华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
报告期末基金份额总额	25,816,779,729.62份
投资目标	采用指数化投资方式,追求对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率,评价时应按期间折算）。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时,基管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日–2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-78,167,801.46
2.本期利润	1,915,478,761.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0671
4.期末基金资产净值	18,747,214,862.79
5.期末基金份额净值	0.726

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

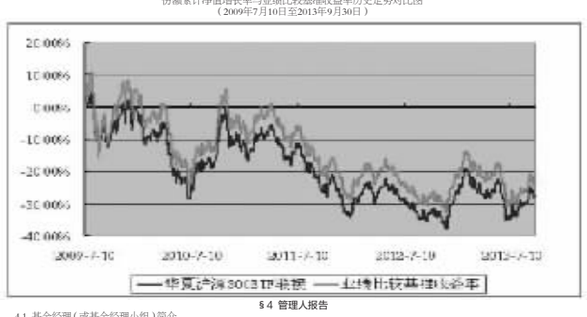
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	10.17%	1.38%	9.25%	1.36%	0.92%	0.02%

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

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

（2009年7月10日至2013年9月30日）



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009–07–10	–	14年	硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009–07–10	–	13年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。

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。

4.2 管理人对投资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《中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》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格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 公平交易专项说明

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 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量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深300指数,业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率,评价时应按期间折算）。沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成,自2005年4月8日起正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深300指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF（华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金）的份额,从而实现基金投资目标,基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

3季度,国际方面,美国经济继续温和复苏,美联储推迟退出量化宽松政策,欧盟经济出现复苏迹象。国内方面,经济出现较明显的反弹,政府在目标区上,土地流转、住宅股等方面陆续释放出积极政策信号。

市场方面,受国内经济增长超预期表现及积极政策预期的影响,A股总体呈震荡上升走势。本报告期,沪深300指数上涨9.47%。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.726元,本报告期份额净值增长率为10.17%,同期业绩比较基准增长率为9.25%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.92%。本基金与业绩比较基准产生偏离的主要原因为目标ETF偏离、成份股分红、日常运作费用、大额申赎赎回等产生的差异。

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4季度,国内经济反弹的力度与持续时间仍有待观察,通货膨胀有望控制在目标范围内。市场资金面难以出现显著宽松,投资者对未来市场并未形成统一的预期,预计沪深300指数以震荡走势为主。如果出现经济基本面持续反弹或宏观经济政策的超预期,沪深300指数可能有较好的投机机会。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好相关投资工作。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	662,089,070.65	3.52
	其中:股票	662,089,070.65	3.52
2	基金投资	17,159,181,989.30	91.28
3	固定收益投资	573,794,546.30	3.05
	其中:债券	573,794,546.30	3.05
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	10,000,000.00	0.05
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	365,357,167.85	1.94
7	其他各项资产	26,985,384.24	0.14
8	合计	18,797,408,158.34	100.00

5.2 报告期末投资目标基金明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	17,159,181,989.30	91.53

5.3 报告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	3,219,218.68	0.02
B	采矿业	52,506,120.09	0.28
C	制造业	263,863,870.85	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,811,551.44	0.12
E	建筑业	29,277,003.63	0.16
F	批发和零售业	23,740,663.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	15,563,338.43	0.08
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,899,311.95	0.09
J	金融业	183,469,411.38	0.98
K	房地产业	30,919,322.82	0.16
L	租赁和商务服务业	6,270,201.98	0.03
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	6,242,528.80	0.03
O	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	1,024,723.00	0.01
S	综合	6,281,804.60	0.03
	合计	662,089,070.65	3.53

5.4 报告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	2,352,570	25,690,064.40	0.14
2	600016	民生银行	2,658,997	25,420,011.32	0.14
3	601166	兴业银行	1,614,816	18,037,494.72	0.10
4	601318	中国平安	466,388	16,650,051.60	0.09
5	000002	万 科A	1,310,800	11,967,604.00	0.06
6	000651	格力电器	424,342	11,270,523.52	0.06
7	600000	浦发银行	1,076,707	10,863,973.63	0.06
8	601328	交通银行	2,044,566	8,791,633.80	0.05
9	601088	中国神华	520,824	8,682,136.08	0.05
10	601288	农业银行	3,421,200	8,553,000.00	0.05

5.5 报告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	300,450,000.00	1.60
2	央行票据	–	–
3	金融债券	269,276,000.00	1.44
	其中:政策性金融债	269,276,000.00	1.44
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	4,068,546.30	0.02
8	其他	–	–
9	合计	573,794,546.30	3.06

5.6 报告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	019302	13国债02	3,000,000	300,450,000.00	1.60
2	130201	13国开01	2,000,000	199,500,000.00	1.06
3	130214	13国开14	700,000	69,776,000.00	0.37
4	110024	隧道转债	39,970	4,068,546.30	0.02
5	–	–	–	–	–

5.7 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	4,213,158.90
2	应收证券清算款	2,868,280.93
3	应收股利	72,484.48
4	应收利息	11,541,816.62
5	应收申购款	8,289,643.31
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	26,985,384.24

5.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	31,350,919,797.02
本报告期基金总申购份额	1,958,333,940.58
减:本报告期基金总赎回份额	7,492,474,007.98
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	25,816,779,729.62

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内披露的主要事项

2013年8月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构单笔申购申请最低限额及定期定额申购每次最低扣款额的公告。

2013年9月11日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大连银行股份有限公司为代销机构的公告。

2013年9月24日发布华夏基金管理有限公司关于对中国农业银行金穗借记卡基金电子交易继续实施费率优惠的公告。

2013年9月25日发布华夏基金管理有限公司公告。

本基金本报告期末无国债期货投资,本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 其他相关信息

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基金管理公司之一。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理9只ETF产品,分别为华夏沪深300ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏能源ETF、华夏材料ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF和华夏恒生ETF,初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品线。

在客户服务方面,3季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:（1）微信公众平台新增办理华夏现金增利证券投资基金的申购和快速赎回业务,方便投资者进行现金管理;（2）直销网上交易进一步扩大了货币基金可还款信用卡的范围,并开通了中国工商银行信用卡的跨行自动还款功能。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

8.1.2《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》;

8.1.3《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

8.1.4法律意见书;

8.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

8.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年十月二十四日

华夏盛世精选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏盛世股票
基金主代码	000061
交易代码	000061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	8,445,040,001.54份
投资目标	紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。
投资策略	本基金以周期优选投资策略为核心,并辅以个股精选和积极债券管理策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数x80%+上证国债指数x20%。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日–2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-311,786,298.79
2.本期利润	651,548,310.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0750
4.期末基金资产净值	6,357,537,903.14
5.期末基金份额净值	0.753

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

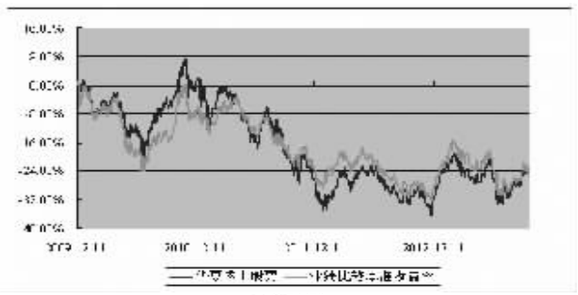
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	11.06%	1.22%	7.70%	1.15%	3.36%	0.07%

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

华夏盛世精选股票型证券投资基金

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

（2009年12月11日至2013年9月30日）



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
阵琨	本基金的基金经理、投资总监、股票投资部副总经理	2009–12–18	–	18年	北京大学MBA。曾任宝盈基金基金经理助理，益民基金投资部部门经理，中国对外经济贸易信托投资公司财务部部门经理等。2006年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略研究员、兴和证券投资基金基金经理（2009年1月1日至2012年1月12日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007年6月12日至2013年4月11日期间）等。

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。

4.2 管理人对投资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《中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》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格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 公平交易专项说明

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 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量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,央行适时调整了2季度末严厉紧缩流动性的政策取向,社会融资总量继续保持合理增长,实体经济也呈现企稳反弹的信号,但投资者担忧经济增长的长期前景不佳,周期类股票表现大幅落后。经过了6月底“钱荒”事件冲击后,投资者偏好进一步转向代表经济转型方向的新兴产业类股票,创业板指数选创新高。股票市场继续呈两级分化走势。3季度中后期,在国家推进上海自贸区建设,改革预期重启的刺激下,金融、地产等低估值板块有所表现,但仅集中于主题类投资。

报告期内,本基金整体股票持仓偏重于低估值板块,部分股票在市场反弹中表现较好,但整体持仓结构与市场热点有一定差距,组合业绩受到一定影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.753元,本报告期份额净值增长率为11.06%,同期业绩比较基准增长率为7.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度,我们认为经济整体仍处于弱复苏的区间,但长期增长动力不足。投资者对实体经济,以及对蓝筹类股票的悲观预期短期内难以改变,我们期待十八届三中全会能够重新树立全社会对继续改革和发展经济的信心。相比估值呈现泡沫迹象的小盘股,我们认为传统产业的转型进展可能改变投资者对低估值类股票的过度悲观,传统企业中的优秀者已经开始或正在进行深刻的变革,并得到市场的认可,这类投资标的相对于高估值品种能够提供较好的安全边际和性价比,我们将继续发掘这类投资机会。

根据上述判断,我们将继续加大研究力度,深入理解经济转型对证券市场的影响,坚持价值投资,做好个股选择。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	5,580,179,780.01	86.53
	其中:股票	5,580,179,780.01	86.53
2	固定收益投资	383,521,236.70	5.95
	其中:债券	383,521,236.70	5.95
	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	478,793,496.93	7.42
6	其他各项资产	6,474,832.87	0.10
7	合计	6,448,969,346.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
B	采矿业	174,135,814.71	2.74
C	制造业	2,724,828,811.84	42.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	299,470,446.89	4.71
E	建筑业	144,487,319.24	2.27
F	批发和零售业	362,605,786.57	5.70
G	交通运输、仓储和邮政业	15,130,000.00	0.24
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	219,984,494.80	3.46
J	金融业	985,655,238.93	15.50
K	房地产业	394,625,906.34	6.21
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	23,098,521.60	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	187,387,339.60	2.95
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	7,335,875.56	0.12
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	41,434,223.93	0.65
	合计	5,580,179,780.01	87.77

5.3 报告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	601166	兴业银行	36,358,225	406,121,373.25	6.39
2	600518	康美药业	18,574,609	347,902,426.57	5.47
3	600089	特变电工	24,999,826	301,747,899.82	4.75
4	600016	民生银行	28,999,876	277,238,814.56	4.36
5	000024	招商地产	10,098,217	242,357,208.00	3.81
6	600690	青岛海尔	16,553,244	220,489,210.08	3.47
7	600252	中恒集团	13,820,196	206,611,930.20	3.25
8	600406	国电南瑞	13,419,191	193,907,309.95	3.05
9	000069	华侨城A	32,308,162	187,387,339.60	2.95
10	600036	招商银行	16,776,028	183,194,225.76	2.88

5.4 报告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	79,960,000.00	1.26
2	央行票据	–	–
3	金融债券	269,629,000.00	4.24
	其中:政策性金融债	269,629,000.00	4.24
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	33,932,236.70	0.53
8	其他	–	–
9	合计	383,521,236.70	6.03

5.5 报告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	130210	13国开10	1,700,000	169,949,000.00	2.67
2	130214	13国开14	1,000,000	99,680,000.00	1.57
3	019219	12国债19	800,000	79,960,000.00	1.26
4	113002	工行转债	207,410	22,987,250.30	0.36
5	110023	民生转债	103,440	10,944,986.40	0.17

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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	1,527,528.90
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	52,250.00
4	应收利息	4,617,196.81
5	应收申购款	277,857.16
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,474,832.87

5.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 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。

5.9.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	8,919,545,313.13
本报告期基金总申购份额	164,847,193.05
减:本报告期基金总赎回份额	639,352,504.64
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	8,445,040,001.54

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 报告期内披露的主要事项

2013年8月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构单笔申购申请最低限额及定期定额申购每次最低扣款额的公告。

2013年9月11日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大连银行股份有限公司为代销机构的公告。

2013年9月24日发布华夏基金管理有限公司关于对中国农业银行金穗借记卡基金电子交易继续实施费率优惠的公告。

2013年9月25日发布华夏基金管理有限公司公告。

本基金本报告期末无国债期货投资,本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 其他相关信息

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基金管理公司之一。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理9只ETF产品,分别为华夏沪深300ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏能源ETF、华夏材料ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF和华夏恒生ETF,初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品线。

在客户服务方面,3季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:（1）微信公众平台新增办理华夏现金增利证券投资基金的申购和快速赎回业务,方便投资者进行现金管理;（2）直销网上交易进一步扩大了货币基金可还款信用卡的范围,并开通了中国工商银行信用卡的跨行自动还款功能。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

8.1.2《华夏盛世精选股票型证券投资基金合同》;

8.1.3《华夏盛世精选股票型证券投资基金托管协议》;

8.1.4法律意见书;

8.1.5基金管理人业务资格批件、