华夏沪深300指数证券投资基金

【2012】第二季度报告

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:二〇一二年七月十八日

§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2012年7月16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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏沪深300指数
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	25,592,453,205.34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	本基金主要采取复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。但因特殊情况(比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致本基金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(如买入非成份股等)进行适当的替代。
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

§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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-161,875,931.42
2.本期利润	278,933,659.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0108
4.期末基金资产净值	18,381,942,267.16
5.期末基金份额净值	0.718

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。

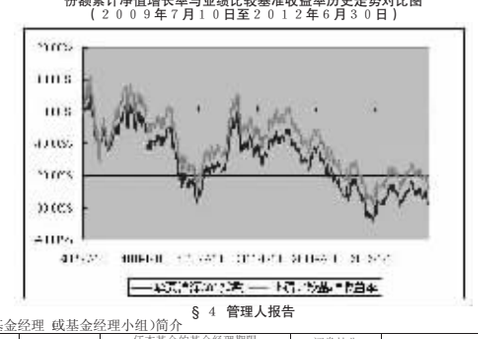
3.2 基金净值表现

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	1.56%	1.07%	0.51%	1.07%	1.05%	0.00%

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
(2009年7月10日至2012年6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		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	12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。
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	13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《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 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,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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

2季度,国际方面,欧洲主权债务问题出现反复,美国经济复苏不及预期,全球大宗商品和重要股票市场均以震荡下跌为主。国内方面,经济继续放缓,通胀持续回落;宏观政策微调力度加大,央行年内第二次下调存款准备金率,并自2008年底以来首次降低存贷款基准利率;投资者始终在政策放松程度预期、经济基本面企稳时间预期之间摇摆。受上述因素影响,A股市场总体呈现先扬后抑的走势,沪深300指数本季度上涨了0.27%。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,研究并认真应对成份股调整、限制投资股票替代投资等工作,努力为投资者带来更好的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,本基金份额净值为0.718元,本报告期份额净值增长率为1.56%,同期业绩比较基准增长率为0.51%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.05%。

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3季度,我们认为,在全球较弱的宏观经济背景下,国内宏观经济放缓趋势仍将持续,通货膨胀将得到有效控制,宏观政策继续以"稳中求进"方式进行微调,出现阶段性经济底部的可能性越来越大。

市场方面,如果国内宏观政策微调超过预期,且国内经济表现保持平稳,则目前处于历史较低估值水平的沪深300指数会出现系统性机会。反之,则会继续保持震荡的走势。

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,做好成份股调整、限制投资股票替代投资等工作,并力争和业绩基准保持一致。

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	17,456,790,258.70	93.79
	其中:股票	17,456,790,258.70	93.79
2	固定收益投资	697,740,000.00	3.75
	其中:债券	697,740,000.00	3.75
	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	371,805,710.21	2.00
6	其他各项资产	85,583,045.66	0.46
7	合计	18,611,919,014.57	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	104,320,688.65	0.57
B	采掘业	1,800,987,509.86	9.80
C	制造业	6,157,429,827.98	33.50
C0	食品、饮料	1,303,376,938.97	7.09
C1	纺织、服装、皮毛	67,812,395.82	0.37
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	370,294,832.96	2.01
C5	电子	257,738,176.78	1.40
C6	金属、非金属	1,452,283,006.35	7.90
C7	机械、设备、仪表	1,869,990,810.62	10.17
C8	医药、生物制品	830,153,314.18	4.52
C99	其他制造业	5,780,352.30	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	423,037,393.36	2.30
E	建筑业	565,524,658.20	3.08
F	交通运输、仓储业	507,052,832.58	2.76
G	信息技术业	502,164,951.31	2.73
H	批发和零售贸易	486,077,086.60	2.64
I	金融、保险业	5,444,226,945.26	29.62
J	房地产业	962,099,309.24	5.23
K	社会服务业	152,523,612.28	0.83
L	传播与文化产业	57,626,930.30	0.31
M	综合类	293,718,513.08	1.60
	合计	17,456,790,258.70	94.97

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	601318	中国平安	11,853,797	542,192,674.78	2.95
2	600837	海通证券	52,809,161	508,552,220.43	2.77
3	600016	民生银行	82,000,000	491,180,000.00	2.67
4	600036	招商银行	44,800,000	489,216,000.00	2.66
5	601328	交通银行	97,520,100	442,741,254.00	2.41
6	601166	兴业银行	30,500,000	395,890,000.00	2.15
7	600000	浦发银行	48,639,470	395,438,891.10	2.15
8	600519	贵州茅台	1,488,167	355,895,138.05	1.94
9	000002	万科A	34,444,500	306,900,495.00	1.67
10	601088	中国神华	11,782,279	264,865,631.92	1.44

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	400,180,000.00	2.18
2	央行票据	96,910,000.00	0.53
3	金融债券	200,650,000.00	1.09
	其中:政策性金融债	200,650,000.00	1.09
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	697,740,000.00	3.80

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	019202	12国债02	1,500,000	151,500,000.00	0.82
2	120405	12农发05	1,000,000	100,470,000.00	0.55
3	120001	12附息国债01	1,000,000	100,270,000.00	0.55
4	110414	11农发14	1,000,000	100,180,000.00	0.54
5	020051	12贴债01	1,000,000	98,240,000.00	0.53

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 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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	1,443,590.65
2	应收证券清算款	38,468,515.08
3	应收股利	25,049,696.40
4	应收利息	10,725,049.15
5	应收申购款	9,896,194.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,583,045.66

5.8.4 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。

5.8.5 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。

5.8.6 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	25,823,720,708.17
本报告期期基金总申购份额	1,126,381,376.67
减:本报告期基金总赎回份额	1,357,648,879.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,592,453,205.34

§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

2012年4月21日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月7日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月11日发布华夏基金管理有限公司公告两则。

2012年6月29日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告。

2012年6月30日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告。

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、杭州和广州设有分公司,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,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。

2012年2季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,高度重视风险管理,同时积极把握投资机会,旗下大部分主动管理的股票型、混合型基金表现优于市场平均水平,债券型基金全部取得正收益。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告(截至2012年6月29日数据),今年以来,华夏盛世股票、华夏成长混合等9只基金净值增长率达到并超过了5%。

2012年6月,境内首批跨境ETF华夏恒生ETF及其联接基金获中国证监会核准募集,内地投资者可通过购买这两只基金实现对香港市场的便捷投资。

§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指数证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏沪深300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
二〇一二年七月十八日

华夏经典配置混合型证券投资基金

【2012】第二季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十八日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月16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2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
报告期末基金份额总额	1,445,979,751.94份
投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡,风险适中。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-27,968,971.45
2.本期利润	2,317,461.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0016
4.期末基金资产净值	1,348,952,366.11
5.期末基金份额净值	0.933

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	0.11%	0.79%	0.87%	0.65%	-0.76%	0.14%

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

华夏经典配置混合型证券投资基金
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
(2004年3月15日至2012年6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		
王海维	本基金的基金经理、投资副总监、股票投资部副总经理	2011-03-17	-	19年	吉林大学经济学硕士,曾任海南省国际信托投资公司投单员、证券总部总经理助理、海口证券营业部总经理、金元证券公司海口营业部总经理、投资管理总部总经理、公司副总裁等。2010年12月加入华夏基金管理有限公司。

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《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 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,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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

2季度,国内经济处于下滑阶段,虽然通货膨胀回落,资金成本降低,但企业刚性成本高企,去库存缓慢,信贷需求不振,企业利润增速下降超出市场预期。受上述因素影响,A股市场震荡下行。

报告期内,本基金超配了食品饮料、医药等行业,并于季度中期增持了证券、保险、工程机械、建材等利率敏感型的强周期品种,另外还增持了部分中小盘成长股。由于仓位较高,组合短期下行波动的风险有所暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,本基金份额净值为0.933元,本报告期份额净值增长率为0.11%,同期业绩比较基准增长率为0.87%。

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3季度,经济下滑企稳的拐点仍未可预期,宏观经济政策逐步放松的综合效应最终会在实体经济上得到体现,但在一个季度或半年的时间内,难以作出明确的判断。

投资策略方面,我们主要反思两方面的策略:1)在宏观经济整体加速下滑阶段,泥沙俱下,即使是最优秀的企业,同样面临短期利润增幅超预期下滑的过程,"自下而上"选择优秀企业的投资策略短期面临挑战;2)中国未来经济增长过程中,城镇化和投资因素仍将发挥积极的作用,投资相关的行业和高端制造业中的龙头企业长期而言仍具备一定的成长性,但短期将面临周期性的剧烈波动。本基金将以长远的眼光,立足于价值选股,积极挖掘消费服务、经济转型与制度变革等领域的成长股,同时力争通过仓位控制和组合策略减少组合波动的风险。

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	994,069,302.51	73.23
	其中:股票	994,069,302.51	73.23
2	固定收益投资	296,169,406.80	21.82
	其中:债券	296,169,406.80	21.82
	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	52,000,172.26	3.83
6	其他各项资产	15,162,276.76	1.12
7	合计	1,357,401,158.33	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	采掘业	24,696,804.80	1.83
C	制造业	468,285,790.81	34.71
C0	食品、饮料	108,445,484.84	8.04
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	13,125,414.17	0.97
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	35,125,388.30	2.60
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	72,920,998.02	5.41
C7	机械、设备、仪表	128,863,742.50	9.55
C8	医药、生物制品	95,384,762.98	7.07
C99	其他制造业	14,420,000.00	1.07
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,836,257.72	1.17
E	建筑业	41,082,623.37	3.05
F	交通运输、仓储业	25,358,137.06	1.88
G	信息技术业	70,750,761.16	5.24
H	批发和零售贸易	58,607,963.35	4.34
I	金融、保险业	181,152,655.01	13.43
J	房地产业	27,065,000.00	2.01
K	社会服务业	53,952,126.47	4.00
L	传播与文化产业	14,246,556.76	1.06
M	综合类	13,034,626.00	0.97
	合计	994,069,302.51	73.69

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	600406	国电南瑞	3,038,564	56,790,761.16	4.21
2	000776	广发证券	1,799,901	53,211,046.83	3.94
3	600887	伊利股份	2,569,600	52,882,368.00	3.92
4	601318	中国平安	999,946	45,737,530.04	3.39
5	002551	尚荣医疗	2,893,615	44,619,543.30	3.31
6	000039	中集集团	3,299,930	43,889,069.00	3.25
7	600000	浦发银行	5,000,000	40,650,000.00	3.01
8	601669	中国水电	8,000,000	34,960,000.00	2.59
9	600754	锦江股份	2,211,926	34,948,430.80	2.59
10	000869	张裕A	470,534	31,648,116.84	2.35

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,082,000.00	8.98
	其中:政策性金融债	121,082,000.00	8.98
4	企业债券	150,086,690.00	11.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	25,000,716.80	1.85
8	其他	-	-
9	合计	296,169,406.80	21.96

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	112006	08万科G2	550,000	57,084,500.00	4.23
2	122051	10石化01	519,550	51,487,405.00	3.82
3	080417	08农发17	500,000	50,505,000.00	3.74
4	080202	08国开02	400,000	40,436,000.00	3.00
5	068007	06首都机场债	400,000	39,912,000.00	2.96

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 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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	1,250,000.00
2	应收证券清算款	7,763,945.88
3	应收股利	-
4	应收利息	5,933,686.62
5	应收申购款	214,644.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,162,276.76

5.8.4 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	21,135,340.80	1.57
2	113001	中行转债	3,865,376.00	0.29

5.8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000776	广发证券	29,350,000.00	2.18	非公开发行流通受限

5.8.6 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	1,461,350,862.96
本报告期基金总申购份额	20,993,594.46
减:本报告期基金总赎回份额	36,364,705.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,445,979,751.94

§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

2012年4月21日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月7日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月11日发布华夏基金管理有限公司公告两则。

2012年5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在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告。

2012年6月29日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告。

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、杭州和广州设有分公司,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,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。

2012年2季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,高度重视风险管理,同时积极把握投资机会,旗下大部分主动管理的股票型、混合型基金表现优于市场平均水平,债券型基金全部取得正收益。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告(截至2012年6月29日数据),今年以来,华夏盛世股票、华夏成长混合等9只基金净值增长率达到并超过了5%。

2012年6月,境内首批跨境ETF华夏恒生ETF及其联接基金获中国证监会核准募集,内地投资者可通过购买这两只基金实现对香港市场的便捷投资。

§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《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏经典配置混合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、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
二〇一二年七月十八日

华夏盛世精选股票型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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:二〇一二年七月十八日

§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2012年7月16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2012年4月1日起至6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	10,362,698,754.96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×80%+上证国债指数×20%。
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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	187,218,913.53
2.本期利润	333,914,663.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0318
4.期末基金资产净值	7,682,561,292.02
5.期末基金份额净值	0.741

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