华夏现金增利证券投资基金

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	华夏现金增利货币
基金主代码	003003
交易代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月7日
报告期末基金份额总额	43,458,952,552.61份
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下,追求超过基准的较高收益。
投资策略	积极判断短期利率变动,合理安排期限,细致研究,谨慎操作,以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“同期7天通知存款利率”。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。
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

§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	321,432,352.03
2.本期利润	321,432,352.03
3.期末基金资产净值	43,458,952,552.61

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,由于货币市场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本基金按日结转份额。

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

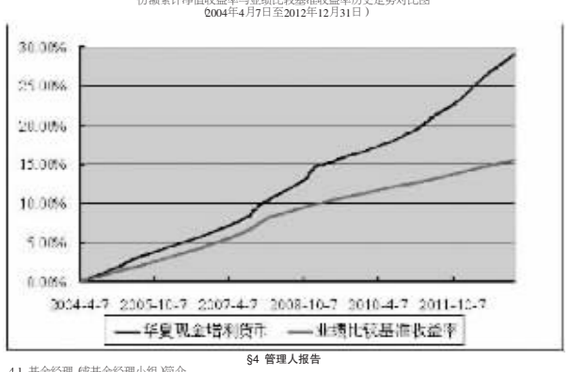
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9580%	0.0027%	0.3393%	0.0000%	0.6187%	0.0027%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华夏现金增利证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年4月7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		
曲波	本基金的基金经理、固定收益部总经理助理	2008-01-18	-	9年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理等。

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,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

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季度,国内宏观经济温和复苏,房地产市场有所回暖且价格上行压力增加,CPI仍处于偏低水平。货币政策以中性偏宽松为主,央行连续利用逆回购操作对资金面进行调节,7天逆回购利率稳定在3.35%。产品方面,货币市场短期利率产品收益率上行15BP;浮息债先跌后涨,整个季度来看表现较好;短期融资券绝对收益率较高,但受供给压力影响,整体收益率上行25BP左右。

报告期内,本基金仍主要投资于同业存款,在短融收益率上行后,于11月开始积极增持了中高评级短融。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为0.9580%,同期业绩比较基准收益率为0.3393%,本基金的业绩比较基准为同期7天通知存款利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年1季度,宏观经济整体上仍处于弱反弹过程,通胀水平仍维持在偏低位置,货币政策仍将以中性偏宽松为主,货币市场利率整体上将保持稳定。经过2012年4季度收益率的进一步上行之后,各类债券投资价值明显提高,其中中高等级短期融资券的投资价值最为显著。

2013年1季度,本基金将保持短期融资券的较高持仓比例,同时继续投资于短期存款,力争在保证流动性的前提下获得较好的利息收入。

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	固定收益投资	20,008,650,072.32	41.11
	其中:债券	20,008,650,072.32	41.11
	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	26,390,101,659.15	54.22
4	其他各项资产	2,270,873,635.72	4.67
5	合计	48,669,625,367.19	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	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	17.74	
	其中:买断式回购融资	0.03	
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	5,073,146,543.42	11.67
	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的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	157
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	160
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	103

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

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	28.47	11.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.61	-
2	30天(含)-60天	3.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	5.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.16	-
4	90天(含)-180天	34.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	34.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.77	11.93

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	1,118,952,731.61	2.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,655,276,258.62	10.71
	其中:政策性金融债	4,655,276,258.62	10.71
4	企业债券	213,843,270.47	0.49
5	企业短期融资券	14,020,577,811.62	32.26
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	20,008,650,072.32	46.04
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	3,810,288,381.16	8.77

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	110221	11国开21	15,300,000	1,509,181,628.96	3.47
2	041261041	12国电集CP004	10,300,000	1,030,458,285.52	2.37
3	090205	09国开05	8,100,000	805,771,126.13	1.85
4	011210005	12中电投SCP005	7,200,000	719,355,635.13	1.66
5	011215003	12中铝业SCP003	6,000,000	599,474,761.39	1.38
6	110212	11国开12	6,000,000	590,879,779.79	1.36
7	019219	12国债19	5,400,000	539,964,290.71	1.24
8	041252038	12中铝业CP002	5,000,000	500,009,190.20	1.15
9	011212004	12华能SCP004	5,000,000	499,522,225.27	1.15
10	100236	10国开36	3,900,000	390,413,373.81	0.90

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	0.09%
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	0.07%

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

鉴于货币市场基金的特性,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 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	379,901,356.77
4	应收申购款	1,890,722,278.95
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,270,873,635.72

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本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

本报告期期初基金份额总额	30,071,837,797.05
本报告期基金总申购份额	43,543,411,692.87
减:本报告期基金总赎回份额	30,156,296,937.31
本报告期期末基金份额总额	43,458,952,552.61

§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12月13日发布关于恢复办理华夏现金增利证券投资基金正常申购业务的公告。

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研研究为基础,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《华夏现金增利证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏现金增利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

华夏大盘精选证券投资基金

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	华夏大盘精选混合	
基金主代码	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年8月11日	
报告期末基金份额总额	326,241,502.27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“自下而上”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,精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性,基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略,即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析,监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险水平合理。	
业绩比较基准	本基金整体的业绩比较基准为“富时中国A200指数×80%+富时中国国债指数×20%”。	
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金,低于成长型股票基金。	
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

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	-131,914,511.70
2.本期利润	99,114,790.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2884
4.期末基金资产净值	2,486,768,606.73
5.期末基金份额净值	7.622

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	4.30%	1.22%	8.73%	1.02%	-4.43%	0.20%

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

华夏大盘精选证券投资基金

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8月11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		
巩怀志	本基金的基金经理、投资副总监、股票投资部副总经理	2012-05-04	-	11年	清华大学MBA。曾任鹏华基金基金经理助理、社保股票组合基金经理等。2005年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏监筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2007年5月9日至2009年1月1日期间)、华夏成长证券投资基金基金经理(2005年10月29日至2010年1月16日期间)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,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

2012年4季度,国际方面,美国继续执行宽松的货币政策,欧债危机处于较为稳定的状态,全球投资者风险偏好上升,新兴市场经济逐步企稳,资金流入大断增加。国内方面,经济在政府基建投资的带动下出现企稳反弹,上中下游需求均有所改善,企业盈利能力环比略有恢复。

A股市场10月横盘震荡,11月在政策维稳预期结束以后出现恐慌性杀跌局面,12月份在外资流入和经济改善推动下出现了一轮反弹行情。期间,低估值周期性行业如银行、地产、汽车、家电、水泥等涨幅较大,而前期被机构过度配置但基本面低于预期的白酒、部分科技行业等出现大幅下跌。

报告期内,本基金重点持有了能够在经济弱周期中保持业绩较快增长的股票。行业配置方面,重点超配了化工、机械、医药、房地产等,其他行业配置较为均衡。从投资效果来看,由于低估值周期股配置不足,组合收益率受到影响。

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7.622元,本报告期份额净值增长率为4.30%,同期业绩比较基准增长率为8.73%。

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2013年1季度,经济企稳反弹的态势可能延续,此期间处于经济活动的季节性淡季、信贷的季节性旺季,流动性将有所改善。股票市场震荡后有望继续反弹,可能出现小规模的行业轮动机会和一些主题性投资机会,但业绩增速高的成长股将最终胜出。

本基金将继续“自下而上”精选竞争力强、可中长期投资的个股,并积极研究改革和经济运行的方向,在控制整体风险的基础上,不断优化投资组合。

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	2,238,200,931.11	87.57
	其中:股票	2,238,200,931.11	87.57
2	固定收益投资	136,260,046.80	5.33
	其中:债券	136,260,046.80	5.33
	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	123,784,483.47	4.84
6	其他各项资产	57,700,287.11	2.26
7	合计	2,555,945,748.49	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	24,088,158.64	0.97
B	采掘业	30,526,244.64	1.23
C	制造业	1,331,524,631.33	53.54
C0	食品、饮料	95,852,581.98	3.85
C1	纺织、服装、皮毛	8,259,687.52	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	51,654,724.12	2.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	369,347,555.96	14.85
C5	电子	147,574,042.10	5.93
C6	金属、非金属	34,577,702.90	1.39
C7	机械、设备、仪表	308,034,300.23	12.39
C8	医药、生物制品	316,224,036.52	12.72
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	139,420,810.00	5.61
F	交通运输、仓储业	66,018,465.95	2.65
G	信息技术业	136,597,742.98	5.49
H	批发和零售贸易	121,883,921.30	4.90
I	金融、保险业	119,089,661.08	4.79
J	房地产业	214,896,806.05	8.64
K	社会服务业	29,851,213.50	1.20
L	传播与文化产业	24,303,275.64	0.98
M	综合类	-	-
	合计	2,238,200,931.11	90.00

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	601886	江河幕墙	6,395,450	139,420,810.00	5.61
2	002664	信质电机	4,969,027	125,567,312.29	5.05
3	300032	金龙机电	5,516,042	108,059,262.78	4.35
4	600285	羚锐制药	9,746,473	105,066,978.94	4.23
5	000999	华润三九	4,199,802	99,535,307.40	4.00
6	000028	国药一致	2,787,073	98,383,676.90	3.96
7	600571	信雅达	9,959,764	89,139,887.80	3.58
8	600527	江南高纤	16,424,316	76,044,583.08	3.06
9	000783	长江证券	7,928,922	74,531,866.80	3.00
10	600048	保利地产	5,399,955	73,439,388.00	2.95

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	76,398,046.80	3.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,862,000.00	2.41
	其中:政策性金融债	59,862,000.00	2.41
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	136,260,046.80	5.48

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	019202	12国债02	713,670	71,395,546.80	2.87
2	120228	12国开28	600,000	59,862,000.00	2.41
3	019201	12国债01	50,000	5,002,500.00	0.20
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。

5.8 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中不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	349,508,875.59
本报告期基金总申购份额	7,728,077.29
减:本报告期基金总赎回份额	30,995,450.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	326,241,502.27

§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12月24日发布关于华夏大盘精选证券投资基金 “前端”收复办理申购、转换转入、定期定额申购业务的公告。

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研研究为基础,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大盘精选证券投资基金,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大盘精选证券投资基金,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《华夏大盘精选证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏大盘精选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

华夏回报证券投资基金

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	华夏回报混合	
基金主代码	002001	
交易代码	002001	002002
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9月5日	
报告期末基金份额总额	7,863,232,038.00份	
投资目标	尽量避免基金资产损失,追求每年较高的绝对回报。	
投资策略	正确判断市场走势,合理配置股票和债券等投资工具的比例,准确选择具有投资价值的股票品种和债券品种进行投资,可以在尽量避免基金资产损失的前提下实现基金每年较高的绝对回报。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为绝对回报标准,为同期一年期定期存款利率。	
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金,低于股票基金。	
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

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	30,306,650.44
2.本期利润	499,955,913.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0633
4.期末基金资产净值	10,139,078,802.82
5.期末基金份额净值	1.289

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