基金管理人, 华夏基金管理有限公司

\$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 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,误导性除述或者

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。

金额宣传人不由众城天后历,现是公司场域的自体市场内部或员门,但不体业强或 是血河。 基金的过程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。 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 其会其未档次

2.1 453645451FIUU					
基金简称	华夏回报混合	华夏回报混合			
基金主代码	002001				
交易代码	002001	002001 002002			
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式			
基金合同生效日	2003年9月5日	2003年9月5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	中国银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	8,301,406,592.75 份	8,301,406,592.75 份			
基金合同存续期	不定期	不定期			

2.2 基金产品说明 E确判断市场走势,合理配置股票和债券等投资工具的比例,准确选择 投资价值的股票品种和债券品种进行投资,可以在尽量避免基金资 3失的前提下实现基金每年较高的绝对回报。 **殳资策略** 业绩比较基准 观险收益特征

2.3 基金管理人和基金托管 言息披露负责人 400-818-6666 tgxxpl@bank-of-chir

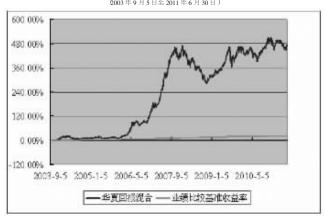
登载基金半年度报告正文的管理人互联 ww.ChinaAMC.com §3 主要财务指标和基金净值表现

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) 310,966,007.93 本期基金份额净值增长率 -2.35% 报告期末 2011 年 6 月 30 日 3.1.2 期末数据和指标 期末基金份额净值 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,计人费用后实际收益水平要低于所列

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

3.2.1 基金份额净值 绩比较基准 收益率③ 浄値 率① 阶段 1)-3 2-4 2.68% 0.81% -2.3590.82% 1.529 -3.87% 0.82% 14.449 0.879 11.73% 18.44% 26.389 7.949 0.00% 0.99% 474.349 1.12% 21.599 0.00% 452.75% 1.12% 3.2.2 自基金合同4

> 华夏回报证券投资基金 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 2003年9月5日至2011年6月30日)



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

2011年上半年,在市场资格的情况下,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10.1年夏天盘精选混合、半夏红利混合在43 只偏股型基金 般票上限 95% 户分别排名第 2 和第 7: 年夏策略混合在48 只灵活配置型基金 般票上限 80% 户排名第 13 里基金论坛 中, 华夏基金 经票上限 80% 户排名第 13 里基金论坛 中, 华夏基金 经累益税 经期间期间 其本金之规。2011年 3 月,在 但参时报》举办的 第七届中国基金处明里是颁奖仪式管中国明星基金论坛 中, 华夏基金 基础 美期间期间 其本金之规。2011年 4 日,在八卷河流港村上市边口票,全社全个规格股南过 化 医甘本金

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。

姓名	职务	任本基金的基	s金经理期限	证券从业年	说明
	87.95	任职日期	离任日期	限	100.97
胡建平	本基金的基金经理	2007-07-31	-	13年	硕士。曾任鹏华基金管理有限公司基金经理、研究员、浙江天堂硅谷创业投资公司投资经理、研究员,浙江天堂硅谷创业投资公司投资经理、研济正证券投资经理、研究员。2007年4月加入华夏基金管理有限公司。
张釗	本基金的基金经理	2011-02-22	-	7年	清华大学工学硕士。曾任中信 建投证券有限责任公司行业好 究员、泰达荷银基金管理公司 舰为泰达宏利基金管理公司 行业研究员。2007年9月加入 华夏基金管理有限公司,历 行业研究员 基金经理助理。

4.2 管理人对报告期外本基金运作灌溉于信情况的说明 本报告期内、本基金管理人严格遵守 证券投资基金法》、征券投资基金销售管理办法》、征券投资基金运作 管理功法》、基金管理人严格遵守 证券投资基金法》、征券投资基金销售管理办法》、征券投资基金运作 管理功法》、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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3 官理人对报告期内公平交易情论的专项识明 4.31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率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《专基金管理有限公司公平交易制度》的规定。 4.32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

性的下跌仍对组合业绩造成一定影响。

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报告期内基金投资销路和运行及100%的中国工业公司5059 4.4.1报告期内基金投资销路和运作分析于CPI持续超出预期,政府继续实施偏紧的宏观调控政策、实体经济资金面出现紧张状况、地方政府的投资能力受到约束。房地产等投资虽然保持了较高增速但是前景不明,投资者开始担忧企业的盈利前景。市场方面、A股市场呈现结构性震荡行情,低市盈率股票表现相对较好。 报告期内,本基金整体风格偏向低估值类股票,但是受累于年初较多的医药和食品行业配置,本轮市场系统

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至 2011 年 6 月 30 日,本基金份额争值为 1.327 元,本报告期份额净值增长率为-2.35%,同期业绩比较基

准增长率为 1.52%。
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,CPI将阶段性见顶,偏紧的宏观调控政策或将得到一定缓解,风险将主要来自商品房投资的逐 步下清。从中长期来看 较高的 CPI 数据与相对较低的经济增长率、同位现示者经济本身的潜在增长率已经下降。 我们对未来经济增长的预期也应有所降低;在劳动力不再无限投给,要素价格逐步市场化等包置素影响下,较高的 物价水平可能会持续较长时间,致黄基团是会有所交替比较多个最好的是一种的大学,以下, 未给投资者带来持续盈利,且体现为存量博弈,在利率逐步市场化的大背景下,其他投资品种对 A 股的替代作用

明显,虽然长期来看市场的自我恢复机制会吸引投资者回归,但是我们应探索更好的制度安排,以缩短市场自我

基于以上判断,我们认为,短期内市场可能会关注下半年周期性因素带来的反弹,而长期来看则将逐步聚焦 有长期投资价值的个股。本基金将坚持严格的选股策略,力争为投资者实现良好的收益。 转级会价额特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,申慎投资,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和基金合同关于估值的约定,对基金信则的定。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信息,对基金的符身的投资品种进行估值。本基金长管/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。假设多数的适当性发表申核意见并出具报告。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,且具有风定。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。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7 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

\$5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 本报告期内,中国经纪不明 3.1 报告到约·4年邀录工品 A.是807 16 间心产均 本报告期内,中国银行股份有限公司 以下称 本托管人" 在对华夏回报证券投资基金 以下称 本基金" 的 托管过程中,严格遵守 征券投资基金法]及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

1276月(A) 1276

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告 住:财务会计报告中的 金融工具风险及管 理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

华夏回报证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

§6 半年度财务会计报告 (朱经审计)

会计主体:华夏回报证券投资基金 报告截止日:2011年6月30日

			单位:人民币
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		582,256,613.63	965,683,908.82
结算备付金		6,791,948.90	8,737,907.42
存出保证金		4,843,374.80	2,438,532.69
交易性金融资产		10,358,944,708.76	10,732,915,463.04
其中:股票投资		7,786,097,369.46	7,945,440,337.84
基金投资		-	-
债券投资		2,572,847,339.30	2,787,475,125.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买人返售金融资产		-	_
应收证券清算款		72,369,009.19	35,239,056.22
应收利息		30,141,009.84	41,613,934.76
应收股利		52,311,944.23	-
应收申购款		2,410,482.73	7,165,339.82
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		11,110,069,092.08	11,793,794,142.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 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		-	7,345,231.28
应付赎回款		11,183,643.39	7,551,286.36
应付管理人报酬		13,227,089.70	15,151,225.72
应付托管费		2,204,514.97	2,525,204.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		66,149,164.55	57,000,326.67
应交税费		78,498.16	78,498.16
应付利息		-	_
应付利润		_	-
递延所得税负债		_	_
其他负债		1,715,504.35	1,633,068.85
负债合计		94,558,415.12	91,284,841.34
所有者权益:		, .,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	,11201101113
实收基金		8,301,406,592.75	8,263,059,331.64
未分配利润		2,714,104,084,21	3,439,449,969.79
所有者权益合计		11,015,510,676.96	11,702,509,301.43
负债和所有者权益总计		11,110,069,092.08	11,793,794,142.77
注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金	A tri sementi feli		

让日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.327 元,基金份额总额 8,301,406,592.75 份。

会计主体:华夏回报证券投资基金 本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

-142,418,411.43 -1,363,662,309.55 中:存款利息收 2,902,042.18 4,198,241.80 42,007,225.31 488,875.0 774,494,129.44 383,468,962.7 308,013,727.9 710,462,618.13 -8,606,525.9 2,620,200.27 84,061,760.7 61,411,311.04 -568,435,107.0 2,187,078,248.89 .汇兑收益 损失以 1,577,484.6 115,050,687.7 130,819,237.96 1.管理人报酬 13,985,193.2 16,104,443.27

16,942,303.66

212,031.7

-257,469,099.1

-257,469,099.13

17,874,716.44

213,418.53

1,494,481,547.5

1,494,481,547.5

单位, 人民币元

6.3 所有者权益 基金净值)变动表 本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

			十四・ノウグロハ		
√72 I-14	本期 2011年1月1日至2011年6月30日				
项目					
	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)	8,263,059,331.64	3,439,449,969.79	11,702,509,301.43		
二、本期经营活动产生的基金净值变动 数 (本期利润)	-	-257,469,099.13	-257,469,099.13		
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)	38,347,261.11	11,740,024.63	50,087,285.74		
其中:1.基金申购款	964,218,434.77	347,774,209.28	1,311,992,644.05		
2.基金赎回款	-925,871,173.66	-336,034,184.65	-1,261,905,358.31		
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (争值减少以""号填列)	-	-479,616,811.08	-479,616,811.08		
五、期末所有者权益 偡金净值)	8,301,406,592.75	2,714,104,084.21	11,015,510,676.96		
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 旣金净值)	10,229,029,292.73	4,123,486,092.39	14,352,515,385.12		
二、本期经营活动产生的基金净值变动 数 (本期利润)	-	-1,494,481,547.51	-1,494,481,547.51		
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 停值减少以""号填列)	-657,420,723.33	-244,212,597.90	-901,633,321.23		
其中:1.基金申购款	660,225,193.82	220,035,549.67	880,260,743.49		
2.基金赎回款	-1,317,645,917.15	-464,248,147.57	-1,781,894,064.72		
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)	9.571.608.569.40	2,384,791,946,98	11.956.400.516.38		

本报告61至64财务报表由下列负责人签署·

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 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

6.4.2 差错更正的说明

0.4.2 在第2年3月 4.4.3 关联方关系 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

基金发起人、基金管理人、基金注册登记机构、基金销售 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 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

0.4.4.1.1 (0.20)				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	
天联力名称	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
信证券	-	-	1,193,129,274.50	11.06%
《4410 拉证六里				

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。

				金额单位:人民币元	
ナルー ない	本 2011年1月1日至	期 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		
关联方名称	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	-	-	15,067,472.10	2.64%	
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。

				金额单位:人民币元	
		2011年1月1日	本期 至 2011 年 6 月 30 日		
关联方名称	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	-	-	-	-	
半 晔士力和	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	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	1,014,153.52	11.26%	1,014,153.52	2.03%	
注:上述佣金按市場		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	

內此券结算风险基金后的净额列示。 该类用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。 6.4.2 关联方报酬 6.4.4.2.1 基金管理费

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。

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

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。

			本期			
		2011年1月1	日至 2011 年 6 月	∃ 30 ⊟		
银行间市场交易 债券交易金额		基金逆回购		基金正回购		
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	97,904,557.53	-	-	-	-	
			度可比期间 日至 2010 年 6 月	∃ 30 ⊟		
银行间市场交易	债券交易金	2額	基金证	逆回购	基金正	E回购
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	478,485,573.70	-	-	-	-	

6.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

		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	-	14,374,804.74
期间申购买人总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	14,374,804.74
期末持有的基金份额占基金总份额比 例	-	0.15%

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

		Abri		单位:人民币
关联方名称	本 2011年1月1日至		上年度。 2010年 1 月 1 日至	
	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
中国银行	582,256,613.63	2,808,174.03	1,635,215,903.98	4,134,923.

2011年1月1日至2011年6月30日 证券代码 证券名称 关联方名称 证券名称 发行方式 总金额

6.4.5 期末 2011年6月30日 金额单位:人民币元 流通受限类 期末估值 单价 後流通受 限 2011- 新发流通受 8-25 限 银禧科 技 5-18 15.92 710,000 12,780,000.00 243,273 5,838,552.00

6.4.	6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票									
									金额单位:人员	引元
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 骰)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家 化	2010- 12-6	控股股东筹划 国资改革事宜	36.88	-	-	2,566,502	40,148,964.92	94,652,593.76	-
	6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券									

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

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

§7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

			金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	7,786,097,369.46	70.08
	其中:股票	7,786,097,369.46	70.08
2	固定收益投资	2,572,847,339.30	23.16
	其中:债券	2,572,847,339.30	23.16
	资产支持证券	_	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	589,048,562.53	5.3
6	其他各项资产	162,075,820.79	1.46
7	合计	11,110,069,092.08	100

全额单位, 人民币元

金额单位:人民币元

0.82

0.76

与基金资产净值比例 %) 公允价值 13,626,836.7 82,700,027.54 4,500,929,406,85 1,104,268,631.98 C1 5,907,036,88 造纸、印刷 4,623,862.7 石油、化学、塑胶、塑料 425,038,320.04 161,949,473.86 C6 金属、非金属 616,907,123.12 C8 医药、生物制品 655,160,337.82 5.95 电力、煤气及水的 76,100,748.02 153,529,966.6 交通运输、仓储: 117,746,977.6 464,643,524.3 4.22 99,107,526.84 1,791,312,171.2 250,724,837.0 186,892,891.99 48,782,454.65

	II N			7,780,097,309.40	/0.08
7.3 期 2	k按公允价值占	基金资产净值比例大	小排序的前十名股票	投资明细	
					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比 例 %)
1	601939	建设银行	165,946,565	819,776,031.10	7.44
2	600887	伊利股份	33,860,788	563,782,120.20	5.12
3	601398	工商银行	123,844,138	552,344,855.48	5.01
4	651	格力电器	14,182,576	333,290,536.00	3.03
5	63	中兴通讯	11,006,683	311,268,995.24	2.83
6	581	威孚高科	7,525,363	290,102,743.65	2.63
7	600585	海螺水泥	10,427,828	289,476,505.28	2.63
8	895	双汇发展	3,469,952	229,259,728.64	2.08
9	600267	海正药业	5,539,523	206,845,788.82	1.88
10	527	美的电器	10,628,749	195,462,694.11	1.77
注:投	资者欲了解本	设告期末基金投资的	的所有股票明细,应阅]读登载于本基金管理	人网站的半年度报告

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

527 197,501,648.5 176,523,756.2 浦发银行 423 145,865,053.9 601117 138,631,437.44 895 127,255,439.7 121,918,090 600256 广汇股份 120,551,462.10 600519 115,705,151.51 107,821,438.4 600251 105,543,231.2 13 600352 浙江龙盛 98,907,918.79 95,403,104.0 937 冀中能源 93,311,868.3 2415 海康威视 92,446,222.6 89,272,445.6 600318 巢东股份 81,126,757.90 18 20 73,348,536.24

注: 买人金额"按买人成交金额 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

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	194,584,410.72	1.6	
2	423	东阿阿胶	176,476,906.69	1.5	
3	600713	南京医药	121,357,614.10	1.0	
4	601166	兴业银行	120,494,526.71	1.0	
5	895	双汇发展	119,413,028.32	1.0	
6	600271	航天信息	109,372,079.25	0.9	
7	601888	中国国旅	107,132,742.38	0.9	
8	2008	大族激光	106,693,944.66	0.9	
9	600251	冠农股份	104,866,723.94	0	
10	600770	综艺股份	99,504,487.57	3.0	
11	937	冀中能源	97,580,362.01	0.0	
12	2011	盾安环境	92,854,340.71	0.7	
13	792	盐湖股份	87,107,463.60	0.7	
14	600036	招商银行	84,900,379.98	0.7	
15	600415	小商品城	84,215,722.99	0.7	
16	9	中国宝安	83,185,078.23	0.7	
17	973	佛塑科技	81,764,895.61	0	
18	600997	开滦股份	79,256,006.71	0.0	
19	2	万科A	78,805,068.23	0.0	
20	63	中兴通讯	78,078,302.86	0.0	

	单位:人民币元
买人股票成本 戗交)总额	5,686,036,544.81
卖出股票收入 戗交 总额	5,583,629,836.94
注: 买人股票成本"、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

金额单位:人民币元

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

			35 DA - DT - > Ch C 1 D > C
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	国家债券	319,604,850.30	2.9
2	央行票据	585,735,000.00	5.32
3	金融债券	1,418,874,500.00	12.88
-	其中:政策性金融债	1,418,874,500.00	12.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	248,632,989.00	2.26
8	其他	-	-
9	合计	2,572,847,339.30	23.36

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						
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	80413	08农发 13	4,300,000	430,000,000.00	3.9		
2	100236	10国开 36	3,000,000	300,480,000.00	2.73		
3	113002	工行转债	2,098,700	248,632,989.00	2.26		
4	1001080	10央行票据 80	2,500,000	244,125,000.00	2.22		
5	80222	08国开 22	2,000,000	198,640,000.00	1.8		

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

本基金本报告期末未持有权证。

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內受到公开谴责,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i
名称	金额
存出保证金	4,843,374.80
应收证券清算款	72,369,009.19
应收股利	52,311,944.23
应收利息	30,141,009.84
应收申购款	2,410,482.73
其他应收款	-
待摊费用	-
其他	-
合计	162,075,820.79
	存出保证金 应收证券清算款 应收段利 应收利息 应收申购款 其他应收款 特摊费用 其他

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 工行转债 113002 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说题

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 由于四舍五人的原因,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

		持有人结构				
持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者		个人投资者		
10 11/0/ 500 9 /)114 H H J M J M J M J M J M J M J M J M J M	持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例	
556,384	14,920.28	87,091,895.04	1.05%	8,214,314,697.71	98.95%	
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						

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 0.019

单位:份 基金合同生效日 2003 年 9 月 5 日)基金份额总额 3,796,885,823.40

964,218,434.7 925,871,173.66 太报告期基金拆分变动份额 本报告期期末基金份额总额 8,301,406,592.75 §10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议

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

复》,李要华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理,因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。 10.3 洗及基金管理人,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,本基金未召开基金份额持有人大会。

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 其全和田证券公司亦易单元的右关情况 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

全额单位, 人民币元 交易单元数量 券商名称 成交金额 佣金 1,633,125,665.0 1,326,924.2 14.28% 14.609 1,495,925,062. 1,215,447. 13.08% 海通证券 1,431,252,034 829,757,680 705,292.5 490,616,457. 229,689,045.2 195,235.5

227,370,305.7 184,740.4

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。

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 \mathbf{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,

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,本基金还选择了长江证券、南京证券、西南证券、兴业证券、中国银河证券、中信证券的交易

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

券商名称 4期回购成交 额的比例 成交金额 成交金额 广发证券 91,906,460.5 64.269 400,000,000 17.029 987,478.3 39,940,005.6 10,180,461.90 7.12%

华夏基金管理有限公司 二〇一一年八月二十四日

金额单位:人民币元