

## 华夏回报证券投资基金

## [2013]年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送达日期:二〇一四年三月十六日

重要提示

基金管理人的董事、董事会秘书或高级管理人员不直接从事基金的管理运作,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的责任。本年度报告已经三分之二以上董事复核并形成书面意见,并由董事长签章。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2014年3月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现、基金份额持有人信息等重大信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导陈述或者重大遗漏。

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未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其定期报告。

本报告所载的财务资料未经审计,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,请投资者注意查阅。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

本年度报告摘要自发布之日起文本公告,阅读年度报告全文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称 华夏回报混合

基金代码 002001

002002

交易方式 灵活申购开放式

基金合同生效日 2003年7月5日

基金募集金额 8,664,732,709.35元

基金合同存续期 不定期

基金产品类型 投资目标 尽量避免基金资产损失,追求每年平均的绝对回报。

投资策略 通过精选的行业配置和品种筛选,在尽量规避基金资产损失的前提下,追求每年平均的绝对回报。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为绝对回报率为同期一年期定期存款利率。

风险收益特征 本基金属于中等风险品种,其预期收益和预期风险均低于股票型基金,但高于货币市场基金。

基金管理人和基金托管人

基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金代销机构 银行理财产品

直销中心 电子邮箱

400-818-6666

客服电话

service@chinaAMC.com

客户服务电话

400-818-6666

传真

010-63167070

010-66594942

2.2 基金产品说明

投资目标 尽量避免基金资产损失,追求每年平均的绝对回报。

投资策略 通过精选的行业配置和品种筛选,在尽量规避基金资产损失的前提下,追求每年平均的绝对回报。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为绝对回报率为同期一年期定期存款利率。

风险收益特征 本基金属于中等风险品种,其预期收益和预期风险均低于股票型基金,但高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人

华夏基金管理有限公司

基金托管人

中国银行股份有限公司

基金代销机构

银行理财产品

直销中心

电子邮箱

400-818-6666

客服电话

service@chinaAMC.com

客户服务电话

400-818-6666

传真

010-63167070

010-66594942

2.4 信息披露方式

披露责任主体

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

5.3 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 近期数据和指标 2013年 2012年 2011年

本期已实现收益 1,552,584,424.08 36,366,439.18 101,593,660.42

本期利润 2,332,124,635.31 732,443,890.60 -1,312,357,712.54

加权平均基金份额本期利润 0.2880 0.0911 -0.1579

本期基金份额净值增长率为 23.90% 7.51% -11.77%

3.1.2 期末数据指标 2013年末 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额利润 0.0360 -0.0078 -0.0129

期末基金资产净值 12,461,997,125.51 10,139,078,802.82 9,872,905,195.67

期末基金份额总额 1,438 1,289 1,199

注:①所有基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计算时未考虑实际收费水平将导致所列数字有差异。②本公司已实行收益分配政策,投资人认购或申购基金的费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益减去本公司公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏回报证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2003年9月日至2013年12月31日)

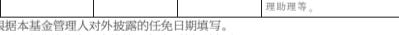


3.2.2 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏回报证券投资基金

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

(2003年9月日至2013年12月31日)

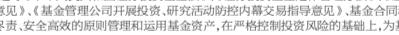


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏回报证券投资基金

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

(2003年9月日至2013年12月31日)



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

3.3.1 年度利润表 附注号 2013年 2012年 2011年

本期利润 482,148,474.84 272,412,447.57 1,204,560,932.31

年初未分配利润 1,500 - -

可供分配利润 1,500 - -

期末未分配利润 0.575 199,573,043.33 280,043,767.75

可供分配利润 1,438 1,289 1,199

注:①本基金利润分配指标不包括持有人认购或交易基金的费用,计算时未考虑实际收费水平将导致所列数字有差异。②本公司已实行收益分配政策,投资人认购或申购基金的费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益减去本公司公允价值变动收益。

3.4 基金净值表现

3.4.1 本期净值表现

3.4.2 本期净值表现

3.4.3 本期净值表现

3.4.4 本期净值表现

3.4.5 本期净值表现

3.4.6 本期净值表现

3.4.7 本期净值表现

3.4.8 本期净值表现

3.4.9 本期净值表现

3.4.10 本期净值表现

3.4.11 本期净值表现

3.4.12 本期净值表现

3.4.13 本期净值表现

3.4.14 本期净值表现

3.4.15 本期净值表现

3.4.16 本期净值表现

3.4.17 本期净值表现

3.4.18 本期净值表现

3.4.19 本期净值表现

3.4.20 本期净值表现

3.4.21 本期净值表现

3.4.22 本期净值表现

3.4.23 本期净值表现

3.4.24 本期净值表现

3.4.25 本期净值表现

3.4.26 本期净值表现

3.4.27 本期净值表现

3.4.28 本期净值表现

3.4.29 本期净值表现

3.4.30 本期净值表现

3.4.31 本期净值表现

3.4.32 本期净值表现

3.4.33 本期净值表现

3.4.34 本期净值表现

3.4.35 本期净值表现

3.4.36 本期净值表现

3.4.37 本期净值表现

3.4.38 本期净值表现

3.4.39 本期净值表现

3.4.40 本期净值表现

3.4.41 本期净值表现

3.4.42 本期净值表现

3.4.43 本期净值表现

3.4.44 本期净值表现

3.4.45 本期净值表现

3.4.46 本期净值表现

3.4.47 本期净值表现

3.4.48 本期净值表现

3.4.49 本期净值表现

3.4.50 本期净值表现

3.4.51 本期净值表现

3.4.52 本期净值表现

3.4.53 本期净值表现

3.4.54 本期净值表现

3.4.55 本期净值表现</