华夏大盘精选证券投资基金

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	华夏大盘精选混合	
基金主代码	000011	
交易代码	000011	000012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年8月11日	
报告期末基金份额总额	383,585,588.22份	
投资目标	追求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金主要采取"自下而上"的个股精选策略,根据细致的财务分析和深入的上市公司调研,精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性,基金还将在资产配置层面捕以风险管理策略,即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析,监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险水平合理。	
业绩比较基准	本基金整体的业绩比较基准为"富时中国A200指数×80%+富时中国国债指数×20%"。	
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金,低于成长型股票基金。	
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	

§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	252,104,480.84
2.本期利润	359,996,321.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.8806
4.期末基金资产净值	3,575,368,016.56
5.期末基金份额净值	9.321

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

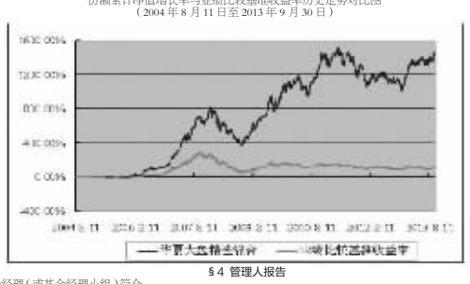
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.62%	1.25%	7.09%	1.14%	3.53%	0.11%

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

华夏大盘精选证券投资基金

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

(2004年8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		
孙彬	本基金的基金经理、投资研究部总监	2013-09-23	-	6年	中国人民大学金融学硕士。2007年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任行业研究员、投资研究部总经理助理、基金经理助理、投资研究部副总监等。
程海泳	本基金的基金经理、公司总经理助理、投资总监、股票投资部总经理	2013-06-28	2013-09-23	16年	北京大学经济学学士。曾任职于原君安证券有限责任公司、深圳市胜源投资发展有限公司、深圳市世代创业投资有限公司、宝盈基金、景顺长城基金,从事证券研究和投资工作。2004年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任兴安证券投资基金基金经理(2004年9月16日至2005年8月13日期间)、全国社保股票组合基金经理、机构投资部副总经理、国际投资总监等。

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。

③根据本基金管理人于2013年9月24日发布的《华夏基金管理有限公司关于调整基金经理的公告》,增聘孙彬先生为本基金基金经理,程海泳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,国际方面,在美国延迟量化宽松退出预期逐步提升,国内经济总体指标持续向暖的概率不大,政府加快体制改革、调整经济结构将成为未来一段时期的主基调。层出不穷的新产业和新商业模式、跨行业并购等投资主题预示着一个新的改革周期即将到来,但市场整体风险偏好将逐步降温,创业板、新兴产业股票风险积聚。

本基金在选股中将尽量淡化主题色彩,仔细甄别其中真正素质过硬、受益新经济的企业,坚持"自下而上"地构建跨年度成长组合。

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	3,304,919,443.94	91.12
	其中:股票	3,304,919,443.94	91.12
2	固定收益投资	209,653,000.00	5.78
	其中:债券	209,653,000.00	5.78
	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	92,842,558.74	2.56
6	其他各项资产	19,662,616.83	0.54
7	合计	3,627,077,619.51	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,515,101,655.84	70.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	109,453,688.32	3.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	286,123,893.83	8.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	158,697,741.00	4.44
M	科学研究和技术服务业	160,634,142.90	4.49
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	74,908,322.05	2.10
S	综合	-	-
	合计	3,304,919,443.94	92.44

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	601633	长城汽车	6,878,951	351,376,817.08	9.83
2	002241	歌尔声学	7,735,631	327,062,478.68	9.15
3	000538	云南白药	2,426,095	283,998,680.70	7.94
4	000651	格力电器	10,516,117	279,308,067.52	7.81
5	002236	大华股份	5,805,155	264,598,964.90	7.40
6	300228	富瑞特装	2,116,495	164,218,847.05	4.59
7	300215	电科院	6,953,859	160,634,142.90	4.49
8	300058	蓝色光标	2,368,623	158,697,741.00	4.44
9	002415	海康威视	5,821,463	153,686,623.20	4.30
10	000661	长春高新	1,311,193	144,637,699.83	4.05

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	10,015,000.00	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,638,000.00	5.58
	其中:政策性金融债	199,638,000.00	5.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	209,653,000.00	5.86

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	130201	13国开01	1,200,000	119,700,000.00	3.35
2	090407	09农发07	600,000	60,072,000.00	1.68
3	130218	13国开18	200,000	19,866,000.00	0.56
4	019302	13国债02	100,000	10,015,000.00	0.28
5	-	-	-	-	-

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 2013年9月24日长春高新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。

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	966,067.24
2	应收证券清算款	10,524,278.74
3	应收股利	-
4	应收利息	3,652,165.17
5	应收申购款	4,520,105.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,662,616.83

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	435,163,531.70
本报告期基金总申购份额	37,928,005.29
减:本报告期基金总赎回份额	89,505,948.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	383,585,588.22

§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调整基金经理的公告。

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基金管理公司之一。

2013年3季度,华夏基金较好地把握了市场机会,旗下主动管理的股票及混合型基金净值涨幅全部超越沪深300指数,其中9只基金今年以来的净值增长率超过20%;短期理财及货币型基金持续表现良好。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2013年10月4日数据),华夏稳增混合今年以来的净值增长率在12只灵活配置型混合基金(股票上限95%)中排名第1;华夏成长混合今年以来的净值增长率在30只偏股型基金(股票上限80%)中排名第6;华夏经典混合今年以来的净值增长率在71只灵活配置型混合基金(股票上限80%)中排名第7。

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《华夏大盘精选证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏大盘精选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、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

华夏现金增利证券投资基金

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	华夏现金增利货币
基金主代码	003003
交易代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月7日
报告期末基金份额总额	47,024,048,593.93份
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下,追求超过基准的较高收益。
投资策略	积极判断短期利率变动,合理安排期限,细致研究,谨慎操作,以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为"同期7天通知存款利率"。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。
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	530,322,618.43
2.本期利润	530,322,618.43
3.期末基金资产净值	47,024,048,593.93

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

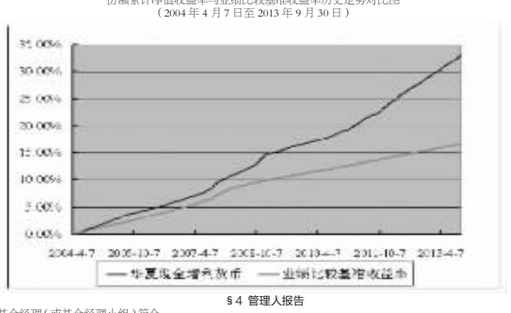
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1148%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.7745%	0.0019%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏现金增利证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年4月7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		
曲波	本基金的基金经理、固定收益部总经理助理	2008-01-18	-	10年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理等。

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《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,外汇占款逐步恢复流入,银行系统持续增加备付金。央行虽然持续通过短期逆回购向市场注入资金,但通过发行3年期央票回收长期流动性,表明货币政策仍维持中性。9月底,资金面受双节及季末双重因素影响在一定程度上收紧。报告期内,各类短期债券收益率均有所上行。

本基金的资产配置上绝大部分为短期存款,且久期较低、期限匹配较好。此外,报告期内,本基金适当增持了以SHIBOR利率为基准的浮息金融债,并从9月开始逐步增持短期融资券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金本报告期份额净值收益率为1.1148%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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,预计货币政策仍将维持中性,资金面大概率上中性偏宽松。债券市场经历3季度的大幅度下跌后有望企稳。从类别来看,国债、短期央票和短期金融债由于绝对利率较低,对货币基金吸引力不大。中高等级短期融资券收益率较高,体现出一定投价值。

本基金将维持较高仓位的高流动性短期存款,适当增持中高等级短期融资券,在保证流动性的前提下争取获得较好的投资收益。

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	固定收益投资	12,836,556,344.90	23.67
	其中:债券	12,836,556,344.90	23.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	40,937,387,975.47	75.47
4	其他各项资产	466,500,350.44	0.86
5	合计	54,240,444,670.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		
1	报告期内债券回购融资余额	占基金资产净值的比例(%)	
			10.49
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,178,055,785.79	15.26
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	19.61	15.26
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.26	-
2	30天(含)-60天	8.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.88	-
3	60天(含)-90天	37.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.94	-
4	90天(含)-180天	34.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	13.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	114.35	15.26

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	539,997,883.94	1.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,743,290,995.41	16.47
	其中:政策性金融债	7,743,290,995.41	16.47
4	企业债券	213,117,398.24	0.45
5	企业短期融资券	4,340,150,067.31	9.23
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	12,836,556,344.90	27.30
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	6,148,268,141.33	13.07

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	110221	11国开21	21,300,000	2,093,496,928.67	4.45
2	130214	13国开14	16,000,000	1,599,128,117.79	3.40
3	130215	13国开15	10,200,000	1,003,978,024.35	2.14
4	090205	09国开05	8,600,000	853,985,908.16	1.82
5	110212	11国开12	6,000,000	591,726,964.54	1.26
6	019219	12国债19	5,400,000	539,997,883.94	1.15
7	110402	11农发02	4,500,000	443,583,713.13	0.94
8	130212	13国开12	4,200,000	412,800,440.68	0.88
9	100236	10国开36	3,900,000	386,571,439.91	0.82
10	041273004	12马钢CP001	3,500,000	349,956,518.97	0.74

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.20%
报告期内偏离度的最低值	0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	449,627,806.63
4	应收申购款	16,872,543.81
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	466,500,350.44

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 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	40,203,049,936.36
本报告期基金总申购份额	51,680,197,404.33
减:本报告期基金总赎回份额	44,859,198,746.76
本报告期期末基金份额总额	47,024,048,593.93

§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7月10日发布关于调整华夏现金增利证券投资基金、华夏货币市场基金、华夏理财30天债券型证券投资基金、华夏理财21天债券型证券投资基金申购业务限额的公告。

2013年7月11日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏现金增利证券投资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6日发布华夏基金管理有限公司关于在直销机构调整华夏现金增利证券投资基金赎回最低保留份额的公告。

2013年9月9日发布关于华夏现金增利证券投资基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告。

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23日发布关于华夏现金增利证券投资基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告。

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《上证50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

8.1.3《上证50交易型开放式指数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、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

上证50交易型开放式指数证券投资基金

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

基金简称	华夏上证50ETF
基金主代码	510050
交易代码	510050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2004年12月30日
报告期末基金份额总额	12,740,566,757份
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	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为"上证50指数"。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证50指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。
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

§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