

# 华夏优势增长股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十五日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 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 2014 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
6.4.7.21 其他费用.....	21
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额区间的情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	41
§11 备查文件目录.....	44

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏优势增长股票型证券投资基金
基金简称	华夏优势增长股票
基金主代码	000021
交易代码	000021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月24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	10,191,809,358.38份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，以 GARP 模型为基础，结合严谨、深入的基本面分析和全面、细致的估值分析和市场面分析，精选出具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估、价格处于合理区间的股票进行投资。同时，考虑到我国股票市场的波动性，基金将主动进行资产配置，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例，以降低投资风险，提高累积收益。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国 A600 指数，债券投资的业绩比较基准为中债综合指数（财富）。基准收益率=富时中国 A600 指数收益率×80% + 中债综合指数（财富）收益率×20%。
风险收益特征	本基金是股票基金，风险高于货币市场基金、债券基金和混合基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096

电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	010-67595096
传真	010-63136700	010-66275853
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	王洪章

## 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》
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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	59,363,028.11
本期利润	-864,762,316.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0820
本期加权平均净值利润率	-6.83%
本期基金份额净值增长率	-6.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-671,406,949.40
期末可供分配基金份额利润	-0.0659
期末基金资产净值	11,827,909,811.66
期末基金份额净值	1.161
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	138.85%

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	2.47%	0.69%	0.79%	0.64%	1.68%	0.05%
过去三个月	-1.11%	0.86%	1.54%	0.71%	-2.65%	0.15%
过去六个月	-6.67%	1.05%	-3.64%	0.83%	-3.03%	0.22%
过去一年	2.02%	1.13%	2.20%	0.93%	-0.18%	0.20%
过去三年	-17.26%	1.19%	-19.89%	1.04%	2.63%	0.15%
自基金合同生效起至今	138.85%	1.59%	44.83%	1.53%	94.02%	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

华夏优势增长股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 11 月 24 日至 2014 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。

2014 年上半年，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获 6 个单项奖；在《上海证券报》主办的“第十一届中国金基金奖”评选中，华夏基金荣获“金基金·TOP 公司大奖”，所管理的基金荣获 5 个单项奖，为获奖最多的基金公司；在《证券时报》主办的“2013 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”和“2013 年度十大明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 3 个单项奖。

在客户服务方面，上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务，方便投资者进行现金管理；（2）华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）在华夏基金微信公众平台增加扫码绑定功能，投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询，提高投资者使用的便利性。

#### 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		
罗泽萍	本基金的基金经理	2012-01-20	2014-03-17	13 年	经济学硕士。曾任大成基金研究部研究员等。2004 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、兴华证

					券投资基金基金经理（2005 年 4 月 12 日至 2007 年 2 月 14 日期间）、兴安证券投资基金基金经理（2007 年 2 月 14 日至 2007 年 11 月 21 日期间）、华夏行业精选股票型证券投资基金（LOF）基金经理（2007 年 11 月 22 日至 2012 年 1 月 20 日期间）等。
郑晓辉	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2013-05-10	-	11 年	北京大学金融学博士。曾任长盛基金研究员、基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理（2006 年 11 月 29 日至 2008 年 4 月 26 日期间）等。2008 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资经理、机构投资部总经理助理、机构投资部副总经理等。
钱悦	本基金的基金经理	2013-06-28	-	10 年	南京大学—荷兰马斯特里赫特管理学院 IMBA。2004 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任高级研究员、投资研究部副总监等。
孙振峰	本基金的基金经理	2013-06-28	-	10 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, 曾任华夏成长证券投资基金基金经理 (2012 年 4 月 5 日至 2013 年 6 月 28 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。

③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调整华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理的公告》, 罗泽萍女士不再担任本基金基金经理。

#### 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, 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

2014 年上半年，国际方面，全球经济增长分化加剧，美国经济继续呈温和复苏态势，日本、欧洲等经济体的复苏道路仍存在一定的不确定性，新兴经济体则继续缓慢回落。国内方面，经济在持续的“微刺激”政策下，环比增长数据逐渐稳定，但增长动力仍然较弱。国家宏观调控政策导向出现变化，央行除了维持银行间较低的利率外，对商业银行贷款发放实施窗口指导，地方政府也尝试出台稳定地产销售的政策。资本市场方面，政府出台了“新国九条”等一系列维护市场稳定的政策。

A 股市场上半年基本在一个较小的区间内窄幅波动，“存量博弈”特征愈演愈烈。期间，受益于经济改革与转型的小部分中小型股票表现非常活跃，汽车、地产、银行等部分低估值板块也有所表现，而白马成长股则不断被抛弃。

报告期内，本基金逐渐降低仓位，减持了部分业绩低于预期的白马成长股，兑现了部分涨幅较大的中小股票收益，增持了部分地产、银行等低估值板块，同时适度投资部分估值相对合理、发展空间较大的中小股票。但由于对“存量博弈”特征催生的中小股票行情认识不足，本基金对计算机、医疗服务等行业投入力度不够，上半年整体投资效果一般。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.161 元，本报告期份额净值增长率为-6.67%，同期业绩比较基准增长率为-3.64%。

#### 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，国际方面，全球经济在各国政府的呵护下可能继续呈现温和复苏态势。国内方面，在一系列稳增长政策影响下，经济失速的风险不大，但中期看增长下台阶的走势仍未结束，市场难见趋势向上行情。受政策博弈影响，市场可能继续以震荡格局为主，“存量博弈”特征很难实质性改变。

下半年，投资上需要警惕经济增速持续回落对企业盈利的负面影响，关注业绩增速与估值的匹配性，持续重点关注受益于经济改革、治理结构良好、具有持续创新能力的企业。本基金将秉承“以业绩增长”为核心的成长型投资理念，重点研究并跟踪业绩增长较为确定、行业成长空间较大、估值相对较为合理的个股。同时注重“自上而下”的大类资产配置，密切关注宏观刺激政策、行业景气演变催生的投资机会，在控制整体风险的基础上，不断优化投资组合。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏优势增长股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	209,287,691.20	1,837,948,913.80
结算备付金		713,994,097.82	20,383,970.35
存出保证金		3,304,309.09	2,718,769.03
交易性金融资产	6.4.7.2	9,499,239,136.62	11,802,331,878.42
其中：股票投资		8,916,210,157.21	11,272,096,648.96
基金投资		-	-
债券投资		583,028,979.41	530,235,229.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,938,304,577.45	236,669,075.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,424,401.34	6,696,851.76
应收股利		-	-
应收申购款		1,088,776.54	4,427,158.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,374,642,990.06	13,911,176,617.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 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		319,999,320.00	-
应付证券清算款		121,977,656.51	91,987,308.11
应付赎回款		19,663,045.39	20,282,398.77
应付管理人报酬		14,398,795.83	17,363,968.14
应付托管费		2,399,799.30	2,893,994.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	67,321,365.97	63,999,722.22
应交税费		-	-
应付利息		304,870.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	668,324.89	775,439.30
负债合计		546,733,178.40	197,302,831.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,191,809,358.38	11,022,682,818.92
未分配利润	6.4.7.10	1,636,100,453.28	2,691,190,966.97
所有者权益合计		11,827,909,811.66	13,713,873,785.89
负债和所有者权益总计		12,374,642,990.06	13,911,176,617.13

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.161 元，基金份额总额 10,191,809,358.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏优势增长股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-719,433,565.38	737,173,107.47
1.利息收入		22,301,377.61	40,520,218.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,957,468.47	11,314,774.71
债券利息收入		10,504,511.97	18,188,746.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,839,397.17	11,016,698.02

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		180,622,221.03	667,944,140.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	125,607,300.82	590,890,866.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,426,786.68	-1,429,333.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	53,588,133.53	78,482,607.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-924,125,344.30	26,365,063.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,768,180.28	2,343,684.59
<b>减：二、费用</b>		145,328,750.81	157,560,020.76
1.管理人报酬		94,359,451.73	111,410,330.69
2.托管费		15,726,575.26	18,568,388.47
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	34,709,941.92	27,432,302.53
5.利息支出		401,856.84	-
其中：卖出回购金融资产支出		401,856.84	-
6.其他费用	6.4.7.21	130,925.06	148,999.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-864,762,316.19	579,613,086.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-864,762,316.19	579,613,086.71

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏优势增长股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	11,022,682,818.92	2,691,190,966.97	13,713,873,785.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-864,762,316.19	-864,762,316.19
三、本期基金份额交易产	-830,873,460.54	-190,328,197.50	-1,021,201,658.04

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	326,353,889.63	66,893,470.17	393,247,359.80
2.基金赎回款	-1,157,227,350.17	-257,221,667.67	-1,414,449,017.84
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）	10,191,809,358.38	1,636,100,453.28	11,827,909,811.66
项目	上年度可比期间		
	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）	13,272,731,883.22	1,294,825,038.69	14,567,556,921.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	579,613,086.71	579,613,086.71
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）	-1,064,610,652.50	-191,769,295.44	-1,256,379,947.94
其中：1.基金申购款	528,264,367.94	90,158,961.81	618,423,329.75
2.基金赎回款	-1,592,875,020.44	-281,928,257.25	-1,874,803,277.69
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）	12,208,121,230.72	1,682,668,829.96	13,890,790,060.68

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：

_____ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏优势增长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]233 号《关于同意华夏优势增长股票型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》、《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 14,101,845,040.96 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（06）第 020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,102,025,101.39 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明



#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。
- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- 5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日

活期存款	209,287,691.20
定期存款	-
其他存款	-
合计	209,287,691.20

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,369,801,260.24	8,916,210,157.21	546,408,896.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,060,700.00	6,948,979.41
	银行间市场	574,785,260.00	576,080,000.00
	合计	580,845,960.00	583,028,979.41
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,950,647,220.24	9,499,239,136.62	548,591,916.38

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	1,938,304,577.45	-
合计	1,938,304,577.45	-

##### 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 2014年6月30日
应收活期存款利息	224,798.26

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	37,802.06
应收债券利息	7,127,442.38
应收买入返售证券利息	2,032,871.64
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,487.00
合计	9,424,401.34

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	67,313,618.10
银行间市场应付交易费用	7,747.87
合计	67,321,365.97

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	74,105.34
预提费用	94,219.55
合计	668,324.89

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,022,682,818.92	11,022,682,818.92
本期申购	326,353,889.63	326,353,889.63
本期赎回（以“-”号填列）	-1,157,227,350.17	-1,157,227,350.17
本期末	10,191,809,358.38	10,191,809,358.38

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	-783,155,576.02	3,474,346,542.99	2,691,190,966.97
本期利润	59,363,028.11	-924,125,344.30	-864,762,316.19
本期基金份额交易产生的变动数	52,385,598.51	-242,713,796.01	-190,328,197.50
其中：基金申购款	-20,153,302.99	87,046,773.16	66,893,470.17
基金赎回款	72,538,901.50	-329,760,569.17	-257,221,667.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-671,406,949.40	2,307,507,402.68	1,636,100,453.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,657,849.97
定期存款利息收入	1,076,388.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	199,242.14
其他	23,987.47
合计	8,957,468.47

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,567,540,662.93
减：卖出股票成本总额	12,441,933,362.11
买卖股票差价收入	125,607,300.82

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	528,443,453.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	519,166,259.41

减：应收利息总额	7,850,407.01
债券投资收益	1,426,786.68

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	53,588,133.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	53,588,133.53

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-924,125,344.30
——股票投资	-926,300,093.66
——债券投资	2,174,749.36

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-924,125,344.30

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,768,180.28
合计	1,768,180.28

注：本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	34,708,866.92
银行间市场交易费用	1,075.00
合计	34,709,941.92

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	39,671.58
银行费用	27,305.51
银行间账户维护费	9,000.00
其他	400.00
合计	130,925.06

### 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

注：①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%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信证券	2,159,320,743.80	9.26%	2,363,173,755.00	13.27%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
中信证券	-	-	20,227,137.20	11.40%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信证券	-	-	2,200,000,000.00	88.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	1,965,843.00	10.10%	2,838,091.60	4.22%
关联方名称	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	2,151,432.93	14.40%	2,151,432.93	3.34%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至
----	-----------------------	----------------------------



	2014 年 6 月 30 日	2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	94,359,451.73	111,410,330.69
其中：支付销售机构的客户维护费	12,837,850.94	18,590,139.12

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

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,726,575.26	18,568,388.47

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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
中国建设银行 活期存款	209,287,691.20	7,657,849.97	2,717,232,586.18	10,876,745.62

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2014 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
600703	三安光电	2014-01-30	2015-01-28	非公开发行流通受限	21.80	22.46	10,091,743	219,999,997.40	226,660,547.78	-
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新发流通受限	12.20	12.20	34,975	426,695.00	426,695.00	-
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	新发流通受限	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-
002089	新海宜	2014-06-23	2014-07-01	增发流通受限	3.61	9.47	473,003	1,707,540.83	4,479,338.41	-
300195	长荣股份	2014-05-20	2015-05-21	非公开发行流通受限	30.00	28.77	528,111	15,843,330.00	15,193,753.47	-

##### 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
002466	天齐锂业	2014-04-29	筹划重	43.16	-	-	159,934	8,285,327.84	6,902,751.44	-

			大资产 重组事 项							
002551	尚荣医疗	2014-06-12	筹划重 大事项	34.36	-	-	524,207	20,120,880.88	18,011,752.52	-
002565	上海绿新	2014-06-16	筹划非 公开发 行股票 事项	8.64	2014-07-07	9.10	20,112,646	109,971,687.42	173,773,261.44	-
002589	瑞康医药	2014-06-13	筹划重 大事项	46.10	2014-07-03	50.71	1,880,000	56,541,834.48	86,668,000.00	-
300088	长信科技	2014-03-13	筹划重 大资产 重组事 项	19.49	2014-07-01	18.00	1,968,062	39,981,044.05	38,357,528.38	-
300199	翰宇药业	2014-02-20	筹划重 大资产 重组事 项	26.63	2014-08-20	29.00	295,105	5,384,280.02	7,858,646.15	-
300253	卫宁软件	2014-05-28	筹划重 大资产 重组事 项	40.53	2014-08-01	37.50	2,929,922	111,123,755.36	118,749,738.66	-
300323	华灿光电	2014-04-28	筹划重 大资产 重组事 项	18.68	2014-07-28	11.21	10,142,408	173,812,068.94	189,460,181.44	-
002090	金智科技	2014-06-23	筹划非 公开发 行股票 事项	14.30	2014-07-07	14.50	1,950,934	23,219,158.38	27,898,356.20	-

#### 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 2014 年 6 月 30 日止, 本基金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 319,999,320.00 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购 到期日	期末估值 单价	数量(张)	期末估值总额
140213	14 国开 13	2014-07-04	99.82	1,000,000	99,820,000.00
140410	14 农发 10	2014-07-04	100.30	2,000,000	200,600,000.00
140429	14 农发 29	2014-07-04	100.37	200,000	20,074,000.00

合计	-	-	-	3,200,000	320,494,000.00
----	---	---	---	-----------	----------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 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之内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 债券发行人信用评级降低导致债券价格下降, 或基金在交易过程中发生交收违约, 而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下, 基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合, 从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易, 除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外, 其余均能及

时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	209,287,691.20	-	-	209,287,691.20
结算备付金	713,994,097.82	-	-	713,994,097.82
结算保证金	3,304,309.09	-	-	3,304,309.09
债券投资	578,031,979.41	4,997,000.00	-	583,028,979.41
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,938,304,577.45	-	-	1,938,304,577.45
应收直销申购款	115,735.82	-	-	115,735.82
卖出回购金融资产款	319,999,320.00	-	-	319,999,320.00
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,837,948,913.80	-	-	1,837,948,913.80
结算备付金	20,383,970.35	-	-	20,383,970.35
结算保证金	2,718,769.03	-	-	2,718,769.03
债券投资	520,952,429.46	4,480,800.00	4,802,000.00	530,235,229.46
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	236,669,075.00	-	-	236,669,075.00
应收直销申购款	318,862.09	-	-	318,862.09
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2014 年 6 月 30 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	1,060,974.23	403,688.13
	利率上升 25 个基点	-1,056,587.02	-401,739.18

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	8,916,210,157.21	75.38	11,272,096,648.96	82.19
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	8,916,210,157.21	75.38	11,272,096,648.96	82.19

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同

	步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2014 年 6 月 30 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	+5%	325,976,643.35	461,761,439.22
	-5%	-325,976,643.35	-461,761,439.22

#### 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 2014 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 8,663,293,082.85 元，第二层级的余额为 835,946,053.77 元，第三层级的余额为 0 元。（截至 2013 年 12 月 31 日止：第一层级的余额为 11,538,170,878.42 元，第二层级的余额为 264,161,000.00 元，第三层级的余额为 0 元。）

##### 6.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于其进行估值调整之日起从第一层级转入第二层级或第三层级，于股票复牌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	8,916,210,157.21	72.05
	其中：股票	8,916,210,157.21	72.05
2	固定收益投资	583,028,979.41	4.71
	其中：债券	583,028,979.41	4.71
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,938,304,577.45	15.66
	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	923,281,789.02	7.46
7	其他各项资产	13,817,486.97	0.11
8	合计	12,374,642,990.06	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,568,000.00	0.05
B	采矿业	13,099,984.00	0.11
C	制造业	6,043,805,330.91	51.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,601,061.66	0.41
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	419,683,613.01	3.55
G	交通运输、仓储和邮政业	32,890,445.52	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,069,619,518.98	9.04
J	金融业	373,930,339.34	3.16
K	房地产业	534,009,582.07	4.51
L	租赁和商务服务业	-	-



M	科学研究和技术服务业	20,945,171.50	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	234,532,160.80	1.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	119,524,949.42	1.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,916,210,157.21	75.38

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	14,556,996	482,127,707.52	4.08
2	002353	杰瑞股份	10,107,331	406,820,072.75	3.44
3	600703	三安光电	14,211,554	323,187,719.51	2.73
4	600535	天士力	8,000,000	310,160,000.00	2.62
5	600587	新华医疗	3,616,113	269,581,224.15	2.28
6	300267	尔康制药	6,515,535	224,851,112.85	1.90
7	000671	阳光城	24,530,900	215,626,611.00	1.82
8	000625	长安汽车	17,500,000	215,425,000.00	1.82
9	600690	青岛海尔	14,000,000	206,640,000.00	1.75
10	000001	平安银行	20,639,481	204,537,256.71	1.73
11	300323	华灿光电	10,142,408	189,460,181.44	1.60
12	002565	上海绿新	20,112,646	173,773,261.44	1.47
13	002421	达实智能	6,410,214	163,332,252.72	1.38
14	000028	国药一致	4,065,328	162,409,853.60	1.37
15	600557	康缘药业	5,396,503	154,879,636.10	1.31
16	000400	许继电气	7,500,000	150,375,000.00	1.27
17	600406	国电南瑞	10,609,355	141,422,702.15	1.20
18	600048	保利地产	25,413,624	126,051,575.04	1.07
19	000826	桑德环境	5,500,000	125,675,000.00	1.06
20	600410	华胜天成	10,189,048	121,147,780.72	1.02
21	300253	卫宁软件	2,929,922	118,749,738.66	1.00
22	002063	远光软件	5,000,000	102,250,000.00	0.86
23	300070	碧水源	3,300,000	96,525,000.00	0.82
24	002589	瑞康医药	1,880,000	86,668,000.00	0.73
25	000541	佛山照明	8,568,664	85,343,893.44	0.72

26	300030	阳普医疗	6,459,624	80,422,318.80	0.68
27	002223	鱼跃医疗	3,282,552	79,601,886.00	0.67
28	300326	凯利泰	2,109,966	79,081,525.68	0.67
29	300244	迪安诊断	1,729,970	75,720,786.90	0.64
30	000651	格力电器	2,499,814	73,619,522.30	0.62
31	002390	信邦制药	3,421,120	72,767,222.40	0.62
32	600340	华夏幸福	2,815,499	70,866,109.83	0.60
33	300274	阳光电源	4,118,750	68,000,562.50	0.57
34	002022	科华生物	2,939,797	67,762,320.85	0.57
35	600036	招商银行	6,614,625	67,733,760.00	0.57
36	600572	康恩贝	4,696,075	65,134,560.25	0.55
37	002176	江特电机	5,113,392	64,070,801.76	0.54
38	002065	东华软件	3,162,939	63,638,332.68	0.54
39	600999	招商证券	5,999,933	60,659,322.63	0.51
40	002484	江海股份	3,172,016	58,872,616.96	0.50
41	300115	长盈精密	2,655,773	58,480,121.46	0.49
42	000002	万科 A	6,999,941	57,889,512.07	0.49
43	002396	星网锐捷	2,040,327	57,108,752.73	0.48
44	002152	广电运通	3,319,705	56,567,773.20	0.48
45	002491	通鼎光电	3,394,784	55,334,979.20	0.47
46	002005	德豪润达	6,407,401	53,629,946.37	0.45
47	300273	和佳股份	1,699,826	52,184,658.20	0.44
48	600893	航空动力	2,000,000	51,540,000.00	0.44
49	002465	海格通信	3,206,870	51,085,439.10	0.43
50	300146	汤臣倍健	1,982,706	48,873,702.90	0.41
51	000712	锦龙股份	3,255,262	48,601,061.66	0.41
52	600525	长园集团	4,361,542	48,151,423.68	0.41
53	600276	恒瑞医药	1,452,060	48,150,309.60	0.41
54	300298	三诺生物	1,105,244	44,099,235.60	0.37
55	300269	联建光电	1,279,585	44,056,111.55	0.37
56	300195	长荣股份	1,528,111	43,963,753.47	0.37
57	300015	爱尔眼科	1,799,678	43,804,162.52	0.37
58	002439	启明星辰	2,038,605	43,605,760.95	0.37
59	300083	劲胜精密	2,000,000	43,320,000.00	0.37
60	000049	德赛电池	1,070,859	43,016,406.03	0.36
61	300380	安硕信息	863,223	42,297,927.00	0.36
62	600699	均胜电子	1,646,023	41,364,557.99	0.35

63	600015	华夏银行	5,000,000	41,000,000.00	0.35
64	600869	远东电缆	4,896,325	39,905,048.75	0.34
65	002262	恩华药业	1,787,793	39,706,882.53	0.34
66	002437	誉衡药业	760,909	39,186,813.50	0.33
67	002221	东华能源	3,477,488	38,913,090.72	0.33
68	300026	红日药业	1,311,721	38,433,425.30	0.32
69	300088	长信科技	1,968,062	38,357,528.38	0.32
70	300017	网宿科技	593,091	37,839,205.80	0.32
71	002474	榕基软件	4,364,556	37,666,118.28	0.32
72	600978	宜华木业	7,369,849	35,964,863.12	0.30
73	600337	美克股份	6,189,801	35,529,457.74	0.30
74	002701	奥瑞金	1,729,781	34,889,682.77	0.29
75	601218	吉鑫科技	5,764,730	34,011,907.00	0.29
76	600372	中航电子	1,500,000	34,005,000.00	0.29
77	300073	当升科技	1,793,311	33,714,246.80	0.29
78	000516	开元投资	4,999,996	33,599,973.12	0.28
79	600376	首开股份	7,758,317	33,515,929.44	0.28
80	600196	复星医药	1,656,016	33,434,963.04	0.28
81	600270	外运发展	2,722,719	32,890,445.52	0.28
82	002690	美亚光电	897,502	31,654,895.54	0.27
83	600594	益佰制药	758,200	31,184,766.00	0.26
84	300145	南方泵业	1,644,788	31,053,597.44	0.26
85	600067	冠城大通	5,999,969	30,059,844.69	0.25
86	300213	佳讯飞鸿	1,875,181	29,890,385.14	0.25
87	300124	汇川技术	928,926	28,982,491.20	0.25
88	300075	数字政通	874,667	28,277,984.11	0.24
89	000021	长城开发	4,791,754	28,271,348.60	0.24
90	300226	上海钢联	755,247	28,125,398.28	0.24
91	002090	金智科技	1,950,934	27,898,356.20	0.24
92	002382	蓝帆股份	1,317,204	26,383,596.12	0.22
93	002553	南方轴承	2,216,814	26,114,068.92	0.22
94	601700	风范股份	1,942,641	25,448,597.10	0.22
95	300299	富春通信	1,861,218	23,860,814.76	0.20
96	600261	阳光照明	2,399,803	23,710,053.64	0.20
97	000559	万向钱潮	2,301,088	23,655,184.64	0.20
98	300037	新宙邦	641,093	23,271,675.90	0.20
99	002279	久其软件	931,909	22,235,348.74	0.19

100	000911	南宁糖业	2,315,941	21,607,729.53	0.18
101	002091	江苏国泰	1,399,800	21,430,938.00	0.18
102	002089	新海宜	2,249,680	21,304,469.60	0.18
103	002417	三元达	2,942,657	21,039,997.55	0.18
104	002311	海大集团	1,904,947	20,973,466.47	0.18
105	300347	泰格医药	625,229	20,945,171.50	0.18
106	002070	众和股份	2,992,881	20,650,878.90	0.17
107	002108	沧州明珠	1,629,757	20,649,021.19	0.17
108	300170	汉得信息	1,580,573	20,389,391.70	0.17
109	300250	初灵信息	771,074	20,302,378.42	0.17
110	600998	九州通	1,500,000	20,085,000.00	0.17
111	002219	恒康医疗	911,334	20,031,121.32	0.17
112	300128	锦富新材	1,465,895	19,862,877.25	0.17
113	002020	京新药业	1,099,966	19,799,388.00	0.17
114	601231	环旭电子	631,273	19,468,459.32	0.16
115	300302	同有科技	493,561	18,947,806.79	0.16
116	000709	河北钢铁	10,104,000	18,793,440.00	0.16
117	300020	银江股份	605,339	18,523,373.40	0.16
118	600566	洪城股份	795,983	18,387,207.30	0.16
119	002551	尚荣医疗	524,207	18,011,752.52	0.15
120	600446	金证股份	580,596	17,847,521.04	0.15
121	002191	劲嘉股份	1,254,856	16,689,584.80	0.14
122	002347	泰尔重工	1,687,874	15,663,470.72	0.13
123	002445	中南重工	993,000	15,540,450.00	0.13
124	600501	航天晨光	1,422,220	14,506,644.00	0.12
125	600855	航天长峰	846,600	14,493,792.00	0.12
126	002416	爱施德	971,621	14,428,571.85	0.12
127	002664	信质电机	280,406	14,398,848.10	0.12
128	002677	浙江美大	1,084,070	14,320,564.70	0.12
129	000919	金陵药业	1,028,100	14,311,152.00	0.12
130	002583	海能达	508,505	13,861,846.30	0.12
131	600290	华仪电气	1,420,850	13,199,696.50	0.11
132	002115	三维通信	1,948,850	13,135,249.00	0.11
133	600737	中粮屯河	2,733,244	13,064,906.32	0.11
134	600312	平高电气	924,806	12,891,795.64	0.11
135	601001	大同煤业	2,347,200	12,839,184.00	0.11
136	300275	梅安森	827,049	12,736,554.60	0.11

137	000060	中金岭南	1,857,732	12,632,577.60	0.11
138	002159	三特索道	655,966	12,332,160.80	0.10
139	002034	美欣达	834,203	12,012,523.20	0.10
140	300199	翰宇药业	295,105	7,858,646.15	0.07
141	300321	同大股份	211,460	7,185,410.80	0.06
142	002466	天齐锂业	159,934	6,902,751.44	0.06
143	002604	龙力生物	509,418	6,276,029.76	0.05
144	002041	登海种业	200,000	5,568,000.00	0.05
145	002433	太安堂	475,222	4,894,786.60	0.04
146	002364	中恒电气	234,869	4,183,016.89	0.04
147	300168	万达信息	199,878	3,667,761.30	0.03
148	002444	巨星科技	368,205	3,497,947.50	0.03
149	300182	捷成股份	152,506	3,057,745.30	0.03
150	603288	海天味业	79,612	2,694,070.08	0.02
151	002326	永太科技	160,000	2,384,000.00	0.02
152	002547	春兴精工	163,769	1,960,314.93	0.02
153	300367	东方网力	20,000	1,692,000.00	0.01
154	000977	浪潮信息	44,388	1,561,569.84	0.01
155	300252	金信诺	45,348	1,239,360.84	0.01
156	600211	西藏药业	41,485	1,068,238.75	0.01
157	000829	天音控股	111,864	946,369.44	0.01
158	600062	华润双鹤	47,141	810,353.79	0.01
159	600085	同仁堂	38,134	664,675.62	0.01
160	002727	一心堂	34,975	426,695.00	0.00
161	300164	通源石油	16,000	260,800.00	0.00
162	300078	中瑞思创	8,192	222,904.32	0.00
163	603168	莎普爱思	9,892	216,140.20	0.00
164	600351	亚宝药业	10,000	92,000.00	0.00
165	300296	利亚德	1,616	26,793.28	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	242,789,975.80	1.77
2	300226	上海钢联	234,221,008.89	1.71
3	000001	平安银行	200,836,301.50	1.46

4	600048	保利地产	192,396,847.08	1.40
5	300323	华灿光电	173,812,068.94	1.27
6	600410	华胜天成	150,366,239.31	1.10
7	600406	国电南瑞	148,578,310.89	1.08
8	002421	达实智能	137,486,698.39	1.00
9	600557	康缘药业	134,051,161.10	0.98
10	000541	佛山照明	126,253,143.58	0.92
11	600999	招商证券	125,667,923.60	0.92
12	002353	杰瑞股份	113,068,687.44	0.82
13	300017	网宿科技	108,625,908.51	0.79
14	000712	锦龙股份	107,333,291.27	0.78
15	600887	伊利股份	106,995,689.84	0.78
16	600372	中航电子	105,592,359.78	0.77
17	601166	兴业银行	104,856,459.84	0.76
18	002390	信邦制药	104,356,738.53	0.76
19	600893	航空动力	100,763,295.79	0.73
20	000829	天音控股	99,634,997.40	0.73

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000625	长安汽车	259,033,123.03	1.89
2	002241	歌尔声学	248,227,475.82	1.81
3	600887	伊利股份	234,565,299.27	1.71
4	002236	大华股份	219,429,653.82	1.60
5	600703	三安光电	198,087,269.68	1.44
6	000826	桑德环境	195,550,523.69	1.43
7	600535	天士力	180,361,386.86	1.32
8	002415	海康威视	176,936,209.63	1.29
9	600690	青岛海尔	169,732,442.28	1.24
10	000671	阳光城	164,229,839.30	1.20
11	600109	国金证券	161,339,385.21	1.18
12	600089	特变电工	157,716,919.09	1.15
13	600886	国投电力	151,765,851.84	1.11

14	300226	上海钢联	148,634,960.64	1.08
15	000651	格力电器	136,099,833.94	0.99
16	600518	康美药业	134,994,556.53	0.98
17	600587	新华医疗	129,847,323.89	0.95
18	300287	飞利信	124,865,982.75	0.91
19	000538	云南白药	116,858,672.61	0.85
20	002385	大北农	116,281,174.62	0.85

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,012,346,964.02
卖出股票收入（成交）总额	12,567,540,662.93

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	571,083,000.00	4.83
	其中：政策性金融债	571,083,000.00	4.83
4	企业债券	4,997,000.00	0.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,948,979.41	0.06
8	其他	-	-
9	合计	583,028,979.41	4.93

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	140410	14 农发 10	3,800,000	381,140,000.00	3.22

2	140213	14 国开 13	1,200,000	119,784,000.00	1.01
3	140212	14 国开 12	500,000	50,085,000.00	0.42
4	140429	14 农发 29	200,000	20,074,000.00	0.17
5	1380141	13 龙岗区投债	50,000	4,997,000.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	3,304,309.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,424,401.34
5	应收申购款	1,088,776.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,817,486.97

#### 7.12.4 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	110011	歌华转债	3,862,578.00	0.03
2	110016	川投转债	2,359,205.10	0.02
3	128002	东华转债	727,196.31	0.01

#### 7.12.5 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	600703	三安光电	226,660,547.78	1.92	非公开发行流通受限

#### 7.12.6 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
594,365	17,147.39	43,111,792.17	0.42%	10,148,697,566.21	99.58%

## 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	761,466.32	0.01%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年11月24日）基金份额总额	14,102,025,101.39
本报告期期初基金份额总额	11,022,682,818.92
本报告期基金总申购份额	326,353,889.63
减：本报告期基金总赎回份额	1,157,227,350.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	10,191,809,358.38

## §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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本基金托管人于 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### 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	
中投证券	2	5,868,800,974.40	25.16%	4,342,526.26	22.32%	-
中金公司	2	3,623,751,236.38	15.54%	2,993,230.33	15.39%	-
中信建投证券	1	3,487,426,107.38	14.95%	3,174,944.72	16.32%	-
中信证券	1	2,159,320,743.80	9.26%	1,965,843.00	10.10%	-
国泰君安证券	1	1,963,096,706.47	8.42%	1,787,202.65	9.19%	-
西南证券	2	1,449,737,335.66	6.22%	1,319,837.71	6.78%	-
国联证券	2	1,441,023,372.66	6.18%	1,311,907.90	6.74%	-
上海证券	1	1,004,577,934.53	4.31%	713,652.06	3.67%	-
广州证券	1	705,600,417.45	3.03%	501,258.53	2.58%	-
财富里昂证券	1	644,589,392.81	2.76%	457,916.49	2.35%	-
申银万国证券	2	537,021,809.82	2.30%	488,905.07	2.51%	-
高华证券	1	303,134,902.07	1.30%	275,973.64	1.42%	-
中国银河证券	1	133,233,639.99	0.57%	121,297.38	0.62%	-

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，本基金还选择了华鑫证券、广发证券、华融证券、太平洋证券、方正证券、安信证券、信达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	
	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
中投证券	-	-	110,000,000.00	100.00%
中金公司	2,536,195.27	60.82%	-	-
中信建投证券	954,000.00	22.88%	-	-
申银万国证券	679,850.82	16.30%	-	-

### 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新增厦门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	2014-01-23
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-07
3	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-12
4	华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-22
5	华夏基金管理有限公司关于调整华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-18
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-16
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-22

8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-23
9	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-29

## §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 《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏优势增长股票型证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司  
二〇一四年八月二十五日