华夏红利混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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:二〇一三年八月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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2013年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	11,876,730,941.54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

2.4 信息披露方式

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

§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(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	234,803,527.89
本期利润	258,221,991.02
加权平均基金份额本期利润	0.0210
本期基金份额净值增长率	1.08%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1193
期末基金资产净值	16,715,949,889.47
期末基金份额净值	1.407

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。

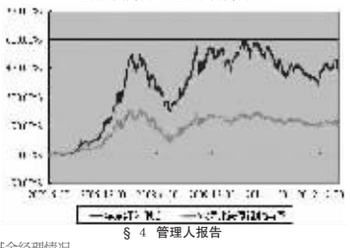
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-10.21%	1.58%	-9.82%	0.98%	-0.39%	0.60%
过去三个月	-3.10%	1.17%	-7.76%	0.76%	4.66%	0.41%
过去六个月	1.08%	1.13%	-7.76%	0.72%	8.84%	0.41%
过去一年	-0.50%	1.02%	-8.65%	0.68%	8.15%	0.34%
过去三年	-1.52%	1.14%	-4.94%	0.75%	3.42%	0.39%
自基金合同生效起至今	435.27%	1.45%	144.78%	1.20%	290.49%	0.25%

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2013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年上半年,市场大幅波动,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,公司旗下所有主动管理的股票和混合型基金收益均战胜沪深300指数,货币型基金表现持续良好。

2013年上半年,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4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,上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高服务质量:①升级了货币基金的快速赎回业务;扩充了支持银行卡的范围,延长了业务办理时间;②推出了货币基金"还贷款"及信用卡还款业务,推出了直销网上交易"跨行随意取"业务,开通了支付宝交易渠道,方便投资者进行现金管理;③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;④开通了华夏基金微信公众服务平台,满足投资者服务渠道多样化的需求。

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		
谭琦	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-01-01	-	10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。
赵航	本基金的基金经理	2011-01-18	-	16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)等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任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。
严鸿宴	本基金的基金经理	2011-11-07	-	12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。

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8月3日发布的《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》,增聘贺振华先生为本基金基金经理。

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,本基金出现3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

2013年上半年,国际方面,美国经济基本面好转,美联储延续了量化宽松政策,但退出信号越来越明确,资本开始从新兴市场向发达国家回流,发达国家股市表现强势,新兴市场则承受较大压力,黄金、铜等大宗商品价格也出现较大跌幅。国内方面,经济在经历了2012年4季度短期企稳反弹后,开始重新放缓,显示出内生动力不足,仍处于"减速一企稳"交替出现的阶段。流动性总体从宽松趋向收紧,特别是6月份因银行间市场监管升级、外汇占款下降等因素出现了"紧急刹车"。市场方面,A股整体进一步下跌,但结构分化明显,沪深300指数大幅下跌,创业板上涨较多,成长股明显跑赢周期股。

报告期内,本基金保持中等仓位运作,在市场反弹过程中,持续降低银行、地产等周期性行业权重,重点投资于医药、信息技术、公用事业等在经济转型时期受益的板块,取得了一定的投资效果,但对创业板、主题板块等参与有限,影响了整体业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为1.407元,本报告期份额净值增长率为1.08%,同期业绩比较基准增长率为-7.76%。

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,出口和房地产投资减速,制造业产能过剩并未解决,经济下行的压力仍然存在;货币政策趋紧,资本流出新兴市场的预期持续存在,下半年的流动性状况将弱于上半年。周期股已较便宜,估值收缩过程或已结束,但在经济下行趋势下,业绩受损的压力并未结束,而代表转型方向的中小盘股票估值偏贵,也存在回调压力。基于上述判断,预计下半年市场仍然缺乏系统性机会,只有结构性、个股的机会。

尽管存在诸多困难,但在经济转型和新一届政府改革的大背景下,符合改革方向、治理结构良好、管理团队优秀的企业仍会获得巨大成功。本基金将在整体谨慎的前提下,以合理价格投资此类优秀个股。

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,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,本基金未实施利润分配。

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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华夏红利混合型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		2,029,116,933.11	2,148,442,075.03
结算备付金		32,918,404.76	8,423,561.29
存出保证金		3,897,779.88	1,750,000.00
交易性金融资产		14,642,223,525.70	15,998,951,985.82
其中:股票投资		13,369,057,310.08	13,793,057,032.75
基金投资		-	-
债券投资		1,273,166,215.62	2,205,894,953.07
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		100,000,270.00	48,500,144.25
应收证券清算款		116,022.97	26,559,051.19
应收利息		19,577,372.61	28,878,523.98
应收股利		17,209,296.55	-
应收申购款		2,648,888.91	8,838,028.57
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,847,708,494.49	18,270,343,370.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30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		-	400,000,000.00
应付证券清算款		12,620,474.85	92,777,618.56
应付赎回款		15,273,548.08	21,967,335.17
应付管理人报酬		21,776,483.73	21,053,997.96
应付托管费		3,629,413.96	3,508,999.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		76,223,943.29	64,036,720.11
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		-	333,015.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,985,165.51	2,181,789.53
负债合计		131,758,605.02	606,109,051.60
所有者权益:			
实收基金		11,876,730,941.54	12,686,414,898.86
未分配利润		4,839,218,947.93	4,977,819,419.67
所有者权益合计		16,715,949,889.47	17,664,234,318.53
负债和所有者权益总计		16,847,708,494.49	18,270,343,370.13

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.407元,基金份额总额11,876,730,941.54份。

6.2 利润表

会计主体:华夏红利混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		458,658,741.72	802,168,579.50
1.利息收入		31,114,562.87	27,134,898.55
其中:存款利息收入		8,994,424.59	5,872,542.59
债券利息收入		18,678,332.11	18,573,708.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,441,806.17	2,688,647.50
其他利息收入		-	0.00
2.投资收益(损失以"-"填列)		401,572,266.01	-606,216,937.03
其中:股票投资收益		254,207,382.34	-745,480,062.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,509,262.96	6,634,318.10
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		141,855,620.71	132,628,807.44
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		23,418,463.13	1,379,991,641.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,553,449.71	1,258,976.40
减:二、费用		200,436,750.70	185,907,977.33
1.管理人报酬		134,962,099.44	136,059,366.81
2.托管费		22,493,683.21	22,676,561.10
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		41,302,560.52	26,688,625.22
5.利息支出		1,459,010.22	263,309.84
其中:卖出回购金融资产支出		1,459,010.22	263,309.84
6.其他费用		219,397.31	220,114.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		258,221,991.02	616,260,602.17
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		258,221,991.02	616,260,602.17

6.3 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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	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)	-	258,221,991.02	258,221,991.02
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)	-809,683,957.32	-396,822,462.76	-1,206,506,420.08
其中:1.基金申购款	568,380,615.71	267,720,232.40	836,100,848.11
2.基金赎回款	-1,378,064,573.03	-664,542,695.16	-2,042,607,268.19
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)	11,876,730,941.54	4,839,218,947.93	16,715,949,889.47
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	12,440,689,053.94	4,545,756,777.86	16,986,445,831.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	616,260,602.17	616,260,602.17
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)	322,692,567.46	125,042,634.36	447,735,201.82
其中:1.基金申购款	1,015,665,089.30	439,128,611.39	1,454,793,700.69
2.基金赎回款	-692,972,521.84	-314,085,977.03	-1,007,058,498.87
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)	12,763,381,621.40	5,287,060,014.39	18,050,441,635.79

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:

王东明　　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

6.4 报表附注

6.4.1 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

本基金报告期所采用的会计政策、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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	2,282,005,406.67	13.04%

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	761,947.08	1.11%

6.4.4.1.4 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。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	1,854,151.98	12.66%	1,866,151.98	2.62%

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	134,962,099.44	136,059,366.81
其中:支付销售机构的客户维护费	22,076,230.34	21,678,403.57

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	22,493,683.21	22,676,561.10

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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国建设银行	2,029,116,933.11	8,729,489.38	1,083,157,855.05	5,697,826.19

注:本基金的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。

6.4.4.6 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。

6.4.5 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.5.1.1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
000562	宏源证券	2012-06-28	2013-07-04	非公开发行流通受限	13.22	8.79	12,000,000	158,640,000.00	105,480,000.00	-
000562	宏源证券	-	2013-07-04	非公开发行转增	-	8.79	12,000,000	-	105,480,000.00	-
000801	四川九洲	2012-07-19	2013-07-23	非公开发行流通受限	6.20	9.39	9,800,000	60,760,000.00	92,022,000.00	-
002106	莱宝高科	2013-03-18	2014-03-19	非公开发行流通受限	16.52	15.35	4,500,000	74,340,000.00	69,075,000.00	-

注:本基金持有的非公开发行股票宏源证券,于2013年6月19日实施2012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6.00元(含税),同时以资本公积金向全体股东每10股转增10股,本基金新增12,000,000股。

6.4.5.2 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
300027	华谊兄弟	2013-06-05	拟披露重大事项	28.55	2013-07-24	31.41	4,028,234	87,754,251.70	115,006,080.70	-
300086	康芝药业	2013-05-23	停牌核查媒体报道	14.73	2013-07-23	14.00	4,944,546	68,273,244.47	72,833,162.58	-
600436	片仔癀	2013-06-21	配股事项	136.82	2013-07-01	118.73	343,918	20,217,241.13	47,054,860.76	-
300056	三维丝	2013-05-10	筹划重大资产重组事项	14.60	2013-07-11	16.02	2,613,946	35,822,918.38	38,163,611.60	-
601918	国投新集	2013-05-16	控股股东筹划重大资产重组事项	7.55	2013-08-23	5.05	5,000,000	50,659,956.40	37,750,000.00	-
300166	东方国信	2013-05-20	筹划向特定对象发行股份购买资产事宜	16.45	2013-08-02	18.10	1,902,025	28,777,074.32	31,288,311.25	-
600547	山东黄金	2013-04-03	筹划重大资产重组事项	32.13	2013-07-01	28.77	851,597	33,748,221.05	27,361,811.61	-
600688	S上石化	2013-06-28	刊登重要公告	8.19	2013-08-20	4.90	2,184,312	23,805,441.37	17,889,515.28	-
000600	建投能源	2013-05-20	筹划重大资产重组事项	4.07	2013-07-15	4.31	3,794,185	22,868,530.58	15,442,332.95	-
600088	中视传媒	2013-05-30	筹划重大资产重组事项	14.29	-	-	785,505	10,471,779.28	11,224,866.45	-
000665	湖北广电	2013-03-26	筹划重大资产重组事项	10.53	2013-07-12	11.58	657,700	7,998,795.85	6,925,581.00	-
000719	大地传媒	2013-05-17	筹划重大资产重组事项	9.61	2013-08-12	10.57	710,100	7,998,078.67	6,824,061.00	-
000999	华润三九	2013-06-03	筹划重大资产重组事项	26.55	2013-08-19	26.51	252,900	6,324,992.69	6,714,495.00	-
601989	中国重工	2013-05-17	控股股东筹划重大事项	4.52	-	-	1,223,564	6,153,820.03	5,530,509.28	-
002252	上海莱士	2013-03-26	筹划重大资产重组事项	21.00	2013-07-02	22.80	90,008	1,791,924.24	1,890,168.00	-
002390	信邦制药	2013-05-31	筹划重大资产重组事项	17.13	-	-	8,900	138,710.94	152,457.00	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013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。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013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。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 各层级金融工具公允价值

截至2013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13,694,566,030.70元,第二层级的余额为947,657,495.00元,第三层级的余额为0元。(截至2012年12月31日止:第一层级的余额为14,581,894,902.71元,第二层级的余额为1,417,057,083.11元,第三层级的余额为0元。)

6.4.6.3 公允价值所属层级间的重大变动

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。

6.4.6.4 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	13,369,057,310.08	79.35
	其中:股票	13,369,057,310.08	79.35
2	固定收益投资	1,273,166,215.62	7.56
	其中:债券	1,273,166,215.62	7.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,270.00	0.59
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,062,035,337.87	12.24
6	其他各项资产	43,449,360.92	0.26
7	合计	16,847,708,494.49	100.00

7.2 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	81,997,555.70	0.49
B	采矿业	269,327,484.28	1.61
C	制造业	7,709,825,058.57	46.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	636,685,890.81	3.81
E	建筑业	54,076,989.56	0.32
F	批发和零售业	569,998,586.27	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	330,171,488.08	1.98
H	住宿和餐饮业	1,541,396.25	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,322,203,963.73