上证50交易型开放式指数证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31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:二〇一四年三月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月24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。

本报告中的财务资料经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§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
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
报告期末基金份额总额	13,485,566,757份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2005年2月23日

2.2 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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	赵会军
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	289,419,362.96	-734,667,219.27	-2,177,699,300.68
本期利润	-2,181,982,143.52	3,207,537,316.02	-3,654,642,521.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1936	0.2756	-0.3431
本期基金份额净值增长率	-12.34%	17.00%	-17.24%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.7280	1.0099	0.7874
期末基金资产净值	21,208,288,299.47	19,359,207,713.60	20,932,372,356.48
期末基金份额净值	1.573	1.855	1.632

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。

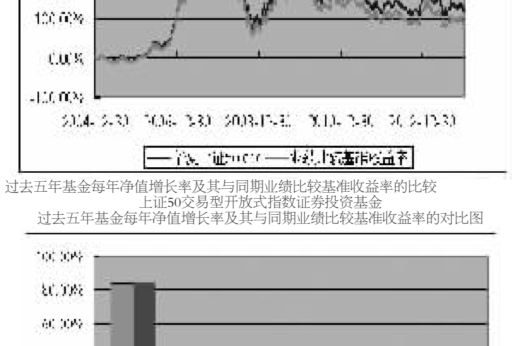
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.29%	1.19%	-4.16%	1.21%	-0.13%	-0.02%
过去六个月	2.72%	1.45%	1.44%	1.45%	1.28%	0.00%
过去一年	-12.34%	1.55%	-15.23%	1.57%	2.89%	-0.02%
过去三年	-15.12%	1.35%	-20.36%	1.36%	5.24%	-0.01%
过去五年	21.90%	1.55%	13.71%	1.57%	8.19%	-0.02%
自基金合同生效起至今	120.20%	1.80%	86.63%	1.85%	33.57%	-0.05%

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

上证50交易型开放式指数证券投资基金
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12月30日至2013年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上证50交易型开放式指数证券投资基金
过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	0.530	689,507,022.41	-	689,507,022.41	-
2012年	0.480	529,255,216.74	-	529,255,216.74	-
2011年	-	-	-	-	-
合计	1.010	1,218,762,239.15	-	1,218,762,239.15	-

§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、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。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。

截至2013年12月31日,华夏基金管理的境内ETF产品规模超过440亿元,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,华夏基金积累了丰富的经验,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。

凭借规范的经营管理及良好的品牌声誉,2013年华夏基金荣获多家机构评选的多个奖项,主要奖项包括:在《证券时报》主办的"2012年度中国基金业明星基金奖"的评选中,华夏基金荣获"五年持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5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,2013年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户的交易便利性:(1)推出了货币基金的"还贷款"及信用卡还款业务,方便投资者进行现金管理;(2)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;(3)开通了华夏基金微信公众服务平台并推出微信交易功能,在淘宝网、天天基金网等平台开通基金业务,并与百度达成互联网业务合作,为投资者提供更多交易渠道。

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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2004-12-30	-	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。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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,本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

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。

报告期内,本基金出现8次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,为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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

本基金跟踪的标的指数为上证50指数,上证50指数由上海证券市场规模大、流动性好、最具代表性的50只股票组成,自2004年1月2日起正式发布,以综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体状况,其目标是建立一个成交活跃、规模较大、主要作为衍生金融工具基础的投资指数。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。

2013年,国际方面,美国经济继续向好,美联储宣布从2014年1月开始削减量化宽松额度;欧盟经济也出现了温和复苏;新兴经济体则普遍增长乏力。国内方面,经济运行整体平稳,但长期积累的深层次矛盾并未缓解,出口、制造业、企业盈利等数据全年多次反复,经济企稳回升的基础仍不巩固;政府自3季度以来连续推出自贸区、土地流转、优先股等积极政策,十八届三中全会的召开也强化了市场对改革政策陆续推出的预期;居民消费价格指数(CPI)全年维持在较低水平;货币供应基本达到调控要求,但期间受美联储退出量化宽松政策预期、国内外汇占款下降、影子银行等诸多因素影响,短期利率在6月份和12月份大幅飙升。

市场方面,A股市场全年整体震荡下跌。年初,市场延续了一段2012年底的反弹行情后,受经济数据偏弱的影响,出现一轮调整;之后两个月,在偏弱的经济数据和较乐观的政策预期的综合影响下,市场呈现震荡行情;6月以后,受经济数据低于预期、资金面偏紧的影响,市场经历了一轮较大幅度下跌;3季度,由于经济数据连续回升、积极政策频出,A股走出一波较大反弹行情;4季度前期,受经济数据表现不佳和三中全会召开导致的乐观预期的综合影响,市场呈现震荡行情;但12月份,由于宏观经济表现低于预期及资金面紧张,A股出现一波较大幅度下跌。报告期内,上证50指数下跌15.23%。

报告期内,本基金严格按照基金合同要求,在指数权重及成份股变动时,努力降低成本、减少市场冲击,逐步调整组合至目标结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为1.573元,本报告期份额净值增长率为-12.34%,同期上证50指数增长率为-15.23%。本基金本报告期跟踪偏离度为+2.89%。本基金与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用以及替代性策略等产生的差异。

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2014年,国内经济增速可能有所放缓,全面深化改革开放的具体政策将陆续出台,但其效果难以立即体现;预计通货膨胀仍将处于较低水平;资金面将是中性偏紧状态,需密切关注美联储退出量化宽松政策以及国内外汇占款变动的影响。市场的不确定性较大,预期将大概率出现震荡行情。但如果经济能够继续维持稳定增长或政府出台超预期的改革政策, 上证50指数代表的金融及大盘蓝筹股或将有相对较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差, 以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时,我们也积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥ETF的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人结合法律法规和业务发展需要,修订了公司的风险管理制度、员工投资行为管理制度等内部制度,进一步完善了公司内部制度体系;围绕防控"三条底线"和内幕交易,组织多项合规培训和合规考试,加强员工的风险意识和合规意识;针对投资研究等重点业务,加大检查力度,促进公司业务合法合规、稳健经营;积极参与新产品、新业务的设计,提出合规建议,对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作,有效防范风险,规避违规行为的发生。

报告期内, 本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定,本基金的收益分配原则为:每份基金份额享有同等分配权。基金当年收益先弥补以前年度亏损后,方可进行当年收益分配。如果基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上,方可进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配1次,最多分配2次,若自基金合同生效日起不满3个月可不进行收益分配。基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配部分的100%。本基金收益分配采取现金方式。法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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1次,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

本报告期内, 本基金托管人在对上证50交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,上证50交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在上证50交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,上证50交易型开放式指数证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为689,507,022.41元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的上证50交易型开放式指数证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明(2014)审字第60739337_B01号

上证50交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的上证50交易型开放式指数证券投资基金财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表和2013年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了上证50交易型开放式指数证券投资基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 边卓群 濮晓达
北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
2014年3月24日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		331,751,437.51	501,535,498.46
结算备付金		637,768.74	-
存出保证金		1,261,217.42	125,000.00
交易性金融资产		20,889,193,564.20	18,981,209,175.07
其中:股票投资		20,781,943,564.20	18,981,209,175.07
基金投资		-	-
债券投资		107,250,000.00	-
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		5,880,796.69	-
应收利息		138,759.62	67,023.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		21,228,863,544.18	19,482,936,696.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		6,804,653.11	113,313,505.61
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,018,796.23	7,670,263.31
应付托管费		1,803,759.24	1,534,052.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		831,551.51	367,729.11
应交税费		15,174.00	15,174.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,101,310.62	828,258.50
负债合计		20,575,244.71	123,728,983.18
所有者权益:			
实收基金		11,391,368,826.13	8,817,542,939.51
未分配利润		9,816,919,473.34	10,541,664,774.09
所有者权益合计		21,208,288,299.47	19,359,207,713.60
负债和所有者权益总计		21,228,863,544.18	19,482,936,696.78

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.573元,基金份额总额13,485,566,757份。

7.2 利润表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		-2,058,900,301.46	3,332,847,319.07
1.利息收入		2,443,301.54	2,251,206.44
其中:存款利息收入		2,321,868.07	2,196,250.68
债券利息收入		121,433.47	54,955.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		407,939,148.11	-616,860,091.62
其中:股票投资收益		-207,225,223.64	-1,100,953,791.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益		10,283,278.02	4,467,524.04
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		604,881,093.73	479,626,176.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,471,401,506.48	3,942,204,535.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,118,755.37	5,251,668.96
减:二、费用		123,081,842.06	125,310,003.05
1.管理人报酬		96,872,425.96	100,076,633.37
2.托管费		19,374,485.26	20,015,326.61
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,359,068.33	3,222,699.12
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		2,475,862.51	1,995,343.95
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-2,181,982,143.52	3,207,537,316.02
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-2,181,982,143.52	3,207,537,316.02

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证50交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	8,817,542,939.51	10,541,664,774.09	19,359,207,713.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,181,982,143.52	-2,181,982,143.52
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)	2,573,825,886.62	2,146,743,865.18	4,720,569,751.80
其中:1.基金申购款	29,275,052,099.76	30,575,398,658.57	59,850,450,758.33
2.基金赎回款	-26,701,226,213.14	-28,428,654,793.39	-55,129,881,006.53
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)	-	-689,507,022.41	-689,507,022.41
五、期末所有者权益(基金净值)	11,391,368,826.13	9,816,919,473.34	21,208,288,299.47

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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)	10,833,861,413.80	10,098,510,942.68	20,932,372,356.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,207,537,316.02	3,207,537,316.02
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)	-2,016,318,474.29	-2,235,128,267.87	-4,251,446,742.16
其中:1.基金申购款	13,986,678,381.58	14,599,852,451.09	28,586,530,832.67
2.基金赎回款	-16,002,996,855.87	-16,834,980,718.96	-32,837,977,574.83
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)	-	-529,255,216.74	-529,255,216.74
五、期末所有者权益(基金净值)	8,817,542,939.51	10,541,664,774.09	19,359,207,713.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

杨明辉 崔雁巍 崔雁巍
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东、一级交易商
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
无锡市国联发展(集团)有限公司	基金管理人的股东

注:①根据华夏基金管理有限公司于2013年9月25日发布的公告,经中国证监会核准,华夏基金管理有限公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资比例59%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例11%)、山东省农村经济开发投资公司(出资比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛海鹏科技投资有限公司(出资比例10%)。

②根据华夏基金管理有限公司于2014年2月12日发布的公告,华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券(出资比例62.2%)、山东省农村经济开发投资公司(比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛海鹏科技投资有限公司(出资比例10%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例7.8%)。

③下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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。

7.4.4.1.4 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。

7.4.4.1.5 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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	96,872,425.96	100,076,633.37

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0.5%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 × 0.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	19,374,485.26	20,015,326.61

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0.1%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 × 0.1% / 当年天数。

7.4.4.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.4.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	6,222,839.00	0.05%	5,084,200.00	0.05%

注:中信证券持有本基金份额变动的交易通过交易所系统进行,相关规定由上交所、登记结算机构等制定。

7.4.4.5 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	331,751,437.51	2,271,875.71	501,535,498.46	2,158,084.81

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.5 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 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
600058	五矿发展	2013-07-24	筹划重大资产重组事项	13.56	2014-01-06	14.92	2,971,853	46,462,458.91	40,298,326.68	-
600547	山东黄金	2013-12-26	筹划终止重大资产重组事项	17.25	2014-01-02	17.52	6,443,695	152,121,520.68	111,153,738.75	-
601901	方正证券	2013-08-26	筹划重大资产重组事项	5.91	2014-01-13	6.24	24,534,330	149,162,227.91	144,997,890.30	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31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。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31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。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

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:

第一层级:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债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报价的金融工具,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/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2各层级金融工具公允价值

截至2013年12月31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20,889,193,564.20元,第二层级的余额为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18,981,209,175.07元,第二层级的余额为0元,第三层级的余额为0元。)

7.4.6.3公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持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。

7.4.6.4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。

§8 投资组合报告

8.1 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	20,781,943,564.20	97.89
	其中:股票	20,781,943,564.20	97.89
2	固定收益投资	107,250,000.00	0.51
	其中:债券	107,250,000.00	0.51
	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	332,389,206.25	1.57
6	其他各项资产	7,280,773.73	0.03
7	合计	21,228,863,544.18	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 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	-	-
B	采矿业	1,483,691,786.12	7.00
C	制造业	3,724,001,435.62	17.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	562,796,374.94	2.65
F	批发和零售业	40,298,326.68	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	558,955,593.68	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	597,367,222.20	2.82
J	金融业	12,918,084,659.68	60.91
K	房地产业	627,903,049.30	2.96
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	-	-
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	-	-
S	综合	268,279,342.98	1.26
	合计	20,781,377,791.20	97.99

8.3 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	152,548,671	1,661,255,027.19	7.83
2	600016	民生银行	209,840,435	1,619,968,158.20	7.64
3	601318	中国平安	37,411,202	1,561,169,459.46	7.36
4	601166	兴业银行	106,067,050	1,075,519,887.00	5.07
5	600837	海通证券	92,076,555	1,042,306,602.60	4.91
6	600000	浦发银行	103,426,062	975,307,764.66	4.60
7	601288	农业银行	242,702,556	601,902,338.88	2.84
8	601601	中国太保	31,031,447	575,012,712.91	2.71
9	601328	交通银行	149,415,397	573,755,124.48	2.71
10	600030	中信证券	41,984,724	535,305,231.00	2.52

注:①报告期内"中信证券"系投资人申购交付组合证券被动持有。

②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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600383	金地集团	299,328,364.33	1.55
2	600999	招商证券	294,802,103.33	1.52
3	600036	招商银行	284,259,258.41	1.47
4	601318	中国平安	276,990,717.97	1.43
5	600518	康美药业	252,287,750.06	1.30
6	601398	工商银行	227,922,163.19	1.18
7	600637	百视通	193,330,698.07	1.00
8	600406	国电南瑞	156,531,501.15	0.81
9	601336	新华保险	148,360,646.43	0.77
10	601788	光大证券	144,458,295.28	0.75
11	601989	中国重工	142,690,501.04	0.74
12	600018	上港集团	138,111,408.01	0.71
13	601117	中国化学	125,907,661.87	0.65
14	600332	白云山	104,253,289.64	0.54
15	601688	华泰证券	99,341,206.03	0.51
16	601818	光大银行	95,312,664.40	0.49
17	600104	上汽集团	53,545,425.63	0.28
18	601166	兴业银行	41,602,616.96	0.21
19	600549	厦门钨业	41,359,935.03	0.21
20	601766	中国南车	37,349,152.83	0.19

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。

8.4.2 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	601328	交通银行	248,629,453.82	1.28
2	600837	海通证券	190,488,536.95	0.98
3	600019	宝钢股份	174,920,156.41	0.90
4	600016	民生银行	174,175,958.81	0.90
5	600036	招商银行	172,235,719.77	0.89
6	601318	中国平安	141,039,427.44	0.73
7	601166	兴业银行	134,297,855.11	0.69
8	600900	长江电力	123,570,845.00	0.64
9	601669	中国水电	121,293,588.99	0.63
10	601788	光大证券	117,937,046.78	0.61
11	601898	中煤能源	95,901,305.07	0.50
12	600000	浦发银行	95,729,330.48	0.49
13	600348	阳泉煤业	92,760,345.51	0.48
14	600123	兰花科创	79,011,475.61	0.41
15	601088	中国神华	63,783,068.51	0.33
16	601288	农业银行	63,481,605.26	0.33
17	600188	兖州煤业	61,187,385.59	0.32
18	600999	招商证券	58,083,717.12	0.30
19	601800	中国交建	48,227,454.84	0.25
20	601668	中国建筑	39,899,387.90	0.21

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。

8.4.3 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	3,386,814,499.64
卖出股票收入(成交)总额	2,909,825,698.65

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	107,250,000.00	0.51
8	其他	-	-
9	合计	107,250,000.00	0.51

8.6 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	113005	平安转债	1,000,000	107,250,000.00	0.51
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	1,261,217.42
2	应收证券清算款	5,880,796.69
3	应收股利	-
4	应收利息	138,759.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,280,773.73

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
193,654	69,637.43	7,766,553,222.00	57.59%	5,719,013,535.00	42.41%

9.2 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	中央汇金投资有限责任公司	2,855,120,251	21.17%
2	全国社保基金零零一组合	440,000,000	3.26%
3	中国人寿再保险股份有限公司	228,268,652	1.69%
4	北京国际信托有限公司-华夏融信3号资金信托	220,000,000	1.63%
5	佛山市顺德区蚬华多媒体制品有限公司	178,838,657	1.33%
6	三井住友银行株式会社-自有资金	160,000,000	1.19%
7	中国财产再保险股份有限公司	153,799,998	1.14%
8	中国大地财产保险股份有限公司	152,184,300	1.13%
9	中粮集团有限公司	151,500,000	1.12%
10	马秀慧	134,008,852	0.99%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,000	0.00%

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。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2004年12月30日)基金份额总额	5,435,331,306
本报告期期初基金份额总额	10,438,566,757
本报告期基金总申购份额	34,657,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	31,610,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,485,566,757

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

本基金管理人于2013年11月29日发布公告,杨明辉先生担任华夏基金管理有限公司董事长,王东明先生不再担任华夏基金管理有限公司董事长。

本基金管理人于2013年12月7日发布公告,张后奇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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为100,000元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供6年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国泰君安证券	1	6,082,033,246.05	100.00%	671,435.93	100.00%	-

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,本基金还选择了国金证券、信达证券、中银国际、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。

11.7.2 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
国泰君安证券	205,363,574.50	100.00%	-	-

华夏基金管理有限公司
二〇一四年三月二十六日