# 华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

## 2011 半年度 报告摘要

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：交通银行股份有限公司**
**报告送出日期：二〇一一年八月二十四日**

### §1 重要提示

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。

基金托管人交通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。

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 | 华夏蓝筹混合（LOF） |
| 基金主代码 | 160311 |
| 交易代码 | 160311 |
| 基金运作方式 | 契约型上市开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年4月24日 |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,048,166,027.62份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2007年5月28日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。 |
| 投资策略 | 本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 崔雁巍 | 张咏东 |
| | 联系电话 | 400-818-6666 | 021-32169999 |
| | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | zhangyd@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-818-6666 | 95559 |
| 传真 | | 010-63136700 | 021-62701216 |

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（2011年1月1日至2011年6月30日） |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 41,743,577.95 |
| 本期利润 | -853,187,375.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0691 |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.49% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2011年6月30日） |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4206 |
| 期末基金资产净值 | 10,418,425,547.40 |
| 期末基金份额净值 | 0.865 |

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

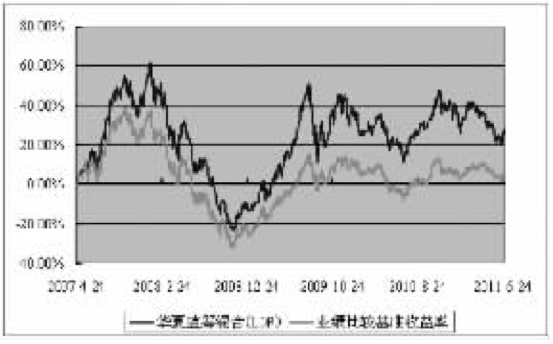
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 3.84% | 1.13% | 0.95% | 0.72% | 2.89% | 0.41% |
| 过去三个月 | -4.74% | 1.02% | -3.00% | 0.66% | -1.74% | 0.36% |
| 过去六个月 | -7.49% | 1.14% | -0.71% | 0.74% | -6.78% | 0.40% |
| 过去一年 | 12.21% | 1.16% | 12.53% | 0.84% | -0.32% | 0.32% |
| 过去三年 | 18.44% | 1.52% | 14.85% | 1.20% | 3.59% | 0.32% |
| 自基金转型以来至今 | 27.60% | 1.61% | 4.92% | 1.33% | 22.68% | 0.28% |

3.2.2 自基金转型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

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

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

（2007年4月24日至2011年6月30日）



注：自2007年4月24日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

### §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 | | |
| 刘文动 | 本基金的基金经理、投资总监 | 2007-06-12 | - | 14年 | 硕士。曾任鹏华基金管理有限公司投资总部副总经理兼机构理财部总监，平安保险集团投资管理中心组合经理助理、平安证券有限责任公司研究员。2006年加入华夏基金管理有限公司，历任兴安证券投资基金基金经理（2006年5月24日至2007年11月21日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007年2月14日至2008年2月27日期间）。 |
| 杨泽辉 | 本基金的基金经理 | 2009-01-01 | - | 7年 | 会计学硕士。2004年加入华夏基金管理有限公司，历任行业研究主管、行业研究员。 |
| 王怡欢 | 本基金的基金经理 | 2011-02-22 | - | 7年 | 北京大学经济学硕士。2004年6月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。 |

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2月24日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告》，增聘王怡欢女士为本基金基金经理。

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《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，CPI不断走高，货币政策持续紧缩，A股市场呈震荡走势，具体而言：年初，市场在对通胀超预期的担忧中低开，但1月份通胀数据好于预期，暂时缓解了市场的悲观情绪，在4月中旬市场一度创出阶段性高点；随后，市场开始一路下探，至6月底，上证指数较年初下跌1.6%。在结构上，由于上半年缺乏整体的行情，资金的博弈主导了阶段性的行业和风格轮动，具体而言：年初，机构持仓集中的高估值成长股经历了调整，而大盘价值股获取了超额收益；随着场内资金进一步减少，2季度末市场热点重新转向中小盘成长股和主题投资类个股。

报告期内，本基金对低估值周期性行业保持了较高仓位，并在市场下跌中增持了部分前景看好但被市场错杀的成长股，取得了较好的投资效果，但由于组合整体仓位较高，本轮系统性下跌依然对基金业绩造成一定的负面影响。

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0.865元，本报告期份额净值增长率为-7.49%，同期业绩比较基准增长率为-0.71%。

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在阶段性见顶后或将逐步回落，紧缩政策可能会有所缓解，经济“软着陆”迹象进一步明朗，市场也将见底回升，但由于经济危机中超发货币的滞后效应，结构性问题很难在短期内得以解决，指数在近期内难有较大的上涨空间。

投资策略上，我们将继续坚持深入的个股研究，不断挖掘真正优秀的成长股，重点关注消费、先进制造业、新材料、新能源等领域，同时，对于周期性行业，我们也将择时买入，争取获得较好的回报。

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、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

2011年上半年度，基金托管人在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011年上半年度，华夏基金管理有限公司在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2011年上半年度，由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏蓝筹核心混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §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：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

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<br>2011年6月30日 | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | - | - |
| 结算备付金 | | 482,119,234.48 | 1,598,684,416.98 |
| 存出保证金 | | 5,096,770.68 | 5,276,363.64 |
| 交易性金融资产 | | 9,790,946,542.17 | 10,479,619,693.31 |
| 其中：股票投资 | | 9,046,981,775.13 | 9,799,838,978.64 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 743,964,767.04 | 679,780,714.67 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 264,891,876.87 | - |
| 应收利息 | | 10,731,941.47 | 6,609,873.42 |
| 应收股利 | | 126,959.79 | - |
| 应收申购款 | | 1,035,716.47 | 3,965,492.32 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 10,554,949,041.93 | 12,094,155,839.67 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2011年6月30日 | 上年度末<br>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 | | - | 95,534,094.81 |
| 应付赎回款 | | 4,724,880.28 | 8,859,593.16 |
| 应付管理人报酬 | | 12,445,956.35 | 15,303,564.08 |
| 应付托管费 | | 2,074,326.06 | 2,550,594.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 114,995,006.68 | 104,051,919.01 |
| 应交税费 | | 166,385.89 | 166,385.89 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 2,116,939.27 | 2,039,206.70 |
| 负债合计 | | 136,523,494.53 | 228,505,357.67 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 5,164,873,602.29 | 5,439,435,510.14 |
| 未分配利润 | | 5,253,551,945.11 | 6,426,214,971.86 |
| 所有者权益合计 | | 10,418,425,547.40 | 11,865,650,482.00 |
| 负债和所有者权益总计 | | 10,554,949,041.93 | 12,094,155,839.67 |

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.865元，基金份额总额12,048,166,027.62份。

6.2 利润表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

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<br>2011年1月1日<br>至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日<br>至2010年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -736,473,454.07 | -2,767,853,741.34 |
| 1.利息收入 | | 14,888,502.87 | 23,258,513.04 |
| 其中：存款利息收入 | | 6,024,758.25 | 12,644,090.79 |
| 债券利息收入 | | 8,146,037.78 | 9,579,503.89 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 717,706.84 | 1,034,918.36 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 142,383,588.31 | 1,117,481,232.85 |
| 其中：股票投资收益 | | 85,064,885.77 | 1,073,674,760.54 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 308,900.99 | 963,831.39 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | 430,634.92 |
| 股利收益 | | 57,009,801.55 | 42,412,006.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -894,930,953.19 | -3,910,480,989.28 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 1,185,407.94 | 1,887,502.05 |
| 减：二、费用 | | 116,713,921.17 | 168,425,852.11 |
| 1.管理人报酬 | | 82,689,055.97 | 109,155,279.57 |
| 2.托管费 | | 13,781,509.34 | 18,192,546.60 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 20,014,691.58 | 40,687,321.90 |
| 5.利息支出 | | - | 156,080.65 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 156,080.65 |
| 6.其他费用 | | 228,664.28 | 234,623.39 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -853,187,375.24 | -2,936,279,593.45 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -853,187,375.24 | -2,936,279,593.45 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

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<br>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） | 5,439,435,510.14 | 6,426,214,971.86 | 11,865,650,482.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -853,187,375.24 | -853,187,375.24 |
| 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） | -274,561,907.85 | -319,475,651.51 | -594,037,559.36 |
| 其中：1.基金申购款 | 168,831,818.19 | 185,452,462.44 | 354,284,280.63 |
| 2.基金赎回款 | -443,393,726.04 | -504,928,113.95 | -948,321,839.99 |
| 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） | 5,164,873,602.29 | 5,253,551,945.11 | 10,418,425,547.40 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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） | 5,471,197,559.63 | 11,206,199,045.04 | 16,677,396,604.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -2,936,279,593.45 | -2,936,279,593.45 |
| 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） | -332,247,175.16 | -631,533,778.93 | -963,780,954.09 |
| 其中：1.基金申购款 | 195,962,291.86 | 350,257,667.88 | 546,219,959.74 |
| 2.基金赎回款 | -528,209,467.02 | -981,791,446.81 | -1,510,000,913.83 |
| 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） | 5,138,950,384.47 | 7,638,385,672.66 | 12,777,336,057.13 |

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 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。

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、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 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

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。

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

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。

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

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。

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 82,689,055.97 | 109,155,279.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 17,418,979.63 | 22,853,404.23 |

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 13,781,509.34 | 18,192,546.60 |

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

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 |
| 交通银行 | - | - | - | - | - | - |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 | | | | | |
| | 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 |
| 交通银行 | 100,497,201.37 | - | - | - | - | - |

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

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 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 | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.42% | 0.42% |

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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间<br>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 |
| 交通银行 | - | 16,363.31 | - | 17,821.09 |

注：①本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

②除此以外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2011年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2010年6月30日：同）。

6.4.4.6 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

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日<br>基金在承销期内买入 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 数量<br>（单位：股/张） | 总金额 |
| 中信证券 | - | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日<br>基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量<br>（单位：股/张） | 总金额 |
| 中信证券 | 601166 | 兴业银行 | 配股发行 | 4,910,808 | 88,394,544.00 |
| 中信证券 | 600036 | 招商银行 | 配股发行 | 5,392,279 | 47,721,669.15 |

6.4.5 期末（2011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 |
| 600157 | 永泰能源 | 2010-07-15 | 2011-07-13 | 非公开发行流通受限 | 16.05 | 16.33 | 3,000,000 | 48,150,000.00 | 48,990,000.00 | - |
| 600157 | 永泰能源 | - | 2011-07-13 | 非公开发行送股及转增 | - | 16.33 | 1,534,620 | - | 25,060,344.60 | - |
| 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 | - |
| 002055 | 得润电子 | 2011-03-10 | 2012-03-11 | 非公开发行流通受限 | 21.00 | 20.09 | 841,490 | 17,671,290.00 | 16,905,534.10 | - |
| 600770 | 综艺股份 | 2011-04-14 | 2012-04-12 | 非公开发行流通受限 | 19.72 | 18.92 | 637,500 | 12,571,500.00 | 12,061,500.00 | - |

注：本基金持有的非公开发行股票永泰能源，于2011年6月14日实施2010年度利润分配及公积金转增股本方案，向全体股东每10股派发现金红利0.0787元（含税），送0.3935股，转增4.7219股，本基金新增1,534,620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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | - | - | 2,999,928 | 42,648,349.20 | 36,959,112.96 | - |
| 000917 | 电广传媒 | 2010-12-27 | 筹划重大资产重组事项 | 24.40 | 2011-07-06 | 26.84 | 250,000 | 5,505,526.11 | 6,100,000.00 | - |

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。

6.4.5.3.2 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。

### §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 | 9,046,981,775.13 | 85.71 |
| | 其中：股票 | 9,046,981,775.13 | 85.71 |
| 2 | 固定收益投资 | 743,964,767.04 | 7.05 |
| | 其中：债券 | 743,964,767.04 | 7.05 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 482,119,234.48 | 4.57 |
| 6 | 其他各项资产 | 281,883,265.28 | 2.67 |
| 7 | 合计 | 10,554,949,041.93 | 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 | 12,600,103.64 | 0.12 |
| B | 采掘业 | 179,402,514.23 | 1.72 |
| C | 制造业 | 5,202,372,800.82 | 49.93 |
| C0 | 食品、饮料 | 646,389,113.68 | 6.20 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 91,403,298.70 | 0.88 |
| C2 | 木材、家具 | 5,679,850.90 | 0.05 |
| C3 | 造纸、印刷 | 11,249,347.50 | 0.11 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 589,602,009.47 | 5.66 |
| C5 | 电子 | 393,867,702.79 | 3.78 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,054,980,635.35 | 10.13 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,820,408,996.29 | 17.47 |
| C8 | 医药、生物制品 | 443,152,312.15 | 4.25 |
| C99 | 其他制造业 | 145,639,533.99 | 1.40 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 38,876,528.96 | 0.37 |
| E | 建筑业 | 10,046,864.40 | 0.10 |
| F | 交通运输、仓储业 | 7,840,000.00 | 0.08 |
| G | 信息技术业 | 699,428,433.24 | 6.71 |
| H | 批发和零售贸易 | 510,319,252.10 | 4.90 |
| I | 金融、保险业 | 1,107,714,985.28 | 10.63 |
| J | 房地产业 | 509,919,868.59 | 4.89 |
| K | 社会服务业 | 235,488,832.41 | 2.26 |
| L | 传播与文化产业 | 69,574,444.00 | 0.67 |
| M | 综合类 | 463,397,147.46 | 4.45 |
| | 合计 | 9,046,981,775.13 | 86.84 |

7.3 期末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（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 33,396,711 | 434,825,177.22 | 4.17 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 15,476,510 | 429,627,917.60 | 4.12 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 64,354,454 | 368,751,021.42 | 3.54 |
| 4 | 000527 | 美的电器 | 17,728,074 | 326,019,280.86 | 3.13 |
| 5 | 000063 | 中兴通讯 | 10,643,652 | 301,002,478.56 | 2.89 |
| 6 | 000423 | 东阿阿胶 | 5,408,546 | 223,156,607.96 | 2.14 |
| 7 | 002304 | 洋河股份 | 1,747,722 | 220,492,607.52 | 2.12 |
| 8 | 000559 | 万向钱潮 | 26,620,584 | 214,029,495.36 | 2.05 |
| 9 | 002008 | 大族激光 | 14,540,012 | 181,459,349.76 | 1.74 |
| 10 | 000002 | 万科A | 20,999,753 | 177,447,912.85 | 1.70 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

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 | 600585 | 海螺水泥 | 340,034,360.57 | 2.87 |
| 2 | 000527 | 美的电器 | 336,595,861.03 | 2.84 |
| 3 | 601117 | 中国化学 | 301,190,237.03 | 2.54 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 277,658,251.54 | 2.34 |
| 5 | 000877 | 天山股份 | 176,061,154.40 | 1.48 |
| 6 | 002326 | 永太科技 | 167,946,714.69 | 1.42 |
| 7 | 600256 | 广汇股份 | 145,197,335.72 | 1.22 |
| 8 | 600316 | 洪都航空 | 144,022,463.78 | 1.21 |
| 9 | 002122 | 天马股份 | 141,403,417.51 | 1.19 |
| 10 | 000969 | 安泰科技 | 134,470,225.45 | 1.13 |
| 11 | 600710 | 常林股份 | 126,079,893.59 | 1.06 |
| 12 | 600016 | 民生银行 | 121,872,849.00 | 1.03 |
| 13 | 000983 | 西山煤电 | 121,542,727.98 | 1.02 |
| 14 | 000401 | 冀东水泥 | 115,645,018.37 | 0.97 |
| 15 | 000789 | 江西水泥 | 112,498,514.72 | 0.95 |
| 16 | 000157 | 中联重科 | 105,866,956.85 | 0.89 |
| 17 | 600019 | 宝钢股份 | 95,025,309.72 | 0.80 |
| 18 | 002092 | 中泰化学 | 94,433,928.87 | 0.80 |
| 19 | 000659 | 珠海中富 | 92,753,293.08 | 0.78 |
| 20 | 600478 | 科力远 | 89,898,000.42 | 0.76 |

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 | 601939 | 建设银行 | 324,904,374.69 | 2.74 |
| 2 | 601299 | 中国北车 | 246,650,068.92 | 2.08 |
| 3 | 600068 | 葛洲坝 | 211,900,537.62 | 1.79 |
| 4 | 601117 | 中国化学 | 206,494,993.14 | 1.74 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 203,711,460.31 | 1.72 |
| 6 | 600362 | 江西铜业 | 197,173,267.25 | 1.66 |
| 7 | 000895 | 双汇发展 | 185,925,583.37 | 1.57 |
| 8 | 601766 | 中国南车 | 182,390,808.82 | 1.54 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 169,368,752.15 | 1.43 |
| 10 | 000939 | 凯迪电力 | 143,900,197.98 | 1.21 |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 137,607,228.39 | 1.16 |
| 12 | 000983 | 西山煤电 | 134,671,561.92 | 1.13 |
| 13 | 002008 | 大族激光 | 125,869,820.85 | 1.06 |
| 14 | 600710 | 常林股份 | 123,617,992.47 | 1.04 |
| 15 | 002048 | 宁波华翔 | 113,743,794.85 | 0.96 |
| 16 | 000755 | 山西三维 | 111,947,311.74 | 0.94 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 104,976,055.78 | 0.88 |
| 18 | 600875 | 东方电气 | 104,287,982.49 | 0.88 |
| 19 | 600016 | 民生银行 | 101,510,856.70 | 0.86 |
| 20 | 000157 | 中联重科 | 93,253,859.08 | 0.79 |

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 | 6,623,305,969.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,567,547,762.86 |

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 | 149,925,934.90 | 1.44 |
| 2 | 央行票据 | 78,120,000.00 | 0.75 |
| 3 | 金融债券 | 398,940,000.00 | 3.83 |
| | 其中：政策性金融债 | 398,940,000.00 | 3.83 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 116,978,832.14 | 1.12 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 743,964,767.04 | 7.14 |

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 | 100311 | 10进出11 | 2,000,000 | 199,520,000.00 | 1.92 |
| 2 | 019021 | 10国债21 | 1,000,000 | 99,920,000.00 | 0.96 |
| 3 | 070201 | 07国开01 | 1,000,000 | 99,850,000.00 | 0.96 |
| 4 | 100226 | 10国开26 | 1,000,000 | 99,570,000.00 | 0.96 |
| 5 | 113002 | 工行转债 | 809,210 | 95,867,108.70 | 0.92 |

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 投资组合报告附注

7.9.1 2010年9月6日大族激光受到深交所通报批评。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。

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 | 5,096,770.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | 264,891,876.87 |
| 3 | 应收股利 | 126,959.79 |
| 4 | 应收利息 | 10,731,941.47 |
| 5 | 应收申购款 | 1,035,716.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 281,883,265.28 |

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 | 95,867,108.70 | 0.92 |
| 2 | 126729 | 燕京转债 | 6,783,123.26 | 0.07 |
| 3 | 110011 | 歌华转债 | 6,475,666.50 | 0.06 |
| 4 | 125709 | 唐钢转债 | 5,792,690.88 | 0.06 |
| 5 | 110009 | 双良转债 | 1,247,552.80 | 0.01 |
| 6 | 110007 | 博汇转债 | 812,690.00 | 0.01 |

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 |
| 699,099 | 17,233.85 | 101,441,099.96 | 0.84% | 11,946,724,927.66 | 99.16% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 华夏基金管理有限公司 | 50,000,000.00 | 13.23% |
| 2 | 中国再保险（集团）股份有限公司 | 12,814,334.00 | 3.39% |
| 3 | 陕西信托解放路证券营业部 | 3,764,933.00 | 1.00% |
| 4 | 刘勇 | 1,744,545.00 | 0.46% |
| 5 | 刘秀云 | 1,453,298.00 | 0.38% |
| 6 | 何均华 | 1,060,500.00 | 0.28% |
| 7 | 徐启英 | 1,049,000.00 | 0.28% |
| 8 | 李萍 | 1,000,000.00 | 0.26% |
| 9 | 张志发 | 997,600.00 | 0.26% |
| 10 | 张平 | 969,717.00 | 0.26% |

8.3 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 | 57,138.79 | 0.00% |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2007年4月24日）基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 12,688,624,208.07 |
| 本报告期基金总申购份额 | 393,818,695.86 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,034,276,876.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 12,048,166,027.62 |

### §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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 | |
| 申银万国证券 | 1 | 3,841,795,545.12 | 29.23% | 3,121,481.37 | 28.51% | - |
| 东方证券 | 1 | 3,678,606,125.34 | 27.99% | 3,126,796.26 | 28.56% | - |
| 招商证券 | 1 | 1,762,015,162.62 | 13.41% | 1,497,703.12 | 13.68% | - |
| 光大证券 | 1 | 1,068,345,303.34 | 8.13% | 868,038.23 | 7.93% | - |
| 中金公司 | 1 | 779,995,278.87 | 5.93% | 662,993.35 | 6.06% | - |
| 国信证券 | 1 | 629,338,501.59 | 4.79% | 511,342.07 | 4.67% | - |
| 华泰联合证券 | 1 | 579,093,600.27 | 4.41% | 492,230.24 | 4.50% | - |
| 中信建投证券 | 1 | 394,986,984.39 | 3.01% | 335,740.65 | 3.07% | - |
| 长城证券 | 1 | 373,317,888.98 | 2.84% | 303,326.42 | 2.77% | - |
| 华宝证券 | 1 | 36,130,151.48 | 0.27% | 29,355.84 | 0.27% | - |

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，本基金还选择了长江证券、东吴证券、国泰君安证券、国元证券、民族证券、齐鲁证券、西部证券和中国银河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 |
| 申银万国证券 | 5,664,283.80 | 10.15% | - | - |
| 东方证券 | - | - | 1,130,000,000.00 | 63.48% |
| 招商证券 | - | - | 650,000,000.00 | 36.52% |
| 光大证券 | 173,618.37 | 0.31% | - | - |
| 中信建投证券 | 49,941,000.00 | 89.53% | - | - |

**华夏基金管理有限公司**
**二〇一一年八月二十四日**