

华夏回报证券投资基金

[2015] 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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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，即中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，确认复核内容真实准确。除基金合同另有约定外，基金管理人和基金托管人对基金净值的计算、报告等存在差异的，以基金管理人的计算结果为准。

基金的过往业绩并不代表未来的表现。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。

本报告期自2015年1月1日至2015年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：华夏回报混合
基金代码：000303
交易代码：000303
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2003年9月4日

报告期末基金的份额总额：7,017,108,338.00份

报告期末基金份额净值：1.00元

报告期末基金资产净值：7,017,108,338.00元

报告期末基金份额持有人数：1,000户

报告期末基金资产净值占总资产的比例（%）：100.00%

报告期末资产负债率（%）：0.00%

报告期末现金类资产占基金资产净值的比例（%）：0.00%

报告期末持有的买入期货合约、期权合约价值占基金资产净值的比例（%）：0.00%

报告期末持有的买入权证、资产支持证券、贵金属交易、股指期货、国债期货等金融衍生工具的期末公允价值占基金资产净值的比例（%）：0.00%

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 代码 证券名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 600087 申利股份 9,589,260 295,826,820.00 3.03

2 600163 长城汽车 4,649,214 241,806,626.14 2.48

3 300271 幸手软件 3,044,218 219,214,384.18 2.25

4 002410 广深铁 3,771,212 131,665,296.00 1.35

5 005272 豪方 1,665,040 126,829,248.00 1.30

6 600036 通广银行 7,19,526 118,642,247.82 1.23

7 002051 中广国际 3,343,327 110,998,456.40 1.14

8 300115 盛富精英 3,421,901 100,877,641.48 1.03

9 600000 浦发银行 6,199,848 97,895,599.92 1.00

10 600072 中行高银 6,592,767 96,847,74.23 0.99

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债券投资明细

金额单位：人民币元

序号 代码 证券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 59,946,000.00 59,946,000.00 0.61

2 向日葵债 - - -

3 金融债 3,585,435,000.00 36.78

其中：政策性金融债 3,585,435,000.00 36.78

4 企业债券 97,479,912.70 1.00

5 短期融资券 - - -

6 中期票据 291,460,000.00 2.99

7 可转债 20,958,383.60 0.23

8 其他 - - -

9 合计 4,055,279,296.30 41.60

5.4 报告期末按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 59,946,000.00 59,946,000.00 0.61

2 向日葵债 - - -

3 金融债 3,585,435,000.00 36.78

4 企业债券 97,479,912.70 1.00

5 短期融资券 - - -

6 中期票据 291,460,000.00 2.99

7 可转债 20,958,383.60 0.23

8 其他 - - -

9 合计 4,055,279,296.30 41.60

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 150403 15农发03 9,300,000 927,117,000.00 9.51

2 150202 15国开02 3,100,000 309,194,000.00 3.17

3 090205 09国开05 2,600,000 261,924,000.00 2.69

4 160221 16农发21 2,600,000 260,720,000.00 2.67

5 100236 10农开26 2,000,000 209,720,000.00 2.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 150403 15农发03 100,000 6,837,000.00 0.07

2 150202 15国开02 100,000 3,100,000 0.03

3 090205 09国开05 100,000 2,600,000 0.03

4 160221 16农发21 100,000 2,600,000 0.03

5 100236 10农开26 100,000 209,720,000.00 0.06

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

序号 证券代码 证券名称 数量(手) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 150403 15农发03 100,000 927,117,000.00 9.51

2 150202 15国开02 100,000 309,194,000.00 3.17

3 090205 09国开05 100,000 261,924,000.00 2.69

4 160221 16农发21 100,000 260,720,000.00 2.67

5 100236 10农开26 100,000 209,720,000.00 0.06

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 600087 申利股份 9,589,260 295,826,820.00 3.03

2 600163 长城汽车 4,649,214 241,806,626.14 2.48

3 300271 幸手软件 3,044,218 219,214,384.18 2.25

4 002410 广深铁 3,771,212 131,665,296.00 1.35

5 005272 豪方 1,665,040 126,829,248.00 1.30

6 600036 通广银行 7,19,526 118,642,247.82 1.23

7 002051 中广国际 3,343,327 110,998,456.40 1.14

8 300115 盛富精英 3,421,901 100,877,641.48 1.03

9 600000 浦发银行 6,199,848 97,895,599.92 1.00

10 600072 中行高银 6,592,767 96,847,74.23 0.99

5.9 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 证券代码 证券名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 600087 申利股份 9,589,260 295,826,820.00 3.03

2 600163 长城汽车 4,649,214 241,806,626.14 2.48

3 300271 幸手软件 3,044,218 219,214,384.18 2.25

4 002410 广深铁 3,771,212 131,665,296.00 1.35

5 005272 豪方 1,665,040 126,829,248.00 1.30

6 600036 通广银行 7,19,526 118,642,247.82 1.23

7 002051 中广国际 3,343,327 110,998,456.40 1.14

8 300115 盛富精英 3,421,901 100,877,641.48 1.03

9 600000 浦发银行 6,199,848 97,895,599.92 1.00

10 600072 中行高银 6,592,767 96,847,74.23 0.99

5.10 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债券投资明细

金额单位：人民币元

序号 代码 证券名称 数量(张) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 150403 15农发03 9,300,000 927,117,000.00 9.51

2 150202 15国开02 3,100,000 309,194,000.00 3.17

3 090205 09国开05 100,000 261,924,000.00 2.69

4 160221 16农发21 100,000 260,720,000.00 2.67

5 100236 10农开26 100,000 209,720,000.00 2.06

5.11 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资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 150403 15农发03 100,000 6,837,000.00 0.07

2 150202 15国开02 100,000 3,100,000 0.03

3 090205 09国开05 100,000 2,600,000 0.03

4 160221 16农发21 100,000 2,600,000