华夏理财30天债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月17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2012年10月24日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏理财30天债券	
基金主代码	001057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月24日	
报告期末基金份额总额	804,651,426.05份	
投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
下属两级基金的交易代码	001057	001058
报告期末下属两级基金的份额总额	689,295,694.51份	115,355,731.54份

§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(2012年10月24日-2012年12月31日)	
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
1.本期已实现收益	10,041,919.29	3,721,035.81
2.本期利润	10,041,919.29	3,721,035.81
3.期末基金资产净值	689,295,694.51	115,355,731.54

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

④本基金合同于2012年10月24日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏理财30天债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
自基金合同生效起至今	0.7496%	0.0043%	0.2545%	0.0000%	0.4951%	0.0043%

华夏理财30天债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
自基金合同生效起至今	0.7953%	0.0043%	0.2545%	0.0000%	0.5408%	0.0043%

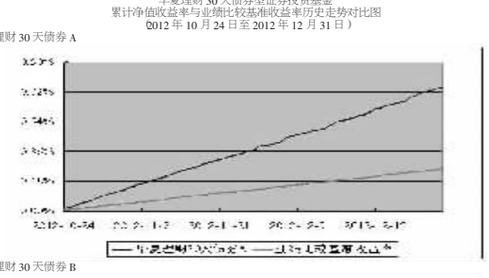
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财30天债券型证券投资基金

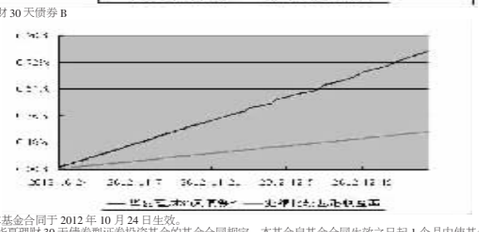
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年10月24日至2012年12月31日)

华夏理财30天债券A



华夏理财30天债券B



注:①本基金合同于2012年10月24日生效。

②根据华夏理财30天债券型证券投资基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起1个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资限制的有关约定。

§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		
李广云	本基金的基金经理	2012-10-24	-	11年	英国华威大学管理科学与运筹学硕士。曾任招商证券研究员、原中信基金研究员、基金经理助理等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任中信现金优势货币市场基金(现名华夏货币市场基金)基金经理(2007年7月12日至2012年2月29日)等。

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 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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

4季度,央行将公开市场7天逆回购利率稳定在3.35%的水平,为银行间市场提供了相对可靠的资金来源,这使得以往年末资金紧张的状况在今年并不突出。短期融资券的供应源源不断,整体收益率有所上行。

报告期内,本基金的投资以短期存款为主,并根据基金规模变动适当增持了短期融资券,通过在一级市场积极申购短期融资券获取一定一二级市场套利收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,华夏理财30天债券A本报告期份额净值收益率为0.7496%;华夏理财30天债券B本报告期份额净值收益率为0.7953%。同期业绩比较基准收益率为0.2545%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年1季度,货币政策预计保持半稳宽松,春节期间银行间市场流动性的波动幅度可能小于往年。本基金仍将以存款和短期融资券作为主要配置对象,同时关注春节因素对货币市场投资价值的影响。

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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	260,194,721.62	28.25
	其中:债券	260,194,721.62	28.25
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	653,239,399.74	70.92
4	其他各项资产	7,665,510.88	0.83
5	合计	921,099,632.24	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		1.78
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	114,911,392.57	14.28
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值情况的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	136
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.76	14.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	32.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	113.52	14.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	260,194,721.62	32.34
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	260,194,721.62	32.34
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041253070	12雅砻江CP003	600,000	60,101,072.22	7.47
2	041274003	12厦翔业CP001	300,000	30,076,098.46	3.74
3	041254067	12汕铁CP001	300,000	30,001,321.02	3.73
4	041256044	12冀建投CP001	300,000	29,971,465.07	3.72
5	041261034	12川煤炭CP001	200,000	20,025,163.97	2.49
6	041259073	12闽能源CP002	200,000	20,022,127.73	2.49
7	041259082	12川交投CP002	200,000	20,000,874.56	2.49
8	041254066	12兰花CP002	100,000	10,001,004.24	1.24
9	041252059	12华电股CP003	100,000	10,000,901.16	1.24
10	041251042	12集通CP001	100,000	10,000,436.96	1.24

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.04%
报告期内偏离度的最低值	-0.03%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,430,819.39
4	应收申购款	5,234,691.49
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,665,510.88

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 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

项目	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
基金合同生效日(2012年10月24日)基金份额总额	1,848,995,297.12	720,883,017.88
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	256,543,029.35	122,103,214.28
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,416,242,631.96	727,630,500.62
本报告期期末基金份额总额	689,295,694.51	115,355,731.54

注:①本基金自于2012年10月24日生效。

②上述"基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额"、"基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额"包含A级基金份额、B级基金份额间升降级的基金份额。

§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

2012年10月25日发布华夏理财30天债券型证券投资基金基金合同生效公告。

2012年11月8日发布华夏基金管理有限公司关于设立青岛分公司的公告。

2012年11月14日发布华夏理财30天债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告。

2012年11月22日发布华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告。

2012年12月3日发布华夏基金管理有限公司关于华夏理财30天债券型证券投资基金新增办理申购业务的代销机构的公告。

2012年12月28日发布华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告。

2012年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告。

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、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2012年4季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,积极把握市场反弹机会,旗下主动管理的股票型、混合型基金均取得了正收益,固定收益类产品也取得了稳定的回报,大部分基金表现优于市场平均水平。在客户服务方面,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提高服务质量;推出货币基金快速赎回业务,投资者可使用中国工商银行借记卡、招商银行储蓄卡、中国建设银行储蓄卡、中国农业银行金穗借记卡等银行卡通过电子交易平台快速赎回华夏现金增利证券投资基金,资金使用效率得到提高;推出余额理财服务,使用中国工商银行借记卡的电子交易客户可通过该功能将多余资金自动申购华夏现金增利证券投资基金,资金闲置时间有效减少。

§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《华夏理财30天债券型证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏理财30天债券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和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。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
二〇一三年一月二十一日

华夏红利混合型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月17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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏红利混合	
基金主代码	002011	
交易代码	002011	002012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年6月30日	
报告期末基金份额总额	12,686,414,898.86份	
投资目标	追求基金资产的长期增值。	
投资策略	在资产配置层面,本基金将采取积极的资产配置策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,确定基金资产在股票、债券和现金上的配置比例。在个股层面,基金主要选择具备良好现金分红能力且财务健康、具备长期增长潜力、市场估值合理的上市公司进行投资。	
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国A股红利150指数,债券投资的业绩比较基准为富时中国国债指数。基准收益率=富时中国A股红利150指数收益率×60%+富时中国国债指数收益率×40%。	
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。本基金主要投资于红利股,属于中等风险的证券投资基金品种。	
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	

§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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-368,708,023.73
2.本期利润	923,279,548.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0726
4.期末基金资产净值	17,664,234,318.53
5.期末基金份额净值	1.392

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 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	5.45%	0.89%	3.60%	0.61%	1.85%	0.28%

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

华夏红利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

(2005年6月30日至2012年12月31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		
谭琦	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-01-01	-	9年	工学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2007年9月27日至2009年1月1日期间)等。
赵航	本基金的基金经理	2011-01-18	-	15年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券资产管理中心投资经理、长城证券投资银行部项目经理、鹏华基金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日期间)、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日期间)等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理(2009年8月7日至2011年11月7日期间)等。
严鸿寒	本基金的基金经理	2011-11-07	-	11年	北京大学管理学硕士。曾任中国工商银行总行计划财务部主任科员、大鹏证券研究员、渤海证券投资经理、上汽集团财务公司投资部经理等。2008年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理(2010年2月4日至2011年11月7日期间)、机构投资经理等。

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 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。

报告期内,本基金出现1次涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,为指数基金因被动跟踪标的指数和基金发生的反向交易。

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

4季度,国际方面,欧美国家实施宽松的货币政策,经济缓慢复苏,全球股市普遍上涨,新兴市场反弹幅度较大,大宗商品价格高位稳定。国内方面,经济显现出短期企稳信号,但是房价反弹、产能过剩以及地方政府资产负债表恶化等中长期制约因素仍然存在。A股市场先下跌,然后快速反弹,风格有所逆转,银行、地产、汽车等早周期板块涨幅靠前,食品饮料、信息技术等板块表现较差。

报告期内,本基金维持低仓位运作,适当增加了采掘、机械行业的比重,降低了零售、信息技术行业的比重,整体结构变化较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为1.392元,本报告期份额净值增长率为5.45%,同期业绩比较基准增长率为3.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,国内经济将继续处于"减速—企稳"交替出现的阶段,2013年年初有望延续2012年4季度短期企稳反弹的格局,同时流动性偏宽松、海外资金流入以及市场处于数据和业绩真空期也将会提振投资者短期信心。但是困扰经济的一些长期问题仍然没有系统解决,经济难有趋势性改善,市场可能不会出现大机会。

基于上述背景,本基金将在整体谨慎的前提下,从三个方面积极把握机会:第一,需求有扩张能力同时率先产能出清的行业;第二,具备较强竞争优势的企业;第三,估值合理的板块。

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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	13,793,057,032.75	75.49
	其中:股票	13,793,057,032.75	75.49
2	固定收益投资	2,205,894,953.07	12.07
	其中:债券	2,205,894,953.07	12.07
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	48,500,144.25	0.27
	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	2,156,865,636.32	11.81
6	其他各项资产	66,025,603.74	0.36
7	合计	18,270,343,370.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	187,071,566.94	1.06
B	采掘业	1,012,824,755.92	5.73
C	制造业	5,798,241,185.47	32.82
C0	食品、饮料	705,731,445.28	4.00
C1	纺织、服装、皮毛	32,578,986.60	0.18
C2	木材、家具	31,118,727.48	0.18
C3	造纸、印刷	68,441,972.75	0.39
C4	石油、化学、塑胶、塑料	709,054,794.50	4.01
C5	电子	421,784,853.18	2.39
C6	金属、非金属	431,565,545.15	2.44
C7	机械、设备、仪表	1,937,281,142.47	10.97
C8	医药、生物制品	1,453,735,659.75	8.23
C99	其他制造业	6,948,058.31	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	801,966,120.36	4.54
E	建筑业	217,371,757.72	1.23
F	交通运输、仓储业	450,446,931.84	2.55
G	信息技术业	767,264,229.21	4.34
H	批发和零售贸易	749,162,124.32	4.24
I	金融、保险业	2,481,846,850.33	14.05
J	房地产业	848,088,421.72	4.80
K	社会服务业	163,955,075.99	0.93
L	传播与文化产业	109,816,537.02	0.62
M	综合类	205,001,475.91	1.16
	合计	13,793,057,032.75	78.08

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

金额单位: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	601318	中国平安	7,592,182	343,849,922.78	1.95
2	600050	中国联通	89,480,698	313,182,443.00	1.77
3	600036	招商银行	18,424,984	253,343,530.00	1.43
4	000400	许继电气	10,257,320	252,842,938.00	1.43
5	601398	工商银行	58,208,510	241,565,316.50	1.37
6	601166	兴业银行	14,246,221	237,769,428.49	1.35
7	600016	民生银行	26,607,619	209,135,885.34	1.18
8	601688	华泰证券	20,807,989	203,918,292.20	1.15
9	600546	山煤国际	9,601,462	195,389,751.70	1.11
10	000562	宏源证券	12,000,000	193,920,000.00	1.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	828,736,370.00	4.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	635,257,000.00	3.60
	其中:政策性金融债	635,257,000.00	3.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,762,000.00	1.36
6	中期票据	-	-
7	可转债	501,139,583.07	2.84
8	其他	-	-
9	合计	2,205,894,953.07	12.49

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

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	010107	21国债(7)	4,000,000	418,760,000.00	2.37
2	019219	12国债19	4,100,000	409,976,370.00	2.32
3	113001	中行转债	2,811,480	270,886,098.00	1.53
4	120228	12国开28	1,800,000	179,586,000.00	1.02
5	120410	12农发10	1,700,000	166,481,000.00	0.94

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 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,750,000.00
2	应收证券清算款	26,559,051.19
3	应收股利	-
4	应收利息	28,878,523.98
5	应收申购款	8,838,028.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,025,603.74

5.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	113001	中行转债	270,886,098.00	1.53
2	113002	工行转债	110,904,822.20	0.63
3	110018	国电转债	94,803,456.00	0.54
4	110016	川投转债	8,414,761.20	0.05
5	110007	博汇转债	6,301,694.10	0.04
6	110017	中海转债	5,769,733.60	0.03
7	113003	重工转债	2,327,160.00	0.01
8	125887	中鼎转债	1,372,143.17	0.01
9	110011	歌华转债	359,714.80	0.00

5.8.5 期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

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(%)	流通受限情况说明
1	000562	宏源证券	193,920,000.00	1.10	非公开发行流通受限

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	12,759,174,730.00
本报告期基金总申购份额	386,395,373.69
减:本报告期基金总赎回份额	459,155,204.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,686,414,898.86

§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

2012年11月8日发布华夏基金管理有限公司关于设立青岛分公司的公告。

2012年11月22日发布华夏基金管理有限公司关于设立北京东四环投资理财中心的公告。

2012年11月30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银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告。

2012年12月28日发布华夏基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告。

2012年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于设立华夏资本管理有限公司的公告。

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、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2012年4季度,华夏基金继续坚持以深入的投资研究为基础,积极把握市场反弹机会,旗下主动管理的股票型、混合型基金均取得了正收益,固定收益类产品也取得了稳定的回报,大部分基金表现优于市场平均水平。在客户服务方面,华夏基金继续以客户需求为导向,持续提高服务质量;推出货币基金快速赎回业务,投资者可使用中国工商银行借记卡、招商银行储