

华夏大盘精选证券投资基金 2010 第四季度报告

2010年12月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年一月二十一日

§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法律责任。
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2011年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合等部分,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。
基金的投资业绩并不表示对未来业绩的保证,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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	华夏大盘精选混合
基金代码	000011
交易代码	000011
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2004年8月11日
报告期末基金份额总额	626,788,909.00份
投资目标	追求基金资产的长期增值
投资策略	本基金主要采取“自上而下”的个股精选策略,根据细致的财务分析和深入的上市公司调研,精选出业绩增长良好且具备成长性个股,并在此基础上,结合对宏观经济、行业景气度、估值等因素的综合分析,政策形势和证券市场走势的综合分析,寻找具有中长期增长潜力的个股,进行中长期投资,追求基金资产的长期增值。

业绩比较基准	本基金整体的业绩比较基准为: 跟踪中国 A200 指数*90%+富时中国 40 指数*10%
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种,其长期平均的预期收益率高于债券基金和混合基金,低于大型股票基金。
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

主要财务指标	报告期 2010 年 10 月 1 日-2010 年 12 月 31 日
1.本期比上年投资收益	854,061,172.97
2.本期利润	910,201,087.61
3.加权平均基金份额本期利润	1.4474
4.期末基金资产净值	7,695,589,791.95
5.期末基金份额净值	12.278

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	13.31%	1.42%	2.46%	1.38%	7.85%	0.04%

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	001904	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		
6	可转债	100,430,000.00	1.31		
7	其他	100,430,000.00	1.31		
8	合计	400,762,535.00	5.21		

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	019004	10国债04	1,200,000	119,964,000.00	1.56
2	0801053	08央行票据53	1,000,000	100,430,000.00	1.31
3	020228	10国债02	900,000	88,884,000.00	1.15
4	020042	10国债16	500,000	49,525,000.00	0.64
5	001012	21国债02	200,000	20,144,000.00	0.26

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	110900001	11国债(零)	300,332,535.00	3,390	0.00004
2	央行票据	100,430,000.00	1.31		
3	金融债	100,430,000.00	1.31		
4	企业债	100,430,000.00	1.31		
5	企业短期融资券	100,430,000.00	1.31		