**中国人寿保险股份有限公司委托华夏基金管理有限公司中证全指组合2018年第1季度报告**

i_2资产管理人：华夏基金管理有限公司

i_2报告日期：2018-01-01至2018-03-31

资产管理人基本信息

单位名称：华夏基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

资格批复文号：证监许可[2008]295号

法定代表人：杨明辉

注册资本：2.38亿

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区A区 100033

联系方式：8610 8806 6688

主要财务指标

（一）组合表现

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 主要会计数据和财务指标 | |
| 1 | 本期利润 | -38,148,689.19 |
| 2 | 本期已实现收益 | -11,624,563.27 |
| 3 | 期末资产净值 | 826,729,323.22 |
| 4 | 期末单位净值 | 1.0334 |

（二）净值表现

报告期内，特定资产管理组合净值增长率与同期业绩基准的比较如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 投资时间 | 净值增长率(1)（%） | 业绩比较基准增长率(2)（%） | (1)-(2)（%） |
| 本报告期 | -4.41 | - | -4.41 |

投资组合报告

（一）报告期末投资资产组合情况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 资产种类 | | 金额(元) | 占总资产比例（%） |
| 1 | 股票 | - | - |
| 2 | 债券 | 100,993.55 | 0.01 |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 基金 | - | - |
| 5 | 资产支持证券 | -49,069,743.72 | -5.53 |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 8 | 银行活期存款及清算备付金 | 198,669,592.74 | 22.40 |
| 9 | 银行定期存款(定期存款、通知存款、协议存款) | - | - |
| 10 | 其他资产(交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款等) | 310,461.41 | 0.04 |
|  | 资产总计 | 886,990,399.06 | 100.00 |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的股票投资组合-A股

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 代码 | 行业 | 公允价值(元) | 占资产净值比例（%） |
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 33,729,738.00 | 4.08 |
| C | 制造业 | 413,854,825.47 | 50.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,079,666.58 | 1.46 |
| E | 建筑业 | 237.50 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 18,148,897.60 | 2.20 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 351,585.24 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 64,152,691.00 | 7.76 |
| J | 金融业 | 76,163,829.06 | 9.21 |
| K | 房地产业 | 29,762,913.20 | 3.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,585,884.94 | 2.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,705,890.52 | 1.90 |
| 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 | 2,396,304.00 | 0.29 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 683,967,556.21 | 82.73 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合-港股

*注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。*

（三）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(元) | 占资产净值比例（%） |
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| 4 | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 5 | 企业债券 | - | - |
| 6 | 企业短期融资券 | - | - |
| 7 | 可转债 | 3,969,011.15 | 0.45 |
| 8 | 其他 | - | - |
|  | 债券总计 | - | 0.00 |

（四）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票明细

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占资产净值比例（%） |
| 1 | 600518 | 康美药业 | 1,105,362.00 | 24,837,484.14 | 3.00 |
| 2 | 002373 | 千方科技 | 1,342,000.00 | 21,955,120.00 | 2.66 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 32,000.00 | 21,875,840.00 | 2.65 |
| 4 | 603799 | 华友钴业 | 164,500.00 | 19,499,830.00 | 2.36 |
| 5 | 601009 | 南京银行 | 2,357,500.00 | 19,260,775.00 | 2.33 |
| 6 | 300274 | 阳光电源 | 962,700.00 | 18,464,586.00 | 2.23 |
| 7 | 002202 | 金风科技 | 1,010,600.00 | 18,312,072.00 | 2.22 |
| 8 | 000963 | 华东医药 | 276,700.00 | 18,123,850.00 | 2.19 |
| 9 | 601988 | 中国银行 | 4,523,464.00 | 17,777,213.52 | 2.15 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 300,673.00 | 17,063,192.75 | 2.06 |

（五）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名债券明细

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占资产净值比例（%） |
| 1 | 113011 | 光大转债 | 31,270 | 3,392,169.60 | 0.41 |
| 2 | 123003 | 蓝思转债 | 5,403 | 529,153.61 | 0.06 |
| 3 | 123003 | 蓝思转债 | 5,403 | 529,153.61 | 0.06 |
| 4 | 128028 | 赣锋转债 | 405 | 47,687.94 | 0.01 |

（六）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名基金明细

（七）报告期末的衍生金融资产明细

（八）报告期内股票投资组合的重大变动

报告期内累计买入价值超出期初组合资产净值2%（至多只列示前20名）的股票明细：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 累计买入金额(元) | 占期初资产净值比例（%） |
| 1 | 002236 | 大华股份 | 25,916,442.35 | 3.00 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 25,839,519.00 | 2.99 |
| 3 | 300274 | 阳光电源 | 25,144,962.48 | 2.91 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 22,951,339.00 | 2.65 |
| 5 | 000768 | 中航飞机 | 22,084,630.20 | 2.55 |
| 6 | 000426 | 兴业矿业 | 21,911,032.61 | 2.53 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 21,550,529.08 | 2.49 |
| 8 | 002373 | 千方科技 | 21,132,339.92 | 2.44 |
| 9 | 600352 | 浙江龙盛 | 19,322,500.20 | 2.23 |
| 10 | 002202 | 金风科技 | 19,214,183.72 | 2.22 |
| 11 | 002376 | 新北洋 | 18,969,360.71 | 2.19 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 17,605,568.00 | 2.04 |
| 13 | 600028 | 中国石化 | 17,464,595.16 | 2.02 |
| 14 | 603993 | 洛阳钼业 | 17,449,202.00 | 2.02 |

投资组合管理情况

(一) 市场回顾

(二) 组合回顾

(三) 投资展望

其他需要说明的情况

声明

**华夏基金管理有限公司**

**2018年6月28日**