

华夏经典配置混合型证券投资基金

2012 第二季度 报告

2012年6月30日

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	24,696,804.80	1.83
C	制造业	468,285,790.81	34.71

C0	食品,饮料	108,445,484.84	8.04
C1	纺织,服装,皮毛	-	-
C2	木材,家具	13,125,414.17	0.97
C3	医药,保健	-	-
C4	石油,化学,塑胶,塑料	35,125,388.20	2.60
C5	电子	-	-
C6	金属,非金属	72,920,998.02	5.41
C7	机械,设备,仪器	128,861,742.50	9.55
C8	其他,生物制品	92,384,762.98	7.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力,煤气及水的生产和供应业	15,836,257.72	1.17
E	建筑业	41,082,623.37	3.05
F	交通运输,仓储业	25,536,117.66	1.88
G	信息传输	70,750,761.16	5.24
H	批发和零售贸易	58,607,963.35	4.34
I	金融,保险业	181,152,655.01	13.43
J	房地产业	27,065,000.00	2.01
K	其他服务业	53,952,126.47	4.00
L	传播,文化,艺术	14,240,556.76	1.06
M	综合类	13,034,626.00	0.97
合计		994,069,302.51	73.69

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

名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
贵州茅台	1,000	1,000.00	0.01%
五粮液	1,000	1,000.00	0.01%
洋河股份	1,000	1,000.00	0.01%
泸州老窖	1,000	1,000.00	0.01%
山西汾酒	1,000	1,000.00	0.01%
古井贡酒	1,000	1,000.00	0.01%
水井坊	1,000	1,000.00	0.01%
舍得酒业	1,000	1,000.00	0.01%
口子窖	1,000	1,000.00	0.01%
董氏酒庄	1,000	1,000.00	0.01%

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	600406	国电南瑞	3,038,564	56,790,761.16	4.21
2	000776	广发证券	1,799,901	53,211,046.83	3.94
3	600887	伊利股份	2,569,600	52,882,368.00	3.92
4	601318	中国平安	999,946	45,737,530.04	3.39

5	000255	尚荣医疗	2,893,615	44,619,543.30	3.31
6	000039	中集集团	3,299,930	43,889,069.00	3.28
7	600000	浦发银行	5,000,000	40,650,000.00	3.01
8	601669	中国水电	8,000,000	34,960,000.00	2.59
9	600754	锦江股份	2,211,926	34,948,430.80	2.59
10	000869	张裕 A	470,534	31,648,116.84	2.35
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	公允价值占净资产的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,082,000.00	8.98
	其中：政策性金融债	121,082,000.00	8.98
4	企业债券	150,086,600.00	11.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债	25,000,716.80	1.85
8	其他	-	-
9	合计	296,169,400.80	21.96

报告期内本基金投资前十名证券中投资于非公开发行股票的数量				金额单位：人民币元
序号	报告期末代码	报告名称	数量(股)	公允价值
1	112006	08华研 G2	550,000	57,084,500.00
2	122051	10石 01	519,550	51,487,405.00
3	080417	08德发 17	500,000	50,505,000.00
4	081002	08南广 02	400,000	40,436,000.00
5	060807	06广都 07	400,000	39,912,000.00
6	060807	06广都 07	400,000	39,912,000.00

5.6 报告期内本基金投资前十名证券公允价值比例大于排名前五名证券投资总额
 本基金报告期末未持有非公开发行股票。

5.7 报告期内本基金投资前十名证券公允价值比例大于排名前五名权证投资总额
 本基金报告期末未持有权证。

5.8 报告期内合规报告
 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 报告期内前十名股票中未持有基金合同约定的投资品种。

5.8.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,250,000.00
2	应收证券清算款	7,763,945.88
3	应收股利	-
4	应收利息	5,913,686.62
5	应收申购款	214,644.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,162,276.76

5.8.4 期末持有处于到期前的可转换债券明细				金额单位：人民币元
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	21,135,340.80	1.57
2	113001	中行转债	3,465,376.00	0.29

5.8.5 期末前10名股票存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	金额单位：人民币元
1	000776	广发证券	29,350,000.00	2.18	非公开发行

5.8.6 股票投资存在限售期的其他说明文字

由于四笔A股的购入、分派之和与持仓之间可能存在尾差

§6 开放式基金份额变动

单位：份

截至本报告期初基金份额总额	1,461,350,826.96
截至本报告期末申购份额	20,993,594.46
截至本报告期末赎回份额	36,365,704.85
截至本报告期末基金份额变动份额	-
截至本报告期末基金份额总额	1,445,979,751.94

§7 影响投资者决策的其他重要信息

1. 报告期内披露的主要事项

2012年4月21日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月7日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月11日发布华夏基金管理有限公司公告。

2012年5月11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。

2012年6月29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交通银行网上银行、手机银行定投业务的公告。

2. 其他重要信息

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设立的首批全国性基金管理公司之一，总部设在北京，并在上海、深圳、成都、武汉和广州设有分公司，在香港设立子公司——香港华夏基金有限公司。目前本公司管理公募基金，境内开放式基金，境内封闭式ETF基金以及特定资产管理产品，香港公开市场股票ROFII基金业务。华夏基金是业务领域最广、资产规模最大的证券投资基金公司之一。2012年2季度，华夏基金继续保持以深入的投资研究为驱动，高度重视风险管理，同时积极把握投资机会，在保持基金资产稳健增值的基础上，取得较好的投资业绩。

根据中国证券基金业协会统计(截至 2012 年 6 月 29 日数据),今年以来,华夏盛世股票、华夏成长混合等 9 基金净申购资金达到约 362 亿元。华夏恒生 ETT 及其他基金获中国证监会核准募集,内地投资者可通过这两只基金实现对香港市场的便捷投资。

S8 备份文件目录

- 8.1 备份文件目录
 - 8.1.1 中国证监会核准基金募集的文件;
 - 8.1.2 华夏经配置混合型证券投资私募基金合同;
 - 8.1.3 华夏经配置混合型证券投资私募基金信托协议;
 - 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
- 备份文件存放于基金管理人处/或基金托管人的住所。
- 8.3 查阅方式
- 投资者可向基金管理人处/或基金托管人的住所免费查阅备份文件,在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备份文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一二年七月十八日

金额单位：人民币元					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120405	12农发 05	1,000,000	100,470,000.00	2.99
2	110414	11农发 14	800,000	80,144,000.00	2.39

3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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。

5.82 报告期内,基金管理人基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现基金投资的前十名证券的发行主体被中国证监会立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.83 基金投资组合中十名股票投资符合基金合同规定的备选股票清单。

5.84 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存出保证金	1,877,712.30	
2	应收证券清算款	—	
3	应收股利	269,597.99	
4	应收利息	3,734,679.05	
5	应收申购款	1,590,063.82	
6	其他应收款	—	
7	待摊费用	—	

8.4	其他	9	合计	7,472,452.56				
8.5	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。								
8.6	期末前十名股票持仓在流通受限股票中的分布情况							
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。								
8.7	报告期末按公允价值计量的基本金融工具公允价值							
由于公允价值的原因,分项之和与合计数之间可能存在尾差。								
96 开放式基金份额变动								
				单位:份				
报告期初基金份额总额				1,486,558,715.99				
报告期间基金总申购份额				73,174,000.05				
本报告期间基金总赎回份额				53,632,626.74				
报告期间基金净申购/赎回份额				19,541,373.30				
报告期末基金份额总额				1,506,400,089.30				

57 影响投资

到期支付 5%。

投资者可向其托管人香港证券 ETP 华夏基金 ETP 及其联席基金托管人证监会核准募集,内地投资者可通过购买该基金实现其投资香港市场的便捷投资。

§6 备查文件目录

1.1 备查文件目录

1.1.1 中国证监会基金募集的相关文件;

1.1.2 中国证监会核准基金募集的批复文件;

1.1.3 华夏基金股票型证券投资基金托管协议;

1.1.4 法律意见书;

1.1.5 基金管理人业务资格和资质、营业执照;

1.1.6 基金托管人业务资格和资质、营业执照;

1.2 存放地点

新设文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

1.3 查阅方式

投资者可至基金管理人处,或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付文件工本费后可在合理时间内获取文件的复印件或复印件。

华夏基金 ETP 华夏基金 ETP

二〇一二年七月十八日