

# 华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F) 2009年半年度报告摘要

2009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:中国银行股份有限公司  
送出日期:二〇〇九年八月二十九日

**81 重要提示**  
基金管理人及基金托管人承诺:本报告所载资料均经过认真核实,误导性陈述或重大遗漏,并对内容的真实性、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。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月20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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,或保证基金份额持有人的收益不受损失。  
基金的投资业绩并不预示其未来业绩表现,投资有风险,投资者应仔细阅读本报告并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。  
本报告自2009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,应读半年度报告正文。

**82 基金简介**  
基金名称:华夏行业股票(L0F)  
交易代码:160314  
基金运作方式:契约型上市开放式  
基金合同生效日:2007年11月22日  
报告期末基金份额总额:13,629,751,087.13份  
基金合同存续期:不定期  
基金上市证券交易所:深圳证券交易所  
报告期末:2009年1月31日

**83 主要财务数据和财务指标**  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	12.90%	1.06%	11.62%	0.98%	1.28%
过去三个月	22.38%	1.20%	20.74%	1.24%	1.64%
过去六个月	55.97%	1.58%	56.52%	1.57%	-0.55%
过去一年	21.36%	1.73%	13.59%	2.06%	7.77%
基金转型以来至今	-13.35%	1.75%	-27.52%	2.18%	14.17%

3.2.2 自基金转型以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比  
华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
报告期末:2009年6月30日

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

3.1 主要会计数据和财务指标  
3.1.1 本期主要财务指标  
本期已实现收益: -934,041,444.92  
本期基金份额净值增长率: 3,897,367,625.17  
加权平均基金份额本期利润: 0.5075  
本期基金份额净值增长率: 3.89736762517  
3.1.2 期末数据和指标  
报告期末基金份额总额: 13,629,751,087.13  
报告期末基金份额净值: 1.1924,261,298.84  
报告期末基金份额净值增长率: 0.875

注:①上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本报告所称期末基金份额净值增长率,是指报告期内基金份额净值增长率扣除同期基金份额净值增长率后的净值增长率,本期利润为本期利润减去本期基金份额净值变动。  
3.2 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

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

报告截止日:2009年6月30日  
单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
银行存款		785,964,858.50	503,281,997.85
结算备付金		8,712,295.45	3,525,883.43
存出保证金		3,760,546.07	1,638,549.12
交易性金融资产		11,226,249,198.39	6,016,581,999.87
应收款项		10,750,248,238.39	4,542,131,654.07
预收款项		-	-
资产支持证券		476,000,960.00	1,474,450,345.80
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		12,878,523.21	11,432,484.69
应收股利		7,512,306.62	-
应收申购款		37,656,614.55	-
其他应收款		-	-
其他资产		675.78	675.78
资产总计		12,082,735,018.57	6,536,461,590.74

负债和所有者权益  
附注号  
本期末  
2009年6月30日  
上年度末  
2008年12月31日

负债	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
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		90,099,803.58	52,587,375.14
应付股利		17,835,375.32	2,507,854.12
应付管理人报酬		13,431,758.93	8,505,877.15
应付托管费		2,238,626.50	1,417,646.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		32,683,586.24	18,430,817.16
应交税费		188,495.40	333,262.61
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,996,073.76	1,779,567.17
负债合计		158,473,719.73	85,562,399.55
所有者权益		-	-
实收基金		3,738,141,556.82	3,152,356,123.43
未分配利润		8,186,119,742.02	3,298,545,067.76
所有者权益合计		11,924,261,298.84	6,450,891,191.19
负债和所有者权益总计		12,082,735,018.57	6,536,461,590.74

注:①本报告期末基金份额净值0.875元,基金份额总额13,629,751,087.13份。  
6.2 利润分配  
会计主体:华夏行业精选股票型证券投资基金(L0F)  
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

项目	附注号	2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
一、收入		4,004,677,093.31	-3,652,170,989.82
1.利息收入		13,815,572.91	61,696,760.43
其中:存款利息收入		3,408,382.51	12,772,283.52
债券利息收入		10,407,190.40	48,499,187.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	425,289.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-842,801,156.22	-893,879,289.75
其中:股权投资收益		-953,604,917.59	-941,070,369.33
基金投资收益		33,228,947.44	4,224,157.74
公允价值变动损益		-1,800.00	-6,750,629.39
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收入		77,574,813.93	41,282,190.52
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		4,831,409,070.09	-2,822,122,039.91
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		2,253,606.25	2,133,