

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  
报告期截止日：二〇一二年一月二十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会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，并对内容的真实性、准确性、完整性和及时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1月17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数据，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华夏回报混合
基金主代码	002001
交易代码	002001 002002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年9月5日
报告期末基金份额总额	7,863,232,038.00份
投资目标	尽最大努力避免基金资产损失，追求每年较高的绝对回报。

投资策略 正确判断市场走势，合理配置股票和债券等投资工具的比例，准确选定具有投资价值的股票品种和债券品种进行投资，在尽量避免基金资产损失的前提下实现基金每年较高的绝对回报。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为绝对回报标准，为同期一年定期存款利率。

风险收益特征 本基金在证券投资基金中属于中等风格的品种，其长期平均的预期收益率和风险高于货币基金，低于股票基金。

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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 30,306,650.44

2.本期利润 499,955,913.85

3.加权平均基金份额本期利润 0.0633

4.期末基金份额净值 10,139,078,802.82

5.期末基金份额净值 10,139,078,802.82

注：(1)本基金收益指包括持有人认购或申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
(2)本期已实现收益系指基于本基金期间收入、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)基金净值增长率＝(报告期期末基金资产净值-报告期初基金资产净值)/报告期初基金资产净值。

5.2 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) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 收益率差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 5.14% 0.63% 7.5% 0.75% 0.00% 4.39% 0.63%

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

华夏回报混合基金净值走势图  
份额累计净值增长率历史走势图  
2003年5月5日至2012年12月31日

图注：(1)本基金收益指包括持有人认购或申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
(2)本基金已实现收益系指基于本基金期间收入、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)基金净值增长率＝(报告期期末基金资产净值-报告期初基金资产净值)/报告期初基金资产净值。

5.3 投资组合报告

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 5,530,812,163.82 54.02

其中：股票 5,530,812,163.82 54.02

2 固定收益投资 3,476,158,469.62 33.95

其中：债券 3,476,158,469.62 33.95

3 金融衍生品投资 - -

4 其他 - -

5 银行存款和结算备付金合计 603,032,238.46 5.89

6 其他各项资产 628,840,648.06 6.14

7 合计 10,238,843,519.96 100.00

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

1 股票 5,530,812,163.82 54.02

2 衍生工具 - -

3 其他 - -

4 买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 603,032,238.46 5.89

6 其他各项资产 628,840,648.06 6.14

7 合计 10,238,843,519.96 100.00

5.5 报告期末按行业分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

1 国债 20,008,650,072.32 41.11

其中：债券 20,008,650,072.32 41.11

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 26,390,101,659.15 54.22

4 其他各项资产 2,270,873,635.72 4.67

5 合计 48,669,625,367.19 100.00

5.6 报告期回购融资情况

金额单位：人民币元

序号 项目 占基金净资产值的百分比(%)

1 报告期内债券回购融资本金余额 17.74

序号 项目 金额 占基金净资产值的百分比(%)

2 报告期末债券回购融资本金余额 5,073,146,543.42 11.67

注：(1)本基金无大额持有人认购或申购本基金的各项费用。  
(2)本基金已实现收益系指基于本基金期间收入、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。  
(3)基金按公允价值进行摊余成本法核算。

5.7 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) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 收益率差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.9580% 0.0027% 0.3393% 0.0000% 0.6187% 0.0027%

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

华夏回报混合基金净值走势图  
份额累计净值增长率历史走势图  
2004年4月21日至2012年12月31日

图注：(1)本基金收益指包括持有人认购或申购本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
(2)本基金已实现收益系指基于本基金期间收入、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)基金净值增长率＝(报告期期末基金资产净值-报告期初基金资产净值)/报告期初基金资产净值。

5.8 备查文件目录

报告期内本基金未出现单只基金资产净值低于500万元的情形，因此无须编制临时报告。

5.9 影响投资者决策的其他重要信息

报告期期内本公司未发布临时公告。

5.10 其他需要说明的事项

无。

## 华夏回报证券投资基金

## 2012年第四个季度报告

报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)