

华夏红利混合型证券投资基金 2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年三月三十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2014 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 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14
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.....	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 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.....	47
8.7 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.....	47
8.8 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.....	47
8.9 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.....	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
8.12 投资组合报告附注.....	48
§9 基金份额持有人信息.....	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	49
§10 开放式基金份额变动.....	49
§11 重大事件揭示.....	49
§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	华夏红利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏红利混合	
基金主代码	002011	
交易代码	002011	002012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005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	
报告期末基金份额总额	7,880,553,361.17份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期增值。
投资策略	在资产配置层面，本基金将采取积极的资产配置策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、债券和现金上的配置比例。在个股层面，基金主要选择具备良好现金分红能力且财务健康、具备长期增长潜力、市场估值合理的上市公司进行投资。
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 A 股红利 150 指数，债券投资的业绩比较基准为富时中国国债指数。基准收益率=富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+富时中国国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。本基金主要投资于红利股，属于中等风险的证券投资基金品种。

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》、《上海证券报》、《证券时报》
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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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、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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	1,862,897,964.91	177,217,573.36	-2,106,681,623.40
本期利润	3,213,621,085.79	2,212,819,565.60	334,640,001.07
加权平均基金份额本期利润	0.3365	0.1880	0.0263
本期加权平均净值利润率	20.38%	12.46%	1.90%
本期基金份额净值增长率	22.58%	12.93%	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	701,524,684.11	-1,305,940,227.03	-1,752,550,194.57
期末可供分配基金份额利润	0.0890	-0.1232	-0.1381
期末基金资产净值	15,187,317,325.44	16,663,664,201.21	17,664,234,318.53
期末基金份额净值	1.927	1.572	1.392
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	633.09%	498.04%	429.56%

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	10.05%	1.12%	22.98%	1.00%	-12.93%	0.12%
过去六个月	23.05%	0.97%	37.07%	0.80%	-14.02%	0.17%
过去一年	22.58%	1.06%	35.61%	0.73%	-13.03%	0.33%
过去三年	41.17%	1.08%	34.91%	0.72%	6.26%	0.36%
过去五年	12.85%	1.15%	18.02%	0.77%	-5.17%	0.38%
自基金合同生效起至今	633.09%	1.40%	255.68%	1.14%	377.41%	0.26%

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

华夏红利混合型证券投资基金

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

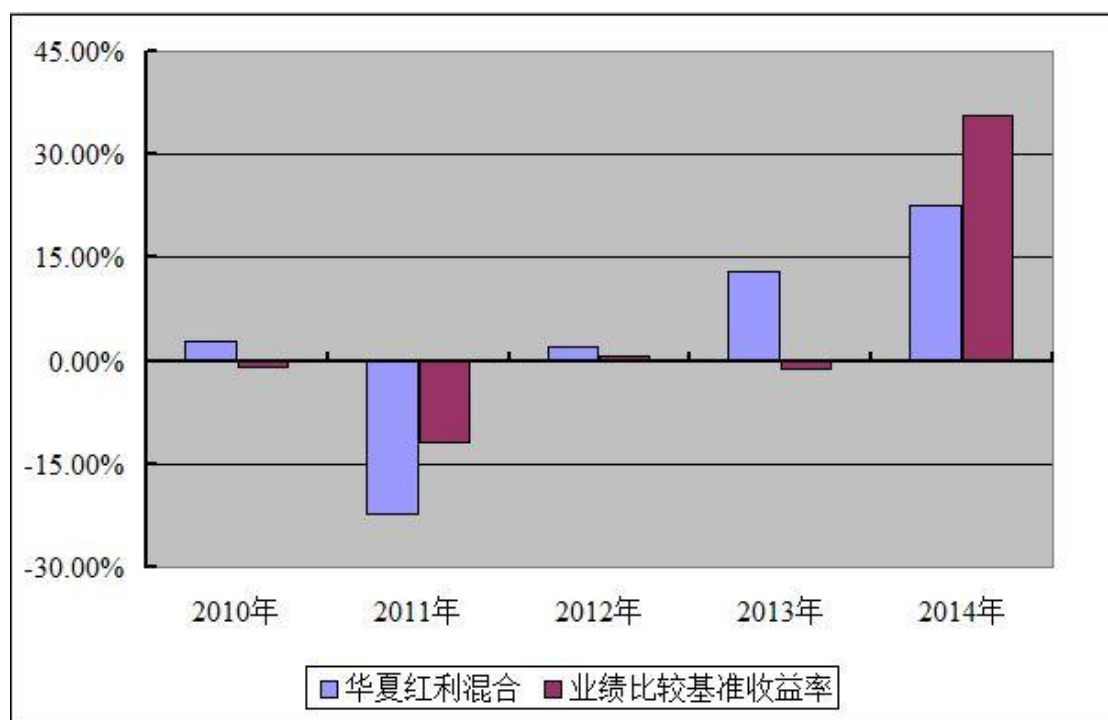
(2005 年 6 月 30 日至 2014 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏红利混合型证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，积极把握市场机会，尽力为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2014 年 12 月 31 日数据），华夏基金旗下 7 只主动管理的股票及混合基金今年以来净值增长率超过 20%，华夏蓝筹混合（LOF）在 43 只偏股型基金（股

票上限 95%)中排名第 7,华夏永福养老理财混合在 10 只偏债型基金中排名第 3。固定收益类产品中,华夏基金旗下 6 只债券型基金今年以来净值增长率超过 10%,华夏亚债中国指数在 16 只指数债券型基金中排名第 4。

2014 年,在《中国证券报》主办的“第十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,2014 年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户的使用便利性和服务体验:(1)改版月度电子账单,对投资者账户持有结构的合理性给予星级评分,便于客户对账户资产进行合理配置;(2)华夏现金增利货币基金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)与腾讯财付通合作推出微信理财通服务,支持资金随时购买财富宝货币基金,赎回快速到账,方便投资者进行现金管理。

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		
赵航	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2011-01-18	-	17 年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券资产管理中心投资经理、长城证券投资银行部项目经理、鹏华基金原普华证券投资基金基金经理(2003 年 4 月 10 日至 2005 年 5 月 21 日期间)、原中信基金中信红利精选股票型证券投资基金基金经理(2008 年 5 月 19 日至 2009 年 4 月 18 日期间)、华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理(2009 年 8 月 7 日至 2011 年 11

					月 7 日期间) 等。
彭海伟	本基金的基金经理、股票投资部总监	2014-01-17	-	10 年	中国科学院管理科学与工程学硕士。曾任原中信基金研究员, 华夏基金研究员、基金经理助理等。
陈虎	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2014-11-21	-	6 年	清华大学博士。曾任南方基金研究员、基金经理助理、南方恒元保本混合型证券投资基金基金经理 (2012 年 12 月 14 日至 2014 年 7 月 18 日期间) 等。2014 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。
谭琦	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-01-01	2014-05-13	11 年	工学硕士。2003 年 7 月加入华夏基金管理有限公司, 曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理 (2007 年 9 月 27 日至 2009 年 1 月 1 日期间) 等。
严鸿宴	本基金的基金经理	2011-11-07	2014-10-10	13 年	北京大学管理学硕士。曾任中国工商银行总行计划财务部主任科员, 大鹏证券研究员, 渤海证券投资经理, 上汽集团财务公司投资部经理等。2008 年 4 月加入华夏基金管理有限公司, 曾任华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理 (2010 年 2 月 4 日至 2011 年 11 月 7 日期间)、机构投资经理等。
贺振华	本基金的基金经理	2013-08-02	2014-10-17	7 年	复旦大学经济学硕士。曾任职于申银万国证券研究所, 担任分析师。2010 年 2 月加入华夏基金管理有限公司, 曾任分析师、华夏行业精选股票型证券投资基金基金经理 (2012 年

					9 月 19 日至 2013 年 9 月 23 日期间) 等。
--	--	--	--	--	---------------------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金出现 1 次涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交

较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和本基金发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年，宏观经济整体运行平稳，增速放缓，上市公司整体盈利增速回落，但居民消费价格指数（CPI）和工业生产价格指数（PPI）持续下降，促使货币政策保持宽松，股市的流动性较为充裕。上半年以创业板为代表的小盘成长股和部分市值较小的跨界成长股表现出色；下半年，尤其是 4 季度降息后，市场风格出现逆转，以金融、地产、建筑、航运等为代表的大盘蓝筹股异军突起。全年来看，2014 年呈现牛市特征，各种投资获利机会较多。

报告期内，本基金继续保持平稳的投资风格，均衡配置组合，分散投资个股。全年业绩表现稳定。4 季度适度增持了大盘蓝筹股，但鉴于均衡配置的原则，本基金未采取激进的调仓行为。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.927 元，本报告期份额净值增长率为 22.58%，同期业绩比较基准增长率为 35.61%。

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 2015 年，宏观经济将继续保持平稳，国内生产总值（GDP）增速目标略有下降，在原油等大宗商品价格持续下跌及市场利率下降降低企业财务成本的背景下，上市公司整体盈利显著恶化的概率不大。流动性方面，受国内总需求不足叠加国际大宗商品下跌带来的输入性通缩压力的影响，货币政策存在继续放松的空间，加之企业和居民的长期资产配置向股市转移，2015 年股市的整体流动性尚可。不过值得警惕的因素也依然存在：（1）美国进入加息周期后，全球范围都将面临流动性收缩压力，尤其是部分新兴市场可能陷入动荡期并对中国形成传导压力；（2）年内将修改《证券法》，注册制将正式推出，这会对高估值且缺乏基本面支撑的部分伪成长股造成巨大的估值回归压力；（3）2014 年推动股市上涨的一个重要资金来源是两融业务带来的杠杆资金，甚至有一部分银行资金以各种方式进入股市，这些资金很不稳定，可能助涨助跌，加大股市的波动性。

2015 年，基于上述判断，本基金将重点在以下几方面做好投资：（1）结合

市场机会，加强波段操作；（2）积极寻找国企改革全面推进过程中的投资机会；（3）继续加大对新兴产业的研究和分析，积极寻找估值和成长相匹配的投资机会；（4）继续保留利率敏感型的大盘蓝筹股为基本配置，并积极波段操作；（5）如市场出现系统性风险，将重点持有以医药和消费品等白马成长股为代表的防御性品种。

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，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司修订法律监察工作管理制度、通信工具管理制度、员工投资行为管理制度、权限管理制度等多项制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；积极参与各项业务的合规性管理，对信息披露文件、各类宣传推介材料进行合规性审查，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司实行全员风险管理，制定出台了风险管理制度、风险管理委员会管理办法、基金流动性风险管理制度等各项风险管理制度，加强风险控制制度建设，特别是投资风险控制，完善控制机制，提高员工的风险管理意识。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究等关键业务和重点岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

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，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、法律监察工作负责人及基金会计工作负责人等。其中，近三分之二的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

安永华明（2015）审字第 60739337_B04 号

华夏红利混合型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红利混合型证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

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

6.2 注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏红利混合型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 汤骏 濮晓达

北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

2015 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表**7.1 资产负债表**

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	295,326,320.56	1,150,169,734.08
结算备付金		32,176,031.46	16,529,306.70
存出保证金		3,281,183.14	2,633,134.87
交易性金融资产	7.4.7.2	14,791,303,078.46	15,705,602,310.77
其中：股票投资		14,004,062,236.40	14,919,831,052.12
基金投资		-	-
债券投资		787,240,842.06	785,771,258.65
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	696,401,484.60	59,550,409.33
应收证券清算款		8,833,795.35	2,553,564.00
应收利息	7.4.7.5	12,400,337.20	8,712,858.31
应收股利		-	-
应收申购款		348,402.73	6,613,773.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,840,070,633.50	16,952,365,091.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		425,199,285.20	-

应付证券清算款		31,561,613.91	165,854,726.72
应付赎回款		82,932,198.59	28,225,379.56
应付管理人报酬		19,781,159.08	21,345,127.48
应付托管费		3,296,859.81	3,557,521.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	88,498,815.36	68,013,110.40
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		321,246.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	912,554.49	1,455,449.46
负债合计		652,753,308.06	288,700,890.50
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,880,553,361.17	10,598,682,132.44
未分配利润	7.4.7.10	7,306,763,964.27	6,064,982,068.77
所有者权益合计		15,187,317,325.44	16,663,664,201.21
负债和所有者权益总计		15,840,070,633.50	16,952,365,091.71

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.927 元，基金份额总额 7,880,553,361.17 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		3,594,413,799.85	2,611,993,729.19
1.利息收入		49,996,870.18	54,809,763.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,645,967.34	15,969,285.03
债券利息收入		37,326,802.57	33,349,361.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,024,100.27	5,491,117.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,186,396,608.43	515,207,873.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,035,435,105.32	314,703,103.35

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,617,943.00	17,792,308.16
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	142,343,560.11	182,712,462.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,350,723,120.88	2,035,601,992.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	7,297,200.36	6,374,100.04
减：二、费用		380,792,714.06	399,174,163.59
1.管理人报酬		236,775,084.94	266,834,190.79
2.托管费		39,462,514.18	44,472,365.16
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	103,134,241.24	85,583,897.60
5.利息支出		995,128.55	1,840,256.00
其中：卖出回购金融资产支出		995,128.55	1,840,256.00
6.其他费用	7.4.7.21	425,745.15	443,454.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,213,621,085.79	2,212,819,565.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,213,621,085.79	2,212,819,565.60

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	10,598,682,132.44	6,064,982,068.77	16,663,664,201.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,213,621,085.79	3,213,621,085.79
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）	-2,718,128,771.27	-1,971,839,190.29	-4,689,967,961.56

其中：1.基金申购款	695,396,279.93	452,068,556.12	1,147,464,836.05
2.基金赎回款	-3,413,525,051.20	-2,423,907,746.41	-5,837,432,797.61
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,880,553,361.17	7,306,763,964.27	15,187,317,325.44
项目	上年度可比期间		
	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）	12,686,414,898.86	4,977,819,419.67	17,664,234,318.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,212,819,565.60	2,212,819,565.60
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）	-2,087,732,766.42	-1,125,656,916.50	-3,213,389,682.92
其中：1.基金申购款	1,013,926,494.19	511,770,093.93	1,525,696,588.12
2.基金赎回款	-3,101,659,260.61	-1,637,427,010.43	-4,739,086,271.04
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）	10,598,682,132.44	6,064,982,068.77	16,663,664,201.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏红利混合型证券投资基金（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[2005]68号文《关于同意华夏红利混合型开放式证券投资基金投资募集的批复》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》、《华夏红利混合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基金，存续期不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 769,853,399.75 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（05）第 010 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 770,195,182.55 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《华夏红利混合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、债券、权证、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。

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 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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。

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、金融资产的分类

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(主要为权证投资)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、金融负债的分类

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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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(主要为权证投资)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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。

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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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。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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- 1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

- 2、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。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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。

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	295,326,320.56	1,150,169,734.08
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	295,326,320.56	1,150,169,734.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,645,987,011.65	14,004,062,236.40	2,358,075,224.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	489,471,961.20	497,344,842.06
	银行间市场	289,171,427.40	289,896,000.00
	合计	778,643,388.60	787,240,842.06
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,424,630,400.25	14,791,303,078.46	2,366,672,678.21
项目	上年度末		

		2013年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		13,904,732,038.30	14,919,831,052.12	1,015,099,013.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	355,898,234.13	359,718,258.65	3,820,024.52
	银行间市场	429,022,481.01	426,053,000.00	-2,969,481.01
	合计	784,920,715.14	785,771,258.65	850,543.51
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,689,652,753.44	15,705,602,310.77	1,015,949,557.33

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

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31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	696,401,484.60	-
合计	696,401,484.60	-
项目	上年度末 2013年12月31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	59,550,409.33	-
合计	59,550,409.33	-

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 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	134,699.89	301,277.14
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	15,930.26	8,186.32
应收债券利息	12,001,696.34	8,393,621.88
应收买入返售证券利息	246,386.56	8,469.58
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,624.15	1,303.39
合计	12,400,337.20	8,712,858.31

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	88,483,330.55	68,003,158.89
银行间市场应付交易费用	15,484.81	9,951.51
合计	88,498,815.36	68,013,110.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	312,554.49	106,449.46
预提费用	100,000.00	349,000.00
合计	912,554.49	1,455,449.46

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,598,682,132.44	10,598,682,132.44
本期申购	695,396,279.93	695,396,279.93
本期赎回（以“-”号填列）	-3,413,525,051.20	-3,413,525,051.20
本期末	7,880,553,361.17	7,880,553,361.17

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	-1,305,940,227.03	7,370,922,295.80	6,064,982,068.77
本期利润	1,862,897,964.91	1,350,723,120.88	3,213,621,085.79
本期基金份额交易产生的变动数	144,566,946.23	-2,116,406,136.52	-1,971,839,190.29
其中：基金申购款	-62,452,719.91	514,521,276.03	452,068,556.12
基金赎回款	207,019,666.14	-2,630,927,412.55	-2,423,907,746.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	701,524,684.11	6,605,239,280.16	7,306,763,964.27

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
活期存款利息收入	8,449,717.03	15,479,136.60
定期存款利息收入	694,444.44	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	447,487.58	437,431.28
其他	54,318.29	52,717.15
合计	9,645,967.34	15,969,285.03

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出股票成交总额	36,379,910,673.51	30,949,388,570.04
减：卖出股票成本总额	34,344,475,568.19	30,634,685,466.69
买卖股票差价收入	2,035,435,105.32	314,703,103.35

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,367,380,114.13	2,250,836,617.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,326,482,475.71	2,189,585,429.58

减：应收利息总额	32,279,695.42	43,458,879.62
买卖债券差价收入	8,617,943.00	17,792,308.16

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 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	142,343,560.11	182,712,462.14
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	142,343,560.11	182,712,462.14

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
1.交易性金融资产	1,350,723,120.88	2,035,601,992.24
——股票投资	1,342,976,210.93	2,034,975,807.89

——债券投资	7,746,909.95	626,184.35
——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	1,350,723,120.88	2,035,601,992.24

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
基金赎回费收入	7,297,200.36	5,924,252.84
其他	-	449,847.20
合计	7,297,200.36	6,374,100.04

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
交易所市场交易费用	103,127,341.24	85,567,747.60
银行间市场交易费用	6,900.00	16,150.00
合计	103,134,241.24	85,583,897.60

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
银行费用	58,345.15	67,054.04
银行间账户维护费	27,000.00	36,000.00
其他	400.00	400.00
合计	425,745.15	443,454.04

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

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东

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。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中信证券	5,993,085,600.19	8.77%	1,770,209,046.18	2.92%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
中信证券	55,440.15	0.04%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	5,456,099.91	9.28%	2,717,396.07	3.07%
关联方名称	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	768,770.19	1.60%	768,770.19	1.13%

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

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

7.4.10.2 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	236,775,084.94	266,834,190.79
其中：支付销售机构的客户维护费	35,618,421.63	43,699,360.42

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

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

年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,462,514.18	44,472,365.16

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

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

7.4.10.3 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

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

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	295,326,320.56	8,449,717.03	1,150,169,734.08	15,479,136.60

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2014 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
002649	博彦科技	2014-01-03	2015-01-07	非公开发行流通受限	26.00	31.60	98,214	2,553,564.00	3,103,562.40	-
600703	三安光电	2014-01-30	2015-01-28	非公开发行流通受限	21.80	14.22	2,522,936	55,000,004.80	35,876,149.92	-
600703	三安光电	-	2015-01-28	非公开发行转增	-	14.22	1,261,468	-	17,938,074.96	-
600401	海润光伏	2014-09-16	2015-09-14	非公开发行流通受限	7.72	6.91	7,440,000	57,436,800.00	51,410,400.00	-

注：①本基金持有的非公开发行股票三安光电，于 2014 年 7 月 4 日实施 2013 年度利润分配、转增股本方案，向全体股东按每 10 股派送现金人民币 2.00 元（含税），同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，本基金新增 1,261,468 股。

②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
600580	卧龙电气	2014-12-08	筹划非公开发行股票事项	10.48	2015-01-14	11.12	1,200,000	11,389,618.56	12,576,000.00	-
600584	长电科技	2014-11-03	筹划重大	11.13	2015-01-14	12.24	2,600,000	24,618,215.03	28,938,000.00	-

			资产重组事项								
000996	中国中期	2014-12-08	筹划重大事项	28.60	-	-	1,499,917	34,342,439.27	42,897,626.20	-	
002070	众和股份	2014-09-05	筹划控股子公司土地出售事项	9.49	2015-03-11	10.00	8,150,312	67,047,261.90	77,346,460.88	-	
002171	精诚铜业	2014-11-24	筹划重大资产重组事项	13.07	-	-	4,763,039	61,230,842.31	62,252,919.73	-	
002396	星网锐捷	2014-10-20	筹划发行股份购买资产事项	27.31	2015-02-09	30.04	1,813,807	47,551,414.14	49,535,069.17	-	
300071	华谊嘉信	2014-12-29	筹划重大事项	16.40	2015-01-30	16.00	1,663,330	29,527,374.67	27,278,612.00	-	
300170	汉得信息	2014-12-10	筹划发行股份购买资产事项	13.22	2015-01-28	14.54	2,462,751	24,524,971.96	32,557,568.22	-	
300278	华昌达	2014-09-22	筹划重大资产重组事项	16.46	2015-02-03	18.11	2,592,859	43,185,644.51	42,678,459.14	-	
002437	誉衡药业	2014-11-21	筹划非公开发行股票事项	23.75	2015-01-26	26.13	13,484,847	273,168,163.27	320,265,116.25	-	
600332	白云山	2014-12-03	筹划非公开发行股票事项	27.11	2015-01-13	29.82	4,301,239	120,618,416.08	116,606,589.29	-	

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 2014 年 12 月 31 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 263,199,285.20 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
110236	11 国开 36	2015-01-07	99.78	900,000	89,802,000.00
140204	14 国开 04	2015-01-07	100.02	100,000	10,002,000.00
140410	14 农发 10	2015-01-07	100.05	1,800,000	180,090,000.00
合计	-	-	-	2,800,000	279,894,000.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 162,000,000.00 元，于 2015 年 1 月 8 日和 2015 年 1 月 12 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 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之内。

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“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久期、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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	295,326,320.56	-	-	295,326,320.56
结算备付金	32,176,031.46	-	-	32,176,031.46
结算保证金	3,281,183.14	-	-	3,281,183.14
债券投资	787,240,842.06	-	-	787,240,842.06
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	696,401,484.60	-	-	696,401,484.60
应收直销申购款	47,030.21	-	-	47,030.21
卖出回购金融资产款	425,199,285.20	-	-	425,199,285.20
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	1,150,169,734.08	-	-	1,150,169,734.08
结算备付金	16,529,306.70	-	-	16,529,306.70
结算保证金	2,633,134.87	-	-	2,633,134.87
债券投资	785,771,258.65	-	-	785,771,258.65
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	59,550,409.33	-	-	59,550,409.33
应收直销申购款	429,702.11	-	-	429,702.11
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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	利率下降 25 个基点	1,005,970.79	1,955,197.79
	利率上升 25 个基点	-1,005,429.56	-1,935,155.71

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。

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 2014 年 12 月 31 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	14,004,062,236.40	92.21	14,919,831,052.12	89.54
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	14,004,062,236.40	92.21	14,919,831,052.12	89.54

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 （2014 年 12 月 31 日）	上年度末 （2013 年 12 月 31 日）
	+5%	393,308,003.45	623,425,140.51
	-5%	-393,308,003.45	-623,425,140.51

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次：

第一层次：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。

第二层次：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。

第三层次：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 各层次金融工具公允价值

截至 2014 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次的余额为 14,393,078,891.18 元，第二层次的余额为 398,224,187.28 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2013 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 15,227,574,310.77 元，第二层次的余额为 478,028,000.00 元，第三层次的余额为 0 元。）

7.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。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次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

7.4.14.4 第三层次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次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	14,004,062,236.40	88.41
	其中：股票	14,004,062,236.40	88.41
2	固定收益投资	787,240,842.06	4.97
	其中：债券	787,240,842.06	4.97
	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	696,401,484.60	4.40
	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	327,502,352.02	2.07
7	其他各项资产	24,863,718.42	0.16
8	合计	15,840,070,633.50	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	129,835,049.48	0.85
B	采矿业	89,400,000.00	0.59
C	制造业	6,445,643,993.59	42.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	420,850,802.31	2.77
E	建筑业	213,493,543.04	1.41
F	批发和零售业	542,141,194.36	3.57
G	交通运输、仓储和邮政业	140,971,714.85	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,170,959,094.76	7.71

J	金融业	2,947,099,582.83	19.41
K	房地产业	796,246,097.23	5.24
L	租赁和商务服务业	160,828,203.98	1.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	546,146,453.41	3.60
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	382,662,625.12	2.52
S	综合	17,783,881.44	0.12
	合计	14,004,062,236.40	92.21

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	300267	尔康制药	17,867,353	705,403,096.44	4.64
2	600887	伊利股份	24,624,109	704,988,240.67	4.64
3	600837	海通证券	25,000,000	601,500,000.00	3.96
4	600690	青岛海尔	31,826,088	590,692,193.28	3.89
5	600000	浦发银行	31,374,589	492,267,301.41	3.24
6	000656	金科股份	25,000,000	387,500,000.00	2.55
7	600016	民生银行	29,830,000	324,550,400.00	2.14
8	002437	誉衡药业	13,484,847	320,265,116.25	2.11
9	601988	中国银行	75,230,000	312,204,500.00	2.06
10	300273	和佳股份	12,549,592	290,523,054.80	1.91
11	000001	平安银行	18,042,226	285,788,859.84	1.88
12	300070	碧水源	6,605,378	229,867,154.40	1.51
13	601166	兴业银行	13,524,979	223,162,153.50	1.47
14	601318	中国平安	2,884,550	215,504,730.50	1.42
15	601801	皖新传媒	12,848,160	213,536,419.20	1.41
16	002065	东华软件	10,672,232	191,139,675.12	1.26
17	600406	国电南瑞	13,096,522	190,554,395.10	1.25
18	000333	美的集团	6,877,093	188,707,431.92	1.24
19	600211	西藏药业	5,000,000	187,300,000.00	1.23
20	000800	一汽轿车	12,079,829	182,888,611.06	1.20
21	600505	西昌电力	16,564,200	171,770,754.00	1.13
22	600036	招商银行	10,299,942	170,876,037.78	1.13

23	000826	桑德环境	5,608,771	153,399,886.85	1.01
24	002219	恒康医疗	7,799,962	148,589,276.10	0.98
25	000002	万科 A	10,346,907	143,822,007.30	0.95
26	300188	美亚柏科	5,463,451	142,978,512.67	0.94
27	300336	新文化	5,063,884	134,192,926.00	0.88
28	002436	兴森科技	4,417,577	128,904,896.86	0.85
29	600525	长园集团	10,475,272	120,360,875.28	0.79
30	601668	中国建筑	16,480,000	119,974,400.00	0.79
31	600332	白云山	4,301,239	116,606,589.29	0.77
32	601688	华泰证券	4,420,000	108,157,400.00	0.71
33	600120	浙江东方	5,733,180	107,325,129.60	0.71
34	000069	华侨城 A	13,000,000	107,250,000.00	0.71
35	002202	金风科技	7,099,874	100,321,219.62	0.66
36	600048	保利地产	9,069,932	98,136,664.24	0.65
37	600395	盘江股份	7,500,000	89,400,000.00	0.59
38	000100	TCL 集团	23,499,921	89,299,699.80	0.59
39	600775	南京熊猫	7,750,793	80,375,723.41	0.53
40	600879	航天电子	5,101,025	79,575,990.00	0.52
41	000898	鞍钢股份	12,869,928	79,150,057.20	0.52
42	600276	恒瑞医药	2,064,834	77,389,978.32	0.51
43	002063	远光软件	3,858,089	77,354,684.45	0.51
44	002070	众和股份	8,150,312	77,346,460.88	0.51
45	600270	外运发展	4,669,693	76,349,480.55	0.50
46	002444	巨星科技	6,349,956	71,119,507.20	0.47
47	000669	金鸿能源	2,380,170	69,857,989.50	0.46
48	000400	许继电气	3,438,497	69,801,489.10	0.46
49	000554	泰山石油	8,000,000	68,320,000.00	0.45
50	000889	茂业物流	6,835,210	66,301,537.00	0.44
51	002171	精诚铜业	4,763,039	62,252,919.73	0.41
52	601199	江南水务	3,222,885	61,686,018.90	0.41
53	600522	中天科技	4,000,000	61,560,000.00	0.41
54	002292	奥飞动漫	1,999,866	58,996,047.00	0.39
55	600693	东百集团	6,436,052	57,667,025.92	0.38
56	002508	老板电器	1,739,315	56,701,669.00	0.37
57	600340	华夏幸福	1,299,939	56,677,340.40	0.37
58	300034	钢研高纳	2,600,966	55,972,788.32	0.37
59	600999	招商证券	1,917,000	54,193,590.00	0.36

60	600703	三安光电	3,784,404	53,814,224.88	0.35
61	300075	数字政通	2,090,507	52,952,542.31	0.35
62	600401	海润光伏	7,440,000	51,410,400.00	0.34
63	600612	老凤祥	1,589,515	51,389,019.95	0.34
64	600337	美克家居	5,207,221	49,676,888.34	0.33
65	601336	新华保险	1,000,000	49,560,000.00	0.33
66	002396	星网锐捷	1,813,807	49,535,069.17	0.33
67	002299	圣农发展	3,904,677	49,394,164.05	0.33
68	000900	现代投资	6,927,775	48,632,980.50	0.32
69	000861	海印股份	6,017,351	48,319,328.53	0.32
70	002280	新世纪	1,289,273	47,548,388.24	0.31
71	002400	省广股份	2,156,415	46,729,513.05	0.31
72	002465	海格通信	2,379,682	45,975,456.24	0.30
73	300066	三川股份	3,044,349	45,665,235.00	0.30
74	601601	中国太保	1,399,926	45,217,609.80	0.30
75	002214	大立科技	2,182,197	45,062,368.05	0.30
76	600292	中电远达	1,999,900	44,557,772.00	0.29
77	300166	东方国信	1,551,428	43,533,069.68	0.29
78	002616	长青集团	1,700,000	43,435,000.00	0.29
79	600850	华东电脑	1,205,129	42,950,797.56	0.28
80	000996	中国中期	1,499,917	42,897,626.20	0.28
81	300236	上海新阳	1,425,555	42,852,183.30	0.28
82	300278	华昌达	2,592,859	42,678,459.14	0.28
83	600196	复星医药	2,000,000	42,200,000.00	0.28
84	002410	广联达	1,873,870	41,974,688.00	0.28
85	601992	金隅股份	3,999,951	40,559,503.14	0.27
86	600150	中国船舶	1,099,955	40,544,341.30	0.27
87	601877	正泰电器	1,293,263	39,250,532.05	0.26
88	002714	牧原股份	885,332	38,954,608.00	0.26
89	002657	中科金财	819,898	38,936,956.02	0.26
90	601888	中国国旅	857,866	38,089,250.40	0.25
91	002176	江特电机	2,600,000	37,778,000.00	0.25
92	600518	康美药业	2,400,000	37,728,000.00	0.25
93	600873	梅花生物	5,199,880	37,231,140.80	0.25
94	002475	立讯精密	1,299,868	35,980,346.24	0.24
95	001696	宗申动力	4,480,000	35,705,600.00	0.24
96	002650	加加食品	2,999,852	35,488,249.16	0.23

97	002678	珠江钢琴	2,679,989	35,402,654.69	0.23
98	300253	卫宁软件	500,124	34,993,676.28	0.23
99	300133	华策影视	1,392,874	34,933,279.92	0.23
100	000958	东方能源	2,741,117	34,812,185.90	0.23
101	300051	三五互联	3,380,151	34,376,135.67	0.23
102	000024	招商地产	1,299,886	34,303,991.54	0.23
103	002701	奥瑞金	1,675,358	34,294,578.26	0.23
104	601628	中国人寿	1,000,000	34,150,000.00	0.22
105	000948	南天信息	2,499,982	33,824,756.46	0.22
106	600571	信雅达	1,214,066	32,694,797.38	0.22
107	300170	汉得信息	2,462,751	32,557,568.22	0.21
108	600446	金证股份	687,800	32,244,064.00	0.21
109	002452	长高集团	1,733,700	31,726,710.00	0.21
110	000902	新洋丰	1,999,854	31,477,701.96	0.21
111	300037	新宙邦	1,056,600	30,778,758.00	0.20
112	601788	光大证券	1,050,000	29,967,000.00	0.20
113	002649	博彦科技	944,083	29,875,316.25	0.20
114	601766	中国南车	4,599,968	29,347,795.84	0.19
115	002667	鞍重股份	882,786	29,343,806.64	0.19
116	600584	长电科技	2,600,000	28,938,000.00	0.19
117	002448	中原内配	1,599,816	27,628,822.32	0.18
118	002051	中工国际	999,857	27,316,093.24	0.18
119	300071	华谊嘉信	1,663,330	27,278,612.00	0.18
120	600068	葛洲坝	2,900,000	27,057,000.00	0.18
121	000709	河北钢铁	6,999,997	26,809,988.51	0.18
122	002007	华兰生物	800,000	26,640,000.00	0.18
123	002458	益生股份	2,228,621	26,320,014.01	0.17
124	000681	视觉中国	1,237,586	25,964,554.28	0.17
125	600019	宝钢股份	3,499,919	24,534,432.19	0.16
126	600168	武汉控股	1,800,000	24,336,000.00	0.16
127	600155	宝硕股份	1,999,931	23,839,177.52	0.16
128	000932	华菱钢铁	5,999,959	23,519,839.28	0.15
129	300367	东方网力	299,894	23,331,753.20	0.15
130	000671	阳光城	1,680,000	23,301,600.00	0.15
131	000639	西王食品	1,399,835	22,677,327.00	0.15
132	300024	机器人	547,855	21,580,008.45	0.14
133	600519	贵州茅台	112,923	21,412,459.26	0.14

134	600233	大杨创世	1,900,000	21,280,000.00	0.14
135	002267	陕天然气	1,959,755	21,184,951.55	0.14
136	600702	沱牌舍得	1,099,873	20,490,633.99	0.13
137	600990	四创电子	349,992	20,292,536.16	0.13
138	600398	海澜之家	1,997,008	20,169,780.80	0.13
139	002435	长江润发	2,113,951	20,145,953.03	0.13
140	000685	中山公用	899,902	20,004,821.46	0.13
141	600562	国睿科技	400,000	19,944,000.00	0.13
142	002304	洋河股份	250,000	19,762,500.00	0.13
143	601390	中国中铁	2,100,000	19,530,000.00	0.13
144	002185	华天科技	1,549,943	19,358,788.07	0.13
145	000739	普洛药业	2,508,891	19,318,460.70	0.13
146	000961	中南建设	1,401,354	19,198,549.80	0.13
147	000158	常山股份	1,999,943	19,179,453.37	0.13
148	601600	中国铝业	3,000,000	18,750,000.00	0.12
149	000838	国兴地产	2,104,375	18,707,893.75	0.12
150	002124	天邦股份	1,999,846	18,238,595.52	0.12
151	600149	廊坊发展	1,199,992	17,783,881.44	0.12
152	601299	中国北车	2,499,920	17,749,432.00	0.12
153	600100	同方股份	1,500,000	17,520,000.00	0.12
154	600526	菲达环保	1,159,902	17,363,732.94	0.11
155	002153	石基信息	250,863	16,456,612.80	0.11
156	601006	大秦铁路	1,499,930	15,989,253.80	0.11
157	002404	嘉欣丝绸	1,472,762	15,817,463.88	0.10
158	000555	神州信息	392,064	15,094,464.00	0.10
159	002054	德美化工	1,699,863	14,737,812.21	0.10
160	002418	康盛股份	1,050,400	14,495,520.00	0.10
161	600580	卧龙电气	1,200,000	12,576,000.00	0.08
162	002727	一心堂	299,924	12,329,875.64	0.08
163	600657	信达地产	1,500,000	12,240,000.00	0.08
164	300233	金城医药	310,427	12,041,463.33	0.08
165	000729	燕京啤酒	1,468,279	11,731,549.21	0.08
166	002279	久其软件	433,720	11,719,114.40	0.08
167	300259	新天科技	900,000	11,565,000.00	0.08
168	300061	康耐特	1,000,000	11,550,000.00	0.08
169	002573	国电清新	399,987	11,071,640.16	0.07
170	000338	潍柴动力	370,000	10,097,300.00	0.07

171	600208	新湖中宝	1,350,000	9,882,000.00	0.07
172	300059	东方财富	350,000	9,786,000.00	0.06
173	600461	洪城水业	800,350	9,332,081.00	0.06
174	300176	鸿特精密	621,411	8,911,033.74	0.06
175	002477	雏鹰农牧	999,932	8,759,404.32	0.06
176	002182	云海金属	719,400	8,042,892.00	0.05
177	600167	联美控股	600,000	7,866,000.00	0.05
178	002285	世联行	500,000	7,520,000.00	0.05
179	000792	盐湖股份	330,000	7,161,000.00	0.05
180	002563	森马服饰	209,934	6,980,305.50	0.05
181	002041	登海种业	199,902	6,406,859.10	0.04
182	600176	中国玻纤	400,000	6,188,000.00	0.04
183	002611	东方精工	449,943	6,078,729.93	0.04
184	000816	江淮动力	996,900	5,991,369.00	0.04
185	600600	青岛啤酒	137,952	5,763,634.56	0.04
186	002112	三变科技	545,160	5,560,632.00	0.04
187	002261	拓维信息	329,949	5,539,843.71	0.04
188	002559	亚威股份	300,000	5,427,000.00	0.04
189	300145	南方泵业	249,981	5,409,588.84	0.04
190	300039	上海凯宝	400,000	5,072,000.00	0.03
191	300348	长亮科技	49,941	4,844,277.00	0.03
192	600963	岳阳林纸	699,934	3,688,652.18	0.02
193	300182	捷成股份	199,970	3,579,463.00	0.02
194	300339	润和软件	179,932	3,449,296.44	0.02
195	000999	华润三九	150,000	3,399,000.00	0.02
196	300180	华峰超纤	150,000	3,303,000.00	0.02
197	000858	五粮液	150,000	3,225,000.00	0.02
198	000540	中天城投	250,000	2,945,000.00	0.02
199	002385	大北农	200,000	2,684,000.00	0.02
200	002572	索菲亚	113,750	2,434,250.00	0.02
201	300195	长荣股份	50,000	1,550,000.00	0.01
202	600376	首开股份	120,000	1,209,600.00	0.01
203	002224	三力士	100,000	868,000.00	0.01
204	601566	九牧王	50,000	645,000.00	0.00
205	600894	广日股份	50,000	642,500.00	0.00
206	600309	万华化学	19,945	434,402.10	0.00
207	600133	东湖高新	50,000	417,500.00	0.00

208	600138	中青旅	25,000	411,500.00	0.00
209	600085	同仁堂	18,284	410,110.12	0.00
210	002698	博实股份	7,575	185,587.50	0.00
211	600535	天士力	4,067	167,153.70	0.00
212	600893	航空动力	5,287	153,111.52	0.00
213	002366	丹甫股份	3,000	90,750.00	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	600837	海通证券	478,578,891.90	2.87
2	601318	中国平安	445,099,866.14	2.67
3	300273	和佳股份	442,562,000.32	2.66
4	600000	浦发银行	437,072,780.90	2.62
5	600016	民生银行	382,173,945.00	2.29
6	601166	兴业银行	367,686,067.33	2.21
7	002437	誉衡药业	363,128,854.10	2.18
8	002176	江特电机	310,337,594.36	1.86
9	300267	尔康制药	306,379,718.13	1.84
10	600410	华胜天成	296,503,028.37	1.78
11	601988	中国银行	292,541,352.22	1.76
12	002065	东华软件	287,894,950.60	1.73
13	000656	金科股份	286,636,895.53	1.72
14	002202	金风科技	252,553,393.77	1.52
15	300037	新宙邦	243,421,086.72	1.46
16	600418	江淮汽车	231,644,653.19	1.39
17	600036	招商银行	211,209,576.53	1.27
18	000002	万科 A	208,130,756.79	1.25
19	000001	平安银行	205,355,501.86	1.23
20	300253	卫宁软件	200,857,806.56	1.21

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	300253	卫宁软件	499,989,023.33	3.00
2	000333	美的集团	441,673,587.58	2.65
3	002437	誉衡药业	441,420,343.39	2.65
4	600690	青岛海尔	388,528,468.32	2.33
5	600887	伊利股份	363,717,652.40	2.18
6	600837	海通证券	356,587,628.01	2.14
7	600410	华胜天成	347,488,967.38	2.09
8	601318	中国平安	336,538,390.31	2.02
9	601166	兴业银行	323,950,106.75	1.94
10	002176	江特电机	290,643,953.69	1.74
11	300101	振芯科技	284,335,480.98	1.71
12	600739	辽宁成大	262,595,688.08	1.58
13	002439	启明星辰	250,246,535.75	1.50
14	300287	飞利信	232,478,039.30	1.40
15	002480	新筑股份	230,537,916.21	1.38
16	002421	达实智能	229,126,002.64	1.38
17	600016	民生银行	227,519,306.59	1.37
18	300039	上海凯宝	219,244,419.36	1.32
19	600418	江淮汽车	216,574,855.63	1.30
20	000768	中航飞机	214,311,070.76	1.29

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	32,085,730,541.54
卖出股票收入（成交）总额	36,379,910,673.51

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	479,777,970.00	3.16

2	央行票据	-	-
3	金融债券	289,896,000.00	1.91
	其中：政策性金融债	289,896,000.00	1.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	17,566,872.06	0.12
8	其他	-	-
9	合计	787,240,842.06	5.18

8.6 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	1,800,000	180,090,000.00	1.19
2	019428	14 国债 28	1,400,000	140,000,000.00	0.92
3	110236	11 国开 36	900,000	89,802,000.00	0.59
4	019217	12 国债 17	800,000	79,792,000.00	0.53
5	019033	10 国债 33	700,000	69,715,870.00	0.46

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	3,281,183.14
2	应收证券清算款	8,833,795.35
3	应收股利	-
4	应收利息	12,400,337.20
5	应收申购款	348,402.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,863,718.42

8.12.4 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	113005	平安转债	13,015,498.80	0.09
2	110017	中海转债	2,335,351.20	0.02
3	110018	国电转债	2,028,516.00	0.01
4	110011	歌华转债	126,036.50	0.00
5	128002	东华转债	61,469.56	0.00

8.12.5 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	002437	誉衡药业	320,265,116.25	2.11	筹划非公开发行股票事项

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
593,641	13,274.95	115,107,880.16	1.46%	7,765,445,481.01	98.54%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	410,707.41	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005年6月30日) 基金份额总额	770,195,182.55
本报告期期初基金份额总额	10,598,682,132.44
本报告期基金总申购份额	695,396,279.93
减：本报告期基金总赎回份额	3,413,525,051.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	7,880,553,361.17

§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 2014 年 8 月 21 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，滕天鸣先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2014 年 9 月 6 日发布公告，张霄岭先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2014 年 9 月 13 日发布公告，汤晓东先生担任华夏基金管理有限公司督察长，方瑞枝女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

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，于 2014 年 11 月 3 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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	
长江证券	1	7,095,390,278.20	10.39%	6,459,640.75	10.99%	-
兴业证券	1	6,595,914,752.70	9.65%	6,004,920.41	10.22%	-
中信证券	1	5,993,085,600.19	8.77%	5,456,099.91	9.28%	-

国金证券	1	5,323,955,287.02	7.79%	4,846,917.28	8.25%	-
东北证券	1	5,023,645,951.93	7.35%	4,573,514.35	7.78%	-
齐鲁证券	3	4,406,283,602.61	6.45%	3,130,223.32	5.33%	-
平安证券	1	4,219,768,823.64	6.18%	3,841,676.66	6.54%	-
东兴证券	2	4,159,583,761.07	6.09%	2,954,961.82	5.03%	-
海通证券	1	3,792,345,894.79	5.55%	3,452,546.39	5.87%	-
民生证券	1	3,781,507,277.33	5.53%	2,686,384.90	4.57%	-
中信建投证券	3	3,169,600,081.73	4.64%	2,365,918.64	4.03%	-
广州证券	1	2,967,591,677.74	4.34%	2,701,694.43	4.60%	-
中投证券	1	2,885,036,550.21	4.22%	2,626,521.51	4.47%	-
国信证券	1	2,613,566,784.79	3.83%	2,379,391.42	4.05%	-
中国银河证券	1	2,519,464,497.37	3.69%	2,293,715.95	3.90%	-
安信证券	1	2,194,778,827.25	3.21%	1,559,171.81	2.65%	-
光大证券	1	1,545,207,213.67	2.26%	1,406,758.90	2.39%	-
瑞银证券	1	34,522,620.49	0.05%	31,429.39	0.05%	-

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，本基金还选择了高华证券、华泰证券、招商证券、国泰君安证券、湘

财证券、国联证券和中原证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，齐鲁证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，东海证券的交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
兴业证券	989,479.50	0.69%	-	-
中信证券	55,440.15	0.04%	-	-
国金证券	52,075,061.10	36.57%	-	-
东北证券	32,782,253.70	23.02%	18,000,000.00	11.11%
齐鲁证券	15,950.00	0.01%	-	-
东兴证券	2,070,239.60	1.45%	-	-
海通证券	919,076.00	0.65%	144,000,000.00	88.89%
中国银河证券	53,488,402.70	37.56%	-	-

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	2014-01-04
2	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏红利混合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	2014-01-18
3	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
4	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
5	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
6	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
7	华夏基金管理有限公司关于调整华夏红利混合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	2014-05-14
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-16

	加申购及定期定额申购费率优惠的公告		
9	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
10	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	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-07-19
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	2014-08-21
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增吉林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	2014-08-28
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-06
15	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增包商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	2014-09-09
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-11
17	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-09-13
18	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	2014-09-18
19	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-11
20	华夏基金管理有限公司关于调整华夏红利混合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	2014-10-11
21	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增宏信证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-15
22	华夏基金管理有限公司关于调整华夏红利混合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	2014-10-18
23	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-10-20
24	华夏基金管理有限公司关于广州分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-11-08
25	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏红利混合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	2014-11-22
26	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-11-25
27	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金	中国证监会指	2014-12-04

	新增代销机构的公告	定报刊及网站	
28	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股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-12-31

§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 《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏红利混合型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
二〇一五年三月三十一日