

# 华夏成长证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年三月二十六日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	
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	8,008,907,453.38份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67595096
传真	010-63136700	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013 年	2012 年	2011 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	949,152,580.93	-1,749,405,966.39	62,215,837.14
本期利润	1,353,452,168.01	636,755,017.05	-2,744,246,294.66
加权平均基金份额本期利润	0.1539	0.0666	-0.2923
本期基金份额净值增长率	15.71%	7.25%	-24.45%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0002	-0.1074	-0.1043
期末基金资产净值	8,905,512,009.22	9,006,429,490.09	8,680,085,605.46
期末基金份额净值	1.112	0.961	0.896

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.68%	0.97%	-	-	-	-
过去六个月	9.88%	0.97%	-	-	-	-
过去一年	15.71%	0.98%	-	-	-	-
过去三年	-6.24%	1.00%	-	-	-	-
过去五年	62.51%	1.18%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	393.39%	1.24%	-	-	-	-

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 12 月 31 日）

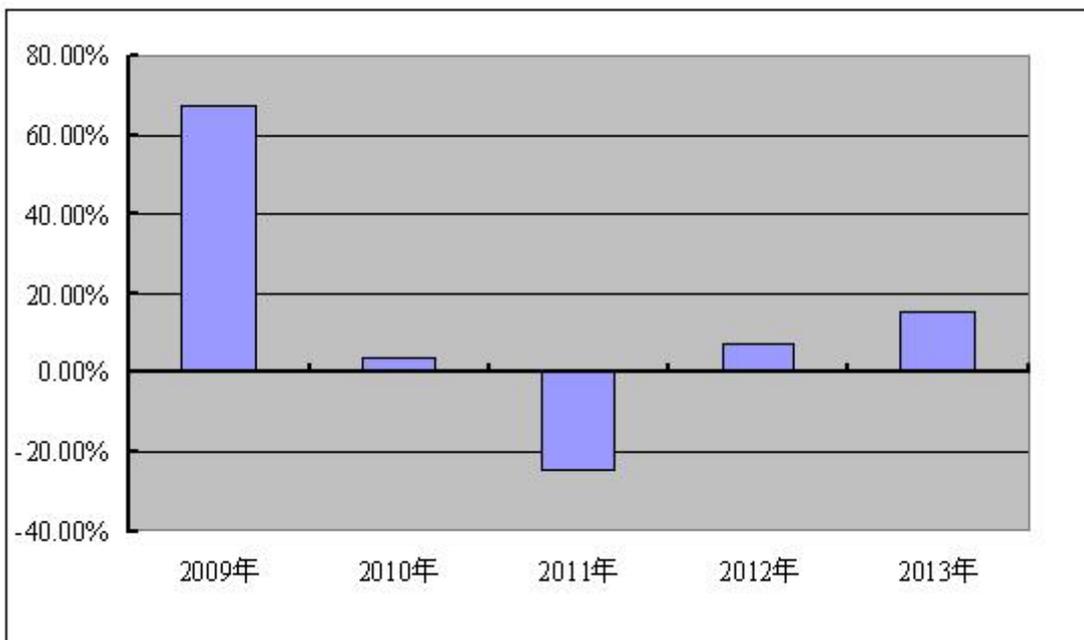


注：本基金未规定业绩比较基准。

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

华夏成长证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率图



注：本基金未规定业绩比较基准。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2013 年，华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础，高度重视风险管理，同时积极把握投资机会，旗下主动管理的股票和混合型基金业绩稳健，短期理财及货币型基金表现持续良好。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 12 月 31 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 29 只偏股型混合基金（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 5。

凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉，2013 年华夏基金荣获多家机构评选的多个奖项，主要奖项包括：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 5 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，2013 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户的交易便利性：（1）推出了货币基金的“还贷款”及信用卡还款业务，方便投资者进行现金管理；（2）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；（3）开通了华夏基金微信公众服务平台并推出微信交易功能，在淘宝网、天天基金网等平台开通基金业务，并与百度达成互联网业务合作，为投资者提供更多交易渠道。

#### 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		
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。
孙振峰	本基金的基金经理	2012-04-05	2013-06-28	9 年	复旦大学经济学博士。曾任银河基金研究员、基金经理助理、银河竞争优势成长股票型证券投资基金基金经理（2009 年 7 月 16 日至 2011 年 11 月 1 日期间）、银河蓝筹精选股票型证券投资基金基金经理（2010 年 7 月 16 日至 2011 年 11 月 1 日期间）等。2011 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。

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 6 月 29 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏成长证券投资基金基金经理的公告》，孙振峰先生不再担任本基金基金经理。

④根据本基金管理人于 2014 年 3 月 18 日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘华夏成长证券投资基金基金经理的公告》，增聘倪邈先生、李铎汶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 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金出现 1 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，经济整体较为平稳，通胀仍保持较温和水平，总体完成年初政府制定目标。自 6 月份开始，一方面央行实行中等偏紧的货币政策，另一方面经济的低效率资金消耗体系变得越来越庞大，对其他经济部分的资金挤出效应越来越强，受上述情况影响，市场利率大幅攀升，并呈现易紧难松的状况。

报告期内，A 股市场受货币市场利率大幅波动、十八届三中全会重大改革文件公布、新股恢复发行等因素影响，走出区间大幅震荡行情。期间分化非常严重，周期类股票持续遭抛售，符合未来经济转型方向的板块如人工智能、影视传媒、手游、软件、互联网等表现突出，传统成长类行业则表现中规中矩，部分业绩超预期的个股表现较好。

报告期内，本基金维持相对中性的仓位，着力于提高仓位有效性，均衡行业配置。自年初开始本基金逐步减持了完全依赖经济弹性的纯周期股，增持了有业绩支撑的经典成长股和周期成长股，期间适度参与了与新经济相关的人工智能、影视传媒、手游、软件等行业，4 季度，本基金适度参与了改革方向的主题投资。全年来看取得了较好的效果。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.112 元，本报告期份额净值增长率为 15.71%，同期上证综指下跌 6.75%，深证成指下跌 10.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年将是传统经济模式和新经济模式交替的关键一年，传统经济模式在经历数次维稳后，已步入越来越难平衡的阶段，后续风险较大；而新经济模式的确立需要较快较大的改革政策和执行力度来促成，十八届三中全会开启了改革大幕，但最终力度需要一步步验证。

2014 年，市场出现整体性行情的机会不大，但由于市场对改革和转型都抱有较大期望，将存在结构性及阶段性的行情，明年的投资也需立足于此。结构性行情可能存在于以下几方面：（1）市场自发产生的，代表新经济未来方向的领域，

如互联网、人工智能、新能源车等；（2）与改革相关的领域，如国企改革、垄断行业放开、高污染行业在环保压力下供给减少带来的行业改善机会等；（3）在盘活存量的大经济背景下，各行业将加速提高集中度，优质龙头个股存在超越行业发展的机会。

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。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人结合法律法规和业务发展需要，修订了公司的风险管理制度、员工投资行为管理制度等内部制度，进一步完善了公司内部制度体系；围绕防控“三条底线”和内幕交易，组织多项合规培训和合规考试，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三

分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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 审计报告

安永华明（2014）审字第 60739337\_B02 号

华夏成长证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏成长证券投资基金财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表和 2013 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

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

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏成长证券投资基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 边卓群 濮晓达

北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

2014 年 3 月 24 日

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华夏成长证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		435,574,952.89	628,164,067.37
结算备付金		10,730,036.33	5,553,794.88
存出保证金		1,512,847.09	4,768,252.45
交易性金融资产		8,400,630,020.49	8,203,056,234.23
其中：股票投资		6,056,664,920.87	6,082,825,279.03
基金投资		-	-
债券投资		2,343,965,099.62	2,120,230,955.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		438,700,219.35	191,300,415.65
应收证券清算款		38,592,197.25	17,012,795.61
应收利息		35,175,351.15	28,761,982.42
应收股利		-	-
应收申购款		3,897,119.18	3,282,718.03
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		9,364,812,743.73	9,081,900,260.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		360,000,000.00	-
应付证券清算款		22,882,565.73	-
应付赎回款		25,731,224.51	16,016,654.47
应付管理人报酬		11,734,619.91	10,810,402.29
应付托管费		1,955,769.99	1,801,733.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		32,938,910.51	41,659,490.19
应交税费		2,773,127.11	2,773,127.11
应付利息		88,541.60	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债		1,195,975.15	2,409,362.76
负债合计		459,300,734.51	75,470,770.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		8,008,907,453.38	9,373,216,081.84
未分配利润		896,604,555.84	-366,786,591.75
所有者权益合计		8,905,512,009.22	9,006,429,490.09
负债和所有者权益总计		9,364,812,743.73	9,081,900,260.64

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.112 元，基金份额总额 8,008,907,453.38 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,562,702,085.66	833,274,635.14
1.利息收入		104,020,852.39	84,815,884.75
其中：存款利息收入		8,381,767.82	5,934,275.09
债券利息收入		86,336,938.17	77,140,080.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,302,146.40	1,741,528.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,049,942,355.35	-1,639,596,143.56
其中：股票投资收益		967,008,961.65	-1,652,106,192.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益		16,462,908.34	-51,571,288.79
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		66,470,485.36	64,081,337.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		404,299,587.08	2,386,160,983.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		4,439,290.84	1,893,910.51
<b>减：二、费用</b>		209,249,917.65	196,519,618.09
1.管理人报酬		140,301,572.19	132,279,257.91

2.托管费		23,383,595.34	22,046,543.04
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		34,978,439.00	39,326,458.42
5.利息支出		10,168,870.58	2,466,557.35
其中：卖出回购金融资产支出		10,168,870.58	2,466,557.35
6.其他费用		417,440.54	400,801.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,353,452,168.01</b>	<b>636,755,017.05</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,353,452,168.01</b>	<b>636,755,017.05</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,373,216,081.84	-366,786,591.75	9,006,429,490.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,353,452,168.01	1,353,452,168.01
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）	-1,364,308,628.46	-90,061,020.42	-1,454,369,648.88
其中：1.基金申购款	1,590,279,925.57	141,383,635.72	1,731,663,561.29
2.基金赎回款	-2,954,588,554.03	-231,444,656.14	-3,186,033,210.17
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）	8,008,907,453.38	896,604,555.84	8,905,512,009.22
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,690,950,718.57	-1,010,865,113.11	8,680,085,605.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	636,755,017.05	636,755,017.05

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)	-317,734,636.73	7,323,504.31	-310,411,132.42
其中: 1.基金申购款	1,302,876,831.18	-101,791,734.26	1,201,085,096.92
2.基金赎回款	-1,620,611,467.91	109,115,238.57	-1,511,496,229.34
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)	9,373,216,081.84	-366,786,591.75	9,006,429,490.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

杨明辉                      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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 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。

##### 7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 7.4.3 关联方关系

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

注:①根据华夏基金管理有限公司于 2013 年 9 月 25 日发布的公告,经中国证监会核准,华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资比例 59%)、南方工业资产

管理有限责任公司(出资比例 11%)、山东省农村经济开发投资公司(出资比例 10%)、POWER CORPORATION OF CANADA (出资比例 10%)、青岛海鹏科技投资有限公司 (出资比例 10%)。

②根据华夏基金管理有限公司于 2014 年 2 月 12 日发布的公告,华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券(出资比例 62.2%)、山东省农村经济开发投资公司(比例 10%)、POWER CORPORATION OF CANADA (出资比例 10%)、青岛海鹏科技投资有限公司(出资比例 10%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例 7.8%)。

③下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	1,922,316,156.00	7.92%	1,566,065,843.56	5.75%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.4.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	-	-	55,264,635.50	2.06%

##### 7.4.4.1.4 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	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至

	2013 年 12 月 31 日		2012 年 12 月 31 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	-	-	1,120,000,000.00	19.59%

#### 7.4.4.1.5 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 12 月 31 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	1,362,145.11	7.09%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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	1,351,218.55	6.59%	1,351,218.55	3.24%

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	140,301,572.19	132,279,257.91
其中：支付销售机构的客户维护费	16,432,440.83	15,270,953.23

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

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

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

基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,383,595.34	22,046,543.04

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

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

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	72,993,010.14	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 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。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 7.4.4.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 活期存款	435,574,952.89	7,871,689.09	628,164,067.37	5,710,639.86

注：本基金的活期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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.5 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.5.1.1 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
000061	农产品	2013-01-23	2014-01-24	非公开发行流通受限	5.46	8.22	10,000,000	54,600,000.00	82,200,000.00	-
002106	莱宝高科	2013-03-18	2014-03-19	非公开发行流通受限	16.52	11.55	3,000,000	49,560,000.00	34,650,000.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

##### 7.4.5.2 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
000625	长安汽车	2013-12-31	待澄清媒体报道	11.45	2014-01-03	11.72	7,694,276	82,620,468.72	88,099,460.20	-
002022	科华生物	2013-12-20	筹划协议转让股份重大事项	16.82	2014-01-27	18.50	10,000	160,091.28	168,200.00	-

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，基金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为 360,000,000.00 元，于 2014 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层级：

第一层级：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

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

#### 7.4.6.2 各层级金融工具公允价值

截至 2013 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为 7,248,453,020.49 元，第二层级的余额为 1,152,177,000.00 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 7,005,375,234.23 元，第二层级的余额为 1,197,681,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

#### 7.4.6.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估

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

#### 7.4.6.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,056,664,920.87	64.67
	其中：股票	6,056,664,920.87	64.67
2	固定收益投资	2,343,965,099.62	25.03
	其中：债券	2,343,965,099.62	25.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	438,700,219.35	4.68
	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	446,304,989.22	4.77
6	其他各项资产	79,177,514.67	0.85
7	合计	9,364,812,743.73	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	227,686,651.91	2.56
B	采矿业	19,673,963.68	0.22
C	制造业	4,181,497,663.94	46.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,948,550.30	1.26
E	建筑业	69,615,455.99	0.78
F	批发和零售业	203,590,031.08	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	48,833,081.07	0.55

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	502,393,004.60	5.64
J	金融业	106,303,505.88	1.19
K	房地产业	146,697,671.00	1.65
L	租赁和商务服务业	183,163,021.80	2.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	255,262,319.62	2.87
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,056,664,920.87	68.01

### 8.3 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	9,680,386	378,309,484.88	4.25
2	601633	长城汽车	5,500,000	226,435,000.00	2.54
3	002643	烟台万润	11,600,000	154,628,000.00	1.74
4	002410	广联达	4,500,000	141,750,000.00	1.59
5	600535	天士力	3,259,414	139,796,266.46	1.57
6	600690	青岛海尔	7,154,990	139,522,305.00	1.57
7	000998	隆平高科	5,049,901	137,761,299.28	1.55
8	000400	许继电气	3,869,017	120,287,738.53	1.35
9	002385	大北农	7,227,195	118,164,638.25	1.33
10	002415	海康威视	5,039,539	115,808,606.22	1.30

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	432,984,798.75	4.81
2	000157	中联重科	270,492,262.79	3.00

3	600383	金地集团	252,936,819.60	2.81
4	601166	兴业银行	226,003,688.46	2.51
5	600048	保利地产	199,078,394.97	2.21
6	000401	冀东水泥	179,334,084.67	1.99
7	002385	大北农	164,426,688.96	1.83
8	600108	亚盛集团	164,312,470.37	1.82
9	000998	隆平高科	150,689,061.69	1.67
10	000001	平安银行	144,488,405.84	1.60
11	002643	烟台万润	143,611,921.52	1.59
12	600739	辽宁成大	131,351,307.58	1.46
13	000651	格力电器	123,828,087.56	1.37
14	600649	城投控股	122,451,562.48	1.36
15	002106	莱宝高科	120,831,948.12	1.34
16	601901	方正证券	119,738,947.54	1.33
17	601311	骆驼股份	119,109,114.20	1.32
18	600271	航天信息	117,562,909.76	1.31
19	601928	凤凰传媒	116,175,426.91	1.29
20	600585	海螺水泥	115,331,858.10	1.28

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	767,195,383.87	8.52
2	601166	兴业银行	382,278,603.41	4.24
3	600048	保利地产	366,643,701.20	4.07
4	601318	中国平安	283,109,313.54	3.14
5	000157	中联重科	249,824,077.03	2.77
6	000002	万科 A	245,463,401.76	2.73
7	600383	金地集团	223,244,123.68	2.48
8	000651	格力电器	212,995,009.21	2.36
9	600000	浦发银行	207,190,098.18	2.30
10	000625	长安汽车	190,389,102.76	2.11
11	600016	民生银行	161,320,886.73	1.79
12	601633	长城汽车	146,722,650.14	1.63

13	601928	凤凰传媒	142,913,385.30	1.59
14	601901	方正证券	128,757,412.97	1.43
15	000001	平安银行	128,175,141.09	1.42
16	600978	宜华木业	127,973,711.43	1.42
17	600572	康恩贝	123,672,192.44	1.37
18	600585	海螺水泥	122,792,242.41	1.36
19	000050	深天马 A	121,253,307.84	1.35
20	002106	莱宝高科	117,024,513.57	1.30

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,491,176,713.62
卖出股票收入（成交）总额	12,912,321,008.54

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	45,390,000.00	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	578,528,000.00	6.50
	其中：政策性金融债	578,528,000.00	6.50
4	企业债券	1,440,718,176.00	16.18
5	企业短期融资券	70,026,000.00	0.79
6	中期票据	95,715,000.00	1.07
7	可转债	113,587,923.62	1.28
8	其他	-	-
9	合计	2,343,965,099.62	26.32

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	126011	08 石化债	4,352,930	432,724,771.30	4.86
2	122149	12 石化 01	4,000,000	380,400,000.00	4.27
3	130243	13 国开 43	2,000,000	198,600,000.00	2.23
4	130210	13 国开 10	1,600,000	159,744,000.00	1.79
5	068007	06 首都机场债	1,600,000	159,264,000.00	1.79

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 2013 年 11 月 24 日 08 石化债、12 石化 01 的发行人中国石化公告了中国政府派出的事故调查组调查的有关情况。本基金投资上述证券的决策程序符合相关法律法规的要求。

8.11.2 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。

8.11.3 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	1,512,847.09
2	应收证券清算款	38,592,197.25
3	应收股利	-
4	应收利息	35,175,351.15
5	应收申购款	3,897,119.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,177,514.67

#### 8.11.4 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	65,919,000.00	0.74
2	110023	民生转债	2,733,729.60	0.03

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
420,123	19,063.24	66,388,182.22	0.83%	7,942,519,271.16	99.17%

#### 9.2 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	3,527,776.94	0.04%

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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2001年12月18日）基金份额总额	3,236,830,105.93
本报告期期初基金份额总额	9,373,216,081.84
本报告期基金总申购份额	1,590,279,925.57
减：本报告期基金总赎回份额	2,954,588,554.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	8,008,907,453.38

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

本基金管理人于 2013 年 11 月 29 日发布公告，杨明辉先生担任华夏基金管理有限公司董事长，王东明先生不再担任华夏基金管理有限公司董事长。

本基金管理人于 2013 年 12 月 7 日发布公告，张后奇先生不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金托管人于 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
信达证券	1	4,929,651,683.43	20.32%	4,469,774.32	23.26%	-
华创证券	1	2,654,646,294.27	10.94%	1,089,464.13	5.67%	-
中信建投证券	1	2,179,956,732.18	8.98%	1,984,630.58	10.33%	-
方正证券	1	1,961,801,891.52	8.08%	1,393,659.41	7.25%	-
中信证券	2	1,922,316,156.00	7.92%	1,362,145.11	7.09%	-
广州证券	1	1,813,520,941.44	7.47%	1,288,316.43	6.71%	-
宏源证券	1	1,464,942,952.92	6.04%	1,333,678.53	6.94%	-
长城证券	2	1,336,181,376.20	5.51%	1,216,462.76	6.33%	-
海通证券	1	1,259,436,494.16	5.19%	1,146,588.45	5.97%	-
东莞证券	1	1,245,445,086.34	5.13%	1,133,849.29	5.90%	-
招商证券	2	903,604,076.83	3.72%	803,814.21	4.18%	-
东方证券	1	682,316,791.27	2.81%	479,413.23	2.50%	-
万联证券	1	681,439,250.26	2.81%	603,006.04	3.14%	-
民生证券	1	439,365,283.06	1.81%	312,125.13	1.62%	-
中金公司	1	376,251,115.75	1.55%	332,944.92	1.73%	-
国信证券	1	245,694,642.95	1.01%	223,680.15	1.16%	-
民族证券	1	96,823,000.46	0.40%	39,735.25	0.21%	-
国泰君安证券	1	71,978,191.08	0.30%	-	-	-

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，本基金还选择了华泰证券、中国银河证券、高华证券、平安证券和申银万国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，广州证券的交易单元和中信证券的部分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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
信达证券	360,925.50	0.03%	-	-
华创证券	472,403,055.30	35.93%	3,509,200,000.00	25.26%
中信建投证券	170,687,398.40	12.98%	900,000,000.00	6.48%
方正证券	260,799,277.90	19.84%	3,250,000,000.00	23.40%
广州证券	24,657,357.90	1.88%	3,179,500,000.00	22.89%
宏源证券	167,390,187.50	12.73%	2,470,900,000.00	17.79%
海通证券	61,390,058.40	4.67%	581,600,000.00	4.19%
东莞证券	80,422,934.00	6.12%	-	-
招商证券	46,308,189.00	3.52%	-	-
华泰证券	30,397,800.00	2.31%	-	-

华夏基金管理有限公司

二〇一四年三月二十六日