

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

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。

基金托管人中国工商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）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末投资目标基金明细.....	29
7.3 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.8 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.....	41
7.9 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.....	41
7.10 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.....	41
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.13 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
§11 备查文件目录.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,458,596,812.50份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 12 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	56,487,137.37
本期利润	-1,001,778,741.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0399
本期加权平均净值利润率	-6.01%
本期基金份额净值增长率	-5.55%
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	-8,219,226,945.52
期末可供分配基金份额利润	-0.3360
期末基金资产净值	16,239,369,866.98
期末基金份额净值	0.664
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	-33.60%

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	1.22%	0.75%	0.46%	0.74%	0.76%	0.01%
过去三个月	2.00%	0.83%	1.08%	0.83%	0.92%	0.00%
过去六个月	-5.55%	0.99%	-6.23%	0.99%	0.68%	0.00%
过去一年	0.76%	1.12%	-0.53%	1.11%	1.29%	0.01%
过去三年	-23.33%	1.24%	-24.43%	1.23%	1.10%	0.01%
自基金合同生效起至今	-33.60%	1.33%	-29.46%	1.38%	-4.14%	-0.05%

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

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

华夏基金是境内 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。

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服务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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	15 年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	14 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基

金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2014 年上半年，国际方面，美国经济复苏，失业率持续下降，美联储继续逐步退出量化宽松政策；欧洲经济温和复苏，欧央行 6 月初下调了主要再融资利率，继续实施货币宽松；多个新兴市场年初因受美国退出量化宽松政策影响，货币明显贬值，之后有所恢复。国内方面，经济总体运行平稳，通胀处于较低水平，央行在 2 季度两次定向降准，市场资金面相对宽松；但房地产投资和销售下滑较快，人民币短期快速贬值，国内首次出现债券到期付息违约事件，投资者对经济运行环境的担忧并未消除。

受上述因素影响，上半年 A 股市场先震荡下跌，之后逐渐企稳。报告期内，

沪深 300 指数下跌 7.08%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.664 元，本报告期份额净值增长率为-5.55%，同期业绩比较基准增长率为-6.23%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.68%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为目标 ETF 偏离、成份股调整、成份股分红、日常运作费用、大额申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，美国和欧洲经济将持续复苏，美联储仍将逐步实施退出量化宽松政策。国内方面，经济虽然运行平稳，但仍将面临较多挑战。改革推进力度及相应的财政、货币、税收政策调整等都将对经济和市场产生较大影响。

市场方面，如果在相关宏观经济政策的支持下，实体经济出现企稳向上局面，则目前处于历史相对较低估值水平的沪深300指数会有较好的投资机会；反之，则可能继续维持震荡。

我们将根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2014 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	152,597,068.23	201,784,922.30
结算备付金		528,551.86	1,214,171.01
存出保证金		343,893.26	3,329,090.91
交易性金融资产	6.4.7.2	16,086,986,926.30	17,958,637,597.20
其中：股票投资		659,716,396.71	851,184,300.79
基金投资		14,764,531,675.62	16,387,831,440.89
债券投资		662,738,853.97	719,621,855.52
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	50,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	13,326,551.07	16,817,947.12
应收股利		-	-
应收申购款		1,889,073.90	4,400,974.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,305,672,064.62	18,206,184,702.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		24,048,435.73	6,337,262.97
应付赎回款		39,184,101.26	16,144,697.85
应付管理人报酬		635,376.12	779,473.17
应付托管费		127,075.21	155,894.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,592,371.66	1,519,785.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	714,837.66	832,904.48
负债合计		66,302,197.64	25,770,018.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	24,458,596,812.50	25,851,203,709.02
未分配利润	6.4.7.10	-8,219,226,945.52	-7,670,789,024.95
所有者权益合计		16,239,369,866.98	18,180,414,684.07
负债和所有者权益总计		16,305,672,064.62	18,206,184,702.66

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.664 元，基金份额总额 24,458,596,812.50 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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 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
一、收入		-995,712,695.43	-2,220,108,361.33
1.利息收入		15,374,504.05	11,212,841.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	799,800.35	1,351,829.47
债券利息收入		14,446,790.04	9,861,012.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		127,913.66	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,584,431.69	-362,538,746.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-38,407,642.71	-415,382,992.14
基金投资收益	6.4.7.13	-62,808,899.41	34,103,004.55
债券投资收益	6.4.7.14	893,018.56	1,605,008.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	146,907,955.25	17,136,232.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-1,058,265,878.54	-1,870,552,375.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	594,247.37	1,769,918.62
减：二、费用		6,066,045.74	9,926,940.62
1.管理人报酬		3,969,198.39	5,865,159.11
2.托管费		793,839.69	1,173,031.81
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.21	709,735.79	2,396,013.67
5.利息支出		407,932.78	283,182.28
其中：卖出回购金融资产支出		407,932.78	283,182.28
6.其他费用	6.4.7.22	185,339.09	209,553.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,001,778,741.17	-2,230,035,301.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,001,778,741.17	-2,230,035,301.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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）	25,851,203,709.02	-7,670,789,024.95	18,180,414,684.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,001,778,741.17	-1,001,778,741.17
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）	-1,392,606,896.52	453,340,820.60	-939,266,075.92
其中：1.基金申购款	1,206,405,625.24	-406,680,068.51	799,725,556.73
2.基金赎回款	-2,599,012,521.76	860,020,889.11	-1,738,991,632.65
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）	24,458,596,812.50	-8,219,226,945.52	16,239,369,866.98
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）	27,756,194,055.50	-7,227,266,903.23	20,528,927,152.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,230,035,301.95	-2,230,035,301.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,594,725,741.52	-1,241,936,671.14	2,352,789,070.38
其中：1.基金申购款	7,691,411,565.87	-2,261,822,386.21	5,429,589,179.66
2.基金赎回款	-4,096,685,824.35	1,019,885,715.07	-3,076,800,109.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	31,350,919,797.02	-10,699,238,876.32	20,651,680,920.70

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：

<u>杨明辉</u>	<u>崔雁巍</u>	<u>崔雁巍</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原名华夏沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]531 号《关于核准华夏沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2009 年 7 月 6 日至 2009 年 7 月 8 日期间共募集 24,771,692,420.44 元（不含认购资金利息），业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2009）第 718 号予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 24,771,957,170.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 264,749.65 份基金份额。本基金的基金管理人

为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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	152,597,068.23
定期存款	-
其他存款	-
合计	152,597,068.23

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		700,916,535.46	659,716,396.71	-41,200,138.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	508,200.00	484,853.97	-23,346.03
	银行间市场	659,382,539.18	662,254,000.00	2,871,460.82
	合计	659,890,739.18	662,738,853.97	2,848,114.79
资产支持证券		-	-	-
基金		16,360,304,580.97	14,764,531,675.62	-1,595,772,905.35
其他		-	-	-
合计		17,721,111,855.61	16,086,986,926.30	-1,634,124,929.31

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
交易所市场买入返售金融资产	50,000,000.00	-
合计	50,000,000.00	-

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	51,934.98
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	237.90
应收债券利息	13,274,223.49
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	154.70

合计	13,326,551.07
----	---------------

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	1,590,121.84
银行间市场应付交易费用	2,249.82
合计	1,592,371.66

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	56,151.34
预提费用	158,686.32
合计	714,837.66

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	25,851,203,709.02	25,851,203,709.02
本期申购	1,206,405,625.24	1,206,405,625.24
本期赎回（以“-”号填列）	-2,599,012,521.76	-2,599,012,521.76
本期末	24,458,596,812.50	24,458,596,812.50

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,906,463,159.09	-1,764,325,865.86	-7,670,789,024.95
本期利润	56,487,137.37	-1,058,265,878.54	-1,001,778,741.17
本期基金份额交易产生的变动数	313,608,887.61	139,731,932.99	453,340,820.60
其中：基金申购款	-271,916,206.54	-134,763,861.97	-406,680,068.51

基金赎回款	585,525,094.15	274,495,794.96	860,020,889.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,536,367,134.11	-2,682,859,811.41	-8,219,226,945.52

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	782,930.59
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	7,199.31
其他	9,670.45
合计	799,800.35

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	-38,407,642.71
股票投资收益--赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-38,407,642.71

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	481,103,266.78
卖出股票成本总额	519,510,909.49
买卖股票差价收入	-38,407,642.71

6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	603,112,724.97

减：卖出/赎回基金成本总额	665,921,624.38
基金投资收益	-62,808,899.41

6.4.7.14 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	659,219,653.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	641,606,100.00
减：应收利息总额	16,720,534.84
债券投资收益	893,018.56

6.4.7.15 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。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.18 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	8,536,275.69

基金投资产生的股利收益	138,371,679.56
合计	146,907,955.25

6.4.7.19 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	-1,058,265,878.54
——股票投资	-22,356,206.66
——债券投资	2,370,119.27
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,038,279,791.15
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,058,265,878.54

6.4.7.20 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	594,247.37
合计	594,247.37

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

6.4.7.21 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	707,635.79
银行间市场交易费用	2,100.00
合计	709,735.79

6.4.7.22 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	39,671.58
信息披露费	119,014.74
银行费用	22,152.77
银行间账户维护费	4,500.00
合计	185,339.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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管理费	3,969,198.39	5,865,159.11
其中：支付销售机构的客户维护费	9,520,873.90	12,342,497.81

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=(前一日的基金资产净值 - 前一日基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 0.5% / 当年天数。若前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分为负数，则按 0 计算。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	793,839.69	1,173,031.81

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(剩余部分若为负数则取 0)的 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行 活期存款	152,597,068.23	782,930.59	410,347,217.30	1,246,103.16

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至 2014 年 6 月 30 日止，本基金持有份目标 ETF 基金份额 6,691,380,773 份(2013 年 12 月 31 日：6,926,386,915 份)，占其总份额的比例为 75.13%(2013 年 12 月 31 日：86.79%)。

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	111,009	2,419,996.20	2,493,262.14	-
002727	一心堂	2014-06-25	2014-07-02	新发流通受限	12.20	12.20	26,904	328,228.80	328,228.80	-
603168	莎普爱思	2014-06-24	2014-07-02	新发流通受限	21.85	21.85	9,085	198,507.25	198,507.25	-

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。

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
600637	百视通	2014-05-29	筹划重大资产重组事项	32.03	-	-	103,742	3,986,793.63	3,322,856.26	-
000562	宏源证券	2013-10-31	筹划重大资产重组事项	8.22	2014-07-28	8.93	341,500	2,939,973.24	2,807,130.00	-
600832	东方明珠	2014-05-29	筹划重大资产重组事项	10.98	-	-	199,900	1,331,692.96	2,194,902.00	-
000878	云南铜业	2014-04-17	筹划重大事项	7.61	2014-07-17	7.50	257,329	3,164,112.23	1,958,273.69	-
601669	中国电建	2014-05-13	筹划重大资产重组事项	2.79	-	-	581,223	1,685,960.87	1,621,612.17	-
000009	中国宝安	2014-05-28	筹划发行股份购买资	10.21	2014-8-15	9.33	156,812	1,598,367.04	1,601,050.52	-

			产事项							
000960	锡业股份	2014-05-06	筹划重大资产重组事项	12.44	2014-8-5	13.68	115,115	1,563,416.84	1,432,030.60	-
002570	贝因美	2014-06-19	拟披露重大事项	14.36	-	-	95,926	1,440,731.48	1,377,497.36	-
600516	方大炭素	2014-06-30	待澄清媒体报道	9.59	2014-07-02	9.05	114,100	949,221.25	1,094,219.00	-
600498	烽火通信	2014-06-30	筹划股权激励计划事项	11.91	2014-07-07	12.10	63,600	886,601.53	757,476.00	-

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, 本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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,

将风险控制预期在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金管理人通常用 Beta 值等指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	659,716,396.71	4.06	851,184,300.79	4.68
交易性金融资产-基金投资	14,764,531,675.62	90.92	16,387,831,440.89	90.14
衍生金融资产-股指期货投资	-	-	-	-
合计	15,424,248,072.33	94.98	17,239,015,741.68	94.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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%	777,135,044.98	902,112,176.62
-5%	-777,135,044.98	-902,112,176.62	

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 15,422,239,664.16 元，第二层级的余额为 664,747,262.14 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 17,539,591,597.20 元，第二层级的余额为 419,046,000.00 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	659,716,396.71	4.05
	其中：股票	659,716,396.71	4.05
2	基金投资	14,764,531,675.62	90.55
3	固定收益投资	662,738,853.97	4.06
	其中：债券	662,738,853.97	4.06
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	0.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	153,125,620.09	0.94
8	其他各项资产	15,559,518.23	0.10
9	合计	16,305,672,064.62	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	华夏沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	14,764,531,675.62	90.92

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,096,956.20	0.01
B	采矿业	41,558,314.75	0.26
C	制造业	250,717,518.35	1.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,246,678.09	0.14
E	建筑业	23,266,627.00	0.14
F	批发和零售业	18,648,864.14	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	16,230,572.08	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,806,409.85	0.19
J	金融业	203,618,442.24	1.25
K	房地产业	29,202,083.28	0.18
L	租赁和商务服务业	5,607,197.42	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,962,305.39	0.04
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	6,014,169.40	0.04
S	综合	2,740,258.52	0.02
	合计	659,716,396.71	4.06

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	2,584,090	26,461,081.60	0.16
2	601318	中国平安	634,086	24,944,943.24	0.15
3	600016	民生银行	3,733,976	23,187,990.96	0.14
4	601166	兴业银行	1,514,416	15,189,592.48	0.09

5	600000	浦发银行	1,485,907	13,447,458.35	0.08
6	601288	农业银行	3,901,600	9,832,032.00	0.06
7	000651	格力电器	330,342	9,728,571.90	0.06
8	600837	海通证券	984,011	9,003,700.65	0.06
9	000002	万科A	1,082,200	8,949,794.00	0.06
10	601818	光大银行	3,359,558	8,533,277.32	0.05
11	000001	平安银行	756,078	7,492,732.98	0.05
12	601601	中国太保	415,970	7,400,106.30	0.05
13	600887	伊利股份	217,043	7,188,464.16	0.04
14	600104	上汽集团	438,481	6,708,759.30	0.04
15	600519	贵州茅台	46,114	6,547,265.72	0.04
16	601088	中国神华	436,924	6,352,874.96	0.04
17	600406	国电南瑞	433,937	5,784,380.21	0.04
18	601989	中国重工	1,192,500	5,747,850.00	0.04
19	601169	北京银行	695,243	5,603,658.58	0.03
20	601668	中国建筑	1,984,051	5,595,023.82	0.03
21	601328	交通银行	1,411,850	5,477,978.00	0.03
22	600383	金地集团	593,557	5,276,721.73	0.03
23	601006	大秦铁路	789,260	4,980,230.60	0.03
24	600015	华夏银行	586,133	4,806,290.60	0.03
25	600089	特变电工	563,604	4,784,997.96	0.03
26	000333	美的集团	233,403	4,509,345.96	0.03
27	600352	浙江龙盛	275,421	4,448,049.15	0.03
28	000895	双汇发展	120,426	4,310,046.54	0.03
29	000625	长安汽车	347,699	4,280,174.69	0.03
30	600048	保利地产	853,450	4,233,112.00	0.03
31	600585	海螺水泥	265,082	4,167,089.04	0.03
32	600535	天士力	103,099	3,997,148.23	0.02
33	600028	中国石化	749,200	3,948,284.00	0.02
34	601857	中国石油	519,600	3,917,784.00	0.02
35	002024	苏宁云商	587,473	3,853,822.88	0.02
36	600111	包钢稀土	192,920	3,790,878.00	0.02
37	000776	广发证券	383,062	3,754,007.60	0.02
38	600196	复星医药	183,635	3,707,590.65	0.02
39	600050	中国联通	1,125,230	3,634,492.90	0.02
40	000538	云南白药	68,828	3,592,821.60	0.02
41	601377	兴业证券	399,221	3,441,285.02	0.02

42	000063	中兴通讯	260,738	3,420,882.56	0.02
43	600637	百视通	103,742	3,322,856.26	0.02
44	600019	宝钢股份	806,500	3,306,650.00	0.02
45	002304	洋河股份	65,013	3,299,409.75	0.02
46	600150	中国船舶	156,482	3,295,510.92	0.02
47	000423	东阿阿胶	98,112	3,269,091.84	0.02
48	600276	恒瑞医药	98,484	3,265,729.44	0.02
49	600690	青岛海尔	214,428	3,164,957.28	0.02
50	600011	华能国际	557,026	3,152,767.16	0.02
51	600100	同方股份	348,625	3,106,248.75	0.02
52	600518	康美药业	204,301	3,054,299.95	0.02
53	600900	长江电力	488,720	3,039,838.40	0.02
54	601633	长城汽车	118,843	3,006,727.90	0.02
55	002594	比亚迪	62,297	2,958,484.53	0.02
56	000858	五粮液	164,650	2,952,174.50	0.02
57	000725	京东方 A	1,355,680	2,941,825.60	0.02
58	600256	广汇能源	416,400	2,923,128.00	0.02
59	600703	三安光电	127,752	2,885,550.63	0.02
60	600066	宇通客车	177,143	2,859,088.02	0.02
61	000562	宏源证券	341,500	2,807,130.00	0.02
62	601766	中国南车	623,777	2,806,996.50	0.02
63	000568	泸州老窖	171,057	2,801,913.66	0.02
64	600549	厦门钨业	108,196	2,748,178.40	0.02
65	002230	科大讯飞	102,444	2,725,010.40	0.02
66	002415	海康威视	159,536	2,702,539.84	0.02
67	601688	华泰证券	357,653	2,689,550.56	0.02
68	002241	歌尔声学	100,850	2,688,661.00	0.02
69	600018	上港集团	602,800	2,682,460.00	0.02
70	601628	中国人寿	197,005	2,681,238.05	0.02
71	600739	辽宁成大	173,789	2,646,806.47	0.02
72	600309	万华化学	173,532	2,630,745.12	0.02
73	601901	方正证券	482,494	2,619,942.42	0.02
74	000157	中联重科	583,738	2,585,959.34	0.02
75	000917	电广传媒	168,700	2,569,301.00	0.02
76	000425	徐工机械	370,071	2,534,986.35	0.02
77	600795	国电电力	1,139,200	2,472,064.00	0.02
78	002202	金风科技	258,500	2,453,165.00	0.02

79	601299	中国北车	536,150	2,434,121.00	0.01
80	601390	中国中铁	931,851	2,404,175.58	0.01
81	000100	TCL 集团	1,054,000	2,403,120.00	0.01
82	600058	五矿发展	225,055	2,374,330.25	0.01
83	601336	新华保险	110,705	2,339,196.65	0.01
84	000963	华东医药	42,671	2,304,234.00	0.01
85	601939	建设银行	557,200	2,301,236.00	0.01
86	600886	国投电力	448,912	2,289,451.20	0.01
87	601899	紫金矿业	1,048,900	2,286,602.00	0.01
88	600315	上海家化	62,331	2,284,431.15	0.01
89	000069	华侨城 A	477,036	2,237,298.84	0.01
90	601988	中国银行	874,500	2,229,975.00	0.01
91	601009	南京银行	275,600	2,204,800.00	0.01
92	600832	东方明珠	199,900	2,194,902.00	0.01
93	000413	东旭光电	286,500	2,148,750.00	0.01
94	000581	威孚高科	78,863	2,126,935.11	0.01
95	600804	鹏博士	146,685	2,118,131.40	0.01
96	002236	大华股份	77,698	2,093,961.10	0.01
97	600109	国金证券	103,677	2,060,061.99	0.01
98	000783	长江证券	214,058	2,054,956.80	0.01
99	000758	中色股份	205,218	2,039,866.92	0.01
100	600880	博瑞传播	169,000	2,000,960.00	0.01
101	002051	中工国际	121,139	1,962,451.80	0.01
102	000878	云南铜业	257,329	1,958,273.69	0.01
103	600027	华电国际	635,401	1,950,681.07	0.01
104	002008	大族激光	112,100	1,943,814.00	0.01
105	600010	包钢股份	531,300	1,923,306.00	0.01
106	601618	中国中冶	1,118,800	1,913,148.00	0.01
107	601186	中国铁建	407,118	1,876,813.98	0.01
108	000503	海虹控股	95,558	1,863,381.00	0.01
109	002456	欧菲光	86,900	1,862,267.00	0.01
110	002065	东华软件	92,400	1,859,088.00	0.01
111	600600	青岛啤酒	46,108	1,847,086.48	0.01
112	000768	中航飞机	175,292	1,845,824.76	0.01
113	601929	吉视传媒	160,700	1,838,408.00	0.01
114	600332	白云山	71,000	1,767,190.00	0.01
115	600340	华夏幸福	70,018	1,762,353.06	0.01

116	000402	金融街	320,712	1,747,880.40	0.01
117	000793	华闻传媒	146,800	1,724,900.00	0.01
118	600583	海油工程	234,000	1,724,580.00	0.01
119	600079	人福医药	55,832	1,666,585.20	0.01
120	000061	农产品	180,285	1,664,030.55	0.01
121	600009	上海机场	127,905	1,649,974.50	0.01
122	002129	中环股份	86,124	1,642,384.68	0.01
123	600839	四川长虹	533,000	1,641,640.00	0.01
124	601669	中国电建	581,223	1,621,612.17	0.01
125	002038	双鹭药业	36,355	1,620,342.35	0.01
126	600674	川投能源	137,374	1,612,770.76	0.01
127	000009	中国宝安	156,812	1,601,050.52	0.01
128	600252	中恒集团	136,475	1,600,851.75	0.01
129	600741	华域汽车	161,528	1,579,743.84	0.01
130	601216	内蒙君正	148,302	1,561,620.06	0.01
131	600660	福耀玻璃	184,925	1,553,370.00	0.01
132	000598	兴蓉投资	324,500	1,547,865.00	0.01
133	600271	航天信息	74,000	1,544,380.00	0.01
134	600718	东软集团	113,720	1,534,082.80	0.01
135	600705	中航投资	95,448	1,533,849.36	0.01
136	000826	桑德环境	66,963	1,530,104.55	0.01
137	000039	中集集团	113,366	1,525,906.36	0.01
138	600999	招商证券	146,900	1,485,159.00	0.01
139	600489	中金黄金	195,401	1,485,047.60	0.01
140	000999	华润三九	80,002	1,471,236.78	0.01
141	002465	海格通信	92,100	1,467,153.00	0.01
142	600547	山东黄金	93,740	1,451,095.20	0.01
143	600177	雅戈尔	206,159	1,449,297.77	0.01
144	002450	康得新	63,678	1,448,674.50	0.01
145	600118	中国卫星	78,225	1,445,598.00	0.01
146	000623	吉林敖东	93,070	1,444,446.40	0.01
147	600809	山西汾酒	108,374	1,439,206.72	0.01
148	002353	杰瑞股份	35,754	1,439,098.50	0.01
149	603000	人民网	36,560	1,432,786.40	0.01
150	000960	锡业股份	115,115	1,432,030.60	0.01
151	601991	大唐发电	399,638	1,422,711.28	0.01
152	000024	招商地产	136,136	1,418,537.12	0.01

153	601992	金隅股份	250,247	1,406,388.14	0.01
154	002142	宁波银行	151,065	1,389,798.00	0.01
155	601808	中海油服	78,540	1,381,518.60	0.01
156	002570	贝因美	95,926	1,377,497.36	0.01
157	600867	通化东宝	105,657	1,376,710.71	0.01
158	601168	西部矿业	251,671	1,376,640.37	0.01
159	601117	中国化学	260,515	1,357,283.15	0.01
160	600362	江西铜业	110,465	1,355,405.55	0.01
161	600068	葛洲坝	360,080	1,335,896.80	0.01
162	002475	立讯精密	40,698	1,334,080.44	0.01
163	000970	中科三环	111,813	1,328,338.44	0.01
164	002653	海思科	69,107	1,326,854.40	0.01
165	600221	海南航空	785,700	1,312,119.00	0.01
166	600597	光明乳业	81,049	1,300,025.96	0.01
167	600642	申能股份	297,600	1,285,632.00	0.01
168	601888	中国国旅	38,347	1,266,984.88	0.01
169	002422	科伦药业	31,720	1,264,042.00	0.01
170	000792	盐湖股份	83,578	1,259,520.46	0.01
171	002375	亚厦股份	55,414	1,250,139.84	0.01
172	600170	上海建工	284,822	1,221,886.38	0.01
173	600497	驰宏锌锗	132,539	1,220,684.19	0.01
174	600369	西南证券	142,718	1,220,238.90	0.01
175	600649	城投控股	192,530	1,212,939.00	0.01
176	000729	燕京啤酒	185,540	1,206,010.00	0.01
177	002385	大北农	106,093	1,205,216.48	0.01
178	000012	南玻 A	174,438	1,191,411.54	0.01
179	600153	建发股份	218,541	1,191,048.45	0.01
180	000629	攀钢钒钛	566,716	1,178,769.28	0.01
181	601800	中国交建	312,968	1,176,759.68	0.01
182	601018	宁波港	509,421	1,156,385.67	0.01
183	601600	中国铝业	380,248	1,155,953.92	0.01
184	601333	广深铁路	451,200	1,146,048.00	0.01
185	600108	亚盛集团	205,400	1,135,862.00	0.01
186	000338	潍柴动力	63,434	1,128,490.86	0.01
187	600827	友谊股份	101,896	1,118,818.08	0.01
188	000728	国元证券	118,400	1,117,696.00	0.01
189	000983	西山煤电	208,182	1,097,119.14	0.01

190	600516	方大炭素	114,100	1,094,219.00	0.01
191	600588	用友软件	77,280	1,087,329.60	0.01
192	600029	南方航空	463,400	1,070,454.00	0.01
193	600873	梅花生物	206,891	1,061,350.83	0.01
194	601555	东吴证券	148,425	1,056,786.00	0.01
195	000709	河北钢铁	560,700	1,042,902.00	0.01
196	600875	东方电气	87,600	1,039,812.00	0.01
197	002410	广联达	39,227	1,037,161.88	0.01
198	000401	冀东水泥	127,478	1,036,396.14	0.01
199	002007	华兰生物	38,528	1,005,580.80	0.01
200	600060	海信电器	102,900	992,985.00	0.01
201	600123	兰花科创	131,805	991,173.60	0.01
202	600648	外高桥	37,158	989,889.12	0.01
203	600267	海正药业	66,438	985,275.54	0.01
204	601898	中煤能源	243,608	981,740.24	0.01
205	600316	洪都航空	57,143	976,573.87	0.01
206	600655	豫园商城	132,209	973,058.24	0.01
207	600863	内蒙华电	256,012	965,165.24	0.01
208	600688	上海石化	292,800	963,312.00	0.01
209	601118	海南橡胶	156,530	961,094.20	0.01
210	002344	海宁皮城	75,287	938,828.89	0.01
211	000686	东北证券	130,434	935,211.78	0.01
212	601928	凤凰传媒	100,700	934,496.00	0.01
213	601699	潞安环能	122,200	927,498.00	0.01
214	002294	信立泰	30,800	924,616.00	0.01
215	601958	金钼股份	128,284	905,685.04	0.01
216	600348	阳泉煤业	158,713	895,141.32	0.01
217	600008	首创股份	144,600	893,628.00	0.01
218	002292	奥飞动漫	24,302	891,883.40	0.01
219	601866	中海集运	421,700	889,787.00	0.01
220	002400	省广股份	36,011	885,150.38	0.01
221	002310	东方园林	53,280	879,652.80	0.01
222	002001	新 和 成	70,146	869,108.94	0.01
223	000750	国海证券	90,989	859,846.05	0.01
224	600663	陆家嘴	54,100	856,944.00	0.01
225	600415	小商品城	169,424	852,202.72	0.01
226	002500	山西证券	130,600	847,594.00	0.01

227	000630	铜陵有色	94,010	842,329.60	0.01
228	600208	新潮中宝	287,171	838,539.32	0.01
229	600893	航空动力	32,110	827,474.70	0.01
230	600436	片仔癀	10,500	814,065.00	0.01
231	600031	三一重工	158,503	798,855.12	0.00
232	600216	浙江医药	86,707	793,369.05	0.00
233	600664	哈药股份	126,410	786,270.20	0.00
234	600115	东方航空	338,601	782,168.31	0.00
235	600219	南山铝业	152,018	763,130.36	0.00
236	600157	永泰能源	321,670	762,357.90	0.00
237	600498	烽火通信	63,600	757,476.00	0.00
238	000883	湖北能源	143,300	755,191.00	0.00
239	002106	莱宝高科	65,598	741,257.40	0.00
240	000422	湖北宜化	147,869	740,823.69	0.00
241	601607	上海医药	58,671	729,280.53	0.00
242	600085	同仁堂	40,865	712,276.95	0.00
243	002146	荣盛发展	72,964	690,969.08	0.00
244	601098	中南传媒	46,910	677,380.40	0.00
245	600895	张江高科	102,800	670,256.00	0.00
246	600266	北京城建	88,440	660,646.80	0.00
247	600376	首开股份	147,791	638,457.12	0.00
248	601666	平煤股份	155,325	627,513.00	0.00
249	600259	广晟有色	16,110	615,885.30	0.00
250	002673	西部证券	56,300	608,040.00	0.00
251	002399	海普瑞	32,085	599,347.80	0.00
252	000027	深圳能源	105,100	590,662.00	0.00
253	600998	九州通	43,000	575,770.00	0.00
254	601111	中国国航	170,500	560,945.00	0.00
255	000876	新希望	48,561	548,253.69	0.00
256	000937	冀中能源	91,899	535,771.17	0.00
257	600023	浙能电力	109,360	494,307.20	0.00
258	000718	苏宁环球	107,317	483,999.67	0.00
259	000831	五矿稀土	23,000	482,540.00	0.00
260	600546	山煤国际	131,427	470,508.66	0.00
261	600783	鲁信创投	29,200	468,952.00	0.00
262	600372	中航电子	20,469	464,032.23	0.00
263	601258	庞大集团	104,698	459,624.22	0.00

264	601158	重庆水务	88,787	438,607.78	0.00
265	601179	中国西电	122,300	436,611.00	0.00
266	000656	金科股份	62,582	431,189.98	0.00
267	000778	新兴铸管	115,164	427,258.44	0.00
268	000869	张裕 A	17,627	424,986.97	0.00
269	600633	浙报传媒	31,500	418,005.00	0.00
270	600096	云天化	59,413	417,673.39	0.00
271	600395	盘江股份	65,476	417,082.12	0.00
272	002416	爱施德	26,700	396,495.00	0.00
273	603699	纽威股份	20,000	389,400.00	0.00
274	601918	国投新集	138,996	387,798.84	0.00
275	002081	金螳螂	26,633	377,123.28	0.00
276	603993	洛阳钼业	52,200	349,740.00	0.00
277	002269	美邦服饰	41,300	343,203.00	0.00
278	601139	深圳燃气	50,200	335,336.00	0.00
279	600403	大有能源	63,100	333,799.00	0.00
280	002727	一心堂	26,904	328,228.80	0.00
281	000961	中南建设	45,124	294,659.72	0.00
282	601225	陕西煤业	66,500	274,645.00	0.00
283	000156	华数传媒	9,200	258,428.00	0.00
284	601933	永辉超市	37,492	236,949.44	0.00
285	600166	福田汽车	42,612	217,321.20	0.00
286	600143	金发科技	47,852	211,027.32	0.00
287	603168	莎普爱思	9,085	198,507.25	0.00
288	000400	许继电气	9,856	197,612.80	0.00
289	000800	一汽轿车	17,477	167,779.20	0.00
290	601238	广汽集团	20,162	151,819.86	0.00
291	002128	露天煤业	21,942	142,623.00	0.00
292	603006	黎明股份	9,081	129,858.30	0.00
293	000060	中金岭南	14,265	97,002.00	0.00
294	601231	环旭电子	2,800	86,352.00	0.00
295	002429	兆驰股份	10,294	79,675.56	0.00
296	002470	金正大	2,800	53,732.00	0.00
297	002603	以岭药业	1,357	39,922.94	0.00
298	600188	兖州煤业	3,738	25,866.96	0.00
299	600062	华润双鹤	863	14,834.97	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	6,857,054.97	0.04
2	600016	民生银行	6,814,109.00	0.04
3	000001	平安银行	6,510,876.81	0.04
4	600000	浦发银行	6,478,088.07	0.04
5	601318	中国平安	5,909,448.30	0.03
6	601169	北京银行	5,740,169.33	0.03
7	601377	兴业证券	4,996,418.80	0.03
8	600406	国电南瑞	4,354,952.48	0.02
9	600383	金地集团	3,967,611.72	0.02
10	600018	上港集团	3,965,761.03	0.02
11	600104	上汽集团	3,790,574.76	0.02
12	002129	中环股份	3,582,373.58	0.02
13	000776	广发证券	3,542,656.98	0.02
14	002304	洋河股份	3,380,089.37	0.02
15	600079	人福医药	3,240,840.52	0.02
16	002456	欧菲光	3,184,794.82	0.02
17	600109	国金证券	3,141,026.40	0.02
18	600887	伊利股份	2,930,895.01	0.02
19	000538	云南白药	2,907,404.51	0.02
20	600642	申能股份	2,774,324.00	0.02

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	16,474,251.14	0.09
2	600016	民生银行	10,796,525.11	0.06
3	600519	贵州茅台	7,319,614.10	0.04
4	000651	格力电器	6,656,396.13	0.04
5	601166	兴业银行	6,192,228.98	0.03

6	000002	万 科 A	6,052,543.89	0.03
7	000858	五 粮 液	5,937,516.23	0.03
8	600999	招商证券	5,126,880.30	0.03
9	002081	金 螳 螂	5,110,356.70	0.03
10	601328	交通银行	4,991,355.00	0.03
11	601939	建设银行	4,670,531.00	0.03
12	601318	中国平安	4,576,732.49	0.03
13	600011	华能国际	4,575,038.46	0.03
14	000776	广发证券	4,457,932.55	0.02
15	601169	北京银行	4,235,071.72	0.02
16	000063	中兴通讯	4,227,755.56	0.02
17	601288	农业银行	4,026,457.00	0.02
18	600085	同仁堂	3,964,369.54	0.02
19	000338	潍柴动力	3,915,557.02	0.02
20	600372	中航电子	3,912,202.16	0.02

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

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	348,967,691.07
卖出股票收入（成交）总额	481,103,266.78

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

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	662,254,000.00	4.08
	其中：政策性金融债	662,254,000.00	4.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	484,853.97	0.00

8	其他	-	-
9	合计	662,738,853.97	4.08

7.7 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	140204	14 国开 04	2,400,000	241,080,000.00	1.48
2	140207	14 国开 07	1,800,000	180,648,000.00	1.11
3	130243	13 国开 43	1,300,000	130,143,000.00	0.80
4	130249	13 国开 49	600,000	60,378,000.00	0.37
5	110247	11 国开 47	500,000	50,005,000.00	0.31

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	343,893.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,326,551.07
5	应收申购款	1,889,073.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,559,518.23

7.13.4 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	127002	徐工转债	289,593.97	0.00
2	113006	深燃转债	195,260.00	0.00

7.13.5 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。

7.13.6 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	户均持有的	持有人结构

数（户）	基金份额	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
469,829	52,058.51	4,079,577,675.81	16.68%	20,379,019,136.69	83.32%

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	8,940,973.95	0.04%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	>100
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（2009年7月10日）基金份额总额	24,771,957,170.09
本报告期期初基金份额总额	25,851,203,709.02
本报告期基金总申购份额	1,206,405,625.24
减：本报告期基金总赎回份额	2,599,012,521.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,458,596,812.50

§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。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司工作需要，周月秋同志不再担任中国工商银行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	545,863,745.20	66.07%	60,257.08	66.07%	-
光大证券	1	280,326,606.14	33.93%	30,943.00	33.93%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了广发证券、中信证券、中投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
海通证券	2,499,653.40	100.00%	750,000,000.00	100.00%

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的股票的公告	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旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-01
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增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
8	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 《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

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

11.1.4 法律意见书；

11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇一四年八月二十五日