

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2013 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

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 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，普华永道中天会计师事务所（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。

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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	11
§6 审计报告.....	11
§7 年度财务报表.....	12
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3 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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
8.7 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.....	49
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.....	49
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
8.11 投资组合报告附注.....	49
§9 基金份额持有人信息.....	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
§10 开放式基金份额变动.....	51
§11 重大事件揭示.....	51
§12 备查文件目录.....	54

§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
基金简称	华夏沪深 300ETF
基金主代码	510330
交易代码	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	7,980,549,828 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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	杨明辉	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	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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 12 月 25 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	170,968,933.75	1,524,235.52
本期利润	-984,475,204.22	512,194,056.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1234	0.1389
本期加权平均净值利润率	-5.12%	13.71%
本期基金份额净值增长率	-5.43%	3.27%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	-614,754,872.23	10,236,165.85
期末可供分配基金份额利润	-0.0770	0.0006
期末基金资产净值	18,882,058,205.33	16,543,877,304.57
期末基金份额净值	2.3660	1.0327
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	-2.34%	3.27%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰

低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.38%	1.12%	-3.28%	1.12%	-0.10%	0.00%
过去六个月	7.00%	1.29%	5.88%	1.29%	1.12%	0.00%
过去一年	-5.43%	1.39%	-7.65%	1.39%	2.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	-2.34%	1.39%	-2.15%	1.40%	-0.19%	-0.01%

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

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

(2012 年 12 月 25 日至 2013 年 12 月 31 日)



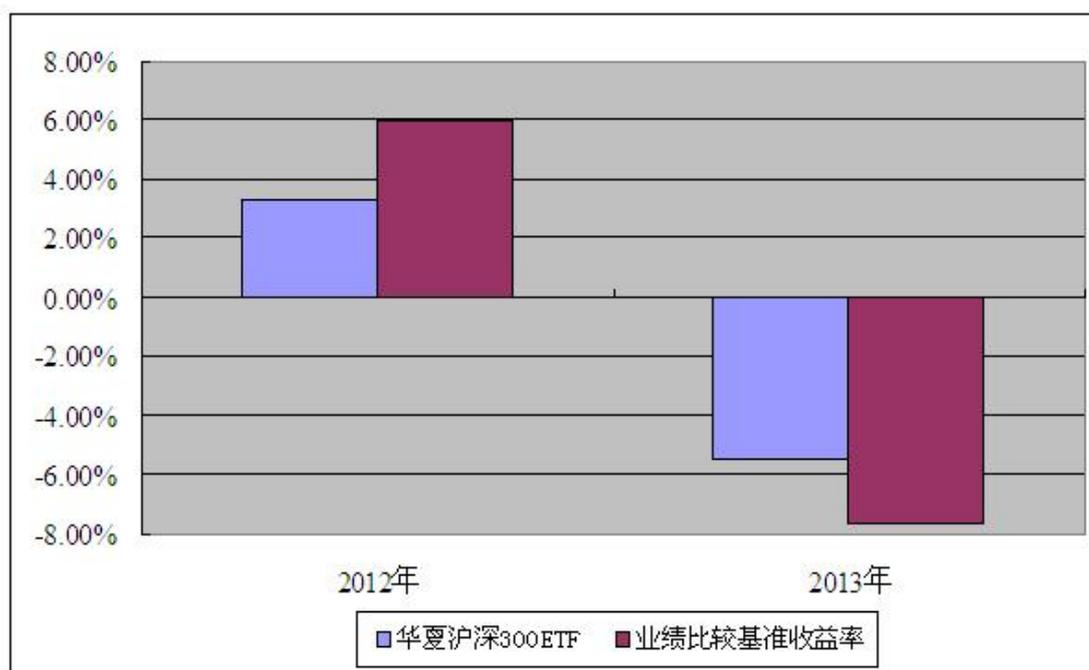
注：根据华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2012 年 12 月 25 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013 年	0.200	160,582,996.56	-	160,582,996.56	-
2012 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日	-	-	-	-	-
合计	0.200	160,582,996.56	-	160,582,996.56	-

§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。

截至 2013 年 12 月 31 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。

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		

张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2012-12-25	-	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 6 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，为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，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。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2013 年，国际方面，美国经济呈现较明显的复苏态势，2 季度以后，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，12 月美联储正式宣布自 2014 年 1 月开始削减量化宽松额度；欧盟经济也出现了温和复苏；日本继续采取宽松货币政策，日元出现了较为明显贬值，对短期经济复苏产生了一定效果。国内方面，经济运行总体平稳，年度国内生产总值（GDP）增长了 7.7%；通货膨胀控制在较低水平，年度居民消费价格指数（CPI）涨幅为 2.6%；货币供应基本达到调控要求，货币供应 M2 年末余额同比增长 13.6%；货币供应 M1 年末余额同比增长 9.3%，但 6 月份和 12 月份仍然出现了短期利率大幅飙升的“钱荒”现象；宏观政策上，11 月召开的十八届三中全会提出了一系列重大改革方案。

市场方面，A 股市场全年整体震荡下跌。春节前，在投资者对经济复苏和流动性宽松等的较强预期下，市场出现上涨；随后在经济基本面不及预期，流动性逐渐紧张，特别是 6 月下旬短期利率大幅上升等因素影响下，市场震荡下跌；之后随着经济基本面预期转好以及自贸区、土地流转等一系列改革政策出台，特别是十八届三中全会的顺利召开，市场震荡上升；12 月，由于经济表现不及预期和短期利率再次大幅上升，市场又出现一定调整。报告期内，沪深 300 指数下跌了 7.65%。

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、赎回以及成份股调整、限制投资股票替代投资等工作。

为更好地体现本基金的工具产品特征，经申请，本基金自 2013 年 4 月 24 日

起被纳入上海证券交易所的融资融券标的证券名单。此外，为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司和海通证券股份有限公司等被确认为本基金的流动性服务商。

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 2.3660 元，本报告期份额净值增长率为-5.43%，同期沪深 300 指数增长率为-7.65%。本基金本报告期跟踪偏离度为+2.22%。本基金与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用以及替代性策略等产生的差异。

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2014年，国际方面，美国及世界其他主要经济体经济继续向好的可能性较大，但需要关注美联储削减量化宽松额度后对全球经济、资金流向等的影响。国内方面，经济总体上仍然会平稳运行，通货膨胀仍处于较低水平，但需要关注利率市场化以及地方政府债务治理等对经济的影响。基于上述判断，沪深300指数维持震荡的可能性较大。但如果出现经济基本面或者改革政策的超预期，沪深300指数可能有较好的投资机会。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥ETF的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，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合规守信、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对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 160,582,996.56 元。

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 2013 年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 审计报告

普华永道中天审字(2014)第 20708 号

华夏沪深 300 交易型开放式指数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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏沪深 300ETF 基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日和 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度和 2012 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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华夏沪深 300ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发

布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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管理层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，上述华夏沪深 300ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏沪深 300ETF 基金 2013 年 12 月 31 日和 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度和 2012 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 洪磊
上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
2014 年 3 月 7 日

§7 年度财务报表

7.1 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

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,158,037.45	15,485,971.01
结算备付金		31,826,826.66	-
存出保证金		1,842,560.78	-
交易性金融资产	7.4.7.2	18,838,334,377.72	16,510,908,418.74
其中：股票投资		18,775,229,772.26	16,510,908,418.74
基金投资		-	-
债券投资		63,104,605.46	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		58,910,847.17	23,243,095.35
应收利息	7.4.7.5	108,234.09	26,254.41
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		18,953,180,883.87	16,549,663,739.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		51,965,910.41	4,840,275.93
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,064,517.60	691,133.56
应付托管费		1,612,903.50	138,226.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,065,656.15	75,330.73
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	8,413,690.88	41,468.01
负债合计		71,122,678.54	5,786,434.94
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	19,496,813,077.56	16,020,609,566.00
未分配利润	7.4.7.10	-614,754,872.23	523,267,738.57
所有者权益合计		18,882,058,205.33	16,543,877,304.57
负债和所有者权益总计		18,953,180,883.87	16,549,663,739.51

注：①报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.3660 元，基金份额总额 7,980,549,828 份。

②本基金合同于 2012 年 12 月 25 日生效，上年度可比期间自 2012 年 12 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日。

7.2 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

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 12 月 25 日 (基金合同生效 日)至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		-853,066,725.22	513,335,761.01
1.利息收入		10,171,716.84	26,254.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,315,011.83	26,254.41
债券利息收入		60,589.01	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,796,116.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		289,436,021.99	2,549,589.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-224,047,684.16	2,549,589.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,120,925.98	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	68,431,440.00	-
股利收益	7.4.7.16	439,931,340.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,155,444,137.97	510,669,821.05

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,769,673.92	90,095.90
减：二、费用		131,408,479.00	1,141,704.44
1.管理人报酬		96,053,287.38	691,133.56
2.托管费		19,210,657.53	138,226.71
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	9,618,679.81	270,876.16
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	6,525,854.28	41,468.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-984,475,204.22	512,194,056.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-984,475,204.22	512,194,056.57

注：本基金合同于 2012 年 12 月 25 日生效，上年度可比期间自 2012 年 12 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日。

7.3 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

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）	16,020,609,566.00	523,267,738.57	16,543,877,304.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-984,475,204.22	-984,475,204.22
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）	3,476,203,511.56	7,035,589.98	3,483,239,101.54
其中：1.基金申购款	11,147,597,596.27	-109,303,538.12	11,038,294,058.15
2.基金赎回款	-7,671,394,084.71	116,339,128.10	-7,555,054,956.61
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）	-	-160,582,996.56	-160,582,996.56
五、期末所有者权益（基金净值）	19,496,813,077.56	-614,754,872.23	18,882,058,205.33

事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 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基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、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、股指期货、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。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《华夏基金管理有限公司关于沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为华夏沪深 300ETF 基金份额折算基准日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。2013 年 1 月 9 日，沪深 300 指数收盘值为 2526.126 点，经本基金管理人计算并经托管人复核的本基金基金资产净值为 16,565,455,671.70 元，折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，折算前基金份额净值为 1.0340 元。根据《华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》中的基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份，折算后基金份额净值为 2.5261 元。本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，本基金登记结算机构已于 2013 年 1 月 10 日进行了变更登记。

7.4.2 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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有

关规定编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2012 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后

的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。赎回转出股票投资收益/(损失)于赎回当日按转出股票以当日市场交易收盘价计算的市值与其成本的差额确认。

当本基金场内申购和赎回对价中包含可以现金替代和退补现金替代时，在本基金补足被替代股票(或采取强制退款)之前，该股票估值日与申购日\赎回日估值的差额确认为“公允价值变动收益/(损失)”。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计

算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	22,158,037.45	15,485,971.01
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	22,158,037.45	15,485,971.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,423,167,825.88	18,775,229,772.26	-647,938,053.62
债 交易所市场	59,940,868.76	63,104,605.46	3,163,736.70

券	银行间市场	-	-	-
	合计	59,940,868.76	63,104,605.46	3,163,736.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		19,483,108,694.64	18,838,334,377.72	-644,774,316.92
项目		上年度末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,000,238,597.69	16,510,908,418.74	510,669,821.05
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		16,000,238,597.69	16,510,908,418.74	510,669,821.05

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应收活期存款利息	9,568.66	26,254.41
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	10,889.01	-
应收债券利息	86,864.30	-

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	912.12	-
合计	108,234.09	26,254.41

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,065,656.15	75,330.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,065,656.15	75,330.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应退替代款	6,543,621.46	-
可退替代款	241,781.14	-
应付指数使用费	1,448,288.28	41,468.01
预提费用	180,000.00	-
合计	8,413,690.88	41,468.01

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,020,609,566.00	16,020,609,566.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2013 年 1 月 9 日基金拆分/ 份额折算前	16,020,609,566.00	-
基金拆分/份额折算调整	-9,462,959,738.00	-

本期申购	4,563,000,000.00	11,147,597,596.27
本期赎回（以“-”号填列）	-3,140,100,000.00	-7,671,394,084.71
本期末	7,980,549,828.00	19,496,813,077.56

7.4.7.10 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	10,236,165.85	513,031,572.72	523,267,738.57
本期利润	170,968,933.75	-1,155,444,137.97	-984,475,204.22
本期基金份额交易产生的变动数	21,135,779.75	-14,100,189.77	7,035,589.98
其中：基金申购款	100,140,056.40	-209,443,594.52	-109,303,538.12
基金赎回款	-79,004,276.65	195,343,404.75	116,339,128.10
本期已分配利润	-160,582,996.56	-	-160,582,996.56
本期末	41,757,882.79	-656,512,755.02	-614,754,872.23

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	708,954.49	26,254.41
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	551,272.14	-
其他	54,785.20	-
合计	1,315,011.83	26,254.41

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-53,772,678.18	2,549,589.65
股票投资收益——赎回差价 收入	-170,275,005.98	-

股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-224,047,684.16	2,549,589.65

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合同 生效日）至 2012 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,214,836,517.04	102,712,567.25
减：卖出股票成本总额	6,268,609,195.22	100,162,977.60
买卖股票差价收入	-53,772,678.18	2,549,589.65

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

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 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	7,555,054,956.61	-
减：现金支付赎回款总额	2,090,598,977.61	-
减：赎回股票成本总额	5,634,730,984.98	-
赎回差价收入	-170,275,005.98	-

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	166,635,693.50	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	161,451,649.27	-
减：应收利息总额	63,118.25	-
债券投资收益	5,120,925.98	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

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 12 月 25 日(基金合 同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	68,431,440.00	-
合计	68,431,440.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日(基金合 同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	439,931,340.17	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	439,931,340.17	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日(基金合 同生效日)至 2012 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,155,444,137.97	510,669,821.05
——股票投资	-1,158,607,874.67	510,669,821.05
——债券投资	3,163,736.70	-
——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	-1,155,444,137.97	510,669,821.05

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	2,769,673.92	-
其他	-	90,095.90
合计	2,769,673.92	90,095.90

注：替代损益指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购\赎回本基金时，补足被替代股票的实际买入成本（或实际卖出金额）与申购日\赎回日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日\赎回日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	9,618,679.81	270,876.16
银行间市场交易费用	-	-
合计	9,618,679.81	270,876.16

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合 同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	-
信息披露费	80,000.00	-
指数使用费	5,763,197.15	41,468.01
上市费	85,000.00	-
银行费用	15,408.14	-
分红手续费	481,748.99	-
其他	500.00	-
合计	6,525,854.28	41,468.01

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2014 年 2 月 10 日发布的分红公告，本基金向 2014 年 2 月 13 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元。

7.4.9 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	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东、一级交易商
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
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏沪深 300ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金

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中信证券股份有限公司于 2013 年 12 月 26 日发布公告，经广东省工商行政管理局核准，其全资子公司中证期货有限公司名称变更为“中信期货有限公司”。

④下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合同 生效日）至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	96,053,287.38	691,133.56

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 0.5% 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 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合同生 效日）至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	19,210,657.53	138,226.71

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 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额占 基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基 金份额占 基金总份 额的比例
中信证券	16,288,165.00	0.20%	283.00	0.00%
华夏沪深 300ETF 联接	6,926,386,915.00	86.79%	15,417,800,721.00	96.24%

注：中信证券持有本基金份额变动的交易通过交易所系统进行，相关规定由上交所、登记结算机构等制定。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 12 月 25 日（基金合同生效 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
中国工商银行 活期存款	22,158,037.45	708,954.49	15,485,971.01	26,254.41

注：本基金的活期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。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 13,619,254,560.00 元（上年度可比期间：0 元），支付给中信期货的佣金为 136,193.57 元（上年度可比期间：0 元）。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2013-09-05	2013-09-06	0.200	160,582,996.56	-	160,582,996.56	-
合计	-	-	0.200	160,582,996.56	-	160,582,996.56	-

注：根据本基金管理人于 2014 年 2 月 10 日发布的分红公告，本基金向 2014 年 2 月 13 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元。

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002106	莱宝高科	2013-03-18	2014-03-19	非公开发行流通受限	16.52	11.55	800,000	13,216,000.00	9,240,000.00	-

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。

7.4.12.2 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
000625	长安汽车	2013-12-31	待澄清媒体报道	11.45	2014-01-03	11.72	6,751,497	53,020,306.84	77,304,640.65	-
601901	方正证券	2013-08-26	筹划重大资产重组事项	5.91	2014-01-13	6.24	10,610,400	52,951,607.18	62,707,464.00	-
600547	山东黄金	2013-12-26	筹划终止重大资产重组事项	17.25	2014-01-02	17.52	2,723,204	85,984,862.63	46,975,269.00	-

000562	宏源证券	2013-10-31	筹划重大资产重组事项	8.22	-	-	4,315,629	39,823,934.85	35,474,470.38	-
600058	五矿发展	2013-07-24	筹划重大资产重组事项	13.56	2014-01-06	14.92	1,561,684	24,878,885.49	21,176,435.04	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比

		例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	18,775,229,772.26	99.43	16,510,908,418.74	99.80
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	18,775,229,772.26	99.43	16,510,908,418.74	99.80

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	+5%	938,761,488.61	-
	-5%	-938,761,488.61	-

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 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 18,829,094,377.72 元，第二层级的余额为 9,240,000.00 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 16,510,908,418.74

元，第二层级的余额为 0 元，第三层级的余额为 0 元。)

7.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

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。

7.4.14.4 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。

§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	18,775,229,772.26	99.06
	其中：股票	18,775,229,772.26	99.06
2	固定收益投资	63,104,605.46	0.33
	其中：债券	63,104,605.46	0.33
	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	53,984,864.11	0.28
6	其他各项资产	60,861,642.04	0.32
7	合计	18,953,180,883.87	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	136,119,669.44	0.72
B	采矿业	1,167,229,584.26	6.18
C	制造业	6,903,616,376.26	36.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	595,166,188.87	3.15
E	建筑业	648,347,190.55	3.43
F	批发和零售业	609,714,957.97	3.23

G	交通运输、仓储和邮政业	512,132,644.32	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	496,867,428.25	2.63
J	金融业	6,168,104,788.37	32.67
K	房地产业	935,004,325.97	4.95
L	租赁和商务服务业	139,998,245.79	0.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	187,187,340.90	0.99
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	94,768,028.22	0.50
S	综合	180,925,969.09	0.96
	合计	18,775,182,738.26	99.43

8.3 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	601318	中国平安	17,053,342	711,635,961.66	3.77
2	600036	招商银行	59,542,078	648,413,229.42	3.43
3	600016	民生银行	81,597,390	629,931,850.80	3.34
4	600837	海通证券	42,145,153	477,083,131.96	2.53
5	601166	兴业银行	41,352,692	419,316,296.88	2.22
6	600000	浦发银行	40,579,300	382,662,799.00	2.03
7	000651	格力电器	8,652,476	282,589,866.16	1.50
8	000002	万科A	34,718,885	278,792,646.55	1.48
9	601288	农业银行	88,864,800	220,384,704.00	1.17
10	601328	交通银行	56,873,105	218,392,723.20	1.16
11	601601	中国太保	11,365,579	210,604,178.87	1.12
12	600887	伊利股份	5,221,814	204,068,491.12	1.08
13	600519	贵州茅台	1,490,292	191,323,686.96	1.01
14	601088	中国神华	11,899,640	188,252,304.80	1.00
15	000001	平安银行	14,864,766	182,093,383.50	0.96
16	601398	工商银行	49,801,238	178,288,432.04	0.94
17	601668	中国建筑	54,448,400	170,967,976.00	0.91
18	600104	上汽集团	11,883,290	168,029,720.60	0.89
19	601006	大秦铁路	21,342,200	157,718,858.00	0.84

20	601818	光大银行	58,125,282	154,613,250.12	0.82
21	000776	广发证券	11,771,659	146,910,304.32	0.78
22	002024	苏宁云商	16,191,709	146,211,132.27	0.77
23	601169	北京银行	19,435,257	145,958,780.07	0.77
24	600015	华夏银行	16,562,680	141,942,167.60	0.75
25	601939	建设银行	34,249,179	141,791,601.06	0.75
26	600048	保利地产	15,780,542	130,189,471.50	0.69
27	000538	云南白药	1,256,455	128,145,845.45	0.68
28	600999	招商证券	10,098,458	128,048,447.44	0.68
29	000333	美的集团	2,457,531	122,876,550.00	0.65
30	600585	海螺水泥	7,158,334	121,405,344.64	0.64
31	600111	包钢稀土	5,229,034	116,450,587.18	0.62
32	600690	青岛海尔	5,915,360	115,349,520.00	0.61
33	600900	长江电力	17,775,903	112,343,706.96	0.59
34	600383	金地集团	16,768,400	112,012,912.00	0.59
35	000895	双汇发展	2,359,226	111,072,360.08	0.59
36	601989	中国重工	18,953,652	106,329,987.72	0.56
37	000858	五粮液	6,775,881	106,110,296.46	0.56
38	601688	华泰证券	11,668,586	104,550,530.56	0.55
39	600089	特变电工	9,744,600	104,462,112.00	0.55
40	600406	国电南瑞	6,857,769	101,975,025.03	0.54
41	600518	康美药业	5,584,210	100,515,780.00	0.53
42	002415	海康威视	4,323,558	99,355,362.84	0.53
43	600256	广汇能源	11,291,085	98,684,082.90	0.52
44	600050	中国联通	30,494,800	97,888,308.00	0.52
45	601857	中国石油	12,577,300	96,970,983.00	0.51
46	002241	歌尔声学	2,750,454	96,485,926.32	0.51
47	600535	天士力	2,204,036	94,531,104.04	0.50
48	600276	恒瑞医药	2,465,310	93,632,473.80	0.50
49	000063	中兴通讯	7,068,140	92,380,589.80	0.49
50	600739	辽宁成大	5,098,835	89,433,565.90	0.47
51	600637	百视通	2,410,212	89,105,537.64	0.47
52	600028	中国石化	19,687,177	88,198,552.96	0.47
53	600018	上港集团	16,416,450	86,678,856.00	0.46
54	601766	中国南车	17,024,741	85,293,952.41	0.45
55	000157	中联重科	15,638,370	85,229,116.50	0.45
56	601628	中国人寿	5,396,241	81,645,126.33	0.43

57	000069	华侨城 A	15,347,315	81,340,769.50	0.43
58	002236	大华股份	1,963,166	80,254,226.08	0.43
59	600196	复星医药	4,086,700	80,058,453.00	0.42
60	600309	万华化学	3,856,800	79,835,760.00	0.42
61	600011	华能国际	15,642,772	79,152,426.32	0.42
62	000625	长安汽车	6,751,497	77,304,640.65	0.41
63	000783	长江证券	7,305,073	75,972,759.20	0.40
64	600795	国电电力	31,597,385	74,253,854.75	0.39
65	000423	东阿阿胶	1,866,509	73,839,096.04	0.39
66	601299	中国北车	14,871,100	73,165,812.00	0.39
67	000100	TCL 集团	31,067,600	72,387,508.00	0.38
68	000338	潍柴动力	3,808,781	72,366,839.00	0.38
69	600019	宝钢股份	17,638,453	72,141,272.77	0.38
70	600315	上海家化	1,699,642	71,775,881.66	0.38
71	600031	三一重工	11,104,700	71,292,174.00	0.38
72	002353	杰瑞股份	885,898	70,313,724.26	0.37
73	601377	兴业证券	7,412,215	70,119,553.90	0.37
74	601899	紫金矿业	28,820,200	66,574,662.00	0.35
75	601336	新华保险	2,887,964	66,076,616.32	0.35
76	000581	威孚高科	2,115,613	65,160,880.40	0.35
77	002450	康得新	2,670,072	64,882,749.60	0.34
78	600703	三安光电	2,609,583	64,691,562.57	0.34
79	601009	南京银行	7,813,309	63,209,669.81	0.33
80	002594	比亚迪	1,674,171	63,082,763.28	0.33
81	000725	京东方 A	29,294,900	62,984,035.00	0.33
82	601901	方正证券	10,610,400	62,707,464.00	0.33
83	600600	青岛啤酒	1,251,883	61,279,672.85	0.32
84	601633	长城汽车	1,464,717	60,302,398.89	0.32
85	601988	中国银行	22,657,812	59,363,467.44	0.31
86	600100	同方股份	5,798,926	58,975,077.42	0.31
87	601117	中国化学	7,325,400	58,603,200.00	0.31
88	600804	鹏博士	4,105,545	57,723,962.70	0.31
89	600352	浙江龙盛	4,358,955	57,625,385.10	0.31
90	000024	招商地产	2,766,473	57,487,308.94	0.30
91	600066	宇通客车	3,265,408	57,340,564.48	0.30
92	600832	东方明珠	5,839,900	57,055,823.00	0.30
93	002230	科大讯飞	1,172,999	56,128,002.15	0.30

94	600332	白云山	2,014,474	55,720,350.84	0.30
95	600369	西南证券	5,529,754	54,910,457.22	0.29
96	600085	同仁堂	2,432,000	52,044,800.00	0.28
97	601607	上海医药	3,512,000	51,942,480.00	0.28
98	601186	中国铁建	11,045,736	51,804,501.84	0.27
99	000402	金融街	9,883,208	51,689,177.84	0.27
100	000728	国元证券	5,065,740	51,670,548.00	0.27
101	600583	海油工程	6,635,700	51,493,032.00	0.27
102	600010	包钢股份	11,940,102	51,461,839.62	0.27
103	000568	泸州老窖	2,497,338	50,296,387.32	0.27
104	601390	中国中铁	18,632,900	49,936,172.00	0.26
105	002038	双鹭药业	978,701	49,473,335.55	0.26
106	600150	中国船舶	2,043,180	49,424,524.20	0.26
107	600009	上海机场	3,445,776	49,343,512.32	0.26
108	600597	光明乳业	2,202,831	48,902,848.20	0.26
109	000826	桑德环境	1,402,033	48,790,748.40	0.26
110	002202	金风科技	5,760,837	48,563,855.91	0.26
111	002385	大北农	2,965,400	48,484,290.00	0.26
112	601808	中海油服	2,152,181	48,036,679.92	0.25
113	000623	吉林敖东	2,688,004	47,738,951.04	0.25
114	600208	新湖中宝	14,885,642	47,634,054.40	0.25
115	000039	中集集团	3,204,658	47,621,217.88	0.25
116	600886	国投电力	12,082,480	47,484,146.40	0.25
117	600649	城投控股	5,678,200	47,299,406.00	0.25
118	002304	洋河股份	1,154,750	47,136,895.00	0.25
119	600547	山东黄金	2,723,204	46,975,269.00	0.25
120	002142	宁波银行	5,076,963	46,860,368.49	0.25
121	000768	中航飞机	4,889,823	46,648,911.42	0.25
122	600705	中航投资	2,741,808	46,555,899.84	0.25
123	002081	金螳螂	2,092,239	45,987,413.22	0.24
124	601555	东吴证券	5,238,872	45,054,299.20	0.24
125	600489	中金黄金	5,262,100	44,990,955.00	0.24
126	601991	大唐发电	10,513,913	44,578,991.12	0.24
127	600108	亚盛集团	5,535,900	44,453,277.00	0.24
128	600252	中恒集团	3,253,375	44,376,035.00	0.24
129	000400	许继电气	1,404,791	43,674,952.19	0.23
130	600660	福耀玻璃	5,211,600	43,204,164.00	0.23

131	000009	中国宝安	4,513,518	42,652,745.10	0.23
132	600362	江西铜业	2,980,569	42,264,468.42	0.22
133	002570	贝因美	1,376,150	42,247,805.00	0.22
134	600177	雅戈尔	5,631,266	42,234,495.00	0.22
135	601669	中国水电	13,713,800	42,101,366.00	0.22
136	600221	海南航空	20,986,200	41,972,400.00	0.22
137	600266	北京城建	4,327,810	41,893,200.80	0.22
138	000970	中科三环	3,255,400	41,799,336.00	0.22
139	000729	燕京啤酒	5,135,209	41,595,192.90	0.22
140	000983	西山煤电	5,840,116	41,464,823.60	0.22
141	600079	人福医药	1,446,788	41,016,439.80	0.22
142	600839	四川长虹	13,443,819	40,869,209.76	0.22
143	002422	科伦药业	888,900	40,791,621.00	0.22
144	600271	航天信息	2,014,475	40,631,960.75	0.22
145	000793	华闻传媒	3,400,354	40,396,205.52	0.21
146	600340	华夏幸福	1,990,413	40,266,054.99	0.21
147	000876	新 希 望	2,806,229	40,213,261.57	0.21
148	600674	川投能源	3,601,865	40,196,813.40	0.21
149	600642	申能股份	8,816,449	40,114,842.95	0.21
150	600741	华域汽车	3,921,676	39,765,794.64	0.21
151	600118	中国卫星	2,141,632	39,684,440.96	0.21
152	000792	盐湖股份	2,357,345	39,438,381.85	0.21
153	000012	南 玻 A	4,819,964	39,234,506.96	0.21
154	600893	航空动力	2,022,202	38,684,724.26	0.20
155	600718	东软集团	3,140,197	38,530,217.19	0.20
156	600153	建发股份	5,368,325	38,383,523.75	0.20
157	601168	西部矿业	7,016,793	37,820,514.27	0.20
158	000831	五矿稀土	1,708,519	37,672,843.95	0.20
159	601888	中国国旅	1,070,890	37,374,061.00	0.20
160	000598	兴蓉投资	6,452,999	37,169,274.24	0.20
161	000800	一汽轿车	3,034,217	36,107,182.30	0.19
162	002344	海宁皮城	1,721,662	35,776,136.36	0.19
163	601600	中国铝业	10,493,878	35,679,185.20	0.19
164	600029	南方航空	12,962,254	35,646,198.50	0.19
165	000562	宏源证券	4,315,629	35,474,470.38	0.19
166	601699	潞安环能	3,287,430	35,076,878.10	0.19
167	000963	华东医药	758,698	34,900,108.00	0.18

168	000999	华润三九	1,400,791	34,865,687.99	0.18
169	600060	海信电器	3,004,809	34,675,495.86	0.18
170	600415	小商品城	5,837,077	34,263,641.99	0.18
171	601018	宁波港	13,976,900	34,103,636.00	0.18
172	000425	徐工机械	4,422,339	33,653,999.79	0.18
173	000629	攀钢钒钛	15,709,492	33,618,312.88	0.18
174	000778	新兴铸管	5,271,581	33,579,970.97	0.18
175	601333	广深铁路	12,024,260	33,547,685.40	0.18
176	000060	中金岭南	5,258,443	33,023,022.04	0.17
177	601118	海南橡胶	4,401,026	32,699,623.18	0.17
178	000061	农产品	3,869,882	32,584,406.44	0.17
179	600143	金发科技	5,793,600	32,212,416.00	0.17
180	600694	大商股份	1,114,972	32,200,391.36	0.17
181	600109	国金证券	1,888,469	32,047,318.93	0.17
182	000709	河北钢铁	15,999,800	31,999,600.00	0.17
183	600811	东方集团	5,010,653	31,517,007.37	0.17
184	601800	中国交建	7,789,530	31,469,701.20	0.17
185	002146	荣盛发展	3,143,508	31,435,080.00	0.17
186	600875	东方电气	2,499,000	31,412,430.00	0.17
187	600348	阳泉煤业	4,442,550	31,364,403.00	0.17
188	002310	东方园林	962,645	31,295,588.95	0.17
189	600655	豫园商城	4,026,900	31,248,744.00	0.17
190	601933	永辉超市	2,346,415	31,183,855.35	0.17
191	601898	中煤能源	6,530,800	31,151,916.00	0.16
192	002375	亚厦股份	1,203,498	31,050,248.40	0.16
193	600166	福田汽车	6,055,200	30,881,520.00	0.16
194	002456	欧菲光	638,648	30,706,195.84	0.16
195	601992	金隅股份	4,507,005	30,647,634.00	0.16
196	600372	中航电子	1,284,134	30,639,437.24	0.16
197	601618	中国中冶	17,430,900	30,504,075.00	0.16
198	000750	国海证券	2,609,760	29,855,654.40	0.16
199	600068	葛洲坝	7,499,500	29,698,020.00	0.16
200	002007	华兰生物	1,032,531	29,633,639.70	0.16
201	600008	首创股份	4,281,082	28,940,114.32	0.15
202	601099	太平洋	4,845,595	28,831,290.25	0.15
203	600062	华润双鹤	1,287,399	28,799,115.63	0.15
204	600436	片仔癀	305,216	28,784,920.96	0.15

205	000686	东北证券	1,810,568	28,643,185.76	0.15
206	600497	驰宏锌锗	3,052,759	28,604,351.83	0.15
207	600827	友谊股份	2,875,900	28,385,133.00	0.15
208	600598	北大荒	2,495,519	28,224,319.89	0.15
209	002500	山西证券	4,081,900	28,165,110.00	0.15
210	600498	烽火通信	1,819,858	28,025,813.20	0.15
211	600267	海正药业	1,873,740	27,768,826.80	0.15
212	601928	凤凰传媒	2,852,603	27,270,884.68	0.14
213	600648	外高桥	838,364	27,020,471.72	0.14
214	600549	厦门钨业	1,116,788	26,847,583.52	0.14
215	600316	洪都航空	1,539,293	26,752,912.34	0.14
216	600588	用友软件	1,921,514	26,593,753.76	0.14
217	002001	新 和 成	1,365,163	26,347,645.90	0.14
218	000630	铜陵有色	2,589,052	25,942,301.04	0.14
219	601958	金钼股份	3,552,000	25,752,000.00	0.14
220	600123	兰花科创	2,399,100	25,598,397.00	0.14
221	600027	华电国际	8,351,200	25,220,624.00	0.13
222	601238	广汽集团	3,027,380	24,945,611.20	0.13
223	600115	东方航空	9,005,200	24,944,404.00	0.13
224	600863	内蒙华电	7,300,937	24,896,195.17	0.13
225	600216	浙江医药	2,363,756	24,701,250.20	0.13
226	002294	信立泰	714,295	24,571,748.00	0.13
227	601111	中国国航	6,157,078	24,320,458.10	0.13
228	000758	中色股份	2,254,196	24,232,607.00	0.13
229	600376	首开股份	4,754,800	23,916,644.00	0.13
230	600663	陆家嘴	1,405,904	23,886,308.96	0.13
231	600688	上海石化	7,807,466	23,812,771.30	0.13
232	002129	中环股份	1,266,002	23,522,317.16	0.12
233	000046	泛海建设	5,227,053	23,469,467.97	0.12
234	601666	平煤股份	4,440,700	23,358,082.00	0.12
235	603000	人民网	298,714	23,290,730.58	0.12
236	600219	南山铝业	4,461,188	23,242,789.48	0.12
237	601098	中南传媒	2,052,062	22,552,161.38	0.12
238	601158	重庆水务	3,812,000	22,452,680.00	0.12
239	000878	云南铜业	2,575,494	22,432,552.74	0.12
240	600664	哈药股份	3,643,300	22,333,429.00	0.12
241	600516	方大炭素	2,929,700	22,295,017.00	0.12

242	601866	中海集运	8,977,600	22,174,672.00	0.12
243	600895	张江高科	2,922,869	21,950,746.19	0.12
244	002155	辰州矿业	2,687,450	21,203,980.50	0.11
245	600873	梅花集团	3,394,010	21,178,622.40	0.11
246	600058	五矿发展	1,561,684	21,176,435.04	0.11
247	600157	永泰能源	3,914,302	21,098,087.78	0.11
248	600188	兖州煤业	2,287,602	20,313,905.76	0.11
249	601106	中国一重	9,374,100	19,591,869.00	0.10
250	002106	莱宝高科	1,693,623	19,561,345.65	0.10
251	600170	上海建工	3,131,640	19,510,117.20	0.10
252	601717	郑煤机	3,009,994	18,812,462.50	0.10
253	000937	冀中能源	2,496,204	18,521,833.68	0.10
254	000528	柳 工	2,894,160	18,406,857.60	0.10
255	000960	锡业股份	1,721,381	18,384,349.08	0.10
256	000933	神火股份	3,787,477	18,255,639.14	0.10
257	600809	山西汾酒	945,200	18,242,360.00	0.10
258	600160	巨化股份	3,366,770	18,079,554.90	0.10
259	600259	广晟有色	459,910	17,867,503.50	0.09
260	600783	鲁信创投	859,990	17,638,394.90	0.09
261	002673	西部证券	1,322,027	17,450,756.40	0.09
262	000401	冀东水泥	2,027,400	17,192,352.00	0.09
263	600546	山煤国际	3,385,180	16,756,641.00	0.09
264	002653	海思科	826,385	16,337,631.45	0.09
265	002399	海普瑞	770,984	15,650,975.20	0.08
266	000718	苏宁环球	3,414,106	15,602,464.42	0.08
267	600859	王府井	852,835	15,487,483.60	0.08
268	601369	陕鼓动力	2,327,571	15,478,347.15	0.08
269	002299	圣农发展	1,602,219	15,429,368.97	0.08
270	002431	棕榈园林	745,944	15,411,203.04	0.08
271	002069	獐子岛	1,049,560	15,313,080.40	0.08
272	600096	云天化	1,711,412	15,231,566.80	0.08
273	601918	国投新集	3,796,980	15,111,980.40	0.08
274	601231	环旭电子	710,049	14,946,531.45	0.08
275	600395	盘江股份	2,002,300	14,536,698.00	0.08
276	601001	大同煤业	2,511,600	14,517,048.00	0.08
277	002603	以岭药业	438,659	14,388,015.20	0.08
278	600970	中材国际	1,688,603	14,015,404.90	0.07

279	600528	中铁二局	2,722,800	13,940,736.00	0.07
280	601258	庞大集团	2,768,061	13,867,985.61	0.07
281	002051	中工国际	676,616	13,802,966.40	0.07
282	600971	恒源煤电	1,887,200	13,455,736.00	0.07
283	000536	华映科技	498,532	13,455,378.68	0.07
284	000869	张裕 A	497,249	13,425,723.00	0.07
285	601101	昊华能源	1,826,900	13,171,949.00	0.07
286	600582	天地科技	1,816,633	12,770,929.99	0.07
287	600997	开滦股份	2,273,800	12,665,066.00	0.07
288	601139	深圳燃气	1,596,864	12,631,194.24	0.07
289	600403	大有能源	1,772,613	12,621,004.56	0.07
290	000961	中南建设	1,744,510	12,263,905.30	0.06
291	600881	亚泰集团	2,973,771	11,657,182.32	0.06
292	000596	古井贡酒	463,289	10,386,939.38	0.06
293	600550	天威保变	1,918,306	9,975,191.20	0.05
294	000656	金科股份	1,167,095	9,430,127.60	0.05
295	000703	恒逸石化	1,181,927	8,840,813.96	0.05
296	002269	美邦服饰	660,344	8,142,041.52	0.04
297	600432	吉恩镍业	913,150	7,058,649.50	0.04
298	002065	东华软件	166,624	5,631,891.20	0.03
299	603993	洛阳钼业	844,796	5,482,726.04	0.03
300	000969	安泰科技	633,994	4,710,575.42	0.02
301	000156	华数传媒	221,244	4,548,776.64	0.02
302	002128	露天煤业	554,764	4,449,207.28	0.02
303	000807	云铝股份	1,195,020	4,063,068.00	0.02
304	000422	湖北宜化	616,960	3,868,339.20	0.02
305	002378	章源钨业	203,631	3,594,087.15	0.02
306	000539	粤电力 A	620,700	2,948,325.00	0.02
307	000027	深圳能源	506,000	2,783,000.00	0.01
308	600508	上海能源	278,300	2,757,953.00	0.01
309	000780	平庄能源	566,940	2,585,246.40	0.01
310	600125	铁龙物流	295,600	1,681,964.00	0.01
311	002092	中泰化学	296,600	1,571,980.00	0.01
312	000059	辽通化工	244,500	1,220,055.00	0.01
313	600005	武钢股份	505,000	1,111,000.00	0.01
314	600169	太原重工	291,900	884,457.00	0.00
315	601788	光大证券	100,000	869,000.00	0.00

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	601318	中国平安	295,289,428.42	1.78
2	000002	万 科 A	239,674,874.79	1.45
3	000001	平安银行	222,028,688.76	1.34
4	600036	招商银行	158,260,117.38	0.96
5	000651	格力电器	153,427,914.84	0.93
6	601398	工商银行	140,765,452.78	0.85
7	000333	美的集团	140,601,078.88	0.85
8	600016	民生银行	107,738,816.56	0.65
9	000776	广发证券	102,582,741.83	0.62
10	600018	上港集团	94,384,535.36	0.57
11	000858	五 粮 液	93,360,096.51	0.56
12	000538	云南白药	88,304,023.13	0.53
13	002450	康得新	88,176,480.26	0.53
14	600332	白云山	80,175,005.83	0.48
15	000562	宏源证券	76,817,248.23	0.46
16	601377	兴业证券	73,747,139.15	0.45
17	002241	歌尔声学	73,398,973.23	0.44
18	002024	苏宁云商	72,025,657.69	0.44
19	002415	海康威视	71,597,719.95	0.43
20	000157	中联重科	70,603,063.57	0.43

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	000001	平安银行	193,804,964.11	1.17
2	000002	万 科 A	189,460,440.54	1.15
3	600837	海通证券	167,333,335.11	1.01
4	600016	民生银行	163,115,999.37	0.99
5	000527	美的电器	148,822,294.34	0.90

6	600000	浦发银行	127,849,394.35	0.77
7	601166	兴业银行	123,231,097.02	0.74
8	000651	格力电器	120,906,247.99	0.73
9	601328	交通银行	118,732,852.84	0.72
10	601318	中国平安	115,442,905.82	0.70
11	600036	招商银行	94,083,009.67	0.57
12	000538	云南白药	83,310,348.68	0.50
13	601788	光大证券	75,848,849.88	0.46
14	000858	五粮液	75,486,577.36	0.46
15	000776	广发证券	72,700,041.14	0.44
16	002024	苏宁云商	64,565,186.41	0.39
17	601377	兴业证券	64,502,694.12	0.39
18	000063	中兴通讯	57,461,630.10	0.35
19	000157	中联重科	55,907,367.87	0.34
20	000895	双汇发展	54,409,127.40	0.33

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	7,512,738,228.32
卖出股票收入（成交）总额	6,214,836,517.04

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	63,104,605.46	0.33

8	其他	-	-
9	合计	63,104,605.46	0.33

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	128002	东华转债	264,210	37,101,953.46	0.20
2	113003	重工转债	143,000	16,663,790.00	0.09
3	127002	徐工转债	56,485	5,273,439.60	0.03
4	113006	深燃转债	41,040	4,065,422.40	0.02
5	-	-	-	-	-

8.7 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。

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 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。

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	1,842,560.78
2	应收证券清算款	58,910,847.17
3	应收股利	-
4	应收利息	108,234.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,861,642.04

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	113003	重工转债	16,663,790.00	0.09

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		华夏沪深 300ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,295	3,477,363.76	1,014,847,132.00	12.72%	39,315,781.00	0.49%	6,926,386,915.00	86.79%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	888,470,969	11.13%
2	海通证券股份有限公司	26,243,000	0.33%
3	中信证券股份有限公司	16,288,165	0.20%
4	海通证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	9,622,740	0.12%
5	华西证券有限责任公司融券专用证券账户	7,631,709	0.10%
6	马秀慧	7,000,000	0.09%
7	光大证券股份有限公司	6,172,001	0.08%
8	国君资管—交行—国泰君安君享对冲七号分级限额特定资产管理计划	5,982,500	0.07%
9	中国对外经济贸易信托有限公司—博普量化套利集合资金信托计划	5,214,556	0.07%
10	中信建投证券股份有限公司	4,305,700	0.05%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	6,926,386,915	86.79%

9.3 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年12月25日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	16,020,609,566
本报告期基金总申购份额	4,563,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	3,140,100,000
本报告期基金拆分变动份额	-9,462,959,738
本报告期期末基金份额总额	7,980,549,828

§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。

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

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	
国泰君安证券	1	6,035,743,559.56	45.30%	666,353.15	46.13%	-
国金证券	3	4,856,558,875.78	36.45%	512,843.19	35.50%	-
中银国际证券	1	2,432,241,238.39	18.25%	265,314.48	18.37%	-

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本基金合同于 2012 年 12 月 25 日生效，除本表列示外，本基金还选择了信达证券、中国银河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。

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
国泰君安证券	211,873,810.70	86.33%	17,470,000,000.00	100.00%
中银国际证券	33,540,294.37	13.67%	-	-

11.8 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华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-07
2	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-11
3	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-11
4	华夏基金管理有限公司关于华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-11
5	华夏基金管理有限公司关于新增华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-29

6	关于调整上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金现金替代比例、现金替代金额计算公式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-01-29
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-03-20
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
9	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-09-02
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-09-25
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-11-29
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-12-07

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

12.1.2 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一四年三月二十六日