

**华夏沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金  
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	6
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
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 期末投资目标基金明细.....	29
7.3 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.4 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
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
§11 备查文件目录.....	45

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,350,919,797.02份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 16 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式, 追求对标的指数的有效跟踪, 获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF 的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况, 本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析, 对投资组合进行监控和调整, 密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利, 以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1\%$ (指年收益率, 评价时应按期间折算)。
风险收益特征	本基金属于股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		王东明	姜建清

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-359,482,926.50
本期利润	-2,230,035,301.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0811
本期加权平均净值利润率	-10.85%
本期基金份额净值增长率	-10.95%
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	-10,699,238,876.32
期末可供分配基金份额利润	-0.3413
期末基金资产净值	20,651,680,920.70
期末基金份额净值	0.659
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	-34.10%

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	-14.08%	1.78%	-14.71%	1.77%	0.63%	0.01%
过去三个月	-10.10%	1.37%	-10.96%	1.38%	0.86%	-0.01%
过去六个月	-10.95%	1.43%	-11.64%	1.42%	0.69%	0.01%
过去一年	-8.22%	1.31%	-9.07%	1.30%	0.85%	0.01%
过去三年	-9.35%	1.31%	-10.43%	1.30%	1.08%	0.01%
自基金合同生效起至今	-34.10%	1.38%	-29.47%	1.44%	-4.63%	-0.06%

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2009 年 7 月 10 日至 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。

截至 2013 年 6 月 30 日，华夏基金管理的境内 ETF 产品规模超过 440 亿元，是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一。在 ETF 基金管理方面，华夏基金积累了丰富的经验，目前旗下管理 9 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏能源 ETF、华夏材料 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF 和华夏恒生 ETF，初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	14 年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	13 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1\%$ （指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF（华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金）的份额，从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

2013 年上半年，国际方面，美国经济呈现较明显的复苏态势，货币政策维持宽松，然而 2 季度美联储即将退出量化宽松政策的预期导致市场出现较大波动；欧洲经济仍然相对疲弱；日本继续采取宽松货币政策，日元出现较为明显的贬值，对日本短期经济复苏产生一定效果但长期尚需观察。国内方面，经济运行总体平稳，但投资、消费、出口等数据在 2 季度出现了一定程度放缓；通货膨胀

仍然维持在较低水平；社会融资总额同比仍保持较快增长，但 6 月份受外汇占款下降等因素影响，市场资金面趋紧，6 月中下旬短期利率大幅飙升。

上半年，A 股证券市场总体呈震荡走势。春节前，在投资者对经济复苏、流动性宽松等的较强预期下，市场出现了上涨，沪深 300 指数期间涨幅接近 10%。随后在经济基本面不及预期，流动性逐渐紧张的背景下，市场总体震荡下跌。报告期内，沪深 300 指数下跌 12.78%。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

#### 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 0.659 元，本报告期份额净值增长率为-10.95%，同期业绩比较基准增长率为-11.64%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.69%。本基金与业绩比较基准产生偏离的主要原因为目标 ETF 偏离、成份股分红、日常运作费用、大额申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，国内经济可能进一步放缓，通货膨胀维持低位，宏观政策可能会一定程度微调，但大幅超预期调整的可能性不大。

基于上述判断，市场方面，沪深 300 指数以震荡走势为主。如果出现经济基本面或者宏观经济政策的超预期，沪深 300 指数可能有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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，本基金托管人在对华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2013 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	410,347,217.30	355,271,755.02
结算备付金		7,238,458.02	9,818,489.58
存出保证金		7,998,794.47	1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	20,186,629,203.67	20,216,603,687.86
其中：股票投资		2,689,363,364.89	3,611,710,126.96
基金投资		16,779,303,838.78	15,921,962,804.58
债券投资		717,962,000.00	682,930,756.32
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,227,312.31	1,478,841.84
应收利息	6.4.7.5	12,008,549.97	14,713,006.17
应收股利		4,576,592.78	-
应收申购款		184,925,093.62	13,213,727.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	13,699.00	-
资产总计		20,820,964,921.14	20,612,099,507.75
<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		-	-
应付证券清算款		50,542,983.44	-
应付赎回款		114,962,043.75	72,024,101.37
应付管理人报酬		908,677.20	7,289,768.90
应付托管费		181,735.44	1,457,953.76

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,369,157.26	1,103,587.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,319,403.35	1,296,944.30
负债合计		169,284,000.44	83,172,355.48
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,350,919,797.02	27,756,194,055.50
未分配利润	6.4.7.10	-10,699,238,876.32	-7,227,266,903.23
所有者权益合计		20,651,680,920.70	20,528,927,152.27
负债和所有者权益总计		20,820,964,921.14	20,612,099,507.75

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.659 元，基金份额总额 31,350,919,797.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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>		-2,220,108,361.33	1,178,964,896.56
1.利息收入		11,212,841.96	12,424,001.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,351,829.47	932,892.97
债券利息收入		9,861,012.49	11,491,108.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-362,538,746.46	-541,573,065.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-415,382,992.14	-755,532,279.72
基金投资收益	6.4.7.13	34,103,004.55	-
债券投资收益	6.4.7.14	1,605,008.67	4,179,642.20
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	17,136,232.46	209,779,572.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,870,552,375.45	1,707,055,786.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,769,918.62	1,058,174.48
<b>减：二、费用</b>		9,926,940.62	60,756,563.44
1.管理人报酬		5,865,159.11	47,499,309.87
2.托管费		1,173,031.81	9,499,861.96
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	2,396,013.67	3,509,874.42
5.利息支出		283,182.28	44,587.83
其中：卖出回购金融资产支出		283,182.28	44,587.83
6.其他费用	6.4.7.20	209,553.75	202,929.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,230,035,301.95	1,118,208,333.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,230,035,301.95	1,118,208,333.12

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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）	27,756,194,055.50	-7,227,266,903.23	20,528,927,152.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,230,035,301.95	-2,230,035,301.95
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）	3,594,725,741.52	-1,241,936,671.14	2,352,789,070.38
其中：1.基金申购款	7,691,411,565.87	-2,261,822,386.21	5,429,589,179.66
2.基金赎回款	-4,096,685,824.35	1,019,885,715.07	-3,076,800,109.28
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	31,350,919,797.02	-10,699,238,876.32	20,651,680,920.70

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
金净值)			
一、期初所有者权益（基金净值）	25,970,707,526.21	-8,415,104,647.07	17,555,602,879.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,118,208,333.12	1,118,208,333.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-378,254,320.87	86,385,375.77	-291,868,945.10
其中：1.基金申购款	2,357,042,660.91	-626,896,481.99	1,730,146,178.92
2.基金赎回款	-2,735,296,981.78	713,281,857.76	-2,022,015,124.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	25,592,453,205.34	-7,210,510,938.18	18,381,942,267.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王东明                      崔雁巍                      崔雁巍  
 基金管理人负责人      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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原名华夏沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]531 号《关于核准华夏沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 8 日期间共募集 24,771,692,420.44 元（不含认购资金利息），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2009）第 718 号予以验

证。经向中国证监会备案,《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 24,771,957,170.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 264,749.65 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证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	410,347,217.30
定期存款	-
其他存款	-
合计	410,347,217.30

#### 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	2,838,374,170.91	2,689,363,364.89	-149,010,806.02
债券	交易所市场	299,788,000.00	299,100,000.00
	银行间市场	419,780,780.00	418,862,000.00
	合计	719,568,780.00	717,962,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	18,585,004,680.53	16,779,303,838.78	-1,805,700,841.75
其他	-	-	-
合计	22,142,947,631.44	20,186,629,203.67	-1,956,318,427.77

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	100,759.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,257.30
应收债券利息	11,900,933.60
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	3,599.40
合计	12,008,549.97

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
其他应收款	13,699.00
待摊费用	-
合计	13,699.00

#### 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	1,367,873.06
银行间市场应付交易费用	1,284.20
合计	1,369,157.26

#### 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	750,000.00
应付赎回费	386,381.24
预提费用	183,022.11
合计	1,319,403.35

#### 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	27,756,194,055.50	27,756,194,055.50
本期申购	7,691,411,565.87	7,691,411,565.87
本期赎回（以“-”号填列）	-4,096,685,824.35	-4,096,685,824.35
本期末	31,350,919,797.02	31,350,919,797.02

#### 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	-5,929,697,235.53	-1,297,569,667.70	-7,227,266,903.23
本期利润	-359,482,926.50	-1,870,552,375.45	-2,230,035,301.95
本期基金份额交易产生的变	-818,460,021.52	-423,476,649.62	-1,241,936,671.14

动数			
其中：基金申购款	-1,740,291,615.05	-521,530,771.16	-2,261,822,386.21
基金赎回款	921,831,593.53	98,054,121.54	1,019,885,715.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,107,640,183.55	-3,591,598,692.77	-10,699,238,876.32

#### 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	1,246,103.16
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	43,257.05
其他	62,469.26
合计	1,351,829.47

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-143,488,425.05
股票投资收益——赎回差价 收入	-
股票投资收益——申购差价 收入	-271,894,567.09
合计	-415,382,992.14

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,344,649,757.30
减：卖出股票成本总额	1,488,138,182.35
买卖股票差价收入	-143,488,425.05

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
申购基金份额对价总额	3,240,120,874.24
减：现金支付申购款总额	954,535,897.62
减：申购股票成本总额	2,557,479,543.71
申购差价收入	-271,894,567.09

#### 6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	744,230,529.64
减：卖出/赎回基金成本总额	710,127,525.09
基金投资收益	34,103,004.55

#### 6.4.7.14 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	559,301,263.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	543,547,488.53
减：应收利息总额	14,148,766.79
债券投资收益	1,605,008.67

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 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	17,136,232.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,136,232.46

#### 6.4.7.17 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	-1,870,552,375.45
——股票投资	429,657,315.67
——债券投资	-1,420,447.79
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-2,298,789,243.33
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,870,552,375.45

#### 6.4.7.18 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	1,709,918.62
其他	60,000.00
合计	1,769,918.62

注：本基金赎回时份额持有不满 1 年的，收取 0.5% 的赎回费，持有满 1 年以上（含 1 年）的，赎回费为 0。其中，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 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	2,394,738.67
银行间市场交易费用	1,275.00
合计	2,396,013.67

#### 6.4.7.20 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	59,507.37
信息披露费	119,014.74
银行费用	22,031.64
银行间账户维护费	9,000.00
合计	209,553.75

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

###### 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	5,865,159.11	47,499,309.87
其中：支付销售机构的客户维护费	12,342,497.81	12,483,620.48

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.5%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 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.5% / 当年天数。若前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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	1,173,031.81	9,499,861.96

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=(前一日基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.1% / 当年天数。若前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

#### 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
中国工商银行	410,347,217.30	1,246,103.16	370,512,316.01	898,861.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至 2013 年 6 月 30 日止，本基金持有 7,525,363,878 份目标 ETF 基金份额(2012 年 12 月 31 日：15,417,800,721 份)，占其总份额的比例为 88.80%(2012 年 12 月 31 日：96.24%)。

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	4,000,000	52,880,000.00	35,160,000.00	-
000562	宏源证券	-	2013-07-04	非公开	-	8.79	4,000,000	-	35,160,000.00	-

				发行转增						
--	--	--	--	------	--	--	--	--	--	--

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 4,000,000 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
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	67,771	1,987,522.65	1,799,320.05	-
600547	山东黄金	2013-04-03	筹划重大资产重组事项	32.13	2013-07-01	28.77	36,554	1,296,440.67	1,174,480.02	-
600598	北大荒	2013-05-27	筹划重大资产重组事项	8.35	2013-07-19	8.35	117,300	979,527.85	979,455.00	-
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	9,711	85,666.69	73,318.05	-
601989	中国重工	2013-05-17	控股股东筹划重大事项	4.52	-	-	138,020	736,680.66	623,850.40	-

#### 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 Beta 值等指标来衡量市场风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金的其他价格风险与目标 ETF 基金相似。

本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	2,689,363,364.89	13.02	3,611,710,126.96	17.59
交易性金融资产-基金投资	16,779,303,838.78	81.25	15,921,962,804.58	77.56
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	19,468,667,203.67	94.27	19,533,672,931.54	95.15

##### 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，各类持仓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 系数的计算方法与目标 ETF 基金相同。		
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%	1,013,791,016.40	1,018,748,009.93

	-5%	-1,013,791,016.40	-1,018,748,009.93
--	-----	-------------------	-------------------

#### 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 19,695,647,883.62 元，第二层级的余额为 490,981,320.05 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 19,753,609,665.56 元，第二层级的余额为 462,994,022.30 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	2,689,363,364.89	12.92
	其中：股票	2,689,363,364.89	12.92
2	基金投资	16,779,303,838.78	80.59
3	固定收益投资	717,962,000.00	3.45
	其中：债券	717,962,000.00	3.45
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	417,585,675.32	2.01
7	其他各项资产	216,750,042.15	1.04
8	合计	20,820,964,921.14	100.00

### 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	华夏沪深 300ETF	股票型	交易型 开放式	华夏基金管理有限公司	16,779,303,838.78	81.25

### 7.3 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	13,832,998.02	0.07
B	采矿业	178,921,604.40	0.87
C	制造业	1,013,884,247.20	4.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	136,962,995.20	0.66
E	建筑业	124,945,798.00	0.61
F	批发和零售业	83,185,994.36	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	60,905,789.60	0.29

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,705,452.61	0.28
J	金融业	808,367,999.32	3.91
K	房地产业	157,022,322.12	0.76
L	租赁和商务服务业	12,240,157.87	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,747,754.12	0.08
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	4,855,452.73	0.02
S	综合	19,784,799.34	0.10
	合计	2,689,363,364.89	13.02

## 7.4 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	600036	招商银行	8,899,070	103,229,212.00	0.50
2	600016	民生银行	11,584,800	99,281,736.00	0.48
3	000562	宏源证券	8,200,000	72,078,000.00	0.35
4	601318	中国平安	1,964,147	68,273,749.72	0.33
5	601166	兴业银行	4,259,044	62,906,079.88	0.30
6	000002	万科A	5,950,800	58,615,380.00	0.28
7	600519	贵州茅台	230,402	44,322,432.74	0.21
8	000651	格力电器	1,644,342	41,207,210.52	0.20
9	600000	浦发银行	4,463,198	36,955,279.44	0.18
10	601088	中国神华	2,066,824	35,011,998.56	0.17
11	601328	交通银行	8,128,066	33,081,228.62	0.16
12	601288	农业银行	12,643,500	31,103,010.00	0.15
13	600104	上汽集团	2,237,398	29,556,027.58	0.14
14	601818	光大银行	10,034,258	28,999,005.62	0.14
15	601668	中国建筑	8,525,551	27,878,551.77	0.13
16	600048	保利地产	2,708,500	26,841,235.00	0.13
17	601006	大秦铁路	4,433,960	26,337,722.40	0.13
18	601601	中国太保	1,639,586	26,118,604.98	0.13
19	000858	五粮液	1,289,450	25,840,578.00	0.13
20	601336	新华保险	1,023,519	25,291,154.49	0.12

21	600837	海通证券	2,343,074	21,978,034.12	0.11
22	601991	大唐发电	4,202,129	21,598,943.06	0.10
23	600886	国投电力	6,313,112	21,338,318.56	0.10
24	600332	广州药业	618,800	21,200,088.00	0.10
25	600111	包钢稀土	1,011,320	21,106,248.40	0.10
26	600887	伊利股份	660,166	20,649,992.48	0.10
27	600863	内蒙华电	3,549,975	20,057,358.75	0.10
28	000776	广发证券	1,777,436	19,693,990.88	0.10
29	000895	双汇发展	492,582	18,934,852.08	0.09
30	601857	中国石油	2,459,800	18,719,078.00	0.09
31	600010	包钢股份	4,513,200	18,504,120.00	0.09
32	601800	中国交建	4,461,368	18,068,540.40	0.09
33	600900	长江电力	2,569,420	17,780,386.40	0.09
34	600015	华夏银行	1,899,656	17,134,897.12	0.08
35	600585	海螺水泥	1,279,782	17,123,483.16	0.08
36	000063	中兴通讯	1,336,514	17,040,553.50	0.08
37	002450	康得新	600,378	16,798,576.44	0.08
38	000527	美的电器	1,297,491	16,114,838.22	0.08
39	600031	三一重工	2,140,303	16,073,675.53	0.08
40	600315	上海家化	352,931	15,878,365.69	0.08
41	600011	华能国际	2,952,326	15,765,420.84	0.08
42	000157	中联重科	2,887,738	15,680,417.34	0.08
43	002024	苏宁云商	3,081,535	15,438,490.35	0.07
44	600518	康美药业	799,501	15,374,404.23	0.07
45	600637	百视通	547,041	15,317,148.00	0.07
46	600535	天士力	388,799	15,221,480.85	0.07
47	601688	华泰证券	1,870,386	15,075,311.16	0.07
48	000538	云南白药	177,694	14,928,072.94	0.07
49	000423	东阿阿胶	383,151	14,820,280.68	0.07
50	600406	国电南瑞	988,728	14,761,709.04	0.07
51	002106	莱宝高科	959,349	14,726,007.15	0.07
52	600383	金地集团	2,071,557	14,210,881.02	0.07
53	002142	宁波银行	1,571,665	13,312,002.55	0.06
54	002304	洋河股份	245,079	13,307,789.70	0.06
55	601377	兴业证券	1,465,321	13,305,114.68	0.06
56	002081	金螳螂	466,322	13,276,187.34	0.06
57	002594	比亚迪	441,397	13,202,184.27	0.06



58	600795	国电电力	5,651,800	12,886,104.00	0.06
59	600050	中国联通	4,127,330	12,877,269.60	0.06
60	002241	歌尔声学	352,750	12,801,297.50	0.06
61	600256	广汇能源	970,914	12,583,045.44	0.06
62	601628	中国人寿	859,647	11,768,567.43	0.06
63	000625	长安汽车	1,259,057	11,696,639.53	0.06
64	600703	三安光电	592,243	11,631,652.52	0.06
65	601117	中国化学	1,218,180	11,597,073.60	0.06
66	601901	方正证券	2,092,463	11,571,320.39	0.06
67	000725	京东方 A	5,175,980	11,490,675.60	0.06
68	002146	荣盛发展	812,964	11,470,922.04	0.06
69	600089	特变电工	1,408,800	11,340,840.00	0.05
70	000024	招商地产	466,857	11,335,287.96	0.05
71	601555	东吴证券	1,654,325	11,332,126.25	0.05
72	000069	华侨城 A	2,161,936	11,177,209.12	0.05
73	601766	中国南车	3,064,377	11,031,757.20	0.05
74	000963	华东医药	276,704	11,026,654.40	0.05
75	600066	宇通客车	595,291	10,911,684.03	0.05
76	000001	平安银行	1,085,443	10,821,866.71	0.05
77	600340	华夏幸福	327,579	10,659,420.66	0.05
78	000568	泸州老窖	447,906	10,651,204.68	0.05
79	002353	杰瑞股份	153,013	10,557,897.00	0.05
80	600690	青岛海尔	967,213	10,552,293.83	0.05
81	600309	万华化学	644,758	10,329,023.16	0.05
82	601299	中国北车	2,735,850	10,286,796.00	0.05
83	002038	双鹭药业	173,955	10,193,763.00	0.05
84	601939	建设银行	2,453,974	10,183,992.10	0.05
85	601788	光大证券	987,300	10,070,460.00	0.05
86	601899	紫金矿业	4,101,300	9,761,094.00	0.05
87	601607	上海医药	915,771	9,734,645.73	0.05
88	600276	恒瑞医药	367,455	9,686,113.80	0.05
89	600546	山煤国际	793,911	9,399,906.24	0.05
90	600177	雅戈尔	1,515,059	9,257,010.49	0.04
91	601238	广汽集团	1,247,262	9,179,848.32	0.04
92	002570	贝因美	321,325	8,981,033.75	0.04
93	600804	鹏博士	846,685	8,966,394.15	0.04
94	002422	科伦药业	166,420	8,871,850.20	0.04

95	600157	永泰能源	1,501,385	8,783,102.25	0.04
96	600999	招商证券	810,256	8,426,662.40	0.04
97	601390	中国中铁	3,390,451	8,272,700.44	0.04
98	600739	辽宁成大	616,255	8,085,265.60	0.04
99	600060	海信电器	777,200	8,075,108.00	0.04
100	600085	同仁堂	368,100	8,054,028.00	0.04
101	000983	西山煤电	985,480	8,041,516.80	0.04
102	601169	北京银行	999,857	7,968,860.29	0.04
103	601633	长城汽车	216,135	7,655,501.70	0.04
104	000012	南玻 A	819,138	7,593,409.26	0.04
105	002415	海康威视	214,530	7,581,490.20	0.04
106	600150	中国船舶	467,963	7,566,961.71	0.04
107	000581	威孚高科	224,042	7,480,762.38	0.04
108	002375	亚厦股份	242,405	7,466,074.00	0.04
109	600362	江西铜业	472,370	7,435,103.80	0.04
110	000338	潍柴动力	425,934	7,389,954.90	0.04
111	000100	TCL 集团	3,251,700	7,381,359.00	0.04
112	600489	中金黄金	791,514	7,353,165.06	0.04
113	600196	复星医药	692,335	7,255,670.80	0.04
114	601186	中国铁建	1,687,118	7,085,895.60	0.03
115	600100	同方股份	1,025,425	7,034,415.50	0.03
116	600348	阳泉煤业	776,713	7,021,485.52	0.03
117	600019	宝钢股份	1,783,365	7,008,624.45	0.03
118	601018	宁波港	3,451,456	6,971,941.12	0.03
119	000768	中航飞机	781,692	6,957,058.80	0.03
120	600583	海油工程	1,061,100	6,865,317.00	0.03
121	000970	中科三环	526,413	6,864,425.52	0.03
122	000629	攀钢钒钛	2,905,416	6,827,727.60	0.03
123	600674	川投能源	664,274	6,755,666.58	0.03
124	000060	中金岭南	1,011,365	6,695,236.30	0.03
125	601168	西部矿业	1,231,171	6,660,635.11	0.03
126	600694	大商股份	226,571	6,554,699.03	0.03
127	600549	厦门钨业	244,396	6,525,373.20	0.03
128	601669	中国水电	2,258,623	6,504,834.24	0.03
129	000792	盐湖股份	382,778	6,484,259.32	0.03
130	600009	上海机场	533,565	6,360,094.80	0.03
131	600029	南方航空	2,232,600	6,295,932.00	0.03

132	601699	潞安环能	526,300	6,294,548.00	0.03
133	601600	中国铝业	1,996,948	6,290,386.20	0.03
134	601988	中国银行	2,320,612	6,288,858.52	0.03
135	600252	中恒集团	450,575	6,253,981.00	0.03
136	600660	福耀玻璃	868,441	6,244,090.79	0.03
137	000783	长江证券	788,284	6,235,326.44	0.03
138	000539	粤电力 A	1,369,313	6,189,294.76	0.03
139	000729	燕京啤酒	1,077,140	6,150,469.40	0.03
140	000402	金融街	1,220,012	6,112,260.12	0.03
141	000623	吉林敖东	415,970	6,064,842.60	0.03
142	002294	信立泰	209,200	6,054,248.00	0.03
143	002051	中工国际	216,391	6,030,817.17	0.03
144	601258	庞大集团	1,010,398	5,971,452.18	0.03
145	000009	中国宝安	540,619	5,946,809.00	0.03
146	600893	航空动力	359,810	5,929,668.80	0.03
147	600352	浙江龙盛	631,600	5,924,408.00	0.03
148	002385	大北农	552,426	5,701,036.32	0.03
149	600028	中国石化	1,359,705	5,683,566.90	0.03
150	601009	南京银行	665,609	5,611,083.87	0.03
151	000039	中集集团	533,366	5,509,670.78	0.03
152	002236	大华股份	140,998	5,390,353.54	0.03
153	002202	金风科技	984,000	5,303,760.00	0.03
154	000630	铜陵有色	491,810	5,301,711.80	0.03
155	600005	武钢股份	2,348,600	5,260,864.00	0.03
156	000750	国海证券	499,999	5,159,989.68	0.02
157	601888	中国国旅	175,647	5,128,892.40	0.02
158	000425	徐工机械	650,771	5,108,552.35	0.02
159	600115	东方航空	1,979,101	5,066,498.56	0.02
160	000876	新希望	509,891	5,022,426.35	0.02
161	002007	华兰生物	222,064	5,014,205.12	0.02
162	601958	金钼股份	625,784	4,962,467.12	0.02
163	600497	驰宏锌锗	499,939	4,874,405.25	0.02
164	601898	中煤能源	991,208	4,847,007.12	0.02
165	000878	云南铜业	499,329	4,843,491.30	0.02
166	600096	云天化	601,100	4,802,789.00	0.02
167	600600	青岛啤酒	126,334	4,798,165.32	0.02
168	002299	圣农发展	526,078	4,755,745.12	0.02

169	600718	东软集团	580,120	4,722,176.80	0.02
170	002310	东方园林	123,220	4,718,093.80	0.02
171	600832	东方明珠	829,500	4,570,545.00	0.02
172	600649	城投控股	651,170	4,506,096.40	0.02
173	000709	河北钢铁	2,427,200	4,490,320.00	0.02
174	601933	永辉超市	383,345	4,473,636.15	0.02
175	600267	海正药业	351,038	4,465,203.36	0.02
176	600655	豫园商城	681,109	4,434,019.59	0.02
177	000800	一汽轿车	356,677	4,387,127.10	0.02
178	600271	航天信息	331,700	4,385,074.00	0.02
179	600498	烽火通信	258,190	4,254,971.20	0.02
180	601618	中国中冶	2,568,900	4,135,929.00	0.02
181	601808	中海油服	291,001	4,100,204.09	0.02
182	600881	亚泰集团	1,050,100	4,084,889.00	0.02
183	600166	福田汽车	800,112	4,080,571.20	0.02
184	600068	葛洲坝	1,028,580	4,052,605.20	0.02
185	600875	东方电气	373,420	3,853,694.40	0.02
186	600108	亚盛集团	586,700	3,825,284.00	0.02
187	600369	西南证券	494,596	3,793,551.32	0.02
188	600516	方大炭素	456,700	3,699,270.00	0.02
189	600741	华域汽车	469,828	3,664,658.40	0.02
190	002344	海宁皮城	191,587	3,661,227.57	0.02
191	601139	深圳燃气	400,000	3,556,000.00	0.02
192	600372	中航电子	168,784	3,536,024.80	0.02
193	600118	中国卫星	248,872	3,529,004.96	0.02
194	000528	柳 工	526,808	3,424,252.00	0.02
195	000960	锡业股份	275,915	3,366,163.00	0.02
196	601666	平煤股份	643,025	3,343,730.00	0.02
197	601992	金隅股份	665,547	3,327,735.00	0.02
198	000937	冀中能源	374,399	3,305,943.17	0.02
199	000046	泛海建设	672,956	3,284,025.28	0.02
200	600403	大有能源	385,200	3,281,904.00	0.02
201	000686	东北证券	198,517	3,223,916.08	0.02
202	600873	梅花集团	806,091	3,200,181.27	0.02
203	600316	洪都航空	204,643	3,192,430.80	0.02
204	600123	兰花科创	251,290	3,178,818.50	0.02
205	600143	金发科技	654,899	3,163,162.17	0.02

206	000422	湖北宜化	463,169	3,126,390.75	0.02
207	600169	太原重工	1,331,800	3,103,094.00	0.02
208	600859	王府井	191,172	3,079,780.92	0.01
209	600809	山西汾酒	125,657	3,078,596.50	0.01
210	002155	辰州矿业	381,307	3,065,708.28	0.01
211	600376	首开股份	548,991	3,046,900.05	0.01
212	600132	重庆啤酒	201,368	3,026,561.04	0.01
213	002500	山西证券	505,500	2,992,560.00	0.01
214	601118	海南橡胶	699,630	2,896,468.20	0.01
215	600027	华电国际	907,044	2,857,188.60	0.01
216	600415	小商品城	561,400	2,840,684.00	0.01
217	600216	浙江医药	131,804	2,704,618.08	0.01
218	600160	巨化股份	461,602	2,691,139.66	0.01
219	600170	上海建工	391,800	2,679,912.00	0.01
220	600642	申能股份	675,025	2,565,095.00	0.01
221	600219	南山铝业	544,818	2,555,196.42	0.01
222	600208	新湖中宝	820,100	2,534,109.00	0.01
223	000027	深圳能源	500,000	2,515,000.00	0.01
224	000656	金科股份	213,882	2,478,892.38	0.01
225	000758	中色股份	242,641	2,457,953.33	0.01
226	000401	冀东水泥	297,295	2,443,764.90	0.01
227	600811	东方集团	484,253	2,387,367.29	0.01
228	601333	广深铁路	987,400	2,271,020.00	0.01
229	601158	重庆水务	438,087	2,256,148.05	0.01
230	601866	中海集运	1,169,000	2,244,480.00	0.01
231	000728	国元证券	263,083	2,225,682.18	0.01
232	600664	哈药股份	373,539	2,218,821.66	0.01
233	600971	恒源煤电	284,584	2,191,296.80	0.01
234	000969	安泰科技	281,264	2,182,608.64	0.01
235	600188	兖州煤业	230,582	2,167,470.80	0.01
236	601928	凤凰传媒	257,403	2,164,759.23	0.01
237	600528	中铁二局	446,500	2,161,060.00	0.01
238	601106	中国一重	1,040,900	2,102,618.00	0.01
239	002092	中泰化学	396,400	2,013,712.00	0.01
240	600221	海南航空	948,700	1,916,374.00	0.01
241	002001	新 和 成	127,946	1,885,924.04	0.01
242	000933	神火股份	414,762	1,849,838.52	0.01

243	600582	天地科技	286,312	1,838,123.04	0.01
244	000999	华润三九	67,771	1,799,320.05	0.01
245	600125	铁龙物流	333,000	1,764,900.00	0.01
246	600395	盘江股份	192,876	1,764,815.40	0.01
247	600153	建发股份	269,476	1,695,004.04	0.01
248	601111	中国国航	395,478	1,676,826.72	0.01
249	002673	西部证券	144,400	1,673,596.00	0.01
250	601001	大同煤业	285,507	1,635,955.11	0.01
251	600259	广晟有色	43,545	1,601,149.65	0.01
252	000807	云铝股份	421,675	1,568,631.00	0.01
253	601179	中国西电	503,808	1,541,652.48	0.01
254	600508	上海能源	150,903	1,466,777.16	0.01
255	601101	昊华能源	181,180	1,436,757.40	0.01
256	600970	中材国际	150,000	1,380,000.00	0.01
257	002069	獐子岛	116,122	1,376,045.70	0.01
258	000156	华数传媒	83,600	1,345,960.00	0.01
259	601098	中南传媒	144,595	1,344,733.50	0.01
260	002269	美邦服饰	150,000	1,326,000.00	0.01
261	600839	四川长虹	709,800	1,270,542.00	0.01
262	600588	用友软件	134,217	1,199,899.98	0.01
263	600547	山东黄金	36,554	1,174,480.02	0.01
264	000718	苏宁环球	196,917	1,157,871.96	0.01
265	000869	张裕 A	31,943	1,090,534.02	0.01
266	000961	中南建设	101,300	990,714.00	0.00
267	600598	北大荒	117,300	979,455.00	0.00
268	000778	新兴铸管	198,684	975,538.44	0.00
269	601369	陕鼓动力	131,737	889,224.75	0.00
270	002128	露天煤业	95,198	832,030.52	0.00
271	600997	开滦股份	137,000	780,900.00	0.00
272	600266	北京城建	75,175	769,040.25	0.00
273	600098	广州发展	150,000	756,000.00	0.00
274	601717	郑煤机	120,294	751,837.50	0.00
275	601558	华锐风电	189,150	720,661.50	0.00
276	600058	五矿发展	65,984	719,225.60	0.00
277	600783	鲁信创投	50,890	675,819.20	0.00
278	601099	太平洋	127,495	640,024.90	0.00
279	601989	中国重工	138,020	623,850.40	0.00

280	600550	天威保变	114,236	623,728.56	0.00
281	000061	农产品	101,390	609,353.90	0.00
282	000825	太钢不锈	233,800	600,866.00	0.00
283	002603	以岭药业	25,584	582,291.84	0.00
284	600895	张江高科	109,269	579,125.70	0.00
285	600109	国金证券	48,969	563,143.50	0.00
286	600432	吉恩镍业	59,200	515,632.00	0.00
287	000596	古井贡酒	23,172	483,831.36	0.00
288	600331	宏达股份	112,021	453,685.05	0.00
289	600770	综艺股份	71,424	421,401.60	0.00
290	600456	宝钛股份	31,020	363,864.60	0.00
291	002405	四维图新	22,028	307,951.44	0.00
292	600062	华润双鹤	13,326	266,786.52	0.00
293	002122	天马股份	72,236	257,882.52	0.00
294	002073	软控股份	24,900	208,911.00	0.00
295	000559	万向钱潮	38,685	203,096.25	0.00
296	600779	水井坊	16,300	186,798.00	0.00
297	600827	友谊股份	27,052	185,847.24	0.00
298	000780	平庄能源	25,359	136,177.83	0.00
299	600022	山东钢铁	85,273	135,584.07	0.00
300	600037	歌华有线	21,700	131,502.00	0.00
301	000883	湖北能源	17,820	86,070.60	0.00
302	601216	内蒙君正	10,000	75,000.00	0.00
303	601918	国投新集	9,711	73,318.05	0.00
304	000703	恒逸石化	6,921	59,589.81	0.00
305	000059	辽通化工	12,000	54,360.00	0.00
306	002399	海普瑞	2,557	45,514.60	0.00
307	601233	桐昆股份	5,900	29,854.00	0.00
308	002431	棕榈园林	1,414	26,809.44	0.00
309	002378	章源钨业	1,159	21,615.35	0.00

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	600036	招商银行	104,497,347.89	0.51
2	600016	民生银行	102,570,902.68	0.50

3	601166	兴业银行	68,605,334.05	0.33
4	601318	中国平安	67,459,610.75	0.33
5	600000	浦发银行	51,777,172.22	0.25
6	600519	贵州茅台	49,406,391.92	0.24
7	601328	交通银行	45,957,107.84	0.22
8	000002	万 科 A	45,930,351.72	0.22
9	601088	中国神华	36,274,555.80	0.18
10	600837	海通证券	36,226,588.11	0.18
11	601818	光大银行	30,215,586.93	0.15
12	601006	大秦铁路	29,638,262.60	0.14
13	601601	中国太保	28,766,991.73	0.14
14	601668	中国建筑	28,661,257.84	0.14
15	000651	格力电器	28,062,491.16	0.14
16	600048	保利地产	26,686,159.43	0.13
17	600104	上汽集团	26,424,462.22	0.13
18	601336	新华保险	26,231,481.12	0.13
19	600111	包钢稀土	22,650,670.30	0.11
20	601991	大唐发电	22,567,656.61	0.11

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。

### 7.5.2 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	000002	万 科 A	66,070,394.38	0.32
2	600887	伊利股份	41,085,554.87	0.20
3	000651	格力电器	34,455,641.19	0.17
4	000001	平安银行	29,366,252.80	0.14
5	000776	广发证券	27,944,132.96	0.14
6	000858	五 粮 液	27,332,661.11	0.13
7	601166	兴业银行	22,544,969.62	0.11
8	600837	海通证券	21,954,378.46	0.11
9	000157	中联重科	21,487,451.81	0.10
10	600000	浦发银行	20,260,623.97	0.10
11	600016	民生银行	19,641,927.09	0.10
12	000538	云南白药	19,601,770.73	0.10



13	002024	苏宁云商	16,736,594.64	0.08
14	600036	招商银行	14,398,368.77	0.07
15	000983	西山煤电	13,752,812.96	0.07
16	000100	TCL 集团	13,735,238.52	0.07
17	000069	华侨城 A	13,241,781.83	0.06
18	000562	宏源证券	13,136,490.54	0.06
19	000895	双汇发展	12,908,120.73	0.06
20	000338	潍柴动力	12,695,598.95	0.06

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。

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,693,366,313.92
卖出股票收入（成交）总额	1,344,649,757.30

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。

### 7.6 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	299,100,000.00	1.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	418,862,000.00	2.03
	其中：政策性金融债	418,862,000.00	2.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	717,962,000.00	3.48

### 7.7 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	019302	13 国债 02	3,000,000	299,100,000.00	1.45
2	130201	13 国开 01	2,000,000	198,900,000.00	0.96

3	120228	12 国开 28	1,000,000	99,950,000.00	0.48
4	130214	13 国开 14	700,000	70,112,000.00	0.34
5	080307	08 进出 07	500,000	49,900,000.00	0.24

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	7,998,794.47
2	应收证券清算款	7,227,312.31
3	应收股利	4,576,592.78
4	应收利息	12,008,549.97
5	应收申购款	184,925,093.62
6	其他应收款	13,699.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,750,042.15

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 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	70,320,000.00	0.34	非公开发行 流通受限

### 7.11.6 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
556,544	56,331.43	7,761,675,060.85	24.76%	23,589,244,736.17	75.24%

### 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	10,646,166.26	0.03%

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 (2009年7月10日) 基金份额总额	24,771,957,170.09
本报告期期初基金份额总额	27,756,194,055.50
本报告期基金总申购份额	7,691,411,565.87
减：本报告期基金总赎回份额	4,096,685,824.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,350,919,797.02

## §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	
海通证券	1	2,580,411,974.82	63.91%	284,868.85	67.01%	-
光大证券	1	1,457,134,492.66	36.09%	140,243.43	32.99%	-

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，本基金还选择了广发证券、中投证券和中信证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	134,563,697.60	91.38%	768,500,000.00	100.00%	1,452,636,900.08	100.00%
光大证券	12,700,566.39	8.62%	-	-	-	-

### 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
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 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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