

华夏策略精选灵活配置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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	33
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.....	33
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.....	33
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	33
7.10 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	35
§11 备查文件目录.....	38

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏策略混合
基金主代码	002031
交易代码	002031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月23日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	844,856,595.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的长期、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×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金是灵活配置型混合基金，混合基金的风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金；而灵活配置型混合基金的资产配置比例可灵活调整，在混合基金中也属于较高风险、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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	唐州徽
	联系电话	400-818-6666	95566
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大 街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	王东明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	11,563,653.66
本期利润	61,556,331.92
加权平均基金份额本期利润	0.0744
本期加权平均净值利润率	4.28%
本期基金份额净值增长率	5.91%
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	546,328,166.64
期末可供分配基金份额利润	0.6467
期末基金资产净值	1,438,126,144.44
期末基金份额净值	1.702
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	131.24%

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	-7.75%	1.37%	-8.66%	1.03%	0.91%	0.34%
过去三个月	-0.64%	1.03%	-6.18%	0.80%	5.54%	0.23%
过去六个月	5.91%	1.01%	-6.23%	0.82%	12.14%	0.19%
过去一年	4.67%	0.88%	-4.06%	0.75%	8.73%	0.13%
过去三年	30.06%	1.07%	-2.40%	0.75%	32.46%	0.32%
自基金合同 生效起至今	131.24%	1.15%	23.36%	0.91%	107.88%	0.24%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏策略精选灵活配置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

(2008 年 10 月 23 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	2012-05-04	-	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。
--	--	--	--	--	-------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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，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

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，但对新兴产业的投资不够充分。

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 1.702 元，本报告期份额净值增长率为 5.91%，同期业绩比较基准增长率为-6.23%。

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，以合理价格投资这类优秀的成长股。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏策略精选灵活配置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
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	82,159,887.98	108,546,654.34
结算备付金		5,370,887.95	312,896.19
存出保证金		449,684.28	81,507.50
交易性金融资产	6.4.7.2	1,249,850,201.57	986,414,757.44
其中：股票投资		909,541,640.68	739,814,951.84
基金投资		-	-
债券投资		340,308,560.89	246,599,805.60
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	120,000,000.00	-
应收证券清算款		-	40,133,473.99
应收利息	6.4.7.5	4,968,137.97	3,418,447.97
应收股利		213,742.88	-
应收申购款		1,128,226.75	2,074,863.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,464,140,769.38	1,140,982,601.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		13,070,685.93	643,687.61
应付赎回款		1,120,326.20	41,244,631.61
应付管理人报酬		1,860,759.33	1,386,093.86
应付托管费		310,126.58	231,015.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,889,286.51	8,689,423.70
应交税费		680,334.32	680,334.32
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	83,106.07	309,944.52
负债合计		26,014,624.94	53,185,131.26

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	844,856,595.28	676,743,864.64
未分配利润	6.4.7.10	593,269,549.16	411,053,605.20
所有者权益合计		1,438,126,144.44	1,087,797,469.84
负债和所有者权益总计		1,464,140,769.38	1,140,982,601.10

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.702 元，基金份额总额 844,856,595.28 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏策略精选灵活配置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
一、收入		77,832,751.92	171,566,060.43
1.利息收入		4,291,204.59	5,763,474.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	846,977.85	964,844.68
债券利息收入		2,839,337.00	4,778,673.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		604,889.74	19,956.18
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,219,814.64	-120,633,716.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,134,421.57	-122,341,330.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,024,653.44	-6,759,702.60
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	9,110,046.51	8,467,315.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	49,992,678.26	285,176,521.69
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	329,054.43	1,259,781.56
减：二、费用		16,276,420.00	25,076,052.32
1.管理人报酬		10,639,134.28	17,019,024.06
2.托管费		1,773,189.05	2,836,504.01
3.销售服务费		-	-

4.交易费用	6.4.7.18	3,765,230.27	5,123,841.72
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	98,866.40	96,682.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,556,331.92	146,490,008.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,556,331.92	146,490,008.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏策略精选灵活配置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）	676,743,864.64	411,053,605.20	1,087,797,469.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,556,331.92	61,556,331.92
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）	168,112,730.64	120,659,612.04	288,772,342.68
其中：1.基金申购款	319,657,792.17	232,350,925.11	552,008,717.28
2.基金赎回款	-151,545,061.53	-111,691,313.07	-263,236,374.60
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）	844,856,595.28	593,269,549.16	1,438,126,144.44
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）	1,216,892,224.24	1,353,517,870.12	2,570,410,094.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	146,490,008.11	146,490,008.11

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）	-299,046,192.69	-432,741,398.74	-731,787,591.43
其中：1.基金申购款	166,888,829.33	109,145,298.19	276,034,127.52
2.基金赎回款	-465,935,022.02	-541,886,696.93	-1,007,821,718.95
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）	-	-492,506,432.05	-492,506,432.05
五、期末所有者权益（基金净值）	917,846,031.55	574,760,047.44	1,492,606,078.99

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

华夏策略精选灵活配置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”）证监许可[2008]595号《关于核准华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，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》、《华夏策略精选灵活配置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，存续期限为不定期。首次设立募集不包含认购资金利息共募集 1,583,729,346.93 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2008)验字第 60469435_A04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,583,765,847.96 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《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资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。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]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	82,159,887.98
定期存款	-
其他存款	-
合计	82,159,887.98

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	920,507,673.15	909,541,640.68	-10,966,032.47	
债券	交易所市场	254,368,114.76	250,610,560.89	-3,757,553.87
	银行间市场	89,925,762.60	89,698,000.00	-227,762.60
	合计	344,293,877.36	340,308,560.89	-3,985,316.47
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	1,264,801,550.51	1,249,850,201.57	-14,951,348.94
----	------------------	------------------	----------------

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
交易所市场买入返售金融资产	120,000,000.00	-
合计	120,000,000.00	-

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	33,107.08
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	2,416.90
应收债券利息	4,871,535.81
应收买入返售证券利息	60,875.78
应收申购款利息	-
其他	202.40
合计	4,968,137.97

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	8,887,987.11
银行间市场应付交易费用	1,299.40
合计	8,889,286.51

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	-
应付赎回费	4,222.31
预提费用	78,883.76
合计	83,106.07

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	676,743,864.64	676,743,864.64
本期申购	319,657,792.17	319,657,792.17
本期赎回（以“-”号填列）	-151,545,061.53	-151,545,061.53
本期末	844,856,595.28	844,856,595.28

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	434,504,318.02	-23,450,712.82	411,053,605.20
本期利润	11,563,653.66	49,992,678.26	61,556,331.92
本期基金份额交易产生的变动数	100,260,194.96	20,399,417.08	120,659,612.04
其中：基金申购款	194,324,371.46	38,026,553.65	232,350,925.11
基金赎回款	-94,064,176.50	-17,627,136.57	-111,691,313.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	546,328,166.64	46,941,382.52	593,269,549.16

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	811,958.39
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	27,650.35
其他	7,369.11
合计	846,977.85

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	1,198,555,816.85
减：卖出股票成本总额	1,183,421,395.28
买卖股票差价收入	15,134,421.57

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	128,531,638.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	125,298,343.44
减：应收利息总额	4,257,948.69
债券投资收益	-1,024,653.44

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	9,110,046.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,110,046.51

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	49,992,678.26
——股票投资	48,581,087.06
——债券投资	1,411,591.20

——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	49,992,678.26

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	329,054.43
合计	329,054.43

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	3,764,805.27
银行间市场交易费用	425.00
合计	3,765,230.27

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	34,712.18
信息披露费	39,671.58
银行费用	15,082.64
银行间账户维护费	9,000.00
其他	400.00
合计	98,866.40

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	-	-	757,052,846.31	25.28%

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	-	-	43,463,036.30	11.97%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回 购成交总额 的比例	成交金额	占当期债券回 购成交总额 的比例
中信证券	-	-	40,000,000.00	28.57%

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 总量的比例
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 总量的比例
中信证券	643,494.50	25.52%	643,494.50	8.24%

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	10,639,134.28	17,019,024.06
其中：支付销售机构的客户维护费	952,143.33	1,407,273.72

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 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托管费	1,773,189.05	2,836,504.01

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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
期初持有的基金份额	13,626,206.77	9,999,000.00
期间申购/买入总份额	-	3,627,206.77
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	13,626,206.77	13,626,206.77
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.61%	1.48%

注：上年度可比期间“期间申购/买入总份额”为红利再投资所获得的基金份额。

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
中国银行	82,159,887.98	811,958.39	249,616,876.37	952,199.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
600983	合肥三洋	2013-05-14	控股股东筹划重大事项	9.96	2013-08-14	10.90	2,058,147	18,326,143.85	20,499,144.12	-
300086	康芝药业	2013-05-23	停牌核查媒体报道	14.73	2013-07-23	14.00	563,898	7,811,173.86	8,306,217.54	-
002390	信邦制药	2013-05-31	筹划重大资产重组事项	17.13	-	-	312,315	4,838,493.99	5,349,955.95	-
300027	华谊兄弟	2013-06-05	拟披露重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	31,976	630,224.40	912,914.80	-

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	82,159,887.98	-	-	82,159,887.98
结算备付金	5,370,887.95	-	-	5,370,887.95
结算保证金	449,684.28	-	-	449,684.28
债券投资	194,607,110.20	134,319,120.51	11,382,330.18	340,308,560.89
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	120,000,000.00
应收直销申购款	167,245.40	-	-	167,245.40
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	108,546,654.34	-	-	108,546,654.34
结算备付金	312,896.19	-	-	312,896.19
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	157,739,790.60	73,940,515.00	14,919,500.00	246,599,805.60
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	23,158.08	-	-	23,158.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
----	---

	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2013 年 6 月 30 日）	上年度末 （2012 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	887,337.86	1,671,006.83
	利率上升 25 个基点	-876,476.01	-1,650,322.65

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	909,541,640.68	63.24	739,814,951.84	68.01
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	909,541,640.68	63.24	739,814,951.84	68.01

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%	33,498,418.63	31,723,265.13
	-5%	-33,498,418.63	-31,723,265.13

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 1,160,152,201.57 元，第二层级的余额为 89,698,000.00 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 946,506,757.4 元，第二层级的余额为 39,908,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，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，于股票复牌价能体现公允价值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	909,541,640.68	62.12
	其中：股票	909,541,640.68	62.12
2	固定收益投资	340,308,560.89	23.24
	其中：债券	340,308,560.89	23.24
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	120,000,000.00	8.20
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	87,530,775.93	5.98
7	其他各项资产	6,759,791.88	0.46
8	合计	1,464,140,769.38	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	782,611.20	0.05
B	采矿业	422,700.00	0.03
C	制造业	619,564,050.03	43.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,470,585.50	3.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,947,243.94	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	35,685,222.71	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,772,681.73	5.76
J	金融业	57,049,205.99	3.97
K	房地产业	35,776,502.45	2.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,140,121.69	0.64
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	912,914.80	0.06
S	综合	1,017,800.64	0.07
	合计	909,541,640.68	63.24

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	300057	万顺股份	3,550,188	50,945,197.80	3.54
2	000915	山大华特	1,910,930	43,282,564.50	3.01
3	002148	北纬通信	1,000,000	32,640,000.00	2.27
4	600976	武汉健民	1,499,999	32,399,978.40	2.25
5	000400	许继电气	1,182,801	32,030,251.08	2.23
6	600887	伊利股份	1,013,555	31,704,000.40	2.20
7	000100	TCL 集团	11,999,914	27,239,804.78	1.89
8	601222	林洋电子	1,699,870	25,396,057.80	1.77
9	601318	中国平安	725,118	25,205,101.68	1.75
10	000527	美的电器	1,999,947	24,839,341.74	1.73
11	002480	新筑股份	1,600,061	24,800,945.50	1.72
12	000088	盐田港	7,128,435	23,737,688.55	1.65
13	600983	合肥三洋	2,058,147	20,499,144.12	1.43
14	600337	美克股份	3,689,704	19,850,607.52	1.38
15	300072	三聚环保	1,226,856	19,691,038.80	1.37
16	000669	金鸿能源	518,974	19,637,976.16	1.37
17	600690	青岛海尔	1,727,706	18,849,272.46	1.31
18	600050	中国联通	5,827,211	18,180,898.32	1.26
19	300349	金卡股份	439,927	17,953,420.87	1.25
20	600406	国电南瑞	1,159,449	17,310,573.57	1.20
21	600886	国投电力	4,799,901	16,223,665.38	1.13
22	600649	城投控股	2,325,946	16,095,546.32	1.12
23	002415	海康威视	449,860	15,898,052.40	1.11
24	002630	华西能源	753,104	15,589,252.80	1.08
25	600750	江中药业	805,756	14,366,629.48	1.00
26	300146	汤臣倍健	299,890	13,192,161.10	0.92
27	000002	万科 A	1,309,906	12,902,574.10	0.90
28	600016	民生银行	1,499,950	12,854,571.50	0.89
29	000690	宝新能源	2,699,988	12,608,943.96	0.88

30	002437	誉衡药业	491,734	12,573,638.38	0.87
31	000401	冀东水泥	1,369,074	11,253,788.28	0.78
32	600705	中航投资	799,881	11,206,332.81	0.78
33	600207	安彩高科	2,499,978	10,549,907.16	0.73
34	600285	羚锐制药	779,447	10,257,522.52	0.71
35	600197	伊力特	999,931	9,819,322.42	0.68
36	000661	长春高新	100,000	9,791,000.00	0.68
37	600713	南京医药	2,199,970	9,547,869.80	0.66
38	002241	歌尔声学	261,738	9,498,472.02	0.66
39	600686	金龙汽车	1,000,000	9,350,000.00	0.65
40	000978	桂林旅游	1,500,841	9,140,121.69	0.64
41	002410	广联达	438,439	8,312,803.44	0.58
42	300086	康芝药业	563,898	8,306,217.54	0.58
43	600000	浦发银行	940,000	7,783,200.00	0.54
44	601313	江南嘉捷	1,000,000	6,780,000.00	0.47
45	600572	康恩贝	602,344	6,679,994.96	0.46
46	000608	阳光股份	1,299,900	6,590,493.00	0.46
47	002063	远光软件	437,952	6,328,406.40	0.44
48	002475	立讯精密	299,932	6,298,572.00	0.44
49	600518	康美药业	324,921	6,248,230.83	0.43
50	600998	九州通	499,946	5,794,374.14	0.40
51	002223	鱼跃医疗	299,990	5,654,811.50	0.39
52	002390	信邦制药	312,315	5,349,955.95	0.37
53	600372	中航电子	249,966	5,236,787.70	0.36
54	000536	华映科技	199,951	5,138,740.70	0.36
55	000989	九芝堂	463,909	5,130,833.54	0.36
56	300089	长城集团	733,109	5,007,134.47	0.35
57	300180	华峰超纤	420,051	4,742,375.79	0.33
58	000895	双汇发展	119,922	4,609,801.68	0.32
59	600352	浙江龙盛	489,917	4,595,421.46	0.32
60	002440	闰土股份	200,000	4,134,000.00	0.29
61	600875	东方电气	299,939	3,095,370.48	0.22
62	601727	上海电气	871,400	2,910,476.00	0.20
63	002353	杰瑞股份	30,333	2,092,977.00	0.15
64	000709	河北钢铁	999,976	1,849,955.60	0.13
65	002436	兴森科技	109,701	1,848,461.85	0.13
66	600697	欧亚集团	100,000	1,839,000.00	0.13

67	600377	宁沪高速	259,300	1,397,627.00	0.10
68	600055	华润万东	143,777	1,384,572.51	0.10
69	600256	广汇能源	78,534	1,017,800.64	0.07
70	300027	华谊兄弟	31,976	912,914.80	0.06
71	600097	开创国际	72,464	782,611.20	0.05
72	000902	中国服装	100,000	766,000.00	0.05
73	000792	盐湖股份	39,089	662,167.66	0.05
74	601808	中海油服	30,000	422,700.00	0.03
75	600086	东方金钰	20,000	405,400.00	0.03
76	600251	冠农股份	23,902	330,325.64	0.02
77	000540	中天城投	26,803	187,889.03	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	52,005,680.99	4.78
2	300057	万顺股份	47,001,215.89	4.32
3	600406	国电南瑞	42,783,163.94	3.93
4	601288	农业银行	38,399,267.46	3.53
5	002437	誉衡药业	35,543,927.59	3.27
6	002415	海康威视	35,021,861.23	3.22
7	000100	TCL 集团	33,418,419.32	3.07
8	002148	北纬通信	32,367,063.10	2.98
9	601222	林洋电子	29,496,713.72	2.71
10	601788	光大证券	29,172,184.53	2.68
11	600976	武汉健民	29,141,469.33	2.68
12	600016	民生银行	28,535,318.26	2.62
13	002480	新筑股份	27,388,279.66	2.52
14	000527	美的电器	26,947,048.84	2.48
15	000661	长春高新	26,124,000.00	2.40
16	002292	奥飞动漫	24,603,901.17	2.26
17	600649	城投控股	22,985,355.36	2.11
18	600337	美克股份	22,814,538.69	2.10
19	600805	悦达投资	22,295,202.36	2.05
20	300072	三聚环保	20,141,920.39	1.85

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	600028	中国石化	41,840,412.70	3.85
2	601288	农业银行	35,639,920.59	3.28
3	000002	万科 A	32,723,687.48	3.01
4	000400	许继电气	29,794,370.35	2.74
5	600406	国电南瑞	28,326,430.81	2.60
6	002437	誉衡药业	27,746,022.68	2.55
7	601788	光大证券	27,299,694.53	2.51
8	002292	奥飞动漫	26,893,204.81	2.47
9	600050	中国联通	25,809,301.67	2.37
10	600805	悦达投资	25,533,366.72	2.35
11	600316	洪都航空	23,651,913.91	2.17
12	600642	申能股份	18,192,886.67	1.67
13	300027	华谊兄弟	18,058,041.73	1.66
14	000661	长春高新	17,960,888.01	1.65
15	600837	海通证券	17,306,506.35	1.59
16	000430	张家界	16,847,886.46	1.55
17	600795	国电电力	16,740,650.72	1.54
18	002415	海康威视	16,437,217.45	1.51
19	000006	深振业 A	16,422,327.26	1.51
20	300072	三聚环保	16,265,604.75	1.50

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	1,304,566,997.06
卖出股票收入（成交）总额	1,198,555,816.85

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,760,000.00	5.55
	其中：政策性金融债	79,760,000.00	5.55
4	企业债券	162,864,750.69	11.32
5	企业短期融资券	9,938,000.00	0.69
6	中期票据	-	-
7	可转债	87,745,810.20	6.10
8	其他	-	-
9	合计	340,308,560.89	23.66

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	113002	工行转债	789,590	86,365,354.20	6.01
2	120228	12 国开 28	400,000	39,980,000.00	2.78
3	130201	13 国开 01	400,000	39,780,000.00	2.77
4	122149	12 石化 01	279,500	27,667,705.00	1.92
5	122957	09 蓉工投	150,000	15,163,500.00	1.05

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	449,684.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	213,742.88
4	应收利息	4,968,137.97
5	应收申购款	1,128,226.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,759,791.88

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	86,365,354.20	6.01

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 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
15,180	55,655.90	270,892,918.47	32.06%	573,963,676.81	67.94%

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	4,619,589.95	0.55%

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 100 万份以上；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（2008年10月23日）基金份额总额	1,583,765,847.96
本报告期期初基金份额总额	676,743,864.64
本报告期基金总申购份额	319,657,792.17
减：本报告期基金总赎回份额	151,545,061.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	844,856,595.28

§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。中国银行股份有限公司发布公告，根据国家金融工作需要，自 2013 年 3 月 17 日起，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务；自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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	
兴业证券	1	710,105,021.03	28.37%	643,207.44	28.44%	-
瑞银证券	1	500,135,225.42	19.98%	455,322.36	20.13%	-
西部证券	1	431,369,978.92	17.23%	381,719.87	16.88%	-
申银万国证券	2	380,716,958.52	15.21%	346,603.31	15.32%	-
中国银河证券	1	312,495,339.15	12.48%	284,495.23	12.58%	-
中银国际证券	1	104,420,846.21	4.17%	92,402.33	4.09%	-
国信证券	2	63,879,444.66	2.55%	58,155.84	2.57%	-

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、国泰君安证券、中信建投证券、中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，申银万国证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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
兴业证券	30,473,512.73	11.11%	-	-
瑞银证券	116,176,604.70	42.35%	630,400,000.00	29.52%
申银万国证券	15,312,900.00	5.58%	355,000,000.00	16.62%
中国银河证券	112,377,377.50	40.96%	1,150,000,000.00	53.85%

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上海浦东发展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	2013-02-01
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旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司办理定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-02-22
4	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
5	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
6	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	2013-04-01
7	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
8	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
9	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 《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏策略精选灵活配置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