
华夏红利混合型证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 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

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

§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 2011 年 8 月 19 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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	8
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
6.2 利润表.....	10
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	11
6.4 报表附注.....	12
§7 投资组合报告.....	25
7.1 期末基金资产组合情况.....	25
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	26
7.3 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.....	26
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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明细.....	35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 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明细.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
§8 基金份额持有人信息.....	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	37
§9 开放式基金份额变动.....	37
§10 重大事件揭示.....	37
§11 备查文件目录.....	40

§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	11,116,337,027.68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	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.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 3 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		范勇宏	郭树清

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》
登载基金半年度报告正文的管理	www.ChinaAMC.com

人互联网网址	
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 3 层

§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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	814,739,881.52
本期利润	-867,068,491.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0782
本期加权平均净值利润率	-4.11%
本期基金份额净值增长率	-4.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	2,407,266,523.29
期末可供分配基金份额利润	0.2166
期末基金资产净值	20,776,726,394.54
期末基金份额净值	1.869
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	540.82%

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。

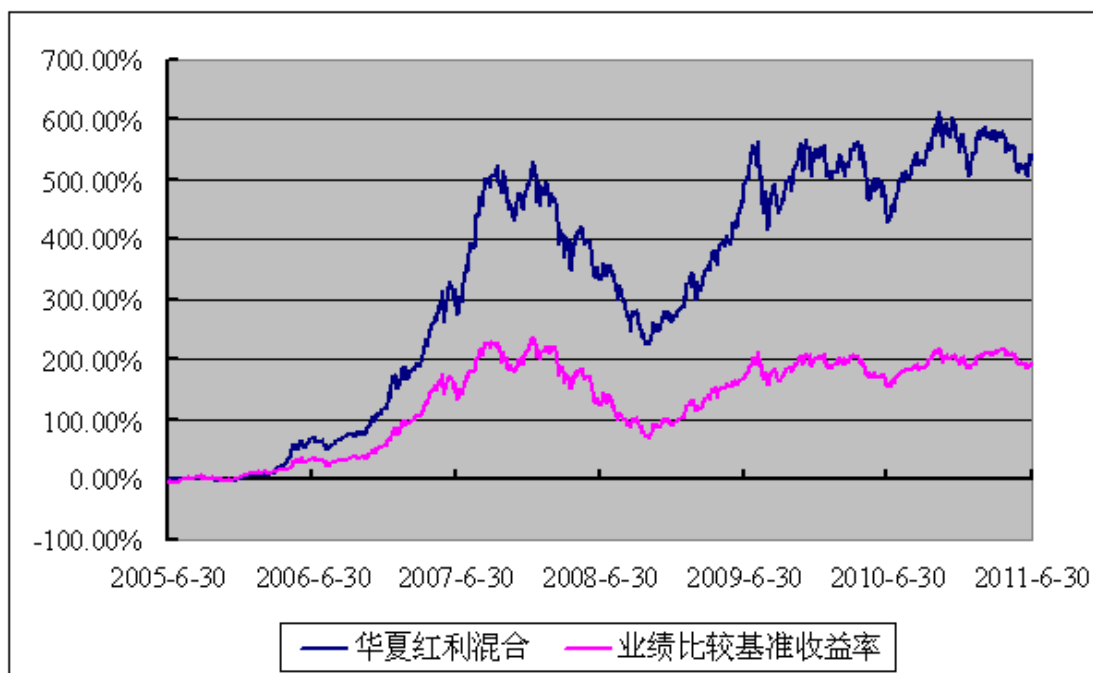
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	3.66%	1.03%	-0.58%	0.74%	4.24%	0.29%
过去三个月	-3.21%	0.96%	-4.72%	0.67%	1.51%	0.29%
过去六个月	-4.15%	1.10%	-1.51%	0.75%	-2.64%	0.35%
过去一年	17.90%	1.20%	14.33%	0.83%	3.57%	0.37%
过去三年	45.54%	1.49%	29.78%	1.26%	15.76%	0.23%
自基金合同生效起至今	540.82%	1.54%	194.39%	1.33%	346.43%	0.21%

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 2011 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、杭州和广州设有分公司，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、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，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2011 年上半年，在市场震荡的情况下，华夏基金加强风险控制，坚持稳健的投资风格，努力把握投资机会。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 2011 年 6 月 30 日数据），华夏收入股票在 217 只标准股票型基金中排名第 10；华夏大盘精选混合、华夏红利混合在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中分别排名第 2 和第 7；华夏策略混合在 48 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 1。

2011 年 3 月，在《证券时报》举办的“第七届中国基金业明星奖颁奖仪式

暨中国明星基金论坛”中，华夏基金获得“长期回报明星基金公司奖”；2011年4月，在《上海证券报》主办的中国“金基金”奖颁奖典礼中，华夏基金第六次荣获“金基金 TOP 公司奖”；在《中国证券报》、中央电视台主办的“中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金第六次荣获年度“金牛基金管理公司奖”。

上半年，为更好地满足客户需求，华夏基金恢复办理原中信四只基金的转换业务；并调整了在本公司进行登记结算的基金的分红方式变更规则，从而使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金分别设置分红方式。

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	2009-01-01	-	8 年	工学硕士。2003 年加入华夏基金管理有限公司，历任行业研究员、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）。
赵航	本基金的基金经理	2011-01-18	-	14 年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券公司资产管理中心投资经理、长城证券公司投资银行部项目经理、鹏华基金管理有限公司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）、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）。2009 年 1 月加入华夏基金管理有限公司。
郑煜	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2010-01-16	2011-03-17	13 年	中国科技大学管理科学与工程学硕士。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理，原中信基金股权投资部总监。2009 年 1 月加入华夏基金管理有限公司。

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 2011 年 1 月 20 日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》，增聘赵航先生为本基金基金经理。

④根据本基金管理人于 2011 年 3 月 19 日发布的《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》，郑煜女士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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、基金合同和其他有关法律、法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

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。

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

2011 年上半年，美国经济复苏乏力，欧洲债务问题反复，国际市场大宗商品价格仍维持高位。国内方面，CPI 逐月走高，货币政策总体偏紧，市场利率不断抬升。市场方面，A 股市场 1 季度盘整上升，2 季度快速下跌后有所反弹。

报告期内，本基金重点投资于有色、食品饮料、水泥等行业中的精选个股，回避高估值的中小盘股票，业绩表现好于市场平均水平。但仍有两个问题值得反思：第一，如何更为充分地把握住相对有限的机会；第二，对于市场系统性的变化，应避免为追求精确而失去大局观。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.869 元, 本报告期份额净值增长率为-4.15%, 同期业绩比较基准增长率为-1.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来, 我们认为中短期内宏观经济的走向仍不明朗, 但事物的发展都是从量变到质变, 从局部到整体, 因此在行业和企业层面观察到的变化可能正是对未来宏观走势作出的预示。

投资策略上, 本基金将重视行业和企业层面的改善, 努力选择时间适宜、空间足够的投资标的。

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、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中, 超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验, 且具有风控、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合规守信、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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,021,502,330.27	1,963,399,206.15
结算备付金		11,985,765.26	44,189,108.85
存出保证金		13,090,429.71	9,764,215.90
交易性金融资产	6.4.7.2	19,863,064,926.03	19,693,817,337.58
其中：股票投资		17,939,180,881.35	18,496,846,728.79
基金投资		-	-
债券投资		1,923,884,044.68	1,196,970,608.79
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	966,318.66	1,006,880.18
买入返售金融资产	6.4.7.4	299,880,349.94	-
应收证券清算款		20,072,280.48	67,666,489.97
应收利息	6.4.7.5	29,305,664.69	8,918,463.03
应收股利		15,912,087.68	-
应收申购款		2,704,307.36	2,956,106.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		21,278,484,460.08	21,791,717,807.90
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2011 年 6 月 30 日	2010 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		-	-
应付证券清算款		233,869,328.08	5,391,448.42
应付赎回款		13,706,302.98	13,004,276.37
应付管理人报酬		24,755,872.09	27,932,638.68
应付托管费		4,125,978.69	4,655,439.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	223,576,242.19	206,211,052.24
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,474,765.91	1,403,519.50
负债合计		501,758,065.54	258,847,950.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,116,337,027.68	11,042,962,218.67
未分配利润	6.4.7.10	9,660,389,366.86	10,489,907,638.63
所有者权益合计		20,776,726,394.54	21,532,869,857.30
负债和所有者权益总计		21,278,484,460.08	21,791,717,807.90

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.869 元，基金份额总额

11,116,337,027.68 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-639,846,259.89	-3,799,588,231.33
1.利息收入		24,195,939.32	22,776,653.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,409,823.95	10,405,895.75
债券利息收入		14,376,239.95	11,670,634.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,409,875.42	700,123.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,015,223,242.77	1,257,313,030.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	915,652,984.92	1,173,047,414.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-636,894.73	3,263,814.56
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-153,261.45

股利收益	6.4.7.15	100,207,152.58	81,155,062.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-1,681,808,373.07	-5,082,995,276.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	2,542,931.09	3,317,360.92
减：二、费用		227,222,231.66	270,811,359.37
1.管理人报酬		156,956,941.80	177,081,611.87
2.托管费		26,159,490.30	29,513,602.04
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	42,985,374.75	63,817,265.42
5.利息支出		907,910.53	192,129.09
其中：卖出回购金融资产支出		907,910.53	192,129.09
6.其他费用	6.4.7.19	212,514.28	206,750.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-867,068,491.55	-4,070,399,590.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-867,068,491.55	-4,070,399,590.70

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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	11,042,962,218.67	10,489,907,638.63	21,532,869,857.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-867,068,491.55	-867,068,491.55
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)	73,374,809.01	37,550,219.78	110,925,028.79
其中：1.基金申购款	1,126,401,844.80	1,018,689,981.93	2,145,091,826.73
2.基金赎回款	-1,053,027,035.79	-981,139,762.15	-2,034,166,797.94
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)	11,116,337,027.68	9,660,389,366.86	20,776,726,394.54
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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)	7,839,904,494.81	19,165,492,591.96	27,005,397,086.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,070,399,590.70	-4,070,399,590.70
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)	2,164,403,076.63	2,674,700,154.15	4,839,103,230.78
其中：1.基金申购款	3,088,254,625.29	4,404,622,807.60	7,492,877,432.89

2.基金赎回款	-923,851,548.66	-1,729,922,653.45	-2,653,774,202.11
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）	-	-7,671,270,567.61	-7,671,270,567.61
五、期末所有者权益（基金净值）	10,004,307,571.44	10,098,522,587.80	20,102,830,159.24

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：

范勇宏 崔雁巍 崔雁巍
 基金管理公司负责人 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 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。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日发布的《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》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。其中，对基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日	
	活期存款	1,021,502,330.27
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	1,021,502,330.27	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	17,890,045,264.17	17,939,180,881.35	49,135,617.18	
债券	交易所市场	1,053,936,379.35	1,085,512,044.68	31,575,665.33
	银行间市场	841,220,204.66	838,372,000.00	-2,848,204.66
	合计	1,895,156,584.01	1,923,884,044.68	28,727,460.67
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	19,785,201,848.18	19,863,064,926.03	77,863,077.85	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	966,318.66	-	772,183.22
其中：权证	-	966,318.66	-	772,183.22
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	966,318.66	-	772,183.22

注：备注栏中列示权证投资成本。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2011 年 6 月 30 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	299,880,349.94	-
交易所市场买入返售金融资产	-	-
合计	299,880,349.94	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	322,615.15
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	5,393.60
应收债券利息	28,936,863.13
应收买入返售证券利息	40,729.51
应收申购款利息	-
其他	63.30
合计	29,305,664.69

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	223,561,151.57
银行间市场应付交易费用	15,090.62
合计	223,576,242.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	51,664.41
预提费用	173,101.50

合计	1,474,765.91
----	--------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,042,962,218.67	11,042,962,218.67
本期申购	1,126,401,844.80	1,126,401,844.80
本期赎回（以“-”号填列）	-1,053,027,035.79	-1,053,027,035.79
本期末	11,116,337,027.68	11,116,337,027.68

6.4.7.10 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	1,581,275,894.00	8,908,631,744.63	10,489,907,638.63
本期利润	814,739,881.52	-1,681,808,373.07	-867,068,491.55
本期基金份额交易产生的变动数	11,250,747.77	26,299,472.01	37,550,219.78
其中：基金申购款	213,610,087.58	805,079,894.35	1,018,689,981.93
基金赎回款	-202,359,339.81	-778,780,422.34	-981,139,762.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,407,266,523.29	7,253,122,843.57	9,660,389,366.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,208,025.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	199,214.71
其他	2,583.77
合计	7,409,823.95

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,114,579,128.99
减：卖出股票成本总额	13,198,926,144.07
买卖股票差价收入	915,652,984.92

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,007,767,368.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	995,730,175.50
减：应收利息总额	12,674,087.99
债券投资收益	-636,894.73

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	100,207,152.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	100,207,152.58

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-1,681,767,811.55
——股票投资	-1,685,676,469.98
——债券投资	3,908,658.43
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-40,561.52
——权证投资	-40,561.52
3.其他	-
合计	-1,681,808,373.07

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	2,542,931.09
合计	2,542,931.09

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	42,967,674.75
银行间市场交易费用	17,700.00
合计	42,985,374.75

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	119,012.93
银行费用	34,912.78
银行间账户维护费	9,000.00
合计	212,514.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	3,737,006,096.64	13.23%	4,033,092,220.98	10.07%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	-	-	27,523.44	0.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	3,036,344.69	12.87%	26,805,392.39	11.99%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	3,276,912.42	9.79%	19,443,212.16	10.50%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	156,956,941.80	177,081,611.87
其中：支付销售机构的客户维护费	24,138,395.92	25,424,693.70

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,159,490.30	29,513,602.04

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
期初持有的基金份额	1,466,514.94	810,824.75
期间申购/买入总份额	-	347,545.97
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,466,514.94	-
期末持有的基金份额	-	1,158,370.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.01%

注：①上年度可比期间“期间申购/买入总份额”为红利再投资所获得的基金份额。

②本基金管理人于本报告期经代销机构赎回本基金，适用费率为 0.5%。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,021,502,330.27	7,208,025.47	3,943,487,650.45	10,153,888.11
--------	------------------	--------------	------------------	---------------

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。

6.4.10.6 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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	600036	招商银行	配股发行	3,836,957	33,957,069.45
中信证券	601166	兴业银行	配股发行	601,368	10,824,624.00

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002167	东方锆业	2011-06-30	2012-07-01	非公开发行流通受限	30.06	30.10	2,000,000	60,120,000.00	60,200,000.00	-
000882	华联股份	2011-01-13	2012-01-14	非公开发行流通受限	6.60	6.96	7,150,000	47,190,000.00	49,764,000.00	-
300228	富瑞特装	2011-06-01	2011-09-08	新发流通受限	24.98	34.00	680,000	16,986,400.00	23,120,000.00	-
002574	明牌珠宝	2011-04-18	2011-07-22	新发流通受限	32.00	26.77	600,000	19,200,000.00	16,062,000.00	-
300221	银禧科技	2011-05-18	2011-08-25	新发流通受限	18.00	15.92	710,000	12,780,000.00	11,303,200.00	-
300223	北京君正	2011-05-25	2011-08-31	新发流通受限	43.80	40.86	250,000	10,950,000.00	10,215,000.00	-
601798	蓝科高新	2011-06-14	2011-09-22	新发流通受限	11.00	13.27	264,845	2,913,295.00	3,514,493.15	-

6.4.12.2 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
600315	上海家化	2010-12-06	控股股东筹划 国资改革事宜	36.88	-	-	3,243,855	97,121,176.94	119,633,372.40	-
000876	新希望	2011-06-29	证监会 并购重组 委审核公司 重大资产 重组事宜	19.95	2011-07-05	21.95	3,810,277	72,411,261.17	76,015,026.15	-
600369	西南证券	2011-03-01	筹划重大 重组事项	11.87	2011-08-16	12.49	6,355,498	93,800,284.09	75,439,761.26	-
000716	*ST 南方	2011-06-27	筹划重大 资产重组 事项	9.57	-	-	3,181,998	34,875,390.36	30,451,720.86	-
000759	中百集团	2011-04-14	大股东 筹划公司 重大资产 重组事项	12.32	-	-	2,300,287	19,020,367.12	28,339,535.84	-
600098	广州控股	2011-06-20	控股股东 筹划涉及 公司的重 大事项	6.79	2011-07-08	7.47	2,999,987	25,703,385.94	20,369,911.73	-
600133	东湖高新	2011-05-03	股东筹 划公司 重大资产 重组 事项	8.79	-	-	1,399,822	9,510,774.00	12,304,435.38	-
002296	辉煌科技	2011-06-28	筹划重大 资产重组 事项	26.00	-	-	27,700	239,625.00	720,200.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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、监察稽核部、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、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内。

6.4.13.2 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, 以控制可能的信用风险。

6.4.13.3 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“6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,021,502,330.27	-	-	1,021,502,330.27
结算备付金	11,985,765.26	-	-	11,985,765.26
权证保证金	140,741.00	-	-	140,741.00
债券投资	1,804,164,149.68	20,789,895.00	98,930,000.00	1,923,884,044.68
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	299,880,349.94	-	-	299,880,349.94
应收直销申购款	99,099.56	-	-	99,099.56
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,963,399,206.15	-	-	1,963,399,206.15
结算备付金	44,189,108.85	-	-	44,189,108.85
权证保证金	140,741.00	-	-	140,741.00
债券投资	1,176,025,103.79	20,945,505.00	-	1,196,970,608.79
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	147,120.83	-	-	147,120.83
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。

6.4.13.4.1.2 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债券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 (2011 年 6 月 30 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)

	利率下降25个基点	8,626,743.47	4,015,069.58
	利率上升25个基点	-8,507,570.03	-3,972,315.29

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	17,939,180,881.35	86.34	18,496,846,728.79	85.90
衍生金融资产-权证投资	966,318.66	0.00	1,006,880.18	0.00
合计	17,940,147,200.01	86.35	18,497,853,608.97	85.91

6.4.13.4.3.2 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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	+5%	866,462,436.57	815,618,456.51
	-5%	-866,462,436.57	-815,618,456.51

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	17,939,180,881.35	84.31
	其中：股票	17,939,180,881.35	84.31
2	固定收益投资	1,923,884,044.68	9.04
	其中：债券	1,923,884,044.68	9.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	966,318.66	0.00
4	买入返售金融资产	299,880,349.94	1.41
	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	1,033,488,095.53	4.86
6	其他各项资产	81,084,769.92	0.38
7	合计	21,278,484,460.08	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	373,111,755.64	1.80
B	采掘业	765,969,750.70	3.69
C	制造业	8,268,845,854.93	39.80
C0	食品、饮料	1,490,727,718.50	7.17
C1	纺织、服装、皮毛	101,264,351.08	0.49
C2	木材、家具	12,425,000.00	0.06
C3	造纸、印刷	17,018,726.64	0.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	972,502,879.17	4.68
C5	电子	418,884,662.27	2.02
C6	金属、非金属	1,267,940,209.12	6.10
C7	机械、设备、仪表	2,817,936,295.15	13.56
C8	医药、生物制品	1,064,157,729.65	5.12
C99	其他制造业	105,988,283.35	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	703,522,399.61	3.39
E	建筑业	293,706,474.31	1.41
F	交通运输、仓储业	660,247,525.50	3.18
G	信息技术业	1,183,780,581.67	5.70
H	批发和零售贸易	1,050,912,897.97	5.06
I	金融、保险业	1,884,131,978.51	9.07
J	房地产业	1,999,607,263.92	9.62
K	社会服务业	137,513,826.99	0.66
L	传播与文化产业	297,796,961.10	1.43
M	综合类	320,033,610.50	1.54
	合计	17,939,180,881.35	86.34

7.3 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	600519	贵州茅台	2,549,862	542,177,157.06	2.61
2	600582	天地科技	20,947,339	463,774,085.46	2.23

3	000527	美的电器	23,527,260	432,666,311.40	2.08
4	600256	广汇股份	16,601,732	394,789,186.96	1.90
5	600585	海螺水泥	13,064,939	362,682,706.64	1.75
6	000401	冀东水泥	14,309,865	357,603,526.35	1.72
7	600036	招商银行	26,710,918	347,776,152.36	1.67
8	601318	中国平安	7,009,818	338,363,914.86	1.63
9	600887	伊利股份	19,111,190	318,201,313.50	1.53
10	600050	中国联通	53,942,632	283,198,818.00	1.36
11	600271	航天信息	10,923,100	282,252,904.00	1.36
12	600251	冠农股份	8,001,391	265,326,125.56	1.28
13	000895	双汇发展	3,846,569	254,142,813.83	1.22
14	002167	东方锆业	6,465,866	237,450,221.54	1.14
15	600376	首开股份	17,962,890	237,289,776.90	1.14
16	000651	格力电器	9,999,990	234,999,765.00	1.13
17	600048	保利地产	20,812,921	228,734,001.79	1.10
18	601601	中国太保	9,999,983	223,899,619.37	1.08
19	600016	民生银行	36,658,862	210,055,279.26	1.01
20	600739	辽宁成大	7,519,786	209,050,050.80	1.01
21	601333	广深铁路	49,999,952	205,499,802.72	0.99
22	600694	大商股份	5,311,977	203,076,880.71	0.98
23	000581	威孚高科	5,205,062	200,655,140.10	0.97
24	601398	工商银行	44,237,554	197,299,490.84	0.95
25	600000	浦发银行	19,824,786	195,075,894.24	0.94
26	600060	海信电器	14,380,713	192,989,168.46	0.93
27	601006	大秦铁路	22,517,549	184,418,726.31	0.89
28	000002	万科 A	21,509,957	181,759,136.65	0.87
29	600316	洪都航空	5,009,941	161,470,398.43	0.78
30	002146	荣盛发展	15,599,877	152,878,794.60	0.74
31	000915	山大华特	8,649,886	152,670,487.90	0.73
32	000629	攀钢钒钛	11,999,889	132,838,771.23	0.64
33	000926	福星股份	10,999,909	131,668,910.73	0.63
34	002219	独一味	7,541,325	131,445,294.75	0.63
35	002013	中航精机	6,222,394	129,425,795.20	0.62
36	000659	珠海中富	12,080,596	127,571,093.76	0.61
37	000968	煤气化	5,000,000	126,650,000.00	0.61
38	600019	宝钢股份	20,009,994	120,660,263.82	0.58
39	601088	中国神华	3,999,972	120,559,156.08	0.58
40	600315	上海家化	3,243,855	119,633,372.40	0.58
41	601699	潞安环能	3,500,000	114,835,000.00	0.55
42	002238	天威视讯	6,339,737	113,544,689.67	0.55
43	600510	黑牡丹	10,712,836	104,771,536.08	0.50
44	600823	世茂股份	6,999,988	102,409,824.44	0.49
45	600578	京能热电	10,408,622	101,067,719.62	0.49
46	600395	盘江股份	2,999,924	99,567,477.56	0.48
47	600875	东方电气	3,817,886	97,356,093.00	0.47
48	600056	中国医药	3,701,610	95,353,473.60	0.46
49	600546	山煤国际	3,000,000	93,570,000.00	0.45
50	600266	北京城建	6,167,240	92,816,962.00	0.45
51	601328	交通银行	16,746,490	92,775,554.60	0.45

52	600881	亚泰集团	11,099,914	92,462,283.62	0.45
53	000537	广宇发展	11,499,977	89,124,821.75	0.43
54	601618	中国中冶	22,147,062	87,259,424.28	0.42
55	000400	许继电气	2,799,959	86,266,736.79	0.42
56	600750	江中药业	3,506,479	85,838,605.92	0.41
57	601009	南京银行	9,219,329	82,697,381.13	0.40
58	600831	广电网络	7,618,864	81,369,467.52	0.39
59	002016	世荣兆业	9,999,978	81,199,821.36	0.39
60	600583	海油工程	12,204,013	78,349,763.46	0.38
61	000705	浙江震元	5,819,899	77,288,258.72	0.37
62	000876	新希望	3,810,277	76,015,026.15	0.37
63	600369	西南证券	6,355,498	75,439,761.26	0.36
64	000623	吉林敖东	2,400,000	73,944,000.00	0.36
65	600079	人福医药	3,299,998	72,797,955.88	0.35
66	002153	石基信息	2,083,581	72,716,976.90	0.35
67	600406	国电南瑞	2,000,000	72,600,000.00	0.35
68	601899	紫金矿业	9,999,937	72,399,543.88	0.35
69	600267	海正药业	1,826,371	68,196,693.14	0.33
70	002244	滨江集团	5,499,856	67,648,228.80	0.33
71	002008	大族激光	5,300,385	66,148,804.80	0.32
72	600559	老白干酒	2,303,164	65,018,319.72	0.31
73	600239	云南城投	5,041,132	64,828,957.52	0.31
74	600107	美尔雅	4,199,950	62,663,254.00	0.30
75	600125	铁龙物流	5,884,752	62,025,286.08	0.30
76	600674	川投能源	4,311,964	61,833,563.76	0.30
77	300006	莱美药业	1,440,871	61,784,548.48	0.30
78	600015	华夏银行	5,530,466	60,116,165.42	0.29
79	000063	中兴通讯	2,100,000	59,388,000.00	0.29
80	002089	新海宜	4,208,888	56,188,654.80	0.27
81	601668	中国建筑	13,900,000	56,017,000.00	0.27
82	000858	五粮液	1,561,445	55,774,815.40	0.27
83	002024	苏宁电器	4,343,881	55,645,115.61	0.27
84	000800	一汽轿车	3,915,597	55,444,853.52	0.27
85	600804	鹏博士	7,000,000	55,230,000.00	0.27
86	600067	冠城大通	5,909,303	54,956,517.90	0.26
87	000024	招商地产	2,999,981	54,899,652.30	0.26
88	600283	钱江水利	3,523,620	54,651,346.20	0.26
89	600461	洪城水业	5,194,219	54,435,415.12	0.26
90	600009	上海机场	4,236,753	54,230,438.40	0.26
91	600697	欧亚集团	1,922,115	53,434,797.00	0.26
92	002131	利欧股份	2,938,014	52,884,252.00	0.25
93	600428	中远航运	7,299,952	52,705,653.44	0.25
94	600795	国电电力	17,289,767	51,177,710.32	0.25
95	002023	海特高新	2,999,997	50,879,949.12	0.24
96	000818	*ST 化工	7,999,970	50,239,811.60	0.24
97	600277	亿利能源	3,499,943	50,119,183.76	0.24
98	000901	航天科技	2,999,940	49,949,001.00	0.24
99	000882	华联股份	7,150,000	49,764,000.00	0.24
100	601166	兴业银行	3,600,000	48,528,000.00	0.23

101	600537	海通集团	1,309,942	47,970,076.04	0.23
102	000157	中联重科	2,999,931	46,138,938.78	0.22
103	002122	天马股份	3,553,215	45,481,152.00	0.22
104	002459	天业通联	2,342,422	45,091,623.50	0.22
105	600690	青岛海尔	1,599,960	44,718,882.00	0.22
106	600236	桂冠电力	7,999,776	44,238,761.28	0.21
107	600486	扬农化工	1,999,975	43,479,456.50	0.21
108	600518	康美药业	3,299,969	43,427,592.04	0.21
109	000650	仁和药业	2,999,910	42,688,719.30	0.21
110	600269	赣粤高速	9,044,341	42,598,846.11	0.21
111	000423	东阿阿胶	1,016,079	41,923,419.54	0.20
112	002138	顺络电子	2,038,902	41,736,323.94	0.20
113	000786	北新建材	2,618,185	41,655,323.35	0.20
114	600005	武钢股份	10,000,000	41,500,000.00	0.20
115	600811	东方集团	6,000,000	41,280,000.00	0.20
116	002275	桂林三金	2,570,293	40,996,173.35	0.20
117	300182	捷成股份	1,165,658	40,693,120.78	0.20
118	002309	中利科技	1,557,962	38,871,151.90	0.19
119	600642	申能股份	7,499,949	38,024,741.43	0.18
120	000969	安泰科技	1,906,615	37,236,190.95	0.18
121	600261	阳光照明	1,949,910	36,521,814.30	0.18
122	000709	河北钢铁	7,999,912	36,159,602.24	0.17
123	600176	中国玻纤	1,169,000	35,327,180.00	0.17
124	002458	益生股份	1,554,817	34,983,382.50	0.17
125	002157	正邦科技	3,199,997	34,879,967.30	0.17
126	000697	*ST 偏转	2,148,809	34,058,622.65	0.16
127	600812	华北制药	2,687,927	30,964,919.04	0.15
128	601992	金隅股份	1,999,977	30,959,643.96	0.15
129	600446	金证股份	2,480,464	30,509,707.20	0.15
130	000987	广州友谊	1,453,422	30,507,327.78	0.15
131	000716	*ST 南方	3,181,998	30,451,720.86	0.15
132	000729	燕京啤酒	1,789,990	30,376,130.30	0.15
133	000690	宝新能源	6,040,956	30,325,599.12	0.15
134	600188	兖州煤业	849,950	30,003,235.00	0.14
135	600859	王府井	750,553	29,999,603.41	0.14
136	002165	红宝丽	1,999,948	29,679,228.32	0.14
137	002185	华天科技	2,720,179	29,595,547.52	0.14
138	000811	烟台冰轮	2,342,666	29,377,031.64	0.14
139	600830	香溢融通	3,000,000	29,160,000.00	0.14
140	000559	万向钱潮	3,572,400	28,722,096.00	0.14
141	000069	华侨城 A	3,609,093	28,547,925.63	0.14
142	600649	城投控股	3,499,891	28,419,114.92	0.14
143	000759	中百集团	2,300,287	28,339,535.84	0.14
144	000906	南方建材	2,999,933	28,289,368.19	0.14
145	002030	达安基因	2,759,946	28,206,648.12	0.14
146	600309	烟台万华	1,494,953	27,970,570.63	0.13
147	600880	博瑞传播	1,972,881	27,699,249.24	0.13
148	000888	峨眉山 A	1,500,000	27,300,000.00	0.13
149	600386	北巴传媒	3,094,746	27,295,659.72	0.13

150	002007	华兰生物	801,476	27,202,095.44	0.13
151	300027	华谊兄弟	1,879,630	27,066,672.00	0.13
152	002092	中泰化学	1,999,993	26,239,908.16	0.13
153	002215	诺普信	1,599,954	25,519,266.30	0.12
154	600667	太极实业	3,003,055	25,405,845.30	0.12
155	002123	荣信股份	1,106,470	25,205,386.60	0.12
156	600723	西单商场	2,000,000	25,100,000.00	0.12
157	300074	华平股份	900,000	25,056,000.00	0.12
158	600983	合肥三洋	2,099,842	25,051,115.06	0.12
159	600062	双鹤药业	1,009,975	25,037,280.25	0.12
160	000540	中天城投	1,500,000	24,990,000.00	0.12
161	600522	中天科技	1,054,340	24,924,597.60	0.12
162	601158	重庆水务	3,000,000	24,780,000.00	0.12
163	601369	陕鼓动力	2,249,966	24,682,127.02	0.12
164	600785	新华百货	905,549	24,160,047.32	0.12
165	600331	宏达股份	1,799,931	23,957,081.61	0.12
166	002048	宁波华翔	2,000,000	23,940,000.00	0.12
167	002050	三花股份	717,918	23,906,669.40	0.12
168	002551	尚荣医疗	822,422	23,619,959.84	0.11
169	600226	升华拜克	2,515,945	23,574,404.65	0.11
170	300228	富瑞特装	680,000	23,120,000.00	0.11
171	600340	ST 国祥	2,200,000	22,792,000.00	0.11
172	000875	吉电股份	5,000,000	22,550,000.00	0.11
173	600208	新潮中宝	3,590,301	22,367,575.23	0.11
174	600970	中材国际	817,289	22,336,508.37	0.11
175	000006	深振业 A	3,802,984	22,095,337.04	0.11
176	600135	乐凯胶片	1,404,965	21,987,702.25	0.11
177	300036	超图软件	1,271,947	21,813,891.05	0.10
178	600886	国投电力	2,999,901	21,749,282.25	0.10
179	600487	亨通光电	807,979	21,694,236.15	0.10
180	600249	两面针	2,999,910	21,659,350.20	0.10
181	600436	片仔癀	343,687	21,617,912.30	0.10
182	600420	现代制药	1,589,823	21,557,999.88	0.10
183	002285	世联地产	1,199,855	21,537,397.25	0.10
184	600223	鲁商置业	2,500,000	20,500,000.00	0.10
185	000600	建投能源	3,999,985	20,479,923.20	0.10
186	600780	通宝能源	3,000,000	20,400,000.00	0.10
187	600098	广州控股	2,999,987	20,369,911.73	0.10
188	600475	华光股份	1,068,500	20,290,815.00	0.10
189	600688	S 上石化	2,267,693	20,069,083.05	0.10
190	002039	黔源电力	999,993	19,979,860.14	0.10
191	300145	南方泵业	1,070,266	19,810,623.66	0.10
192	600528	中铁二局	2,276,151	19,779,752.19	0.10
193	600736	苏州高新	3,095,687	19,502,828.10	0.09
194	000837	秦川发展	1,449,912	19,385,323.44	0.09
195	002181	粤传媒	1,799,835	19,384,222.95	0.09
196	002477	雏鹰农牧	600,000	19,188,000.00	0.09
197	300167	迪威视讯	818,441	19,184,257.04	0.09
198	600131	岷江水电	2,000,000	19,120,000.00	0.09

199	000601	韶能股份	4,000,000	19,120,000.00	0.09
200	002053	云南盐化	1,499,987	19,109,834.38	0.09
201	300178	腾邦国际	940,000	18,800,000.00	0.09
202	300166	东方国信	429,349	18,784,018.75	0.09
203	000027	深圳能源	2,462,500	18,567,250.00	0.09
204	600894	广钢股份	2,171,469	18,500,915.88	0.09
205	000788	西南合成	1,853,181	18,457,682.76	0.09
206	600676	交运股份	2,851,380	18,334,373.40	0.09
207	600054	黄山旅游	1,101,030	18,299,118.60	0.09
208	002042	华孚色纺	737,484	18,038,858.64	0.09
209	600713	南京医药	1,356,605	18,029,280.45	0.09
210	000937	冀中能源	699,944	17,743,580.40	0.09
211	300050	世纪鼎利	755,500	17,724,030.00	0.09
212	000608	阳光股份	3,219,715	17,579,643.90	0.08
213	600729	重庆百货	404,215	17,470,172.30	0.08
214	600185	格力地产	2,000,000	17,380,000.00	0.08
215	000514	渝开发	2,199,924	17,159,407.20	0.08
216	600963	岳阳林纸	1,988,169	17,018,726.64	0.08
217	600100	同方股份	1,610,656	16,847,461.76	0.08
218	600010	包钢股份	2,000,000	16,700,000.00	0.08
219	600027	华电国际	4,999,920	16,599,734.40	0.08
220	600439	瑞贝卡	1,499,919	16,589,104.14	0.08
221	000021	长城开发	2,000,988	16,568,180.64	0.08
222	000531	穗恒运 A	1,499,916	16,559,072.64	0.08
223	000598	兴蓉投资	894,298	16,186,793.80	0.08
224	002574	明牌珠宝	600,000	16,062,000.00	0.08
225	600408	安泰集团	2,199,957	16,059,686.10	0.08
226	600322	天房发展	3,000,000	15,930,000.00	0.08
227	000822	山东海化	1,499,957	15,899,544.20	0.08
228	000778	新兴铸管	1,499,924	15,824,198.20	0.08
229	002415	海康威视	399,933	15,713,367.57	0.08
230	600832	东方明珠	1,999,966	15,499,736.50	0.07
231	600452	涪陵电力	1,199,980	15,095,748.40	0.07
232	600962	国投中鲁	847,992	14,848,339.92	0.07
233	000538	云南白药	259,650	14,820,822.00	0.07
234	600742	一汽富维	499,959	14,638,799.52	0.07
235	002299	圣农发展	899,868	14,586,860.28	0.07
236	600481	双良节能	999,912	14,458,727.52	0.07
237	000723	美锦能源	883,949	14,337,652.78	0.07
238	300072	三聚环保	1,032,904	14,078,481.52	0.07
239	002073	软控股份	679,951	14,006,990.60	0.07
240	600064	南京高科	999,996	13,849,944.60	0.07
241	601989	中国重工	999,948	13,789,282.92	0.07
242	600120	浙江东方	1,599,910	13,775,225.10	0.07
243	002133	广宇集团	2,383,254	13,370,054.94	0.06
244	600354	敦煌种业	540,539	13,199,962.38	0.06
245	600153	建发股份	1,445,215	12,862,413.50	0.06
246	002104	恒宝股份	1,000,000	12,550,000.00	0.06
247	002242	九阳股份	1,000,366	12,504,575.00	0.06

248	002240	威华股份	1,750,000	12,425,000.00	0.06
249	000543	皖能电力	1,511,800	12,396,760.00	0.06
250	600738	兰州民百	1,351,139	12,389,944.63	0.06
251	600133	东湖高新	1,399,822	12,304,435.38	0.06
252	600569	安阳钢铁	3,315,781	12,268,389.70	0.06
253	000665	武汉塑料	1,000,000	11,980,000.00	0.06
254	002282	博深工具	758,646	11,910,742.20	0.06
255	000036	华联控股	2,999,934	11,759,741.28	0.06
256	000039	中集集团	531,472	11,628,607.36	0.06
257	002006	精功科技	199,925	11,477,694.25	0.06
258	600280	南京中商	425,686	11,476,494.56	0.06
259	600862	南通科技	899,940	11,474,235.00	0.06
260	300221	银禧科技	710,000	11,303,200.00	0.05
261	600118	中国卫星	499,929	11,203,408.89	0.05
262	600557	康缘药业	790,697	11,077,664.97	0.05
263	600973	宝胜股份	699,999	11,059,984.20	0.05
264	002369	卓翼科技	599,986	10,997,743.38	0.05
265	002321	华英农业	599,950	10,979,085.00	0.05
266	002054	德美化工	969,668	10,908,765.00	0.05
267	601208	东材科技	499,909	10,803,033.49	0.05
268	002033	丽江旅游	534,564	10,766,118.96	0.05
269	002158	汉钟精机	478,518	10,623,099.60	0.05
270	000961	中南建设	999,932	10,539,283.28	0.05
271	002436	兴森科技	424,606	10,432,569.42	0.05
272	000801	四川九洲	892,350	10,226,331.00	0.05
273	300223	北京君正	250,000	10,215,000.00	0.05
274	000551	创元科技	699,989	10,156,840.39	0.05
275	000680	山推股份	576,586	10,142,147.74	0.05
276	601169	北京银行	1,009,861	10,068,314.17	0.05
277	002091	江苏国泰	529,421	9,984,880.06	0.05
278	600096	云天化	499,950	9,944,005.50	0.05
279	000523	广州浪奇	799,980	9,807,754.80	0.05
280	600861	北京城乡	999,938	9,769,394.26	0.05
281	002563	森马服饰	199,293	9,603,929.67	0.05
282	600748	上实发展	1,300,000	9,412,000.00	0.05
283	600231	凌钢股份	999,931	9,119,370.72	0.04
284	000568	泸州老窖	201,566	9,094,657.92	0.04
285	300113	顺网科技	383,460	8,965,294.80	0.04
286	600480	凌云股份	600,000	8,190,000.00	0.04
287	600877	中国嘉陵	999,905	8,119,228.60	0.04
288	002391	长青股份	437,597	8,003,649.13	0.04
289	600826	兰生股份	750,000	7,770,000.00	0.04
290	601866	中海集运	2,111,263	7,684,997.32	0.04
291	002025	航天电器	599,989	7,337,865.47	0.04
292	002396	星网锐捷	515,116	7,314,647.20	0.04
293	300021	大禹节水	697,733	7,291,309.85	0.04
294	300195	长荣股份	165,294	6,707,630.52	0.03
295	002549	凯美特气	225,000	6,570,000.00	0.03
296	002074	东源电器	600,000	6,276,000.00	0.03

297	300171	东 富 龙	149,970	6,133,773.00	0.03
298	300159	新研股份	177,432	5,654,757.84	0.03
299	601808	中海油服	310,928	5,553,174.08	0.03
300	002028	思源电气	388,093	5,312,993.17	0.03
301	600352	浙江龙盛	552,472	5,292,681.76	0.03
302	000619	海螺型材	499,917	4,819,199.88	0.02
303	600825	新华传媒	691,913	4,753,442.31	0.02
304	002405	四维图新	149,976	4,671,752.40	0.02
305	300041	回天胶业	123,086	4,113,534.12	0.02
306	300205	天喻信息	129,906	4,066,057.80	0.02
307	000639	西王食品	127,700	3,977,855.00	0.02
308	002144	宏达高科	285,837	3,973,134.30	0.02
309	002532	新界泵业	199,962	3,903,258.24	0.02
310	600246	万通地产	762,459	3,812,295.00	0.02
311	002060	粤 水 电	299,928	3,803,087.04	0.02
312	600348	国阳新能	150,000	3,621,000.00	0.02
313	002304	洋河股份	28,044	3,538,031.04	0.02
314	601798	蓝科高新	264,845	3,514,493.15	0.02
315	000042	深 长 城	192,198	3,499,925.58	0.02
316	300075	数字政通	132,400	3,025,340.00	0.01
317	002483	润邦股份	200,000	2,840,000.00	0.01
318	600196	复星医药	249,851	2,718,378.88	0.01
319	000410	沈阳机床	243,100	2,664,376.00	0.01
320	600195	中牧股份	116,275	2,645,256.25	0.01
321	300173	松德股份	200,000	2,578,000.00	0.01
322	002407	多 氟 多	48,229	2,483,793.50	0.01
323	300126	锐奇股份	171,294	2,389,551.30	0.01
324	300011	鼎汉技术	83,500	2,185,195.00	0.01
325	002522	浙江众成	100,000	2,095,000.00	0.01
326	000001	深发展 A	119,300	2,036,451.00	0.01
327	300111	向 日 葵	100,000	2,025,000.00	0.01
328	002206	海 利 得	150,000	1,987,500.00	0.01
329	600470	六国化工	196,150	1,961,500.00	0.01
330	300029	天龙光电	80,000	1,824,800.00	0.01
331	002419	天虹商场	79,956	1,723,851.36	0.01
332	601857	中国石油	151,100	1,645,479.00	0.01
333	601126	四方股份	88,502	1,622,241.66	0.01
334	600252	中恒集团	79,476	1,479,048.36	0.01
335	600373	中文传媒	100,000	1,437,000.00	0.01
336	600299	*ST 新材	111,581	1,419,310.32	0.01
337	000666	经纬纺机	100,000	1,382,000.00	0.01
338	600160	巨化股份	39,925	1,295,965.50	0.01
339	600971	恒源煤电	29,959	1,209,145.24	0.01
340	000090	深 天 健	99,953	1,154,457.15	0.01
341	300138	晨光生物	37,700	1,054,846.00	0.01
342	300088	长信科技	50,000	1,009,000.00	0.00
343	600410	华胜天成	62,769	939,024.24	0.00
344	002296	辉煌科技	27,700	720,200.00	0.00
345	000100	TCL 集团	200,000	598,000.00	0.00

346	002233	塔牌集团	41,922	554,628.06	0.00
347	002315	焦点科技	10,441	506,075.27	0.00
348	600991	广汽长丰	23,064	362,104.80	0.00
349	002204	华锐铸钢	11,200	357,280.00	0.00
350	002192	路翔股份	15,700	353,878.00	0.00
351	600320	振华重工	48,600	323,190.00	0.00
352	600770	综艺股份	16,200	306,504.00	0.00
353	600508	上海能源	10,800	263,196.00	0.00
354	600026	中海发展	24,150	203,826.00	0.00
355	000061	农产品	10,319	164,691.24	0.00
356	600611	大众交通	23,900	163,954.00	0.00
357	600007	中国国贸	7,700	69,916.00	0.00
358	000725	京东方 A	15,000	40,950.00	0.00
359	000868	安凯客车	570	5,996.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000527	美的电器	395,063,270.12	1.83
2	600036	招商银行	320,117,428.24	1.49
3	002167	东方锆业	273,801,222.28	1.27
4	600362	江西铜业	272,567,039.20	1.27
5	600519	贵州茅台	252,724,651.09	1.17
6	600739	辽宁成大	236,232,881.63	1.10
7	600376	首开股份	233,542,247.79	1.08
8	601601	中国太保	233,192,084.61	1.08
9	600048	保利地产	221,049,714.10	1.03
10	601318	中国平安	210,553,397.32	0.98
11	600060	海信电器	205,793,670.92	0.96
12	601333	广深铁路	205,388,531.34	0.95
13	000651	格力电器	194,639,194.65	0.90
14	600146	大元股份	167,643,288.48	0.78
15	002146	荣盛发展	161,966,402.50	0.75
16	600000	浦发银行	159,804,659.11	0.74
17	601699	潞安环能	158,765,968.16	0.74
18	600016	民生银行	156,799,963.85	0.73
19	000002	万科 A	155,881,255.36	0.72
20	000401	冀东水泥	153,136,519.05	0.71

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。

7.4.2 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	600068	葛洲坝	699,444,588.54	3.25
2	000063	中兴通讯	409,994,737.74	1.90

3	000629	攀钢钒钛	294,702,859.28	1.37
4	600362	江西铜业	276,519,190.07	1.28
5	600271	航天信息	259,209,428.03	1.20
6	601808	中海油服	243,999,846.99	1.13
7	600519	贵州茅台	236,391,349.63	1.10
8	600028	中国石化	232,393,700.70	1.08
9	600499	科达机电	229,627,388.19	1.07
10	600100	同方股份	220,118,660.84	1.02
11	600873	梅花集团	213,189,702.64	0.99
12	000903	云内动力	212,425,869.92	0.99
13	600887	伊利股份	181,710,076.97	0.84
14	600415	小商品城	158,541,532.55	0.74
15	000801	四川九洲	155,985,111.52	0.72
16	600360	华微电子	154,382,486.92	0.72
17	600487	亨通光电	153,626,502.27	0.71
18	600583	海油工程	152,317,243.79	0.71
19	600283	钱江水利	150,314,996.50	0.70
20	601888	中国国旅	140,870,411.07	0.65

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。

7.4.3 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	14,326,936,766.61
卖出股票收入（成交）总额	14,114,579,128.99

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。

7.5 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	865,678,968.60	4.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	688,147,000.00	3.31
-	其中：政策性金融债	688,147,000.00	3.31
4	企业债券	20,789,895.00	0.10
5	企业短期融资券	150,225,000.00	0.72
6	中期票据	-	-
7	可转债	199,043,181.08	0.96
8	其他	-	-
9	合计	1,923,884,044.68	9.26

7.6 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	010110	21 国债(00)	3,430,960	342,478,427.20	1.65
2	019021	10 国债 21	3,000,000	299,760,000.00	1.44
3	110230	11 国开 30	2,800,000	276,948,000.00	1.33
4	070419	07 农发 19	2,000,000	202,300,000.00	0.97
5	113002	工行转债	1,510,400	178,937,088.00	0.86

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	580027	长虹 CWB1	397,662	966,318.66	0.00

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	13,090,429.71
2	应收证券清算款	20,072,280.48
3	应收股利	15,912,087.68
4	应收利息	29,305,664.69
5	应收申购款	2,704,307.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,084,769.92

7.9.4 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	113002	工行转债	178,937,088.00	0.86
2	110007	博汇转债	7,135,732.50	0.03
3	125709	唐钢转债	984,189.69	0.00
4	126729	燕京转债	919,418.14	0.00
5	110011	歌华转债	439,642.80	0.00

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,092,609	10,174.12	484,652,684.07	4.36%	10,631,684,343.61	95.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,489,190.43	0.01%

§9 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	11,042,962,218.67
本报告期基金总申购份额	1,126,401,844.80
减：本报告期基金总赎回份额	1,053,027,035.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,116,337,027.68

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2011年2月9日，本基金托管人发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。2011年1月31日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

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到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
瑞银证券	1	7,174,975,520.39	25.40%	6,098,707.66	25.85%	-
中信证券	1	3,737,006,096.64	13.23%	3,036,344.69	12.87%	-
国金证券	1	3,657,417,406.57	12.95%	3,108,770.17	13.18%	-
长江证券	1	2,791,624,055.33	9.88%	2,268,216.49	9.61%	-
齐鲁证券	2	1,771,853,065.26	6.27%	1,506,070.25	6.38%	-
兴业证券	1	1,750,507,778.76	6.20%	1,422,301.42	6.03%	-
国泰君安证券	1	1,521,919,992.41	5.39%	1,236,572.94	5.24%	-
国信证券	1	1,354,630,213.04	4.80%	1,100,645.10	4.67%	-
海通证券	1	1,143,619,278.59	4.05%	972,064.49	4.12%	-
高华证券	1	1,018,257,101.76	3.60%	865,511.67	3.67%	-
东北证券	1	850,723,425.50	3.01%	723,103.72	3.06%	-
平安证券	1	564,232,046.71	2.00%	479,595.63	2.03%	-
华泰联合证券	1	554,825,893.30	1.96%	471,599.91	2.00%	-
中投证券	1	240,847,936.00	0.85%	204,718.45	0.87%	-
光大证券	1	99,928,495.03	0.35%	84,938.39	0.36%	-
中原证券	1	16,579,871.69	0.06%	13,471.21	0.06%	-

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，本基金还选择了广州证券、国联证券、华泰证券、湘财证券、招商证券、中国银河证券、中信建投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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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
瑞银证券	201,509,988.40	34.97%	140,000,000.00	9.52%
国金证券	2,117,781.50	0.37%	390,000,000.00	26.53%
长江证券	465,782.61	0.08%	-	-
兴业证券	1,733,141.20	0.30%	-	-
海通证券	4,645,929.00	0.81%	-	-
高华证券	203,333,427.70	35.29%	440,000,000.00	29.93%
东北证券	-	-	500,000,000.00	34.01%
平安证券	162,411,169.50	28.19%	-	-

10.8 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设立杭州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-01-05
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-01-15
3	华夏基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-01-20
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信证券股份有限公司办理定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-11
5	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	2011-03-19
6	华夏基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-31
7	华夏基金管理有限公司关于在中国农业银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-07
8	华夏基金管理有限公司关于调整基金分红方式变更规则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-25
9	华夏基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费率公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-05-13
10	关于停止中行广东省分行长城借记卡基金网上交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-05-28
11	华夏基金管理有限公司关于运用自有资金进行基金投资的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-04

12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-23
----	---	--------------	------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 11.1.2 《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏红利混合型证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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
二〇一一年八月二十四日