

华夏大盘精选证券投资基金

2012第一季度报告

2012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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年四月二十三日

\$1 重要提示
基金管理人的董事会及监事会在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、完整性负责，承担个别及连带责任。
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2012年4月19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。保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金经理在履行职责时勤勉尽责地管理基金和运用基金资产，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。
本基金中财会资料经审计。
本报告期自2012年1月1日起至3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 [000012]
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004/8/1
报告期末基金份额总额:462,724,117.16份
投资目标:追求基金资产的长期增值。

本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，根据细致的基本面分析和深入的行业研究，选择具有持续竞争优势的公司，基金还会在资产配置方面通过调整股票仓位等，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金在运作中秉承并贯彻其未来表现。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。

本基金中财会资料经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -317,420,913.73

2.本期利润 141,073,095.98

3.加权平均基金份额本期利润 4,704,097,241.40

4.期末基金份额净值 10,166

(注:本基金的业绩报酬指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。)

(注:本基金的收益分配政策详见本基金合同收入分配条款, 其他收入、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额, 本期利润即为本期实现的收入加上其他收入、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, 本期利润即为本期实现的收入加上本期公允价值变动收益。)

3.2 基金的净值表现

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差额的比较

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

2004/8/1日至2012年3月31日

1400.00%
1200.00%
1000.00%
800.00%
600.00%
400.00%
200.00%
0.00%
-200.00%

2004-3-11 2006-2-11 2007-2-11 2009-2-11 2010-2-11 2012-2-11
——华夏大盘精选——业绩比较基准

5.4 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债券投资明细

单位:人民币元

序号 **债券代码** **债券名称** **数量(份)** **公允价值** **占基金资产净值比例(%)**

1 600256 广汇股份 18,779,485 442,444,666.60 9.41

2 601061 大秦铁路 41,000,000 305,450,000.00 6.49

3 600050 中国联通 54,417,567 230,186,304.41 4.89

4 601166 兴业银行 16,000,000 213,120,000.00 4.53

5 600028 中国石化 26,571,454 191,048,754.26 4.06

6 600086 东方航空 14,000,000 172,340,000.00 3.66

7 600239 银川银行 20,000,798 141,005,625.90 3.00

8 601688 华泰证券 15,999,987 147,459,885.86 2.99

9 600036 招商银行 62,772,500.00 147,373,181.10 2.23

10 300004 南风股份 4,102,201 94,637,777.07 2.01

(注:本基金的业绩报酬指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。)

(注:本基金的收益分配政策详见本基金合同收入分配条款, 其他收入、不含公允价值变动收益、其他收入、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额, 本期利润即为本期实现的收入加上其他收入、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, 本期利润即为本期实现的收入加上本期公允价值变动收益。)

3.2.2 基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率差额的比较

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

2004/8/1日至2012年3月31日

1400.00%
1200.00%
1000.00%
800.00%
600.00%
400.00%
200.00%
0.00%
-200.00%

2004-3-11 2006-2-11 2007-2-11 2009-2-11 2010-2-11 2012-2-11
——华夏大盘精选——业绩比较基准

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

单位:人民币元

序号 **债券代码** **债券名称** **数量(份)** **公允价值** **占基金资产净值比例(%)**

1 110015 石化转债 1,801,670 182,112,803.60 3.87

2 113002 工行转债 1,200,000 129,924,000.00 2.76

3 091995 09国债15 1,000,000 99,780,000.00 2.12

4 019202 12国开02 400,000 40,012,000.00 0.85

5 - - - - -

(注:本基金的业绩报酬指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。)

(注:本基金的收益分配政策详见本基金合同收入分配条款, 其他收入、不含公允价值变动收益、其他收入、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额, 本期利润即为本期实现的收入加上其他收入、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, 本期利润即为本期实现的收入加上本期公允价值变动收益。)

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(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

王亚伟 本基金的基金经理 2005-12-31 - 17年 经济学硕士, 曾任中信国际资产管理有限公司基金经理, 2003年8月加入华夏基金管理有限公司, 历任兴华证券投资基金、华夏精选股票型证券投资基金、华夏回报股票型证券投资基金、华夏大盘精选股票型证券投资基金基金经理, 2001年12月18日至2005年4月1日期间, 华夏大盘精选股票型证券投资基金基金经理, 2002年1月1日至2005年4月28日期间, 本基金基金经理, 2005年4月29日至2006年1月1日期间, 本基金基金经理, 2006年1月1日至2007年1月1日期间, 本基金基金经理, 2007年1月1日至2008年1月1日期间, 本基金基金经理, 2008年1月1日至2009年1月1日期间, 本基金基金经理, 2009年1月1日至2010年1月1日期间。

(注:上述任职日期、离任日期均指对外披露的任免日期填写。)

②本基金从成立以来从未从行业协会、从业人员资格管理机构处的相关规定。

③基金管理人对宏观经济、证券市场运行走势的简要判断。

④报告期内本基金投资策略和运作情况说明。

⑤公平交易制度的执行情况。

⑥关联交易定价政策。

⑦报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元

序号 **债券代码** **债券名称** **数量(份)** **公允价值** **占基金资产净值比例(%)**

1 110015 石化转债 1,801,670 182,112,803.60 3.87

2 113002 工行转债 1,200,000 129,924,000.00 2.76

3 091995 09国债15 1,000,000 99,780,000.00 2.12

4 019202 12国开02 400,000 40,012,000.00 0.85

5 - - - - -

(注:本基金的业绩报酬指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。)

(注:本基金的收益分配政策详见本基金合同收入分配条款, 其他收入、不含公允价值变动收益、其他收入、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额, 本期利润即为本期实现的收入加上其他收入、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, 本期利润即为本期实现的收入加上本期公允价值变动收益。)

4.2 报告期内基金的现金流量

截至2012年3月31日, 本基金份额净值为10.166元, 本期报告期的净值增长率为0.65%, 同期间相比基准增长率为0.25%。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场运行走势的简要判断。

4.4 报告期内本基金投资策略和运作情况说明。

4.5 公平交易制度的执行情况。

4.6 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号 **项目** **金额** **占基金总资产的比例(%)**

1 权益投资 3,891,739,024.47 77.99

其中:股票 3,891,739,024.47 77.99

2 固定收益投资 451,828,803.60 9.06

其中:债券 451,828,803.60 9.06

3 货币市场工具 451,828,803.60 9.06

4 其他资产 4,989,738,883.12 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 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股票投资明细

单位:人民币元

序号 **股票代码** **股票名称** **数量(股)** **公允价值** **占基金资产净值比例(%)**

1 600256 广汇股份 18,779,485 442,444,666.60 9.41

2 601061 大秦铁路 41,000,000 305,450,000.00 6.49

3 600050 中国联通 54,417,567 230,186,304.41 4.89

4 601166 兴业银行 16,000,000 213,120,000.00 4.53

5 600028 中国石化 26,571,454 191,048,754.26 4.06

6 600086 东方航空 14,000,000 172,340,000.00 3.66

7 600239 银川银行 20,000,798 141,005,625.90 3.00

8 601688 华泰证券 15,999,987 147,459,885.86 2.99

9 600036 招商银行 62,772,500.00 147,373,181.10 2.23

10 300004 南风股份 4,102,201 94,637,777.07 2.01

(注:本基金的业绩报酬指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。)

(注:本基金的收益分配政策详见本基金合同收入分配条款, 其他收入、不含公允价值变动收益、其他收入、不含公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额, 本期利润即为本期实现的收入加上其他收入、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, 本期利润即为本期实现的收入加上本期公允价值变动收益。)

5.4 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债券投资明细

单位:人民币元

序号 **债券代码** **债券名称** **数量(份)** **公允价值** **占基金资产净值比例(%)**

1 110015 石化转债 1,801,670 18