.05
242	002275	桂林三金	541,403	8,370,090.38	0.05
243	000987	广州友谊	944,734	8,096,370.38	0.05
244	000729	燕京啤酒	1,414,697	8,077,919.87	0.05
245	600522	中天科技	947,502	7,996,916.88	0.05
246	000837	秦川发展	1,375,579	7,675,730.82	0.05
247	600420	现代制药	500,000	7,605,000.00	0.05
248	600056	中国医药	452,923	7,423,407.97	0.04
249	000888	峨眉山 A	474,142	7,382,390.94	0.04
250	002042	华孚色纺	1,376,903	7,270,047.84	0.04
251	601158	重庆水务	1,404,770	7,234,565.50	0.04
252	601098	中南传媒	777,000	7,226,100.00	0.04
253	002185	华天科技	926,050	7,158,366.50	0.04
254	000021	长城开发	1,600,000	7,120,000.00	0.04
255	002331	皖通科技	733,467	7,099,960.56	0.04
256	000665	湖北广电	657,700	6,925,581.00	0.04
257	000719	大地传媒	710,100	6,824,061.00	0.04

258	300026	红日药业	200,766	6,813,998.04	0.04
259	002092	中泰化学	1,339,767	6,806,016.36	0.04
260	300083	劲胜股份	398,456	6,757,813.76	0.04
261	600481	双良节能	948,643	6,754,338.16	0.04
262	000999	华润三九	252,900	6,714,495.00	0.04
263	600378	天科股份	746,990	6,595,921.70	0.04
264	600115	东方航空	2,517,749	6,445,437.44	0.04
265	002458	益生股份	794,894	6,367,100.94	0.04
266	601299	中国北车	1,683,601	6,330,339.76	0.04
267	600271	航天信息	475,874	6,291,054.28	0.04
268	000016	深康佳 A	2,082,336	6,288,654.72	0.04
269	600479	千金药业	613,060	6,283,865.00	0.04
270	002690	美亚光电	259,964	6,246,934.92	0.04
271	600161	天坛生物	441,705	6,232,457.55	0.04
272	002013	中航精机	512,894	6,067,536.02	0.04
273	600900	长江电力	856,694	5,928,322.48	0.04
274	600280	南京中商	257,256	5,821,703.28	0.03
275	002028	思源电气	368,493	5,796,394.89	0.03
276	002362	汉王科技	580,071	5,690,496.51	0.03
277	002023	海特高新	497,921	5,616,548.88	0.03
278	601989	中国重工	1,223,564	5,530,509.28	0.03
279	600019	宝钢股份	1,364,833	5,363,793.69	0.03
280	600660	福耀玻璃	711,354	5,114,635.26	0.03
281	300071	华谊嘉信	318,442	5,088,703.16	0.03
282	600408	安泰集团	1,769,385	4,971,971.85	0.03
283	600461	洪城水业	737,022	4,871,715.42	0.03
284	002456	欧菲光	96,219	4,585,797.54	0.03
285	002033	丽江旅游	446,059	4,549,801.80	0.03
286	002371	七星电子	224,508	4,422,807.60	0.03
287	000925	众合机电	500,000	3,970,000.00	0.02
288	002254	泰和新材	620,478	3,933,830.52	0.02
289	002630	华西能源	181,219	3,751,233.30	0.02
290	000911	南宁糖业	630,800	3,702,796.00	0.02
291	002251	步步高	162,995	3,605,449.40	0.02
292	300074	华平股份	192,513	3,484,485.30	0.02
293	000718	苏宁环球	587,450	3,454,206.00	0.02
294	002547	春兴精工	340,080	3,407,601.60	0.02

295	002220	天宝股份	467,500	3,150,950.00	0.02
296	600236	桂冠电力	968,697	3,128,891.31	0.02
297	600742	一汽富维	194,172	2,706,757.68	0.02
298	002419	天虹商场	336,277	2,690,216.00	0.02
299	600379	宝光股份	379,490	2,629,865.70	0.02
300	300336	新文化	67,189	2,604,917.53	0.02
301	600535	天士力	65,874	2,578,967.10	0.02
302	000651	格力电器	97,700	2,448,362.00	0.01
303	600588	用友软件	265,657	2,374,973.58	0.01
304	600409	三友化工	542,277	1,984,733.82	0.01
305	002344	海宁皮城	101,798	1,945,359.78	0.01
306	002252	上海莱士	90,008	1,890,168.00	0.01
307	600600	青岛啤酒	45,518	1,728,773.64	0.01
308	600008	首创股份	258,223	1,647,462.74	0.01
309	600196	复星医药	154,933	1,623,697.84	0.01
310	600754	锦江股份	122,625	1,541,396.25	0.01
311	002701	奥瑞金	54,518	1,537,407.60	0.01
312	600893	航空动力	84,587	1,393,993.76	0.01
313	000656	金科股份	112,512	1,304,014.08	0.01
314	002078	太阳纸业	290,270	1,280,090.70	0.01
315	600151	航天机电	163,791	1,194,036.39	0.01
316	600718	东软集团	143,483	1,167,951.62	0.01
317	000039	中集集团	108,102	1,116,693.66	0.01
318	600470	六国化工	185,956	1,087,842.60	0.01
319	002436	兴森科技	64,197	1,081,719.45	0.01
320	600380	健康元	244,660	1,017,785.60	0.01
321	600221	海南航空	473,750	956,975.00	0.01
322	600320	振华重工	320,950	914,707.50	0.01
323	600879	航天电子	136,102	913,244.42	0.01
324	600664	哈药股份	151,557	900,248.58	0.01
325	002387	黑牛食品	118,400	841,824.00	0.01
326	600396	金山股份	133,332	811,991.88	0.00
327	600026	中海发展	202,528	704,797.44	0.00
328	300006	莱美药业	28,321	623,911.63	0.00
329	600058	五矿发展	55,698	607,108.20	0.00
330	601991	大唐发电	118,103	607,049.42	0.00
331	601988	中国银行	220,876	598,573.96	0.00



332	000012	南玻 A	64,422	597,191.94	0.00
333	002011	盾安环境	50,000	507,000.00	0.00
334	600809	山西汾酒	19,178	469,861.00	0.00
335	600521	华海药业	28,210	430,202.50	0.00
336	600018	上港集团	140,382	348,147.36	0.00
337	600963	岳阳林纸	107,404	292,138.88	0.00
338	600486	扬农化工	7,610	267,263.20	0.00
339	000869	张裕 A	6,421	219,212.94	0.00
340	300115	长盈精密	4,884	156,971.76	0.00
341	002390	信邦制药	8,900	152,457.00	0.00
342	002311	海大集团	11,411	130,770.06	0.00
343	600118	中国卫星	8,112	115,028.16	0.00
344	002391	长青股份	5,800	114,086.00	0.00
345	600261	阳光照明	4,220	53,509.60	0.00
346	600276	恒瑞医药	1,717	45,260.12	0.00
347	000963	华东医药	1,000	39,850.00	0.00
348	000407	胜利股份	5,173	30,313.78	0.00
349	600201	金宇集团	1,000	20,600.00	0.00
350	002192	路翔股份	1,272	17,884.32	0.00
351	600390	金瑞科技	1,000	16,330.00	0.00
352	600826	兰生股份	1,222	13,527.54	0.00
353	000050	深天马 A	1,000	11,730.00	0.00
354	000783	长江证券	1,000	7,910.00	0.00
355	600422	昆明制药	196	5,194.00	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	600837	海通证券	397,094,149.06	2.25
2	002415	海康威视	269,666,084.15	1.53
3	600887	伊利股份	266,199,396.44	1.51
4	601688	华泰证券	256,082,806.50	1.45
5	600048	保利地产	250,758,132.38	1.42
6	600406	国电南瑞	216,689,653.27	1.23
7	600690	青岛海尔	209,004,965.54	1.18
8	000063	中兴通讯	198,340,493.22	1.12

9	000002	万科 A	196,304,252.28	1.11
10	600518	康美药业	189,808,687.39	1.07
11	000024	招商地产	178,061,782.96	1.01
12	300134	大富科技	173,241,573.39	0.98
13	000783	长江证券	169,084,696.83	0.96
14	601288	农业银行	168,119,733.03	0.95
15	600383	金地集团	164,398,246.13	0.93
16	601918	国投新集	156,563,777.21	0.89
17	000401	冀东水泥	155,731,451.71	0.88
18	000100	TCL 集团	151,959,568.96	0.86
19	601788	光大证券	149,992,733.84	0.85
20	600337	美克股份	149,447,733.15	0.85

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	601688	华泰证券	472,802,850.92	2.68
2	000783	长江证券	273,872,718.80	1.55
3	600036	招商银行	240,441,638.52	1.36
4	600048	保利地产	230,604,104.94	1.31
5	600837	海通证券	229,276,517.69	1.30
6	600546	山煤国际	219,704,326.75	1.24
7	600383	金地集团	216,512,338.95	1.23
8	601166	兴业银行	206,509,059.72	1.17
9	000050	深天马 A	197,242,688.15	1.12
10	601288	农业银行	176,820,864.16	1.00
11	600805	悦达投资	171,181,325.81	0.97
12	600028	中国石化	166,439,175.24	0.94
13	000024	招商地产	165,095,749.24	0.93
14	600867	通化东宝	139,383,968.38	0.79
15	000538	云南白药	138,223,495.53	0.78
16	600000	浦发银行	133,625,930.78	0.76
17	600199	金种子酒	131,027,292.32	0.74
18	600276	恒瑞医药	130,278,487.21	0.74

19	600332	广州药业	128,652,688.61	0.73
20	000598	兴蓉投资	127,425,835.79	0.72

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	13,872,808,010.07
卖出股票收入（成交）总额	14,563,529,295.40

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	504,495,000.00	3.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	568,886,000.00	3.40
	其中：政策性金融债	568,886,000.00	3.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	199,785,215.62	1.20
8	其他	-	-
9	合计	1,273,166,215.62	7.62

### 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	019219	12 国债 19	4,100,000	409,590,000.00	2.45
2	130214	13 国开 14	2,000,000	200,320,000.00	1.20
3	120228	12 国开 28	1,800,000	179,910,000.00	1.08
4	113002	工行转债	1,012,090	110,702,404.20	0.66
5	130210	13 国开 10	1,000,000	100,150,000.00	0.60

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	3,897,779.88
2	应收证券清算款	116,022.97
3	应收股利	17,209,296.55
4	应收利息	19,577,372.61
5	应收申购款	2,648,888.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,449,360.92

7.10.4 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	110,702,404.20	0.66

2	113001	中行转债	48,230,995.80	0.29
3	110016	川投转债	9,346,296.00	0.06
4	110007	博汇转债	6,627,808.20	0.04
5	110017	中海转债	6,013,506.80	0.04
6	110018	国电转债	4,476,542.00	0.03
7	113003	重工转债	2,405,040.00	0.01
8	125887	中鼎转债	1,484,014.12	0.01
9	110011	歌华转债	379,076.00	0.00

### 7.10.5 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	000562	宏源证券	210,960,000.00	1.26	非公开发行流通受限

### 7.10.6 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
900,326	13,191.59	279,049,749.31	2.35%	11,597,681,192.23	97.65%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	764,384.38	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	12,686,414,898.86
本报告期基金总申购份额	568,380,615.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,378,064,573.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,876,730,941.54

## §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 2013 年 5 月 25 日发布公告，刘文动先生不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	
安信证券	1	6,923,186,817.84	24.43%	4,854,296.50	20.76%	-
中投证券	1	4,460,098,977.70	15.74%	4,060,471.40	17.36%	-
中信建投证券	3	3,797,895,039.46	13.40%	3,017,666.47	12.90%	-

国金证券	1	2,863,189,227.88	10.10%	2,606,641.02	11.15%	-
东北证券	1	2,841,292,410.36	10.02%	2,586,704.00	11.06%	-
国信证券	1	2,162,732,475.52	7.63%	1,913,802.58	8.18%	-
东海证券	1	1,468,033,591.29	5.18%	1,042,890.13	4.46%	-
国泰君安证券	1	1,058,712,094.05	3.74%	941,233.45	4.02%	-
国联证券	1	954,107,593.60	3.37%	868,614.37	3.71%	-
长江证券	1	744,653,144.83	2.63%	658,942.67	2.82%	-
民生证券	1	611,635,821.34	2.16%	431,891.21	1.85%	-
广州证券	1	457,093,612.86	1.61%	404,481.48	1.73%	-

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，本基金还选择了高华证券、光大证券、海通证券、华泰证券、平安证券、齐鲁证券、瑞银证券、湘财证券、兴业证券、中国银河证券、招商证券、中信证券和中原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，中信建投证券的部分交易单元、东海证券的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。

#### 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
中投证券	294,996,666.20	34.67%	808,600,000.00	24.15%
中信建投证券	166,786,272.00	19.60%	125,000,000.00	3.73%
国金证券	285,072,387.40	33.50%	-	-
东北证券	96,029,298.80	11.29%	2,414,500,000.00	72.12%
国联证券	8,028,376.70	0.94%	-	-

### 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旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金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	2013-01-04
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-02-18
3	华夏基金管理有限公司关于开通财付通理财账户基金网上交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-02-25
4	华夏基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通上海银行、平安银行、中国邮政储蓄银行借记卡电子交易业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-03-12
5	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	2013-03-20
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增烟台银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-04-16
7	华夏基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户基金电子交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-05-23
8	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-05-25

## §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 《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏红利混合型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

二〇一三年八月二十六日