华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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：二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏策略混合
基金主代码	002031
交易代码	002031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月23日
报告期末基金份额总额	698,238,358.30份
投资目标	通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的长期、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金是灵活配置型混合基金，混合基金的风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金；而灵活配置型混合基金的资产配置比例可灵活调整，在混合基金中也属于较高风险、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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	61,425,918.77
2.本期利润	-29,437,218.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0409
4.期末基金资产净值	1,293,723,458.41
5.期末基金份额净值	1.853

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。

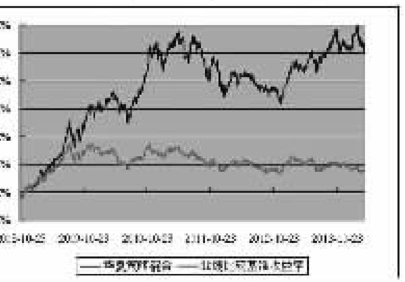
3.2 基金净值表现

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	-2.37%	1.11%	-4.01%	0.66%	1.64%	0.45%

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

华夏策略精选灵活配置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
（2008年10月23日至2014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		
谭琦	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2012-05-04	-	11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）。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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，宏观经济继续缓慢下行，政府政策中性，在政府大力主导调结构的影响下，受益于经济结构转型的新兴产业成长速度明显高于传统产业。基于上述背景，A股市场继续呈现结构性行情，以计算机、医疗服务为代表的部分新兴产业大幅上涨，传统产业股票则创出新低。

报告期内，本基金保持稳健的投资风格，行业配置相对均衡，略微偏向成长股，增持了信息技术、食品饮料等行业个股。本基金加大了“自下而上”发掘个股的力度，一些新增长点发力而市场关注偏低的个股对组合正贡献较大，如软件领域的小市值个股、植物蛋白饮料个股等；而一些长期看好但短期不能证实其增长点的个股贡献较多，如智慧家电板块等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日，本基金份额净值为1.853元，本报告期份额净值增长率为-2.37%，同期业绩比较基准增长率为-4.01%。

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2季度，宏观经济形势仍将继续下行，但亮点也不少。逐步深化的改革将带动中国经济稳步向前，同时，新兴产业如新能源汽车、云计算、移动互联网、信息安全、医疗服务等也正处于增长轨道。不过随着改革进入深水区，困难、阻力和成本也在加大，经济整体的压力不小。基于上述背景，结合长短期因素，我们认为未来股市仍将是结构性行情。

2季度，本基金将重点在以下几个方面把握结构性投资机会：（1）关注行业基本面趋势向好的股票；（2）精选业绩增长、市场关注度偏低、估值与成长较匹配的股票；（3）随着IPO的开闸和多层次的资本市场建设，股市不断迎来新鲜血液，本基金将加大覆盖面，努力选股，积极寻找全新的投资机会。

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	932,587,887.97	71.37
	其中：股票	932,587,887.97	71.37
2	固定收益投资	270,625,364.02	20.71
	其中：债券	270,625,364.02	20.71
	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	23,893,215.23	1.83
6	其他各项资产	79,635,307.93	6.09
7	合计	1,306,741,775.15	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	19,290,622.00	1.49
B	采矿业	-	-
C	制造业	629,737,018.40	48.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,791,726.33	0.76
E	建筑业	29,071,364.05	2.25
F	批发和零售业	78,629,876.89	6.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,073,241.70	10.75
J	金融业	12,049,000.00	0.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,021,133.14	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,923,905.46	0.38
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	932,587,887.97	72.09

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	600690	青岛海尔	4,464,819	72,508,660.56	5.60
2	600887	伊利股份	2,013,547	72,145,389.01	5.58
3	300057	万顺股份	3,200,168	37,089,947.12	2.87
4	000716	南方食品	2,749,872	35,198,361.60	2.72
5	300170	汉得信息	1,706,892	34,649,907.60	2.68
6	002480	新筑股份	2,552,692	34,308,180.48	2.65
7	000593	大通燃气	4,999,822	33,248,816.30	2.57
8	300182	捷成股份	784,051	31,910,875.70	2.47
9	002051	中工国际	1,599,965	29,071,364.05	2.25
10	000915	山大华特	985,420	26,744,298.80	2.07

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,954,000.00	5.41
	其中：政策性金融债	69,954,000.00	5.41
4	企业债券	154,559,815.72	11.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	46,111,548.30	3.56
8	其他	-	-
9	合计	270,625,364.02	20.92

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	113002	工行转债	440,000	43,727,200.00	3.38
2	130218	13国开18	300,000	30,000,000.00	2.32
3	130236	13国开36	300,000	29,967,000.00	2.32
4	122149	12石化01	279,500	26,776,100.00	2.07
5	122957	09蓉工投	150,000	14,995,500.00	1.16

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	273,842.48
2	应收证券清算款	70,024,595.39
3	应收股利	-
4	应收利息	6,865,646.17
5	应收申购款	2,471,223.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,635,307.93

5.10.4 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	43,727,200.00	3.38
2	110023	民生转债	1,175,412.80	0.09

5.10.5 期末前十名股票中存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存在流通受限情况。

5.10.6 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	747,941,323.21
本报告期基金总申购份额	43,949,917.15
减：本报告期基金总赎回份额	93,652,882.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	698,238,358.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,626,206.77
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,626,206.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.95

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年1月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告。

2014年1月23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厦门银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年2月12日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年2月22日发布华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告。

8.2 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。

2014年3月，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”的评选中，华夏基金第八次荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获6个单项奖：华夏现金增利货币荣获“2013年度货币市场金牛基金奖”，华夏中小板ETF荣获“2013年度指数型金牛基金奖”，华夏经典混合荣获“2013年度混合型金牛基金奖”，华夏回报混合荣获“三年期混合型金牛基金奖”，华夏大盘精选混合、华夏策略混合荣获“五年期混合型金牛基金奖”。

在客户服务方面，1季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务，方便投资者进行现金管理；（2）华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）开通了华夏基金百度轻应用，满足投资者服务渠道多样化的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

9.1.3《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

9.1.4法律意见书；

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年四月二十二日

华夏盛世精选股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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：二〇一四年四月二十二日

§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2014年4月18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2014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	7,264,027,215.19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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	146,080,792.70
2.本期利润	-168,203,608.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0221
4.期末基金资产净值	5,230,200,442.19
5.期末基金份额净值	0.720

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。

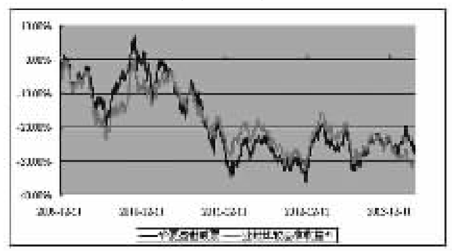
3.2 基金净值表现

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	-3.36%	1.22%	-6.16%	0.95%	2.80%	0.27%

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2014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、投资总监、股票投资部副总经理	2009-12-18	-	19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）、兴华证券投资基金基金经理（2007年6月12日至2013年4月11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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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，宏观经济稳中有降，整体流动性环境宽松，短期资金利率受年初资金充沛的影响略有走低。由于房地产销售呈较弱态势，投资者开始担忧房地产产业链面临新一轮下行风险。市场方面，A股震荡走低，在种类较多且收益率较高的银行理财等新型投资渠道的影响下，股市对社会资金缺乏吸引力，市场存量博弈的特征明显。1季度前半期，股市延续2013年的结构分化趋势，资金继续追逐预期成长空间较大的新兴行业股票，白马成长股因资金流出而持续下跌；1季度后半期，伴随美股中概股的调整，投资者趋于谨慎，市场整体回落。

报告期内，本基金继续对股票组合进行微调，继续增持部分成长前景较佳的中小市值股票。由于市场整体波动区间不大，本基金组合业绩表现平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日，本基金份额净值为0.720元，本报告期份额净值增长率为-3.36%，同期业绩比较基准增长率为-6.16%。

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2季度，市场的风险和收益并存。一方面整体资金价格仍处于较高水平，压制了资产价格，股市短期内缺乏向上突破的动力；另一方面随着改革的深入，微观企业的转型进展加速，无论传统国企还是新兴产业都在努力寻找新的发展机遇。创新和改革仍将是未来投资的焦点，我们将继续沿着“创新改变中国”和“改革释放红利”两条投资主线寻找投资机会。以创业板为代表的中小市值股票过去一年涨幅较大，可能出现阶段性调整，成长股在未来也可能分化。

2季度，本基金将“自上而下”密切跟踪房地产市场发展动态，对系统性风险保持警惕；同时“自下而上”加强个股研究，把握市场分化的机会，坚持价值投资，精选个股。

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	4,076,873,550.74	77.24
	其中：股票	4,076,873,550.74	77.24
2	固定收益投资	329,807,880.20	6.25
	其中：债券	329,807,880.20	6.25
	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	845,269,901.25	16.02
6	其他各项资产	25,933,155.88	0.49
7	合计	5,277,884,488.07	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	18,021,406.90	0.34
B	采矿业	251,587,362.51	4.81
C	制造业	2,844,397,699.31	54.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	279,673,476.28	5.35
E	建筑业	12,807,337.30	0.24
F	批发和零售业	124,768,612.08	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	228,324,713.26	4.37
J	金融业	126,119,266.64	2.41
K	房地产业	9,362,921.70	0.18
L	租赁和商务服务业	98,735,886.62	1.89
M	科学研究和技术服务业	18,425,643.94	0.35
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	64,649,224.20	1.24
S	综合	-	-
	合计	4,076,873,550.74	77.95

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	600690	青岛海尔	18,292,896	297,076,631.04	5.68
2	600518	康美药业	18,284,609	296,210,665.80	5.66
3	600887	伊利股份	7,605,104	272,490,876.32	5.21
4	600252	中恒集团	16,402,283	210,441,290.89	4.02
5	002683	宏大爆破	6,497,783	165,888,399.99	3.17
6	600406	国电南瑞	8,773,314	123,879,193.68	2.37
7	002005	德豪润达	15,294,831	122,817,492.93	2.35
8	600886	国投电力	26,619,341	122,448,968.60	2.34
9	600271	航天信息	5,430,558	105,678,658.68	2.02
10	600979	广安爱众	18,934,350	87,666,040.50	1.68

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,040,000.00	5.74
	其中：政策性金融债	300,040,000.00	5.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	29,767,880.20	0.57
8	其他	-	-
9	合计	329,807,880.20	6.31

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	140410	14农发10	2,000,000	200,000,000.00	3.82
2	130214	13国开14	1,000,000	100,040,000.00	1.91
3	113002	工行转债	207,410	20,612,405.80	0.39
4	110023	民生转债	103,440	9,155,474.40	0.18
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 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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	1,499,471.65
2	应收证券清算款	21,925,693.28
3	应收股利	-
4	应收利息	2,321,963.70
5	应收申购款	186,027.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,933,155.88

5.10.4 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	110023	民生转债	9,155,474.40	0.18
2	113002	工行转债	20,612,405.80	0.39

5.10.5 期末前十名股票中存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存在流通受限情况。

5.10.6 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	7,902,074,792.15
本报告期基金总申购份额	33,852,635.24
减：本报告期基金总赎回份额	671,900,212.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,264,027,215.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年1月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告。

2014年1月23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厦门银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年2月12日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年2月22日发布华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告。

本基金托管人于2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

8.2 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。

2014年3月，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”的评选中，华夏基金第八次荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获6个单项奖：华夏现金增利货币荣获“2013年度货币市场金牛基金奖”，华夏中小板ETF荣获“2013年度指数型金牛基金奖”，华夏经典混合荣获“2013年度混合型金牛基金奖”，华夏回报混合荣获“三年期混合型金牛基金奖”，华夏大盘精选混合、华夏策略混合荣获“五年期混合型金牛基金奖”。

在客户服务方面，1季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务，方便投资者进行现金管理；（2）华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）开通了华夏基金百度轻应用，满足投资者服务渠道多样化的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《华夏盛世精选股票型证券投资基金基金合同》；

9.1.3《华夏盛世精选股票型证券投资基金托管协议》；

9.1.4法律意见书；

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年四月二十二日

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第一季度 报告

2014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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年四月二十二日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
报告期末基金份额总额	25,102,769,769.49份
投资目标	采用指数化投资方式，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时应按期间折算）。
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。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数。
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。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	114,233,732.65
2.本期利润	-1,322,486,790.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0519
4.期末基金资产净值	16,346,877,124.84
5.期末基金份额净值	0.651

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。

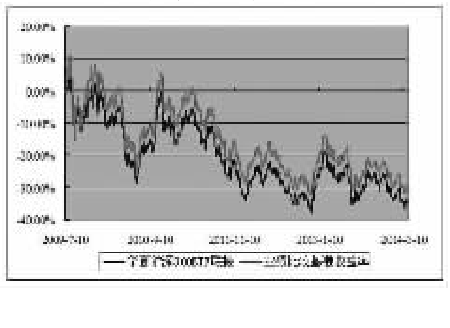
3.2 基金净值表现

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	-7.40%	1.15%	-7.24%	1.13%	-0.16%	0.02%

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

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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7月10日至2014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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	15年	硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2009-07-10	-	14年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理等。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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

本基金跟踪的标的指数为沪深300指数，业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成，自2005年4月8日起正式发布，以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深300指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF（华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金）的份额，从而实现基金投资目标，基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

1季度，国际方面，美国经济数据偏弱，但失业率持续下降，美联储继续逐步退出量化宽松政策；受美联储政策影响，多个新兴市场的货币明显贬值；欧洲经济则继续温和复苏。国内方面，经济运行虽然总体平稳，但投资、消费、贸易等多项经济数据表现低于市场预期，人民币出现快速贬值，国内首次债券到期付息违约事件引发了市场对经济运行环境的担忧。

市场方面，A股在上述因素影响下整体呈震荡下跌走势。沪深300指数本报告期下跌7.88%。

报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日，本基金份额净值为0.651元，本报告期份额净值增长率为-7.40%，同期业绩比较基准增长率为-7.24%。本基金本报告期跟踪偏离度为-0.16%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为目标ETF偏离、日常运作费用、申购赎回等产生的差异。

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2季度，国际方面，美国和欧洲经济将持续复苏，美联储将继续逐步退出量化宽松政策。国内方面，经济运行虽然平稳，但也面临一些挑战，改革推进力度及相应的财政、货币、税收政策调整等都将对经济和市场产生较大影响。

市场方面，如果有相关宏观经济政策的支持，改革红利能够逐步释放，则目前处于历史相对较低估值水平的沪深300指数会有较好的投资机会；反之，则可能继续维持震荡。

我们将根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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	778,224,084.58	4.75
	其中：股票	778,224,084.58	4.75
2	基金投资	14,739,087,014.20	90.02
3	固定收益投资	581,228,424.27	3.55
	其中：债券	581,228,424.27	3.55
	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	259,949,709.21	1.59
7	其他各项资产	14,848,605.70	0.09
8	合计	16,373,337,837.96	100.00

5.2 报告期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	14,739,087,014.20	90.16

5.3 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	4,388,641.94	0.03
B	采矿业	53,610,946.81	0.33
C	制造业	312,434,927.09	1.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,630,978.36	0.17
E	建筑业	30,778,184.30	0.19
F	批发和零售业	25,401,110.26	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	18,751,262.40	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,324,622.90	0.13
J	金融业	220,503,704.13	1.35
K	房地产业	39,462,973.13	0.24
L	租赁和商务服务业	7,136,789.82	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,989,588.96	0.04
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	2,858,229.00	0.02
S	综合	6,952,125.48	0.04
	合计	778,224,084.58	4.76

5.4 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	600016	民生银行	4,205,797	32,216,405.02	0.20
2	600036	招商银行	2,884,590	28,326,673.80	0.17
3	601318	中国平安	642,660	24,138,309.60	0.15
4	601166	兴业银行	1,891,816	18,010,088.32	0.11
5	000651	格力电器	545,142	15,263,976.00	0.09
6	000002	万 科A	1,813,600	14,672,024.00	0.09
7	600519	贵州茅台	78,992	12,220,062.40	0.07
8	601288	农业银行	5,047,200	12,214,224.00	0.07
9	600837	海通证券	1,216,911	11,244,257.64	0.07
10	600000	浦发银行	1,069,607	10,396,580.04	0.06

5.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	580,764,000.00	3.55
	其中：政策性金融债	580,764,000.00	3.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	464,424.27	0.00
8	其他	-	-
9	合计	581,228,424.27	3.56

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	140204	14国开04	2,400,000	240,336,000.00	1.47
2	130243	13国开43	1,300,000	129,831,000.00	0.79
3	130214	13国开14	1,000,000	100,040,000.00	0.61
4	130249	13国开49	600,000	60,612,000.00	0.37
5	110247	11国开47	500,000	49,945,000.00	0.31

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 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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	745,778.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,491,213.87
5	应收申购款	6,611,613.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,848,605.70

5.11.4 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。

5.11.5 期末前十名股票中存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存在流通受限情况。

5.11.6 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	25,851,203,709.02
本报告期基金总申购份额	735,368,394.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,483,802,333.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	25,102,769,769.49

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年1月23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厦门银行股份有限公司为代销机构的公告。

2014年2月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告。

2014年2月12日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年2月22日发布华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告。

8.2 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。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在ETF基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理9只ETF产品，分别为华夏沪深300ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏能源ETF、华夏材料ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF和华夏恒生ETF，初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品线。

2014年3月，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金业金牛奖”的评选中，华夏基金第八次荣获年度“金牛基金管理公司奖”，所管理的基金荣获6个单项奖：华夏现金增利货币荣获“2013年度货币市场金牛基金奖”，华夏中小板ETF荣获“2013年度指数型金牛基金奖”，华夏经典混合荣获“2013年度混合型金牛基金奖”，华夏回报混合荣获“三年期混合型金牛基金奖”，华夏大盘精选混合、华夏策略混合荣获“五年期混合型金牛基金奖”。

在客户服务方面，1季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务，方便投资者进行现金管理；（2）华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见，且可见即可用，提高投资者的交易效率；（3）开通了华夏基金百度轻应用，满足投资者服务渠道多样化的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

9.1.3《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

9.1.4法律意见书；

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年四月二十二日