

华夏沪深300 指数证券投资基金

2010 第一季度报告

2010年3月31日

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
报告截止日期:二〇一〇年四月二十日

重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人华夏基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2010年4月15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,保证其中不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
基金的投资业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,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。
本报告自2010年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况
华夏沪深300指数
基金代码:000015
交易代码:000015
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2009年7月10日
报告期末基金份额总额:27,547,883,557.47份

投资目标
本基金主要采取复制法,跟踪标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪...

主要财务指标
报告期末总资产:14,987,664.00
报告期末净资产:1,635,411,338.86
报告期利润总额:-0.6003
期末可供分配利润:25,739,178,948.58

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+1%
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
基金合同生效日:2009年7月10日

基金产品概况
华夏沪深300指数
基金代码:000015
交易代码:000015
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2009年7月10日

投资目标
本基金主要采取复制法,跟踪标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪...

主要财务指标
报告期末总资产:14,987,664.00
报告期末净资产:1,635,411,338.86
报告期利润总额:-0.6003
期末可供分配利润:25,739,178,948.58

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+1%
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
基金合同生效日:2009年7月10日

基金产品概况
华夏沪深300指数
基金代码:000015
交易代码:000015
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2009年7月10日

投资目标
本基金主要采取复制法,跟踪标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪...

主要财务指标
报告期末总资产:14,987,664.00
报告期末净资产:1,635,411,338.86
报告期利润总额:-0.6003
期末可供分配利润:25,739,178,948.58

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+1%
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
基金合同生效日:2009年7月10日

基金产品概况
华夏沪深300指数
基金代码:000015
交易代码:000015
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2009年7月10日

投资目标
本基金主要采取复制法,跟踪标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相等的回报及追求标的指数的有效跟踪...

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(%)

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(%)

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
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(%)

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权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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
序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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买入返售金融资产投资明细
序号 品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2010 第一季度报告

2010年3月31日

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
报告截止日期:二〇一〇年四月二十日

重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人华夏基金管理有限公司根据本基金合同约定,于2010年4月15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,保证其中不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
基金的投资业绩并不预示其未来表现,投资者有风险,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。
本报告自2010年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况
华夏策略精选灵活配置混合
基金代码:002031
交易代码:002031
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2008年10月23日
报告期末基金份额总额:1,315,665,696.03份

投资目标
通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中存在的投资机会,谋求基金资产的长期持续增长。
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,主动调整市场仓位,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度降低投资组合的风险,提高收益。

主要财务指标
报告期末总资产:2,239,419.68
报告期末净资产:253,923,306.94
报告期利润总额:49,999,970.249
期末可供分配利润:187,500,000.00

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+5%
风险收益特征
本基金是灵活配置型混合基金,混合基金的风险高于货币市场基金、债券基金,低于股票基金;其风险收益特征介于股票基金和债券基金之间。

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
基金合同生效日:2008年10月23日

基金产品概况
华夏策略精选灵活配置混合
基金代码:002031
交易代码:002031
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2008年10月23日

投资目标
通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中存在的投资机会,谋求基金资产的长期持续增长。
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,主动调整市场仓位,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度降低投资组合的风险,提高收益。

主要财务指标
报告期末总资产:2,239,419.68
报告期末净资产:253,923,306.94
报告期利润总额:49,999,970.249
期末可供分配利润:187,500,000.00

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+5%
风险收益特征
本基金是灵活配置型混合基金,混合基金的风险高于货币市场基金、债券基金,低于股票基金;其风险收益特征介于股票基金和债券基金之间。

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
基金合同生效日:2008年10月23日

基金产品概况
华夏策略精选灵活配置混合
基金代码:002031
交易代码:002031
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2008年10月23日

投资目标
通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中存在的投资机会,谋求基金资产的长期持续增长。
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,主动调整市场仓位,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度降低投资组合的风险,提高收益。

主要财务指标
报告期末总资产:2,239,419.68
报告期末净资产:253,923,306.94
报告期利润总额:49,999,970.249
期末可供分配利润:187,500,000.00

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率+5%
风险收益特征
本基金是灵活配置型混合基金,混合基金的风险高于货币市场基金、债券基金,低于股票基金;其风险收益特征介于股票基金和债券基金之间。

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
基金合同生效日:2008年10月23日

基金产品概况
华夏策略精选灵活配置混合
基金代码:002031
交易代码:002031
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2008年10月23日

投资目标
通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中存在的投资机会,谋求基金资产的长期持续增长。
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,主动调整市场仓位,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度降低投资组合的风险,提高收益。

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(%)

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(%)

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
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(%)

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权证投资明细
序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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
序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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买入返售金融资产投资明细
序号 品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)