中信现金优势货币市场基金

【2011】第一季度报告

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:二〇一一年四月二十二日

§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2011年4月19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2011年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中信现金优势货币
基金主代码	288101
交易代码	288101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月20日
报告期末基金份额总额	930,701,475.44份
投资目标	在保持安全性、高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。
投资策略	结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行货币市场工具投资,以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。
业绩比较基准	本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款的税后收益率作为业绩比较基准。
风险收益特征	基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。
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(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	7,435,206.98
2.本期利润	7,435,206.98
3.期末基金资产净值	930,701,475.44

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,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。

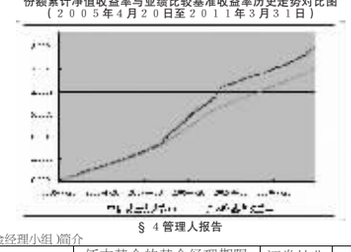
3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	0.9615%	0.0128%	0.7130%	0.0003%	0.2485%	0.0125%

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

中信现金优势货币市场基金
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
(2005年4月20日至2011年3月31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		
李广云	本基金的基金经理	2007-7-12	-	10年	英国华威大学管理科学与运筹学硕士。曾任招商证券研究员、原中信基金研究员、基金经理助理等职。2009年1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生效日期填写。

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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

中信现金优势货币基金与华夏现金增利货币基金投资风格相似。报告期内,中信现金优势货币基金净值收益率为0.9615%,华夏现金增利货币基金净值收益率为0.9363%,二者的投资业绩无明显差异。

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。

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

1季度,货币市场波动幅度显著提高。3个月Shibor利率在4.1%到5.7%之间宽幅波动;7天回购利率在春节前一度突破8%,节后则迅速回落到3%以下。就产品而言,一年期以内的利率产品和短期融资券收益率大幅波动,基于Shibor的浮息金融债受益于Shibor利率的高位波动,价格持续上扬。

报告期内,本基金以持有浮息金融债和短期融资券为主,在春节前把握住了货币市场利率上扬带来的机会,加大了逆回购和定期存款的投资力度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为0.9615%,同期业绩比较基准收益率为0.7130%,本基金的业绩比较基准为一年期定期存款的税后收益率。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度,在通胀压力初底消除前,货币市场难以出现持续宽松的状态。短期融资券持续的供给压力使其利差继续维持在较高水平,浮息债仍然具备持有价值。

本基金在2季度仍将以浮息金融债与短期融资券作为主要配置对象,同时将继续努力把握流动性趋紧所带来的投资机会。

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。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	629,953,030.02	64.51
	其中:债券	629,953,030.02	64.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	67,900,221.85	6.95
	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	233,689,642.49	23.93
4	其他各项资产	45,003,297.93	4.61
5	合计	976,546,192.29	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.12
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	44,949,777.52	4.83
	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	145
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	155
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	94

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	14.21	4.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.18	-
2	30天(含)—60天	27.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	13.99	-
3	60天(含)—90天	2.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	20.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	38.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.35	4.83

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,037,437.56	24.72
	其中:政策性金融债	230,037,437.56	24.72
4	企业债券	20,277,392.76	2.18
5	企业短期融资券	379,638,199.70	40.79
6	其他	-	-
7	合计	629,953,030.02	67.69
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	150,510,926.07	16.17

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110206	11国开06	1,300,000	130,233,533.31	13.99
2	1181039	11北大荒CP02	500,000	50,005,667.43	5.37
3	1181123	11海翼CP02	400,000	40,001,101.69	4.30
4	1081425	10新矿CP01	300,000	30,012,784.99	3.22
5	060208	06国开08	300,000	30,011,448.64	3.22
6	1081439	10建发集CP02	300,000	30,003,227.82	3.22
7	1081323	10浙物产CP02	300,000	29,900,120.99	3.21
8	1081320	10统众CP01	300,000	29,894,793.23	3.21
9	1081300	10阳煤CP01	300,000	29,884,797.31	3.21
10	020204	02国开04	300,000	29,753,031.88	3.20

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	6次
报告期内偏离度的最高值	0.32%
报告期内偏离度的最低值	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

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天的浮动利率债券摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况:

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2011-03-29	20.12	基金规模变动	2个工作日
2	2011-03-30	20.41	基金规模变动	1个工作日

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,351,899.99
3	应收利息	6,821,031.82
4	应收申购款	7,830,366.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,003,297.93

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	428,094,446.87
本报告期基金总申购份额	1,410,056,898.71
减:本报告期基金总赎回份额	907,449,870.14
本报告期期末基金份额总额	930,701,475.44

§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

2011年1月5日发布华夏基金管理有限公司关于设立杭州分公司的公告。

2011年1月26日发布华夏基金管理有限公司关于中信现金优势货币市场基金暂停申购业务及调整申购业务限额的公告。

2011年2月17日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金恢复办理转换转入、转换转出业务的公告。

2011年3月9日发布华夏基金管理有限公司关于在中国银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告。

2011年3月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告。

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。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人,是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

1季度,A股市场区间震荡,华夏基金加强风险控制,坚持稳健的投资风格,公司主动管理的股票型基金与混合型基金整体业绩表现良好。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2011年4月1日数据),华夏成长混合在29只偏股型基金(股票上限80%)中排名第8;华夏稳增混合在12只灵活配置型基金(股票上限95%)中排名第4;华夏策略混合在48只灵活配置型基金(股票上限80%)中排名第2。

2011年3月,在《证券时报》举办的"第七届中国基金业明星奖颁奖仪式暨中国明星基金论坛"中,华夏基金获得"长期回报明星基金公司奖",公司旗下基金获得7个单项奖,华夏基金成为本次评选获奖最多的基金公司。

在客户服务方面,1季度,华夏基金根据客户需求,恢复办理原中信四只基金的转换转出业务,并在中国银行开通旗下部分开放式基金的转换业务。

在践行企业社会责任方面,华夏基金通过华夏人慈善基金会组织实施了新疆和田等贫困地区基础设施建设、贫困村省金沙县扶贫等指定项目。

§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《中信现金优势货币市场基金基金合同》;

8.1.3《中信现金优势货币市场基金托管协议》;

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、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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
二〇一一年四月二十二日

华夏沪深300指数证券投资基金

【2011】第一季度报告

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:二〇一一年四月二十二日

§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2011年4月19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2011年1月1日起至3月31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	24,814,174,793.25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(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	-114,150,573.91
2.本期利润	647,104,217.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0254
4.期末基金资产净值	22,513,548,907.73
5.期末基金份额净值	0.907

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。

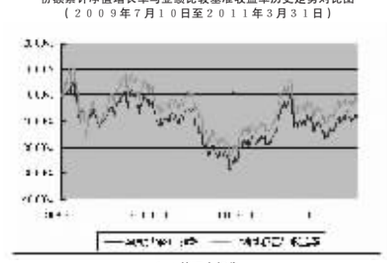
3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	2.72%	1.30%	3.13%	1.30%	-0.41%	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2011年3月31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	2009-7-10	-	11年	硕士。2000年加入华夏基金管理有限公司,历任研究发展部总经理、金融工程部副总经理。
方军	本基金的基金经理	2009-7-10	-	12年	硕士。1999年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、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。

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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

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。

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

1季度,国内经济运行平稳,但通货膨胀压力日益显现,政府持续出台了上调利率、存款准备金率等政策回收流动性,并在房地产领域实施较为严厉的限购政策。对于A股市场而言,虽然市场流动性仍处于相对宽松状态,但受到国内通胀预期增强、中东及北非局势动荡以及日本大地震等因素影响,总体上表现为震荡整理,沪深300指数本季度上涨3.04%。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,积极应对成份股调整,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2011年3月31日,本基金份额净值为0.907元,本报告期份额净值增长率为2.72%,同期业绩比较基准增长率为3.13%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.41%。

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2季度,我们认为通胀压力依然较大,政府可能会持续出台紧缩政策。受此影响,沪深300指数继续震荡的可能性较大。

本基金将会根据基金合同及相关法律法规要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	21,365,220,145.07	93.35
	其中:股票	21,365,220,145.07	93.35
2	固定收益投资	982,409,427.40	4.29
	其中:债券	982,409,427.40	4.29
	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	512,126,241.72	2.24
6	其他各项资产	28,474,672.42	0.12
7	合计	22,888,230,486.61	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	74,917,500.00	0.33
B	采掘业	2,624,228,138.39	11.66
C	制造业	7,653,986,349.32	34.00
C0	食品、饮料	1,119,592,237.40	4.97
C1	纺织、服装、皮毛	84,282,000.00	0.37
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	514,506,831.00	2.29
C5	电子	153,796,660.00	0.68
C6	金属、非金属	1,924,700,990.00	8.55
C7	机械、设备、仪表	2,880,122,595.28	12.79
C8	医药、生物制品	902,417,995.64	4.01
C99	其他制造业	74,567,040.00	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	527,257,217.27	2.34
E	建筑业	650,661,117.90	2.89
F	交通运输、仓储业	952,159,295.81	4.23
G	信息技术业	712,158,045.06	3.16
H	批发和零售贸易	612,065,233.34	2.72
I	金融、保险业	5,712,990,506.88	25.38
J	房地产业	1,153,225,773.00	5.12
K	社会服务业	205,918,600.00	0.91
L	传播与文化产业	32,301,600.00	0.14
M	综合类	453,350,768.10	2.01
	合计	21,365,220,145.07	94.90

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	47,600,000	670,684,000.00	2.98
2	601318	中国平安	12,543,000	620,376,780.00	2.76
3	600016	民生银行	95,900,000	536,081,000.00	2.38
4	601328	交通银行	92,000,000	523,480,000.00	2.33
5	601166	兴业银行	16,390,000	470,556,900.00	2.09
6	600837	海通证券	44,390,000	446,119,500.00	1.98
7	600000	浦发银行	31,702,130	431,783,010.60	1.92
8	601088	中国神华	12,380,000	360,134,200.00	1.60
9	601939	建设银行	68,000,000	337,960,000.00	1.50
10	000002	万 科A	36,400,000	316,316,000.00	1.41

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	405,986,248.40	1.80
2	央行票据	392,415,000.00	1.74
3	金融债券	178,888,000.00	0.79
	其中:政策性金融债	178,888,000.00	0.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	5,120,179.00	0.02
7	其他	-	-
8	合计	982,409,427.40	4.36

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101018	11央行票据18	2,500,000	242,250,000.00	1.08
2	0801044	08央行票据44	1,500,000	150,165,000.00	0.67
3	019101	11国债01	1,000,000	100,000,000.00	0.44
4	019109	11国债09	1,000,000	99,970,000.00	0.44
5	080222	08国开22	1,000,000	99,280,000.00	0.44

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,826,114.43
2	应收证券清算款	1,696,440.00
3	应收股利	2,747,560.00
4	应收利息	11,495,478.31
5	应收申购款	10,709,079.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,474,672.42

5.8.4报告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报告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	25,736,288,433.15
本报告期基金总申购份额	1,508,891,052.79
减:本报告期基金总赎回份额	2,431,004,692.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,814,174,793.25

§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

2011年1月5日发布华夏基金管理有限公司关于设立杭州分公司的公告。

2011年3月9日发布华夏基金管理有限公司关于在中国银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金在中信证券股份有限公司办理定期定额申购业务的公告。

2011年3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中信证券股份有限公司办理定期定额申购业务的公告。

2011年3月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告。

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。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人,是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

1季度,A股市场区间震荡,华夏基金加强风险控制,坚持稳健的投资风格,公司主动管理的股票型基金与混合型基金整体业绩表现良好。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2011年4月1日数据),华夏收入股票在217只标准股票型基金中排名第11;华夏大盘精选混合在43只偏股型基金(股票上限95%)中排名第2;华夏成长混合在29只偏股型基金(股票上限80%)中排名第8;华夏稳增混合在12只灵活配置型基金(股票上限95%)中排名第4;华夏策略混合在48只灵活配置型基金(股票上限80%)中排名第2。

2011年3月,在《证券时报》举办的"第七届中国基金业明星奖颁奖仪式暨中国明星基金论坛"中,华夏基金获得"长期回报明星基金公司奖",公司旗下基金获得7个单项奖,华夏基金成为本次评选获奖最多的基金公司。

在客户服务方面,1季度,华夏基金根据客户需求,恢复办理原中信四只基金的转换转出业务,并在中国银行开通旗下部分开放式基金的转换业务。

在践行企业社会责任方面,华夏基金通过华夏人慈善基金会组织实施了新疆和田等贫困地区基础设施建设、贫困村省金沙县扶贫等指定项目。

§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、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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
二〇一一年四月二十二日

华夏盛世精选股票型证券投资基金

【2011】第一季度报告

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:二〇一一年四月二十二日

§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2011年4月19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2011年1月1日起至3月31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	11,907,166,012.87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,并辅以不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(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	-228,851,247.17
2.本期利润	-332,687,881.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0270
4.期末基金资产净值	11,280,689,185.14
5.期末基金份额净值	0.947

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