

# 华夏成长证券投资基金 2013年第3季度报告

2013年9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：二〇一三年十月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华夏成长混合   |
| 基金主代码      | 000001   |
| 交易代码       | 000001                      000002                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2001 年 12 月 18 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 8,294,966,557.65 份   |
| 投资目标       | 本基金属成长型基金，主要通过投资于具有良好成长性的上市公司的股票，在保持基金资产安全性和流动性的前提下，实现基金的长期资本增值。 |
| 投资策略       | “追求成长性”和“研究创造价值”。  |
| 业绩比较基准     | 本基金无业绩比较基准。  |
| 风险收益特征     | 本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金。                   |
| 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   |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 196,797,506.14            |
| 2.本期利润         | 1,021,383,044.04          |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1190                    |
| 4.期末基金资产净值     | 9,378,627,148.93          |
| 5.期末基金份额净值     | 1.131                     |

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。

### 3.2 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    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| 过去三个月 | 11.76% | 0.97%     | -          | -             | -   | -   |

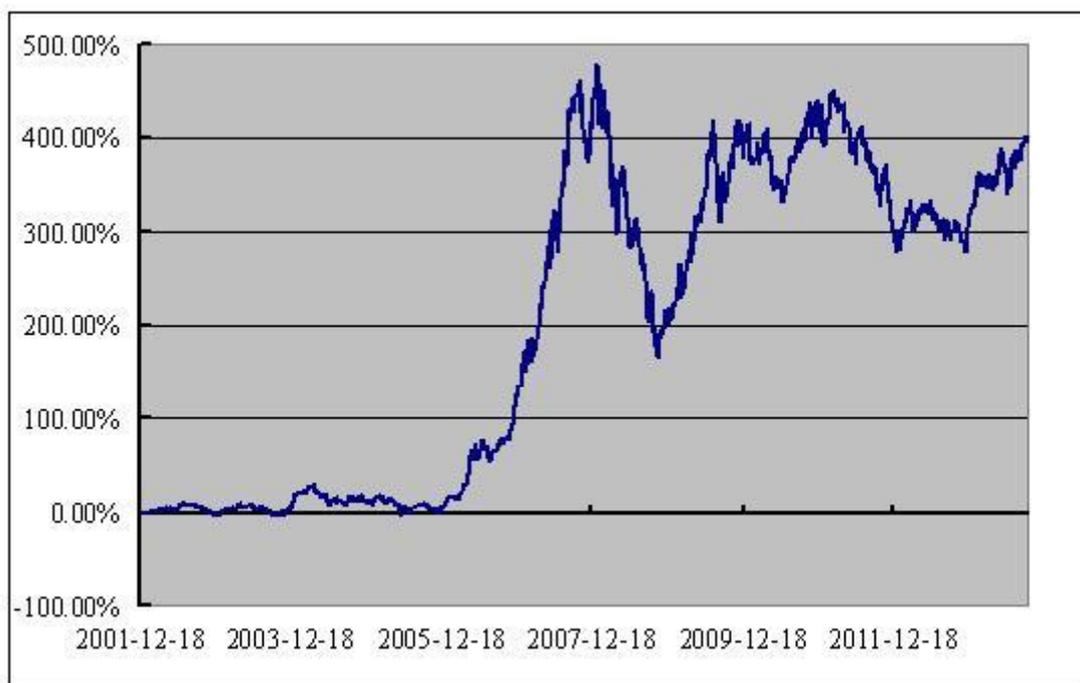
注：本基金未规定业绩比较基准。

#### 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

#### 华夏成长证券投资基金

#### 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

(2001 年 12 月 18 日至 2013 年 9 月 30 日)



注：本基金未规定业绩比较基准。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |        |    |
|    |    |             |      |        |    |

|    |                    |            |   |      |  |
|----|--------------------|------------|---|------|--|
| 童汀 | 本基金的基金经理、股票投资部副总经理 | 2010-01-16 | - | 12 年 | 中国人民银行总行研究生部经济学硕士。曾任南方基金策略研究员、行业研究员、基金经理助理等。2007 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任兴和证券投资基金基金经理（2007 年 4 月 18 日至 2009 年 1 月 1 日期间）、华夏复兴股票型证券投资基金基金经理（2007 年 9 月 10 日至 2009 年 1 月 1 日期间）、华夏红利混合型证券投资基金基金经理（2009 年 1 月 1 日至 2010 年 1 月 16 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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度，主要受正常回补库存以及传统旺季原因的影响，宏观经济在稳增长基调下出现触底回升的走势。同时房价的上涨速度有所加快，通胀开始逐步回升，显示目前经济仍然面临较强的内在约束条件。在国家提出维稳政策、改革预期、经济短期稳住、流动性趋于稳定等综合因素的影响下，A 股市场走出震荡盘升行情，期间符合未来经济转型方向和改革主题的板块表现突出。

报告期内，本基金维持相对中性的仓位，均衡行业配置，增持有业绩支撑的经典成长股和周期成长股，部分参与符合改革方向的主题投资，取得了一定的效果。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.131 元，本报告期份额净值增长率为 11.76%，同期上证综指上涨 9.88%，深证成指上涨 10.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济仍以旧模式为主导，而旧模式的长期向下周期仍未结束，2013 年接近尾声，7.5% 的经济增长目标将圆满完成，而明年经济增长速度可能会再下台阶。4 季度市场整体面临较大不确定性，在经济可能再次下滑的背景下市场较难出现行情，具有长期较好业绩增长前景的经典成长股，以及与新一届政府改革重点相关的行业将表现较好。

本基金将坚持成长型投资理念，把目光放在中国经济中长期发展的角度去寻找投资对象，争取获得长期稳健回报。具体操作上，本基金将采取相对谨慎的投资策略，减少风险暴露，同时在行业上贯彻均衡配置的策略，深入研究并重点持有各行业中的优势龙头企业。

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。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 6,248,403,223.03 | 66.10         |
|    | 其中：股票             | 6,248,403,223.03 | 66.10         |
| 2  | 固定收益投资            | 1,941,299,437.65 | 20.54         |
|    | 其中：债券             | 1,941,299,437.65 | 20.54         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 4  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,224,928,756.39 | 12.96         |
| 6  | 其他各项资产            | 37,882,386.95    | 0.40          |
| 7  | 合计                | 9,452,513,804.02 | 100.00        |

### 5.2 报告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         | 158,956,958.82   | 1.69          |
| B  | 采矿业              | 3,503,296.50     | 0.04          |
| C  | 制造业              | 4,002,197,189.57 | 42.67         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 118,072,714.31   | 1.26          |
| E  | 建筑业              | 58,647,555.90    | 0.63          |
| F  | 批发和零售业           | 60,680,981.56    | 0.65          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 29,977,892.51    | 0.32          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 525,277,432.82   | 5.60          |
| J  | 金融业              | 545,252,035.50   | 5.81          |
| K  | 房地产业             | 269,676,703.43   | 2.88          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 203,899,663.64   | 2.17          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 245,652,798.47   | 2.62          |
| 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 | 26,608,000.00    | 0.28  |
| S | 综合        | -                | -     |
|   | 合计        | 6,248,403,223.03 | 66.62 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 9,450,388  | 422,243,335.84 | 4.50         |
| 2  | 601633 | 长城汽车 | 5,470,233  | 279,419,501.64 | 2.98         |
| 3  | 600837 | 海通证券 | 20,854,473 | 260,889,457.23 | 2.78         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 20,809,863 | 232,446,169.71 | 2.48         |
| 5  | 002643 | 烟台万润 | 11,683,977 | 172,221,820.98 | 1.84         |
| 6  | 000538 | 云南白药 | 1,464,157  | 171,394,218.42 | 1.83         |
| 7  | 002410 | 广联达  | 5,749,822  | 150,070,354.20 | 1.60         |
| 8  | 600535 | 天士力  | 3,259,414  | 146,738,818.28 | 1.56         |
| 9  | 000400 | 许继电气 | 3,709,066  | 119,543,197.18 | 1.27         |
| 10 | 002385 | 大北农  | 9,227,047  | 118,567,553.95 | 1.26         |

5.4 报告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      | 247,440,000.00   | 2.64         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 383,927,000.00   | 4.09         |
|    | 其中：政策性金融债 | 383,927,000.00   | 4.09         |
| 4  | 企业债券      | 1,119,052,112.00 | 11.93        |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,972,000.00    | 0.21         |
| 6  | 中期票据      | 99,275,000.00    | 1.06         |
| 7  | 可转债       | 71,633,325.65    | 0.76         |
| 8  | 其他        | -                | -            |
| 9  | 合计        | 1,941,299,437.65 | 20.70        |

5.5 报告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 | 122149 | 12 石化 01     | 4,000,000 | 388,000,000.00 | 4.14 |
| 2 | 019219 | 12 国债 19     | 2,000,000 | 199,900,000.00 | 2.13 |
| 3 | 130210 | 13 国开 10     | 1,600,000 | 159,952,000.00 | 1.71 |
| 4 | 068007 | 06 首都机场<br>债 | 1,600,000 | 159,008,000.00 | 1.70 |
| 5 | 110236 | 11 国开 36     | 1,300,000 | 126,555,000.00 | 1.35 |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 5.7 报告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。

#### 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.8.1 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。

##### 5.8.2 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。

#### 5.9 投资组合报告附注

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

5.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 5.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,918,665.28  |
| 2  | 应收证券清算款 | 387,740.95    |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 32,022,524.57 |
| 5  | 应收申购款   | 3,553,456.15  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 37,882,386.95 |

## 5.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1  | 110016 | 川投转债 | 66,475,500.00 | 0.71          |
| 2  | 110023 | 民生转债 | 2,996,539.20  | 0.03          |

## 5.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 8,775,369,708.32 |
| 本报告期基金总申购份额   | 253,801,514.02   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 734,204,664.69   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期末基金份额总额   | 8,294,966,557.65 |

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

## 7.1 报告期内披露的主要事项

2013 年 8 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构单笔申购申请最低限额及定期定额申购每次最低扣款额的公告。

2013 年 9 月 11 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大连银行股份有限公司为代销机构的公告。

2013 年 9 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于对中国农业银行金穗借记卡基金电子交易继续实施费率优惠的公告。

2013 年 9 月 25 日发布华夏基金管理有限公司公告。

本基金本报告期末无国债期货投资，本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## 7.2 其他相关信息

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 3 季度，华夏基金较好地把握了市场机会，旗下主动管理的股票及混合型基金净值涨幅全部超越沪深 300 指数，其中 9 只基金今年以来的净值增长率超过 20%；短期理财及货币型基金持续表现良好。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2013 年 10 月 4 日数据），华夏稳增混合今年以来的净值增长率在 12 只灵活配置型混合基金（股票上限 95%）中排名第 1；华夏成长混合今年以来的净值增长率在 30 只偏股型基金（股票上限 80%）中排名第 6；华夏经典混合今年以来的净值增长率在 71 只灵活配置型混合基金（股票上限 80%）中排名第 7。

在客户服务方面，3 季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）微信公众平台新增办理华夏现金增利证券投资基金的申购和快速赎回业务，方便投资者进行现金管理；（2）直销网上交易进一步扩大了货币基金可还款信用卡的范围，并开通了中国工商银行信用卡的跨行自动还款功能。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 8.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 8.1.2 《华夏成长证券投资基金基金合同》；
- 8.1.3 《华夏成长证券投资基金托管协议》；
- 8.1.4 法律意见书；
- 8.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 8.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 8.2 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。

### 8.3 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  
二〇一三年十月二十四日