华夏沪深300指数证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月18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4月1日起至6月30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	25,115,986,438.07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4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-108,136,431.89
2.本期利润	-991,649,297.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0402
4.期末基金资产净值	21,739,820,408.51
5.期末基金份额净值	0.866

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

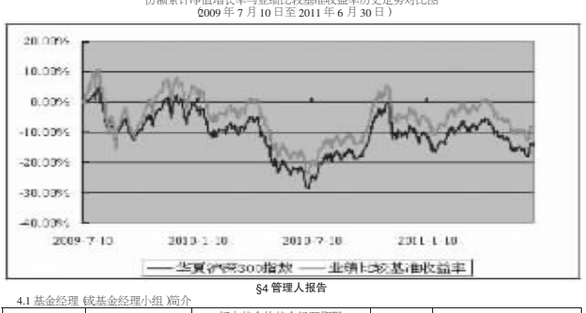
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.52%	1.04%	-5.03%	1.04%	0.51%	0.00%

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6月30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

2季度,国际经济方面,通胀问题从新兴市场向欧美发达经济体蔓延,受此影响,欧洲央行启动加息进程,但希腊等国家债务危机仍未得到有效解决;美国第二期定量宽松政策到期结束后,没有继续推出第三期定量宽松政策,其国债规模上限的提高仍需获得国会批准。新兴市场国家由于通胀普遍高企继续保持紧缩的货币政策。

国内经济方面,连续的货币紧缩措施、针对房地产市场的调控措施开始显现成效,经济增速回落,通胀压力虽在上升但逐步进入见顶阶段,房价涨幅受到一定抑制。

基于上述因素,2季度A股市场持续下跌,食品饮料、银行、煤炭和房地产等行业跌幅较小,而前期估值较高的中小板、创业板股票则跌幅较大。

报告期内,基于对估值水平以及行业发展前景的考量,本基金重点配置了供需形势持续改善的水泥、银行和受益于下一代网络发展的光通信设备等行业。季末,在A股市场出现比较明显的下跌后,本基金主动提高了股票仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为0.866元,本报告期份额净值增长率为-4.52%,同期业绩比较基准增长率为-5.03%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.51%。

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3季度,我们认为通货膨胀压力依然较大,宏观政策仍然偏紧,但通货膨胀可能会出现阶段性高点,同时伴随经济的持续放缓,政府的宏观政策可能会出现放松迹象。此外,境外国家、地区尤其是美国的未来经济及其政策走向、欧洲债务危机等因素也会给国内宏观政策带来重要影响。我们认为,如果宏观政策果真出现放松迹象,沪深300指数可能会出现阶段性机会,反之,则会继续保持震荡整理的走势。

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,做好成份股调整工作,并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	20,647,202,864.37	94.33
	其中:股票	20,647,202,864.37	94.33
2	固定收益投资	876,058,875.80	4.00
	其中:债券	876,058,875.80	4.00
	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	325,080,032.12	1.49
6	其他各项资产	40,465,173.25	0.18
7	合计	21,888,806,945.54	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	117,748,550.70	0.54
B	采掘业	2,419,619,467.32	11.13
C	制造业	7,772,559,803.39	35.75
C0	食品、饮料	1,232,938,185.31	5.67
C1	纺织、服装、皮毛	72,786,000.00	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	525,771,944.05	2.42
C5	电子	222,804,500.00	1.02
C6	金属、非金属	1,942,694,100.66	8.94
C7	机械、设备、仪表	2,868,293,100.45	13.19
C8	医药、生物制品	864,626,072.92	3.98
C99	其他制造业	42,645,900.00	0.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	455,993,680.91	2.10
E	建筑业	655,494,359.42	3.02
F	交通运输、仓储业	784,282,883.54	3.61
G	信息技术业	666,097,585.55	3.06
H	批发和零售贸易	636,410,288.26	2.93
I	金融、保险业	5,462,237,102.65	25.13
J	房地产业	1,027,957,402.92	4.73
K	社会服务业	183,766,094.00	0.85
L	传播与文化产业	45,460,974.71	0.21
M	综合类	419,574,671.00	1.93
	合计	20,647,202,864.37	94.97

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	45,100,000	587,202,000.00	2.70
2	601318	中国平安	11,900,000	574,413,000.00	2.64
3	600837	海通证券	56,599,958	510,531,621.16	2.35
4	600016	民生银行	89,000,000	509,970,000.00	2.35
5	601328	交通银行	89,000,000	493,060,000.00	2.27
6	600000	浦发银行	41,419,017	407,563,127.28	1.87
7	601166	兴业银行	28,350,928	382,170,509.44	1.76
8	601088	中国神华	11,600,000	349,624,000.00	1.61
9	601939	建设银行	63,900,000	315,666,000.00	1.45
10	000002	万科A	35,100,000	296,595,000.00	1.36

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	277,265,875.80	1.28
2	央行票据	241,475,000.00	1.11
3	金融债券	357,318,000.00	1.64
	其中:政策性金融债	357,318,000.00	1.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	876,058,875.80	4.03

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	241,475,000.00	1.11
2	019101	11国债01	1,000,000	100,010,000.00	0.46
3	019109	11国债09	1,000,000	99,970,000.00	0.46
4	080222	08国开22	1,000,000	99,320,000.00	0.46
5	090405	09农发05	1,000,000	98,630,000.00	0.45

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	1,514,503.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	23,775,856.84
4	应收利息	9,225,584.10
5	应收申购款	5,949,228.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,465,173.25

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在在流通受限情况。

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	24,814,174,793.25
本报告期基金总申购份额	1,918,918,786.55
减:本报告期基金总赎回份额	1,617,107,141.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,115,986,438.07

§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4月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告。

2011年4月7日发布华夏基金管理有限公司关于在中国农业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4月25日发布华夏基金管理有限公司关于调整基金分红方式变更规则的公告。

2011年5月13日发布华夏基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费率的公告。

2011年5月28日发布关于停止中行广东省分行长城借记卡基金网上交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告。

2011年6月17日发布华夏基金管理有限公司关于在上海浦东发展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6月23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部分销售机构开办定期定额申购业务的公告。

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。

2季度,A股市场持续下跌,华夏基金加强风险控制,坚持稳健的投资风格,努力为投资人规避风险。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6月30日数据),华夏收入股票在217只标准股票型基金中排名第10;华夏大盘精选混合、华夏红利混合在43只偏股型基金(股票上限95%)中分别排名第2和第7;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1。

2011年4月,在《上海证券报》主办的中国"金基金"奖颁奖典礼中,华夏基金第六次荣获"金基金TOP公司奖";在《中国证券报》、中央电视台主办的"中国基金业金牛奖"评选中,华夏基金第六次荣获年度"金牛基金管理公司奖"。

2季度,为更好地满足广大投资者的理财需求,华夏基金调整了在本公司进行登记结算的基金的分红方式变更规则,从而使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金分别设置分红方式。

§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
二〇一一年七月二十日

华夏经典配置混合型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月18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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
报告期末基金份额总额	1,471,170,331.36份
投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×中信标普300指数+20%×中信金债指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡,风险适中。
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4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	13,214,736.21
2.本期利润	-63,878,716.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0432
4.期末基金资产净值	1,535,244,980.11
5.期末基金份额净值	1.044

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	-3.96%	0.89%	-3.10%	0.66%	-0.86%	0.23%

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

华夏经典配置混合型证券投资基金

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

(2004年3月15日至2011年6月30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		
赵航	本基金的基金经理	2009-8-7	-	14年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券公司资产管理中心投资经理、长城证券公司投资银行部项目经理、鹏华基金管理有限公司原普华证券投资基金基金经理(2003年4月10日至2005年5月21日)、原中信基金中信红利精选股票型证券投资基金基金经理(2008年5月19日至2009年4月18日)。2009年1月加入华夏基金管理有限公司。
王海雄	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2011-3-17	-	18年	吉林大学经济学硕士。曾任海南省国际信托投资公司报单员、证券总部总经理助理、海口证券营业部总经理、金元证券公司海口营业部总经理、投资管理总部总经理、公司副总裁。2010年12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

2季度,国内经济增速回落,企业利润率下滑,同时,通货膨胀持续高企,货币政策继续收紧,部分中小企业面临资动力成本上升、资金紧张的局面。A股市场整体呈现逐步下跌的走势,部分周期性行业和业绩不佳的中小盘股票跌幅较大。

报告期内,本基金坚持"自下而上"精选个股、行业配置适当均衡,主要减持了社会服务业、农林牧渔业等行业个股,增持了水泥建材行业和部分超跌的中小盘股票。但由于部分持仓的中小盘股下跌幅度较大,本基金业绩受到一定拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为1.044元,本报告期份额净值增长率为-3.96%,同期业绩比较基准增长率为-3.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度,预计通货膨胀仍将处于高位,但不会失控,并将逐步回落,货币紧缩政策也将有所放松。我们认为,市场对2季度的经济回落和通货膨胀反应过度,预计将在3季度纠偏,A股市场整体将会呈现震荡向上的格局。

3季度,本基金将保持较高的股票仓位,继续坚持"自下而上"的选股思路,努力挑选出一批能穿越经济波动周期、持续成长的优秀企业,行业方面,重点配置房地产、水泥等先导性行业和部分超跌的高成长中小盘个股,并在中长期集中投资于行业龙头企业。此外,本基金看好可转债的投资机会。

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	权益投资	1,126,238,282.26	72.49
	其中:股票	1,126,238,282.26	72.49
2	固定收益投资	373,793,655.50	24.06
	其中:债券	373,793,655.50	24.06
	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	47,897,444.75	3.02
6	其他各项资产	6,743,086.90	0.43
7	合计	1,553,672,469.41	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	39,200,000.00	2.55
B	采掘业	22,337,734.18	1.45
C	制造业	529,254,866.11	34.47
C0	食品、饮料	83,418,184.90	5.43
C1	纺织、服装、皮毛	23,144,639.04	1.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	882,376.00	0.06
C4	石油、化学、塑胶、塑料	45,001,756.79	2.93
C5	电子	41,592,317.38	2.71
C6	金属、非金属	130,834,401.48	8.52
C7	机械、设备、仪表	148,914,722.95	9.70
C8	医药、生物制品	7,394,400.00	0.48
C99	其他制造业	48,072,067.57	3.13
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	49,235,790.62	3.21
G	信息技术业	83,160,931.40	5.42
H	批发和零售贸易	96,476,034.32	6.28
I	金融、保险业	149,998,492.02	9.77
J	房地产业	107,174,582.02	6.98
K	社会服务业	43,640,254.79	2.84
L	传播与文化产业	5,759,596.80	0.38
M	综合类	-	-
	合计	1,126,238,282.26	73.36

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	000039	中集集团	2,669,752	58,414,173.76	3.80
2	600887	伊利股份	3,000,000	49,950,000.00	3.25
3	600000	浦发银行	5,062,558	49,815,570.72	3.24
4	000877	天山股份	1,399,923	49,753,263.42	3.24
5	000063	中兴通讯	1,677,700	47,445,356.00	3.09
6	600739	辽宁成大	1,500,000	41,700,000.00	2.72
7	600048	保利地产	3,781,198	41,555,366.02	2.71
8	600598	北大荒	2,800,000	39,200,000.00	2.55
9	002369	卓翼科技	2,004,986	36,751,393.38	2.39
10	000718	苏宁环球	4,399,902	35,199,216.00	2.29

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	73,832,557.10	4.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,484,000.00	2.64
	其中:政策性金融债	40,484,000.00	2.64
4	企业债券	162,805,226.30	10.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	96,671,872.10	6.30
8	其他	-	-
9	合计	373,793,655.50	24.35

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	019021	10国债21	700,000	69,944,000.00	4.56
2	112006	08万科G2	550,000	56,994,300.00	3.71
3	122051	10石化01	519,550	50,188,530.00	3.27
4	113002	工行转债	410,990	48,689,985.30	3.17
5	113001	中行转债	454,460	47,981,886.80	3.13

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	1,510,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,222,091.08
5	应收申购款	10,995.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,743,086.90

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	48,689,985.30	3.17
2	113001	中行转债	47,981,886.80	3.13

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在在流通受限情况。

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	1,493,278,559.59
本报告期基金总申购份额	7,183,798.95
减:本报告期基金总赎回份额	29,292,027.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,471,170,331.36

§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4月7日发布华夏基金管理有限公司关于在中国农业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4月25日发布华夏基金管理有限公司关于调整基金分红方式变更规则的公告。

2011年5月13日发布华夏基金管理有限公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费率的公告。

2011年5月28日发布关于停止中行广东省分行长城借记卡基金网上交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告。

2011年6月17日发布华夏基金管理有限公司关于在上海浦东发展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6月23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部分销售机构开办定期定额申购业务的公告。

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。

2季度,A股市场持续下跌,华夏基金加强风险控制,坚持稳健的投资风格,努力为投资人规避风险。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6月30日数据),华夏收入股票在217只标准股票型基金中排名第10;华夏大盘精选混合、华夏红利混合在43只偏股型基金(股票上限95%)中分别排名第2和第7;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1。

2011年4月,在《上海证券报》主办的中国"金基金"奖颁奖典礼中,华夏基金第六次荣获"金基金TOP公司奖";在《中国证券报》、中央电视台主办的"中国基金业金牛奖"评选中,华夏基金第六次荣获年度"金牛基金管理公司奖"。

2季度,为更好地满足广大投资者的理财需求,华夏基金调整了在本公司进行登记结算的基金的分红方式变更规则,从而使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金分别设置分红方式。

§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《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏经典配置混合型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
二〇一一年七月二十日

华夏盛世精选股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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7月18日复核了