

华夏回报证券投资基金

2013年度报告摘要

注：“人金份额”按投入成本金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 卖出基金份额总额及卖出证券的收入金额

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	853,555,268.36	8.42
2	600016	民生银行	620,760,712.71	6.12
3	000002	万科A	513,120,936.63	5.24
4	600048	保利地产	384,177,163.97	3.79
5	600887	伊利股份	313,992,612.78	3.10
6	601088	宁波银行	188,490,311.1	1.86
7	000800	一汽轿车	182,907,707.39	1.80
8	000651	格力电器	179,850,087.11	1.77
9	600557	康美药业	170,164,414.42	1.68
10	600177	华信医药	158,266,659.97	1.55
11	002138	顺鑫农业	149,580,887.44	1.44
12	000663	中兴通讯	141,750,267.57	1.39
13	000625	长安汽车	140,068,596.69	1.38
14	000895	张江高科	139,932,428.66	1.38
15	600332	白云山	139,899,588.43	1.38
16	600867	通化东药	138,134,666.17	1.36
17	300253	卫宁软件	128,615,296.13	1.26
18	002415	海康威视	123,252,104.41	1.21
19	600628	中国石化	113,595,729.68	1.12
20	000683	西南药业	107,187,357.5	1.06

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金额

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	143,175,000.00	1.15
2	000002	万科A	299,133,000.00	0.24
3	000003	招商银行	2,366,530,000.00	18.99
4	000004	浦发银行	1,164,121,350.00	0.93
5	000005	民生银行	1,601,040,000.00	1.29
6	000006	中信银行	285,620,000.00	3.09
7	000007	工商银行	38,672,160.70	0.31
8	000008	农业银行	3,239,843,332.20	26.00

注：“买入股票成本”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。

注：“卖出股票成本”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	143,175,000.00	1.15
2	央行票据	299,133,000.00	0.24
3	金融债券	2,366,530,000.00	18.99
4	其中：政策性金融债	2,366,530,000.00	18.99
5	企业债券	1,164,121,350.00	0.93
6	企业短期融资券	1,601,040,000.00	1.29
7	中期票据	285,620,000.00	3.09
8	其他	38,672,160.70	0.31
9	合计	3,239,843,332.20	26.00

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130236	13国债36	4,300,000	427,033,000.00	3.43
2	090025	09国债05	2,600,000	257,530,000.00	2.07
3	110221	11国债21	2,600,000	255,216,000.00	2.05
4	100236	10国债36	2,000,000	197,660,000.00	1.59
5	110216	11国债16	1,600,000	159,656,000.00	1.21

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123501	13国债02	150,000	15,000,000.00	0.12
2	—	—	—	—	—
3	—	—	—	—	—
4	—	—	—	—	—
5	—	—	—	—	—
6	—	—	—	—	—
7	—	—	—	—	—
8	—	—	—	—	—
9	—	—	—	—	—
10	—	—	—	—	—

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货持仓。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货持仓。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货持仓。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 本基金投资的前十名债券未超出基金合同约定的备选债券库。

8.11.3 期末其他资产明细

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,154.35
2	应收证券清算款	4,276,331.77
3	应收利息	—
4	应收股利	50,703,896.32
5	应收申购款	6,428,691.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	62,380,369.97

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110108	民生转债	22,460,912.50	0.18
2	110023	民生转债	16,211,248.20	0.13

8.11.5 期末前十名股票中存在被流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000025	长安汽车	204,456,707.65	1.64	待流通受限股票

8.11.6 报告期末前十名股票中存在被流通受限情况的说明

8.11.6.1 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.2 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.3 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.4 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.5 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.6 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.7 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.8 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.9 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.10 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.11 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.12 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.13 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.14 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.15 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.16 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.17 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.18 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.19 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.20 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.21 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.22 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.23 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.24 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.25 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.26 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.27 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.28 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.29 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.30 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.31 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.32 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.33 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.34 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.35 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.36 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.37 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.38 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.39 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.40 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.41 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.42 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.43 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.44 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.45 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.46 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.47 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.48 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.49 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.50 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.51 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.52 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.53 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.54 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.55 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.56 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.57 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.58 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.59 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.60 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.61 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.62 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.63 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.64 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.65 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.66 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.67 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.68 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.69 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.70 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.71 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.72 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.73 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.74 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.75 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.76 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.77 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.78 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.79 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.80 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.81 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.82 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.83 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.84 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.85 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.86 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.87 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.88 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.89 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.90 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.91 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.92 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.93 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.94 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.95 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.96 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.97 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.98 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.99 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.100 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.101 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.102 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.103 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。

8.11.6.104 报告期末，本基金投资的前十名股票中，不存在被流通受限的情况。