中信稳定双利债券型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月二十六日

§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2014年3月24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2013年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中信稳定双利债券
基金主代码	288102
交易代码	288102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月20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	838,856,687.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类产品,投资目标是在强调本金稳妥的基础上,积极追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,采取期势策略控制组合久期的波动范围,充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率,实现基金的保值增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为80%×中信标普全债指数+20%×税后一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,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	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

2.4 信息披露方式

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

§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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	25,774,102.44	74,614,467.03	4,632,116.98
本期利润	-5,230,000.59	83,268,800.65	-12,427,478.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0045	0.0688	-0.0093
本期基金份额净值增长率	-1.16%	6.98%	-0.77%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0047	0.0038	-0.0128
期末基金资产净值	835,170,201.91	1,320,342,984.67	1,211,665,863.53
期末基金份额净值	0.9956	1.0332	1.0084

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。

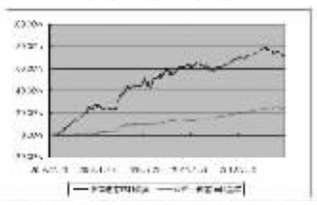
3.2 基金净值表现

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	-1.87%	0.09%	-0.81%	0.05%	-1.06%	0.04%
过去六个月	-3.22%	0.09%	-0.35%	0.04%	-2.87%	0.05%
过去一年	-1.16%	0.09%	2.03%	0.04%	-3.19%	0.05%
过去三年	4.93%	0.14%	9.91%	0.04%	-4.98%	0.10%
过去五年	20.40%	0.25%	12.94%	0.05%	7.46%	0.20%
自基金合同生效起至今	71.44%	0.25%	23.90%	0.05%	47.54%	0.20%

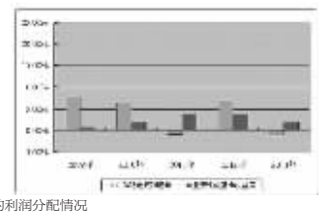
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信稳定双利债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年7月20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

中信稳定双利债券型证券投资基金
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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	0.264	9,769,573.37	23,243,665.28	33,013,238.65	-
2012年	0.450	16,730,676.73	38,941,362.41	55,672,039.14	-
2011年	0.270	10,043,450.87	27,280,172.11	37,323,622.98	-
合计	0.984	36,543,700.97	89,465,199.80	126,008,900.77	-

§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。

2013年,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,高度重视风险管理,同时积极把握投资机会,旗下主动管理的股票和混合型基金业绩稳健,短期理财及货币型基金表现持续良好。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2013年12月31日数据),华夏稳增混合今年以来的净值增长率在12只灵活配置型混合基金(股票上限95%)中排名第1;华夏成长混合今年以来的净值增长率在29只偏股型混合基金(股票上限80%)中排名第6;华夏经典混合今年以来的净值增长率在71只灵活配置型混合基金(股票上限80%)中排名第5。

凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉,2013年华夏基金荣获多家机构评选的多个奖项,主要奖项包括:在《证券时报》主办的“2012年度中国基金业明星基金奖”的评选中,华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”,所管理的基金荣获4个单项奖;在《上海证券报》主办的第十届中国“金基金”奖的评选中,华夏基金荣获“金基金十年·卓越公司奖”;在《中国证券报》主办的“第十届中国基金业金牛奖”的评选中,华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司奖”,所管理的基金荣获5个单项奖;在晨星(中国)举办的“晨星(中国)2013年度基金奖”评选中,华夏回报混合荣获“混合型基金奖”。

在客户服务方面,2013年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户的交易便利性:(1)推出了货币基金的“还贷款”及信用卡还款业务,方便投资者进行现金管理;(2)直销网上交易新增了中国建设银行储蓄卡的“快易付”功能,并增加多家银行卡的电子交易业务,提高投资者的交易效率;(3)开通了华夏基金微信公众服务平台并推出微信交易功能,在淘宝网、天天基金网等平台开通基金业务,并与百度达成互联网业务合作,为投资者提供更多交易渠道。

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		
毛颖	本基金的基金经理	2013-05-13	-	11年	北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员、原中信基金研究员、基金经理助理等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员等。
李广云	本基金的基金经理	2009-02-04	2013-05-29	12年	英国华威大学管理科学与运筹学硕士。曾任招商证券研究员、原中信基金研究员、基金经理助理等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏货币市场基金基金经理(2007年7月12日至2012年2月29日期间)等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③根据本基金管理人于2013年5月15日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘中信稳定双利债券型证券投资基金基金经理的公告》,增聘毛颖女士为本基金基金经理。

④根据本基金管理人于2013年5月30日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整中信稳定双利债券型证券投资基金基金经理的公告》,李广云先生不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,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

2013年,国际方面,对美联储是否会退出量化宽松的预期导致新兴市场6月份出现剧烈动荡。国内方面,经济整体波动并不显著,国内生产总值(GDP)2季度小幅下滑后于3季度逐步企稳;宏观金融监管政策发生重要变化,央行开始逐步提高短端利率收紧流动性,国家审计署进行了地方政府债务审计,地方政府的融资冲动受到一定程度遏制。

债券市场方面,二级市场交易明显缩量,债券一级发行利率抬升带动二级市场和估值收益率不断走高,市场心态发生显著变化。央行在资金市场紧张时仅采取措施避免金融系统出现流动性危机,并未进行积极干预,导致银行主动提高备付金水平;加之利率市场化加快,原沉淀在银行的活期存款更快流向以货币市场基金为代表的短期金融工具,迫使银行追求更稳定的资金来源,在同业存款市场不惜支付更高的利率。基于上述背景,债券市场自2季度后开始逐级下跌,牛市格局转变为熊市。可转债市场整体受资金偏紧影响,全年呈下跌格局,其中小盘可转债表现尚可。

报告期内,本基金大幅减持各类债券,缩短久期,降低杠杆比例。但由于债市跌幅较大,本基金本报告期未能实现正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.9956元,本报告期份额净值增长率为-1.16%,同期业绩比较基准增长率为2.03%。

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2014年,宏观周期的力量在弱化,政府通常采取的反周期政策选择难度加大,市场仍有很多风险因素。资金面仍可能有变数,主要在于:在金融机构未完成整体降杠杆之前,央行对资金面的态度不会有明显变化;IPO重新开闸,对资金面存在扰动;美国量化宽松逐步退出,如果中国宏观经济增速同时明显下滑,外围资金状况可能明显转向;全年公开市场到期资金量很少。供求方面,伴随着整体政府债务的方向性压缩,一方面政府“开前门堵后门”可能增大债券供给,另一方面国债和政策性金融债的供给也可能放大,这将抬升无风险利率水平,既会压制股权投资的吸引力,又造成整个社会资金成本的上升从而显著压制企业盈利,信用利差可能重新扩大。可转债受制于IPO的重新开闸等因素,整体机会不大。

本基金将增持确定性较高的短期存款,以较低仓位波段操作可转债。同时,本基金将耐心等待政策转变,相机转向传统债券型基金的长久期高杠杆操作。

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,基金管理人结合法律法规和业务发展需要,修订了公司的风险管理制度、员工投资行为管理制度等内部制度,进一步完善了公司内部制度体系;围绕防控“三条底线”和内幕交易,组织多项合规培训和合规考试,加强员工的风险意识和合规意识;针对投资研究等重点业务,加大检查力度,促进公司业务合法合规、稳健经营;积极参与新产品、新业务的设计,提出合规建议,对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作,有效防范风险,规避违规行为的发生。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期实施利润分配2次,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内,本基金实施利润分配的金额为33,013,238.65元。

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(2014)审字第60739337_B13号

中信稳定双利债券型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的中信稳定双利债券型证券投资基金财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表和2013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,公允反映了中信稳定双利债券型证券投资基金2013年12月31日的财务状况以及2013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 边卓群 蒋燕华
北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
2014年3月24日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		113,298,015.13	7,348,606.60
结算备付金		10,377,628.55	4,584,728.87
存出保证金		75,818.96	250,000.00
交易性金融资产		853,341,442.20	1,311,243,983.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		841,813,442.20	1,311,243,983.00
资产支持证券投资		11,528,000.00	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	4,983,180.82
应收利息		19,266,086.54	28,317,239.08
应收股利		-	-
应收申购款		115,929.90	1,988,264.08
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		996,474,921.28	1,358,716,002.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		147,469,687.54	32,000,000.00
应付证券清算款		5,952,696.26	-
应付赎回款		3,797,682.85	1,912,267.70
应付管理人报酬		482,032.40	740,289.96
应付托管费		148,317.68	227,781.51
应付销售服务费		296,635.33	455,563.06
应付交易费用		351,024.93	271,810.24
应交税费		2,191,311.60	2,191,311.60
应付利息		46,300.18	4,968.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		569,030.60	569,025.21
负债合计		161,304,719.37	38,373,017.78
所有者权益:			
实收基金		838,856,687.38	1,277,932,701.71
未分配利润		-3,686,485.47	42,410,282.96
所有者权益合计		835,170,201.91	1,320,342,984.67
负债和所有者权益总计		996,474,921.28	1,358,716,002.45

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.9956元,基金份额总额838,856,687.38份。

7.2 利润表

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		26,972,578.39	106,994,951.27
1.利息收入		90,098,852.98	74,644,548.32
其中:存款利息收入		5,147,699.60	399,890.38
债券利息收入		84,217,121.75	73,226,947.93
资产支持证券利息收入		368,344.28	-
买入返售金融资产收入		365,687.35	1,017,710.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-32,280,587.08	23,153,014.60
其中:股票投资收益		-4,068,590.49	-6,491,337.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-28,211,996.59	29,644,352.18
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-31,004,103.03	8,654,333.62
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		158,415.52	543,054.73
减:二、费用		32,202,578.98	23,726,150.62
1.管理人报酬		7,856,134.03	8,147,278.29
2.托管费		2,417,271.93	2,506,854.69
3.销售服务费		4,834,544.10	5,013,709.71
4.交易费用		246,090.93	321,377.20
5.利息支出		16,464,630.23	7,355,201.62
其中:卖出回购金融资产支出		16,464,630.23	7,355,201.62
6.其他费用		383,907.76	381,729.11
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-5,230,000.59	83,268,800.65
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-5,230,000.59	83,268,800.65

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	1,277,932,701.71	42,410,282.96	1,320,342,984.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,230,000.59	-5,230,000.59
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)	-439,076,014.33	-7,853,529.19	-446,929,543.52
其中:1.基金申购款	641,427,588.47	28,084,612.27	669,512,200.74
2.基金赎回款	-1,080,503,602.80	-35,938,141.46	-1,116,441,744.26
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)	-	-33,013,238.65	-33,013,238.65
五、期末所有者权益(基金净值)	838,856,687.38	-3,686,485.47	835,170,201.91
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	1,201,590,909.35	10,074,954.18	1,211,665,863.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	83,268,800.65	83,268,800.65
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)	76,341,792.36	4,738,567.27	81,080,359.63
其中:1.基金申购款	539,195,165.00	23,970,847.23	563,166,012.23
2.基金赎回款	-462,853,372.64	-19,232,279.96	-482,085,652.60
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)	-	-55,672,039.14	-55,672,039.14
五、期末所有者权益(基金净值)	1,277,932,701.71	42,410,282.96	1,320,342,984.67

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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
无锡市国联发展(集团)有限公司	基金管理人的股东
中信万通证券有限责任公司(“中信万通证券”)	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信证券(浙江)有限责任公司(“中信证券(浙江)”)	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

注:①根据华夏基金管理有限公司于2013年9月25日发布的公告,经中国证监会核准,华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资比例59%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例11%)、山东省农村经济开发投资公司(出资比例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%)。

②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%)。

③下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.1.4 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。

7.4.4.1.5 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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,856,134.03	8,147,278.29
其中:支付销售机构的客户维护费	492,150.88	485,957.59

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0.65%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 ×0.65% / 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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,417,271.93	2,506,854.69

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0.20%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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	461,979.35
中国建设银行	2,376,555.19
中信证券	128,995.17
中信证券(浙江)	29,108.48
中信万通证券	7,346.09
合计	3,003,984.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	383,959.21
中国建设银行	2,618,892.05
中信证券	140,996.09
合计	3,143,847.35

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	9,964,922.19	-	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况7.4.4.4.1 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。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	13,298,015.13	271,717.44	7,348,606.60	202,293.21

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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	1380011	13泉州城投债	新债发行	30,000	3,000,000.00
中信证券	124205	13余创债	新债发行	10,000	1,000,000.00
中信证券	41353068	13深燃气CP002	新债发行	100,000	10,000,000.00
中信证券	101353011	13西永MTN003	新债发行	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
中信证券	1280163	12中核债01	新债发行	360,000	36,000,000.00

7.4.5 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013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74,969,687.54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
110206	11国开06	2014-01-06	99.84	500,000	49,920,000.00
130241	13国开41	2014-01-06	99.30	265,000	26,314,500.00
合计	-	-	-	765,000	76,234,500.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额72,500,000.00元,于2014年1月2日、2014年1月3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。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1