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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22日复核了本报告中的财务指

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

本报告中财务资料未经审计

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。

| | 8 2 叁五间汀 |
|------------|-------------------|
| 2.1 基金基本情况 | |
| 基金简称 | 中信稳定双利债券 |
| 基金主代码 | 288102 |
| 交易代码 | 288102 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年7月20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 | 1,198,698,552.60份 |
| 其全人同方统相 | 不完期 |

| | 2.2 基金产品说明 | |
|---|------------|---|
| | 投资目标 | 本基金主要投资于固定收益类产品,投资目标是在强调本金稳妥的基础上,积极追求资产的长期稳定增值。 |
| | 投资策略 | 本基金根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断,在控制利率风险。信用风险以及流动性风险等基础上、采取顺约瞭路轮制组合人期的波动范围,充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率、实现基金的保值增值。 |
| | 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为80%×中信标普全债指数+20%×税后一年期定期存款利率。 |
| , | 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。 |

| | | mm / 1 4 4 2 4 11 11 /4 22 1mm | |
|-------------|----------|--------------------------------|----------------------|
| 2.3 基金管 | 理人和基金托管。 | (| |
| | 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 |
| | 姓名 | 崔雁巍 | 田青 |
| 信息披露 负责人 | 联系电话 | 400-818-6666 | 010-67595096 |
| 94,547 | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | • | 400-818-6666 | 010-67595096 |
| 传真 | | 010-63136700 | 010-66275853 |
| 2.4 信自地 | 設方式 | * | |

www.ChinaAMC.cor

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

| 3.1 主要会计数据和财务指标 | |
|-----------------|---------------------------|
| | 金额单位:人民币元 |
| 3.1.1期间数据和指标 | 报告期 2013年1月1日至2013年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 27,933,440.73 |
| 本期利润 | 28,341,697.96 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0216 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.13% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 报告期末 2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0015 |
| 期末其全资产净值 | 1 233 088 078 67 |

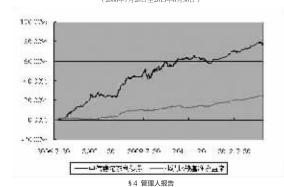
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列 ②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的

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 | -1.10% | 0.16% | -0.19% | 0.05% | -0.91% | 0.11% |
| 过去三个月 | 0.22% | 0.12% | 0.92% | 0.04% | -0.70% | 0.08% |
| 过去六个月 | 2.13% | 0.09% | 2.39% | 0.04% | -0.26% | 0.05% |
| 过去一年 | 4.61% | 0.14% | 3.62% | 0.03% | 0.99% | 0.11% |
| 过去三年 | 14.56% | 0.16% | 9.75% | 0.04% | 4.81% | 0.12% |
| 自基金合同生效 起至今 | 77.13% | 0.26% | 24.34% | 0.05% | 52.79% | 0.21% |

中信稳定双利债券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 (2006年7月20日至2013年6月30日)



4.1 基金管理人及基金经理情况

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公 司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港设有子公司。公司是首批 全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人,以及特 定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的

2013年上半年,市场大幅波动,华夏基金继续坚持以深人的投资研究为基础,高度重视风险管理,同时积极把 2013年上半年,在《证券时报》主办的"2012年度中国基金业时里基金炙"的评选中、平夏基金荣获"五年特续回报明星基金公司奖",所管理的基金荣获4个单项奖;在《上海证券报》主办的第十届中国"金基金"奖的评 选中,华夏基金荣获"金基金十年·卓越公司奖";在《中国证券报》主办的"第十届中国基金业金牛奖"的评选中,华夏基金荣获"被动投资金牛基金公司奖",所管理的基金荣获4个单项奖;在晨星(中国)举办的"晨星(中国)2013年度基金奖"评选中,华夏回报混合荣获"混合型基金奖"。

在客户服务方面,上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高服务质量;(1)升级了货币基金的快速 赎回业务:扩充了支持银行卡的范围,延长了业务办理时间;(2)推出了货币基金"还贷款"及信用卡还款业务, 推出了直销网上交易"跨行随意取"业务,开通了支付宝交易渠道,方便投资者进行现金管理;(3)直销网上交易 新增了中国建设银行储蓄卡的"快易付"功能,并增加多家银行卡的电子交易业务,提高投资者的交易效率;(4) 开通了华夏基金微信公众服务平台,满足投资者服务渠道多样化的需求。 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业 | 说明 |
|--------|----------|-------------|------------|---------|--|
| 灶石 | 現六分子 | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | (元明) |
| 毛颖 | 本基金的基金经理 | 2013-05-13 | - | 11年 | 北京大学金融学硕士。曾任 西南证券研究员、原中信基 金研究员、基金经理助理 等。2009年1月加人华夏基 金管理有限公司,曾任固定 收益部研究员等。 |
| 李广云 | 本基金的基金经理 | 2009-02-04 | 2013-05-29 | 12年 | 英国华威大学管理科学与 运筹学硕士。曾任招商证券 研究员、原中信基金研究员、基金经理助理等。2009 年1月加入华夏基金管理 限公司,曾任华夏货币市利 基金基金经理 2007年7月 12日至2012年2月29日期间) 等。 |
| 注:①上述(| 生职日期、离任! | 日期根据本基金管理 | 理人对外披露的低 | 壬免日期填写。 | |

《迎達券》址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。 《迎接》址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。 《根据本基金管理人于2013年5月15日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘中信稳定双利债券型证券

③根据本基金管理人于2013年5月15日安布的《华夏基金管理有限公司关于增聘中信稳定双利债券型证券投资基金基金经理的公告》,增聘毛额女士为本基金基金经理。 ④根据本基金管理人于2013年5月30日安布的《华夏基金管理有限公司关于调整中信稳定双利债券型证券投资基金基金经理的公告》,李广云先生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递规守信情况的说明本报告期内,本基金管理人严格遵守一个华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金台国和其他有关法律法规,本着诚实信用、激勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额特有人谋求最大利益、没有损害基金份额特有人利益的行为。 4.3 管理人对报告期办公平交易制度的专项的组

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制 度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。 报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年,国内经济增速逐步下降,从1月到6月,全国进出口总值从20%以上的同比增长率下滑到负增 长,工业品出厂价格指数(PPI)持续同比负增长,其他如投资、工业增加值和用电量等数据也逐步走低、社会融资总量同比增速大幅高于货币信贷增幅,与萎靡不振的经济数据形成鲜明对比。2季度,伴随美联储退出宽松货币 政策的预期,以及国内对出口虚增、虚假贸易和套汇的严查,外汇占款增幅从高位转为负值,市场流动性从宽松

本报告期前期,债市大幅上涨,5月份开始逐步下跌,6月份银行间资金紧张格局显著加强,导致债券价格大幅 下挫。可转债也由于资金紧张等原因大幅下跌。

报告期内,本基金增持了风险收益较合理的信用债,减持利率债,并在股市下跌过程中快速降低了可转债仓 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为1.0287元,本报告期份额净值增长率为2.13%,同期业绩比较基准增长

展望下半年,国内经济下行压力依然存在。真实利率较高对企业盈利形成压制,特别是对于企业盈利持续下

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

滑的周期性行业,由于银行收缩其贷款使其需维持高位的融资成本,经营前景更为看淡。

下半年(请市基本面较有利,资金面从分展的聚队环境中逐步放松。但请市资金最大的水龙头——外汇占款趋势性下降,央行的态度对市场资金面将起到重要作用。经济下行过程中,预期信用债利差将显著分化,投资者 会更加关注企业现金流状况。大盘可转债的供给上升预期较为强烈、对下半年可转债市场形成压制。 基于以上判断,本基金在下半年将主要提高组合整体的信用等级,寻找现金流更为安全的债券,持有风险收益更合理的信用债品种。此外,本基金将整体控制可转债仓位。

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 使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、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央策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险 负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中,近三分之二的人员具有10年以上的基

中信稳定双利债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

金从业经验,且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,估值 工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

关法规及基金合同的规定。

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

| 资产 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|------------------|-----|-------------------|---------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 103,570,501.36 | 7,348,606.6 |
| 吉算备付金 | | 15,858,110.79 | 4,584,728.8 |
| 存出保证金 | | 57,511.21 | 250,000.0 |
| 交易性金融资产 | | 1,724,321,262.14 | 1,311,243,983.0 |
| 其中:股票投资 | | 10,128,382.94 | |
| 基金投资 | | - | |
| 贵券投资 | | 1,700,192,879.20 | 1,311,243,983.0 |
| 资产支持证券投资 | | 14,000,000.00 | |
| 汀生金融资产 | | - | |
| 买人返售金融资产 | | - | |
| 立收证券清算款 | | 2,917,256.26 | 4,983,180.8 |
| 立收利息 | | 35,923,325.20 | 28,317,239.0 |
| 立收股利 | | - | |
| 立收申购款 | | 892,728.60 | 1,988,264.0 |
| 弟延所得税资产 | | - | |
| 其他资产 | | - | |
| 资产总计 | | 1,883,540,695.56 | 1,358,716,002.4 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | |
| 交易性金融负债 | | - | |
| 汀生金融负债 | | - | |
| 卖出回购金融资产款 | | 642,099,649.70 | 32,000,000.0 |
| 立付证券清算款 | | 25,377.29 | |
| 立付赎回款 | | 3,648,478.53 | 1,912,267.7 |
| 立付管理人报酬 | | 739,448.40 | 740,289.9 |
| 立付托管费 | | 227,522.59 | 227,781.5 |
| 立付销售服务费 | | 455,045.20 | 455,563.0 |
| 立付交易費用 | | 371,433.28 | 271,810.2 |
| 立交税费 | | 2,191,311.60 | 2,191,311.6 |
| 立付利息 | | 281,598.17 | 4,968.5 |
| 立付利润 | | - | |
| 递延所得税负债 | | - | |
| 其他负债 | | 412,752.13 | 569,025.2 |
| 负债合计 | | 650,452,616.89 | 38,373,017.7 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,198,698,552.60 | 1,277,932,701.7 |
| + // =1=102 | | 34,389,526.07 | 42,410,282.9 |
| 未分配利润 | | | |
| 不分配利用 所有者权益合计 | | 1,233,088,078.67 | 1,320,342,984.6 |

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

| | | | 单位:人民币 |
|-----------------------|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| 项目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年6 月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6 月30日 |
| 一、收入 | | 44,496,772.03 | 62,631,551.47 |
| 1.利息收入 | | 44,949,408.41 | 30,132,981.31 |
| 其中:存款利息收入 | | 332,044.44 | 168,587.42 |
| 债券利息收入 | | 44,301,243.69 | 29,298,472.44 |
| 资产支持证券利息收入 | | 46,474.52 | - |
| 买人返售金融资产收入 | | 269,645.76 | 665,921.45 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 假失以 ""填列) | | -996,190.15 | 11,186,669.67 |
| 其中:股票投资收益 | | -3,222,559.04 | -2,083,702.80 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 2,226,368.89 | 13,270,372.47 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益 (损失以""号填列) | | 408,257.23 | 20,809,100.29 |
| 4.汇兑收益 假失以 ""号填列) | | - | - |
| 5.其他收入 假失以 ""号填列) | | 135,296.54 | 502,800.20 |
| 减:二、费用 | | 16,155,074.07 | 9,844,039.16 |
| 1.管理人报酬 | | 4,423,127.17 | 3,919,795.48 |
| 2.托管费 | | 1,360,962.15 | 1,206,090.84 |
| 3.销售服务费 | | 2,721,924.43 | 2,412,181.82 |
| 4.交易費用 | | 133,258.44 | 125,237.93 |
| 5.利息支出 | | 7,321,969.96 | 1,984,921.90 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 7,321,969.96 | 1,984,921.90 |
| 6.其他费用 | | 193,831.92 | 195,811.19 |
| 三、利润总额 (亏损总额以""号填列) | | 28,341,697.96 | 52,787,512.31 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(争亏损以""号填列) | | 28,341,697.96 | 52,787,512.31 |

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金

| | | | 单位:人民币元 | | |
|--|----------------------------|-----------------------------|------------------|--|--|
| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 | | |
| 一、期初所有者权益 僥金净值) | 1,277,932,701.71 | 42,410,282.96 | 1,320,342,984.67 | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期利润) | - | 28,341,697.96 | 28,341,697.96 | | |
| 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) | -79,234,149.11 | -3,349,216.20 | -82,583,365.31 | | |
| 其中:1.基金申购款 | 602,881,849.69 | 27,345,285.34 | 630,227,135.03 | | |
| 2.基金赎回款 | -682,115,998.80 | -30,694,501.54 | -712,810,500.34 | | |
| 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) | - | -33,013,238.65 | -33,013,238.65 | | |
| 五、期末所有者权益 偡金净值) | 1,198,698,552.60 | 34,389,526.07 | 1,233,088,078.67 | | |
| 项目 | 2012 | 上年度可比期间 2年1月1日至2012年6月30 | I | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 | | |
| 一、期初所有者权益 偡金净值) | 1,201,590,909.35 | 10,074,954.18 | 1,211,665,863.53 | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期利润) | - | 52,787,512.31 | 52,787,512.31 | | |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (争值减少以""号填列) | 21,136,183.14 | 2,124,805.38 | 23,260,988.52 | | |
| 其中:1.基金申购款 | 196,108,963.10 | 7,663,911.13 | 203,772,874.23 | | |
| 2.基金赎回款 | -174,972,779.96 | -5,539,105.75 | -180,511,885.71 | | |
| 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) | - | -12,147,704.85 | -12,147,704.85 | | |
| 五、期末所有者权益 偡金净值) | 1,222,727,092.49 | 52,839,567.02 | 1,275,566,659.51 | | |
| 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 | | | | | |

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

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

6.4.3 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。

关联方名称 **半夏基金管理有限**

注:下述关联交

6.4.4 本报告期

6.4.4.1 通过关联 6.4.4.1.1 股票交 本基金本报告

本基金本报告其

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。 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。

6.4.4.2.1 基金管理费

获得销售服务费的各关联方名称

获得销售服务费的各关联方名称

华夏基金管理有

华夏基金管理有限公

关联方名称

关联方名称

证券 名称

199 649 70元,是以加下债券作为质押。

债券代码

信证券

2013年6月30日

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 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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信。净值计算、利润分配等情况的说明 本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值让 算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基

报告期内,本基金实施利润分配的金额为33,013,238.65元

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。

会计主体:中信稳定双利债券型证券投资基金

| 资产 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|-------------------|-----|-------------------|---------------------|
| iř: | | | |
| 2行存款 | | 103,570,501.36 | 7,348,606.60 |
| 算备付金 | | 15,858,110.79 | 4,584,728.87 |
| 出保证金 | | 57,511.21 | 250,000.00 |
| 易性金融资产 | | 1,724,321,262.14 | 1,311,243,983.00 |
| 中:股票投资 | | 10,128,382.94 | |
| 金投资 | | - | - |
| 券投资 | | 1,700,192,879.20 | 1,311,243,983.00 |
| 产支持证券投资 | | 14,000,000.00 | - |
| 生金融资产 | | _ | - |
| 人返售金融资产 | | - | - |
| 收证券清算款 | | 2,917,256.26 | 4,983,180.82 |
| 7收利息 | | 35,923,325.20 | 28,317,239.08 |
| 7收股利 | | _ | |
| (收申购款 | | 892,728.60 | 1,988,264.08 |
| 延所得税资产 | | - | - |
| 他资产 | | - | - |
| 产总计 | | 1,883,540,695.56 | 1,358,716,002.45 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| i债: | | | |
| 期借款 | | - | |
| 易性金融负债 | | - | |
| i生金融负债 | | - | |
| 出回购金融资产款 | | 642,099,649.70 | 32,000,000.00 |
| 7付证券清算款 | | 25,377.29 | - |
| :付赎回款 | | 3,648,478.53 | 1,912,267.70 |
| 付管理人报酬 | | 739,448.40 | 740,289.96 |
| 付托管费 | | 227,522.59 | 227,781.51 |
| 付销售服务费 | | 455,045.20 | 455,563.06 |
| 付交易费用 | | 371,433.28 | 271,810.24 |
| 交税费 | | 2,191,311.60 | 2,191,311.60 |
| 付利息 | | 281,598.17 | 4,968.50 |
| 付利润 | | - | - |
| 延所得税负债 | | - | - |
| 他负债 | | 412,752.13 | 569,025.21 |
| 债合计 | | 650,452,616.89 | 38,373,017.78 |
| 有者权益: | | | |
| 收基金 | | 1,198,698,552.60 | 1,277,932,701.71 |
| 分配利润 | | 34,389,526.07 | 42,410,282.96 |
| 有者权益合计 | | 1,233,088,078.67 | 1,320,342,984.67 |
| 13 Ed Derme Ed A. | | | |

| 平报 | 1 | | 单位:人民币: |
|----------------------|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| 项目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年6 月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6 月30日 |
| 一、收入 | | 44,496,772.03 | 62,631,551.47 |
| 1.利息收入 | | 44,949,408.41 | 30,132,981.31 |
| 其中:存款利息收入 | | 332,044.44 | 168,587.42 |
| 债券利息收入 | | 44,301,243.69 | 29,298,472.44 |
| 资产支持证券利息收入 | | 46,474.52 | - |
| 买人返售金融资产收入 | | 269,645.76 | 665,921.45 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益 假失以 ""填列) | | -996,190.15 | 11,186,669.67 |
| 其中:股票投资收益 | | -3,222,559.04 | -2,083,702.80 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 2,226,368.89 | 13,270,372.47 |
| 资产支持证券投资收益 | | _ | - |
| 衍生工具收益 | | _ | - |
| 投利收益 | | - | _ |
| 3.公允价值变动收益(损失以""号填列) | | 408,257.23 | 20,809,100.29 |
| 4.汇兑收益 假失以 ""号填列) | | _ | - |
| 5.其他收入 假失以 ""号填列) | | 135,296.54 | 502,800.20 |
| 咸:二、费用 | | 16,155,074.07 | 9,844,039.16 |
| 1.管理人报酬 | | 4,423,127.17 | 3,919,795.48 |
| 2.托管费 | | 1,360,962.15 | 1,206,090.84 |
| 3.销售服务费 | | 2,721,924.43 | 2,412,181.82 |
| 4.交易费用 | | 133,258.44 | 125,237.93 |
| 5.利息支出 | | 7,321,969.96 | 1,984,921.90 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 7,321,969.96 | 1,984,921.90 |
| 6.其他费用 | | 193,831.92 | 195,811.19 |
| 三、利润总额(亏损总额以""号填列) | | 28,341,697.96 | 52,787,512.31 |
| 域:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(争亏损以""号填列) | | 28,341,697.96 | 52,787,512.31 |

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 公司 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 | | 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 | | | | | |
|---|-----------------|------------------------------------|--------|------|-----------|---------------|--------|
| 分有限公司(中国建设银行") | 基金托管人、基金销售机构 | | | | | | 金额单位 |
| 限公司(中信证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 | 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净 |
| 交易均在正常业务范围内按一般商业条款订 | · 🕅 . | | | | | | (%) |
| 期及上年度可比期间的关联方交易 長联方交易单元进行的交易 交易 時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。 交易 時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。 | | 1 | 600886 | 国投电力 | 2,996,563 | 10,128,382.94 | |
| | | 2 | - | - | - | - | |
| | | 3 | - | - | - | - | |
| | | 4 | - | - | - | - | |
| | | 5 | - | - | - | - | |
| | | 6 | _ | _ | _ | _ | |

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 1 | 600886 | 国投电力 | 32,156,086.08 | 2.44 |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2 | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - |
| 8 | - | - | - | - |
| 9 | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - |
| 11 | - | - | - | - |
| 12 | - | - | - | - |
| 13 | - | - | - | - |
| 14 | - | - | - | - |
| 15 | - | - | - | - |
| 16 | - | - | - | - |
| 17 | - | - | - | - |
| 18 | _ | _ | _ | _ |

本期累计买入金额

期初基金资产。例 %)

金额单位, 人民币元

单位:人民币元

892,728.6

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) 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

股票代码

单位:人民币元

223,032.32

单位:人民币元

1,206,090.84

单位:人民币元

292,878.08

169,802.93 1,309,243.3

金额单位:人民币元

3,000,000.0

36,000,000.00

期末估值总额

400.00

100,000

50,175,000.00

41,148,000.00

9,969,000.00

109,284,000.00

金额单位:人民币元

276,214.17

2013年1月1日至2013年6月30日

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 ×0.65% / 当年天数

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0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

142,384.59

发行方式

发行方式

②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值× 0.40% /当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 6.4.4.2 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。

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。

2012年1月1日至2012年6月30日

64.5.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2013年6月30日止,本基金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100.

2013-07-05

2013-07-05

证券名称

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况 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

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

3,570,501.36

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

证券代码

1380011

证券代码

1280163

6453 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

12新奥MTN1

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

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。

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 × 0.20% / 当年天数

股票名称

| 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 | 600886 | 国投电力 | 17,272,086.87 | 1.31 |
| 2 | - | - | - | _ |
| 3 | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | |
| 7 | - | - | - | |
| 8 | - | - | - | |
| 9 | - | - | - | |
| 10 | - | - | - | - |
| 11 | - | - | - | |
| 12 | - | - | - | |
| 13 | - | - | - | |
| 14 | - | - | _ | |
| 15 | - | - | _ | - |
| 16 | - | - | - | |
| 17 | - | - | - | |
| 18 | - | - | - | - |
| 19 | - | - | - | - |
| 20 | - | - | - | - |

在: 英田壶御 按英田成文壶御(成文单竹架以成 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 买人 | 股票成本 | 成交)总额 | | 32,156,086.08 | | | | |
|-----|--------|----------------|------|---------------|------------------|--|--|--|
| 卖出 | 股票收入 | 成交)总额 | | 17,272,086.87 | | | | |
| 费用。 | | | | | | | | |
| 7. | .5 期末按 | ·债券品种分类的债券投资组合 | A A | | 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 | | 1,138,718.00 | 0.09 | | | |
| | 2 | 央行票据 | | - | _ | | | |
| | | | | | | | | |

1,393,788,460.8 113.03 221,917,000.0 18.00 0.2 1,700,192,879.2 137.88 金额单位:人民币5

60,144,000,0

| 5 | 122821 | 11吉城建 | 613,130 | 64,991,780.00 | 5.2 |
|--------|--------|----------|-----------|---------------|------------------|
| 7.7 期末 | 按公允价值占 | 基金资产净值比例 | 引大小排名的前十名 | 名资产支持证券投资明约 | H |
| | | | | | 金额单位:人民司 |
| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(分) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 %) |
| 1 | 119029 | 澜沧江1 | 50,000 | 5,000,000.00 | 0.4 |
| 2 | 119030 | 澜沧江2 | 50,000 | 5,000,000.00 | 0.4 |
| 3 | 119031 | 澜沧江3 | 40,000 | 4,000,000.00 | 0.3 |
| 4 | - | - | - | - | |
| 5 | - | - | - | - | |
| 6 | - | - | - | - | |
| 7 | - | - | - | - | |
| 8 | - | - | - | - | |
| 9 | - | _ | _ | _ | |

其中:政策性金融

截至本报告期末2013年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额541 ,000.00元,于2013年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质 押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

源一层级,对存在活跃市场形价的金融工具,可以相同资产价值在活跃市场上的报价确定公允价值。 第一层级,对存在活跃市场无极价的金融工具,可以相同资产价值在活跃市场上的报价确定公允价值。 第二层级,对估值日活跃市场无极价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调 整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依 据做必要调整确定公允价值。 第三层级,对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层级;

债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。 6.4.6.2各层级金融工具公允价值 截至2013年6月30日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为1,118,286,562.14元,第二

层级的余额为606,034,700.0元、第三层级的余额为0元。截至2012年12月31日止:第一层级的余额为935,025,583,00元,第三层级的余额为376,218,400.00元,第三层级的余额为0元。) 6.4.6.3公允价值所属尽级间的重大变动 6.44.3.2公儿川區川陽/高級同时里人交易 本基金本期足 牛摩可比斯间特有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。 6.46.4第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 %) |
|----|-------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 权益投资 | 10,128,382.94 | 0.54 |
| | 其中:股票 | 10,128,382.94 | 0.54 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,714,192,879.20 | 91.01 |
| | 其中:债券 | 1,700,192,879.20 | 90.27 |
| 3 | 资产支持证券 | 14,000,000.00 | 0.74 |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买人返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 119,428,612.15 | 6.34 |
| 7 | 其他各项资产 | 39,790,821.27 | 2.11 |
| 8 | 合计 | 1,883,540,695.56 | 100.00 |

| 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 | - | - |
| В | 采矿业 | - | - |
| С | 制造业 | - | - |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,128,382.94 | 0.82 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| Н | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 10,128,382.94 | 0.82 |

| π | 金额单位:人民币元 | | | | | | | | | |
|---|-----------------|---------------|-----------|------|--------|----|--|--|--|--|
|] | 占基金资产净值比例 %) | 公允价值 | 数量 段) | 股票名称 | 股票代码 | 序号 | | | | |
| 1 | 0.82 | 10,128,382.94 | 2,996,563 | 国投电力 | 600886 | 1 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 2 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 3 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 4 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 5 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 6 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 7 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 8 | | | | |
| 1 | - | - | - | - | - | 9 | | | | |
| 1 | | | _ | _ | _ | 10 | | | | |

| 序号 | 饭夯代码 | 饭夯名称 | 奴重 伝) | 公允加值 | (%) | | | |
|------------|---|-----------|---------------|---------------|------------------|--|--|--|
| 1 | 1382222 | 13渝水投MTN2 | 800,000 | 79,904,000.00 | 6.48 | | | |
| 2 | 1380160 | 13鲁信集团债 | 700,000 | 69,538,000.00 | 5.64 | | | |
| 3 | 122097 | 11浦路桥 | 629,990 | 66,148,950.00 | 5.36 | | | |
| 4 | 122680 | 12昆建债 | 620,000 | 65,713,800.00 | 5.33 | | | |
| 5 | 122821 | 11吉城建 | 613,130 | 64,991,780.00 | 5.27 | | | |
| 7.7 997/13 | 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 金额单位:人民币元 | | | | | | | |
| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量 (分) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 %) | | | |
| 1 | 119029 | 澜沧江1 | 50,000 | 5,000,000.00 | 0.41 | | | |
| 2 | 119030 | 澜沧江2 | 50,000 | 5,000,000.00 | 0.41 | | | |
| 3 | 119031 | 澜沧江3 | 40,000 | 4,000,000.00 | 0.32 | | | |
| 4 | - | - | I | - | - | | | |
| 5 | - | - | - | - | - | | | |

本基金本报告期末未持有权证。 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 7.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末无股指期货投资。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末无股指期货投资。 7.10 投资组合报告附注 7.10.1 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 7.10.2 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。 7.10.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元 57,511.2 35,923,325.2

39,790,821.27 金额单位:人民币5 占基金资产净值比例 %)

7.105. 期末前十2股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十2股票中不存在流通受限情况。 7.106. 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,分项之和与计项之间可能存在尾差。 8.1. 期末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

15,642,325.56 1.30% 1,183,056,227 98.70%

| 注:截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负 | 负责人未持有本基金份额;本基金的基金 |
|--------------------------------|--------------------|
| 经理未持有本基金份额。 | |
| § 9 开放式基金份额变动 | |
| | 单位:伤 |
| 基金合同生效日 2006年7月20日)基金份额总额 | 4,206,671,453.29 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,277,932,701.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 602,881,849.69 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 682,115,998.80 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | _ |

本报告期期末基金份额总额

10.1 基金好鄉得有人不会供以 本报告期内,本基金未召开基金份鄉持有人大会。 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 本基金管理人于2013年5月25日发布公告,刘文动先生不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。 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。

本报告明元迈及平基宣年代、疮室则广、疮ェ几目里为印500年9000 10.4 基金投资额路的改变 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未发生改变。 10.6 管理人,托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 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 基金租升 | 北牙公口 | J文勿毕兀姓仃胶录(| 文页及1H亚又1/11年0 | TL | 金额单位 | 江:人民币: |
|---|-----------------------------------|------|---------------|------------------|-----------|----------------|--------|
| | | 交易单 | 股票 | 交易 | 应支付该 | 券商的佣金 | |
| | 券商名称 | 元数量 | 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 | 备注 |
| Œ | 泰君安证券 | 2 | 17,272,086.87 | 100.00% | 89,285.24 | 100.00% | - |
| _ | 注 ①为了贯彻市国河收入的方关规定 我从司制定了连接来资的标准 即 | | | | | | |

i 经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

iii 有良好的内控制度,在业内有良好的声誉

即有良好的內经制度,在即內有良好的戶營。 並有整題的研究能力,能及好。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 及實的特殊要求,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: 1 对交易单元选择程序: 1 对交易单元选择程序: 1 对交易单元选择转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。

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择称作对交易单元疾选券的时服务质量和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本报告期内,本基金国租的券商交易单元未发生变更。 ④此处佣金指基金通过单一券商进行股票、债券等交易而合计支付该券商的佣金合计。 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

华夏基金管理有限公司