华夏盛世精选股票型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月十九日

§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4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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏盛世股票
基金主代码	000061
交易代码	000061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	9,509,968,872.67份
投资目标	紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。
投资策略	本基金以周期优选投资策略为核心,并辅以个股精选和积极债券管理策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。
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,属于较高风险、较高收益的品种。
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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	244,892,358.17
2.本期利润	-147,044,144.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0151
4.期末基金资产净值	7,071,200,240.06
5.期末基金份额净值	0.744

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	-1.98%	1.23%	-0.61%	1.24%	-1.37%	-0.01%

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

华夏盛世精选股票型证券投资基金

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

(2009年12月11日至2013年3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		
阳琨	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2009-12-18	-	18年	北京大学MBA,曾任宝盈基金基金经理助理,益民基金投资部部门经理,中国对外经济贸易信托投资公司财务部部门经理等,2006年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略研究员、兴和证券投资基金基金经理(2009年1月1日至2012年1月12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

1季度,国际经济延续了弱复苏格局,但区域间差距加大。美国尽管受到财政减支的影响,但就业和生产情况都强于预期,同时房地产回暖也成为经济复苏的一大支柱。欧洲仍旧挣扎在衰退线上。日本虽然在量宽的基础上加大日元贬值幅度,但实际效果低于预期。虽然发达国家都实行了宽松的货币政策,但不同的经济走势导致美元相对欧元和日元大幅升值。国内经济延续弱复苏,主要亮点表现在净出口的大幅增长,其他如工业、投资和消费则表现平平。

1季度市场利率保持稳定,收益主要来源于票息收入。虽然经济的复苏预期对债市有一定负面影响,但是资金面的宽松状态有效提升了债市需求,市场表现平稳。

报告期内,本基金组合久期与指数基准久期基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,华夏盛世精选股票型证券投资基金份额净值为0.744元,本报告期份额净值增长率为-1.98%,同期业绩比较基准增长率为-0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段,我们依然认为国内经济处于温和复苏的轨道中。由于融资成本明显下降,预计未来一两个季度上市公司的盈利将继续环比好转,股票市场仍处于有吸引力的地位。经过了部分行业和板块市场估值的快速修复,投资者关注点将转到上市公司的业绩上,业绩增长持续性较好的公司将有继续表现的空间。因此,我们预计市场可能呈现震荡向上的格局,虽然短期内牛市重临可能性不大,但在通胀不构成实质性威胁前,股票市场的表现仍值得期待。

根据上述判断,我们认为股票投资依然处于“有可为”的阶段,但行业和股票的选择将会是决定投资业绩的主要因素。因此,我们计划进一步改进个股选择能力,坚持价值投资,做好风险控制,寻找真正能够适应经济转型的新兴行业及传统行业中的个股,谋求基金净值的稳健增长。

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	5,955,433,101.25	83.46
	其中:股票	5,955,433,101.25	83.46
2	固定收益投资	563,670,867.10	7.90
	其中:债券	563,670,867.10	7.90
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	600,116,284.13	8.41
7	其他各项资产	16,845,718.21	0.24
8	合计	7,136,065,970.69	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	-	-
B	采矿业	362,936,910.05	5.13
C	制造业	3,083,016,026.74	43.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	282,598,006.52	4.00
E	建筑业	76,540,795.02	1.08
F	批发和零售业	457,195,236.13	6.47
G	交通运输、仓储和邮政业	116,820,590.61	1.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,800,516.40	1.24
J	金融业	1,433,968,613.02	20.28
K	房地产业	54,556,406.76	0.77
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,955,433,101.25	84.22

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	600518	康美药业	18,999,755	333,255,702.70	4.71
2	601318	中国平安	7,021,070	293,270,093.90	4.15
3	600000	浦发银行	27,759,970	281,208,496.10	3.98
4	600036	招商银行	17,128,531	216,333,346.53	3.06
5	002106	莱宝高科	8,289,091	206,066,802.26	2.91
6	601398	工商银行	50,271,455	203,599,392.75	2.88
7	000157	中联重科	25,199,932	202,607,453.28	2.87
8	600886	国投电力	31,723,329	201,760,372.44	2.85
9	600694	大商股份	5,195,871	192,766,814.10	2.73
10	600690	青岛海尔	14,878,281	189,400,517.13	2.68

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	80,184,000.00	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	450,124,000.00	6.37
	其中:政策性金融债	450,124,000.00	6.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	33,362,867.10	0.47
8	其他	-	-
9	合计	563,670,867.10	7.97

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	120405	12农发05	2,300,000	230,046,000.00	3.25
2	130210	13国开10	1,700,000	170,068,000.00	2.41
3	019219	12国债19	800,000	80,184,000.00	1.13
4	120216	12国开16	500,000	50,010,000.00	0.71
5	113002	工行转债	207,410	22,406,502.30	0.32

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。

5.9 报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 报告期内本基金投资国债期货的投资策略

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末国债期货持仓明细

5.9.3 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	1,836,605.68
2	应收证券清算款	2,287,318.94
3	应收股利	-
4	应收利息	11,786,535.47
5	应收申购款	935,258.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,845,718.21

5.9.4 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	113002	工行转债	22,406,502.30	0.32

5.9.5 期末前十名股票中存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	600694	大商股份	192,766,814.10	2.73	筹划重大资产重组事项

5.9.6 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	9,862,381,270.64
本报告期基金总申购份额	148,292,002.89
减:本报告期基金总赎回份额	500,704,400.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,509,968,872.67

§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

2013年2月18日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告。

2013年2月22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中国工商银行股份有限公司办理定期定额申购业务的公告。

2013年2月25日发布华夏基金管理有限公司关于开通财付通理财账户基金网上交易的公告。

2013年3月12日发布华夏基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通上海银行、平安银行、中国邮政储蓄银行借记卡电子交易业务的公告。

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、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。

2013年1季度,华夏基金旗下绝大部分基金开局良好;主动管理的股票型、混合型基金整体取得正收益,表现明显优于市场平均水平;债券型基金全部取得正收益;指数型基金继续紧密跟踪标的指数;货币型基金表现持续良好。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2013年3月29日数据),华夏复兴股票在328只标准股票型基金中排名前10%;华夏大盘精选混合在43只偏股型基金(股票上限95%)中排名第2;华夏成长混合在30只偏股型基金(股票上限80%)中排名第6。

2013年3月,在《证券时报》主办的“2012年度中国基金业明星基金奖”的评选中,华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”,所管理的基金荣获4个单项奖;在《上海证券报》主办的第十届中国“金基金”奖的评选中,华夏基金荣获“金基金十年·卓越公司奖”;在《中国证券报》主办的“第十届中国基金业金牛奖”的评选中,华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司奖”,所管理的基金荣获4个单项奖;在晨星(中国)举办的“晨星(中国)2013年度基金奖”评选中,华夏回报混合荣获“混合型基金奖”。

在客户服务方面,1季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高服务质量:(1)升级了货币基金的快速赎回业务;扩充了支持银行卡的范围,延长了业务办理时间,提高了投资者办理业务的限额;(2)推出了货币基金的信用卡还款业务,进一步为便投资者的现金管理。

§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《华夏盛世精选股票型证券投资基金基金合同》;

8.1.3《华夏盛世精选股票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
二〇一三年四月十九日

华夏理财30天债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月十九日

§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4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2013年1月1日起至3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	661,715,292.93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	570,512,162.44份 / 91,203,130.49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(2013年1月1日-2013年3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	6,098,826.58	1,166,107.92
2.本期利润	6,098,826.58	1,166,107.92
3.期末基金资产净值	570,512,162.44	91,203,130.49

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。

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
过去三个月	0.9761%	0.0036%	0.3329%	0.0000%	0.6432%	0.0036%

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
过去三个月	1.0359%	0.0036%	0.3329%	0.0000%	0.7030%	0.0036%

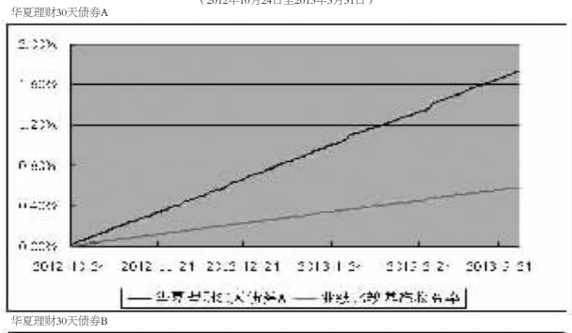
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财30天债券型证券投资基金

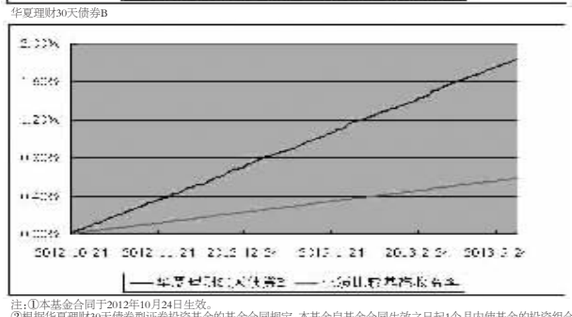
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年10月24日至2013年3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	-	12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

1季度,国内经济延续弱复苏格局,但区域间差距加大。美国尽管受到财政减支的影响,但就业和生产情况都强于预期,同时房地产回暖也成为经济复苏的一大支柱。欧洲仍旧挣扎在衰退线上。日本虽然在量宽的基础上加大日元贬值幅度,但实际效果低于预期。虽然发达国家都实行了宽松的货币政策,但不同的经济走势导致美元相对欧元和日元大幅升值。国内经济延续弱复苏,主要亮点表现在净出口的大幅增长,其他如工业、投资和消费则表现平平。

1季度市场利率保持稳定,收益主要来源于票息收入。虽然经济的复苏预期对债市有一定负面影响,但是资金面的宽松状态有效提升了债市需求,市场表现平稳。

报告期内,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	219,922,508.07	27.87
	其中:债券	219,922,508.07	27.87
	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	560,710,976.79	71.05
4	其他各项资产	8,555,846.13	1.08
5	合计	789,189,330.99	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	9.33
	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	125,999,497.00	19.04
	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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2013-01-25	163	基金规模变动	3个工作日
2	2013-01-28	158	基金规模变动	2个工作日
3	2013-01-29	154	基金规模变动	1个工作日

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	49.96	19.04
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.05	-
2	30天(含)-60天	12.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	9.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	22.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	117.97	19.04

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	59,870,102.16	9.05
	其中:政策性金融债	59,870,102.16	9.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,052,405.91	24.19
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	219,922,508.07	33.24
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	59,870,102.16	9.05

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维客江CP003	600,000	60,075,054.04	9.08
2	110402	11农发02	600,000	59,870,102.16	9.05
3	041254067	12出铁CP001	300,000	30,000,995.54	4.53
4	041256044	12冀建投CP001	300,000	29,978,537.59	4.53
5	041259082	12川交投CP002	200,000	20,000,657.26	3.02
6	041251042	12集通CP001	100,000	10,000,324.62	1.51
7	041254036	12蒙东CP002	100,000	9,996,836.86	1.51
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	0.23%
报告期内偏离度的最低值	0.04%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.17%

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 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,183,801.05
4	应收申购款	3,372,045.08
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,555,846.13

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

项目	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	689,295,694.51	115,355,731.54
本报告期基金总申购份额	469,023,727.36	150,295,148.20
减:本报告期基金总赎回份额	587,807,259.43	174,447,749.25
本报告期期末基金份额总额	570,512,162.44	91,203,130.49

注:上述“本报告期基金总申购份额”、“本报告期基金总赎回份额”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

2013年2月6日发布华夏理财30天债券型证券投资基金暂停申购业务的公告。

2013年2月25日发布华夏基金管理有限公司关于开通财付通理财账户基金网上交易的公告。

2013年3月12日发布华夏基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通上海银行、平安银行、中国邮政储蓄银行借记卡电子交易业务的公告。

2013年3月28日发布关于华夏理财30天债券型证券投资基金暂停申购业务的公告。

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、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。

2013年1季度,华夏基金旗下绝大部分基金开局良好;主动管理的股票型、混合型基金整体取得正收益,表现明显优于市场平均水平;债券型基金全部取得正收益;指数型基金继续紧密跟踪标的指数;货币型基金表现持续良好。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2013年3月29日数据),华夏复兴股票在328只标准股票型基金中排名前10%;华夏大盘精选混合在43只偏股型基金(股票上限95%)中排名第2;华夏成长混合在30只偏股型基金(股票上限80%)中排名第6。

2013年3月,在《证券时报》主办的“2012年度中国基金业明星基金奖”的评选中,华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”,所管理的基金荣获4个单项奖;在《上海证券报》主办的第十届中国“金基金”奖的评选中,华夏基金荣获“金基金十年·卓越公司奖”;在《中国证券报》主办的“第十届中国基金业金牛奖”的评选中,华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司奖”,所管理的基金荣获4个单项奖;在晨星(中国)举办的“晨星(中国)2013年度基金奖”评选中,华夏回报混合荣获“混合型基金奖”。

在客户服务方面,1季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高服务质量:(1)升级了货币基金的快速赎回业务;扩充了支持银行卡的范围,延长了业务办理时间,提高了投资者办理业务的限额;(2)推出了货币基金的信用卡还款业务,进一步为便投资者的现金管理。

§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