

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF) 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
重要提示
基金管理人承诺,为投资者提供真实、准确、完整的信息,并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。

2.1 基金基本情况
基金名称:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
基金代码:160311
基金运作方式:契约型上市开放式
基金合同生效日:2007年4月29日

2.2 基金产品说明
投资目标:追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增长。
投资策略:本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理配置基金资产在股票、债券、货币市场工具及其他投资品种上的投资比例,以谋求实现基金合同约定的风险、提高收益。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
信息披露负责人:张明

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)
本期已实现收益: -250,744,757.65
本期利润: 6,889,286,532.35

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
过去一个月: 14.29% vs 8.58%
过去三个月: 27.54% vs 15.38%
过去六个月: 51.91% vs 40.35%

3.2.2 自基金转型以来基金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
华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007年4月24日至2009年6月30日)

注:自2007年4月24日起,由银证证券投资基金合同修订而成的华夏蓝筹核心混合型证券投资基金LOF基金合同正式生效,根据原证券投资基金LOF基金合同规定,本基金自基金合同生效后1个月内使投资组合比例符合基金合同第十四条C、投资范围、D、联接基金行为与比例限制的有关规定。

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的简介
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。公司总部在北京,上海、深圳、成都、武汉、西安设有分公司,杭州设有基金子公司,在全国设有30多个营业网点。

4.1.2 基金经理
姓名: 魏星
职务: 基金经理
任职日期: 2007-6-12
离职日期: 12年

注:上述任职日期,是指自根据本基金管理人对外披露的定期报告填写。
证券投资基金的存续以基金管理人及基金托管人双方同意为前提,基金管理人有权根据基金合同的约定,在符合法律法规的前提下,变更基金管理人,并相应变更基金托管人。

4.2 本投资组合与其他投资组合的投资范围之比较
本基金为基金管理人旗下其他投资组合的投资风格不同。
4.3 投资策略
本基金管理人一贯奉行控制下管理的理念和原则,制定并严格遵守制度和流程,通过系统和人工等方式全方位贯彻其投资策略和执行流程。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现
上半年,积极的财政政策和适度宽松的货币政策相互促进作用,固定资产投资增速持续,居民消费稳步回升,中国经济强劲反弹,同时伴随着美国银行体系去杠杆化进程的完成,海外经济企稳,投资者情绪渐趋稳定。全球股市表现强劲,A股市场更是异军突起,上半年涨幅超过40%。行业板块上,煤炭、有色、房地产、银行、钢铁等行业表现突出。

4.5 报告期内基金资产组合
截至2009年6月30日,本基金资产组合如下:
股票投资: 14,224,126.00元,占基金资产净值的61.07%
债券投资: 1,831,242,719.94元,占基金资产净值的78.93%

4.6 报告期内基金资产组合的行业分布
截至2009年6月30日,本基金资产组合的行业分布如下:
金融、地产: 1,644,893.85元,占基金资产净值的0.10%
医药生物: 10,509元,占基金资产净值的0.00%

4.7 报告期内基金资产组合的公允价值
截至2009年6月30日,本基金资产组合的公允价值如下:
股票: 14,224,126.00元
债券: 1,831,242,719.94元

4.8 报告期内基金资产组合的流动性
截至2009年6月30日,本基金资产组合的流动性如下:
股票: 14,224,126.00元
债券: 1,831,242,719.94元

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Asset, Reference Number, Period, Value. Rows include Cash, Bank Deposits, Securities, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

Table with 4 columns: Item, Period, Value. Rows include Management Fees, Distribution Fees, etc.

注:上述管理费计提方式按照中国证券投资基金业协会相关规定,由基金管理人按照基金资产净值的一定比例计提,并由基金托管人复核。

注:卖出金额=卖出成交金额-成交手续费-印花税-过户费,不构成相关交易费用。