

(上接B033版)

住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼  
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼  
法定代表人:姚文平  
电话:021-68761616-8522  
传真:020-8767032  
联系人:叶海  
网址:www.tsfund.com.cn  
客户服务电话:400-888-8128  
86)西部证券股份有限公司  
住所:陕西省西安市东大街东新街232号陕西信托大厦16-17楼  
办公地址:陕西省西安市东大街东新街232号陕西信托大厦16-17楼  
法定代表人:刘建武  
电话:029-87417129  
传真:029-87424426  
联系人:王斌  
网址:www.westsec.com  
客户服务电话:95582  
87)华福证券有限责任公司  
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层  
法定代表人:黄金琳  
电话:0591-87383623  
传真:0591-87380420  
联系人:张燕  
网址:www.hfzq.com.cn  
客户服务电话:0591-96326  
88)华安证券股份有限公司  
住所:甘肃省兰州市静宁路308号  
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号  
法定代表人:李晓安  
电话:0931-4890100  
联系人:李昕田  
网址:www.ha1993.com  
客户服务电话:0931-4890619、4890618、4890100  
89)大通证券股份有限公司  
住所:杭州市钱江新城11号金茂大厦  
办公地址:杭州市解放路111号金茂大厦  
法定代表人:沈强平  
电话:0571-87925129  
传真:0571-87828042  
联系人:乔颖  
网址:www.dtscc.com  
客户服务电话:0571-96336  
90)瑞信证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层  
法定代表人:刘弘  
电话:010-58323112  
传真:010-58327487  
联系人:牟伟  
网址:www.abussecurities.com  
客户服务电话:400-887-8827  
91)中国中投证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区益田路5号中投证券大厦21-22层及深圳市福田区益田路5003号中投证券大厦A栋40、48层至21层  
办公地址:深圳市福田区益田路5003号中投证券大厦A栋40、48层至21层  
法定代表人:龙增来  
电话:0755-82032442  
联系人:刘斌  
网址:www.china-invsn.com  
客户服务电话:400-600-8008、95532  
92)西藏同信证券股份有限公司  
住所:拉萨市北京中路101号  
办公地址:上海市共和新路118弄东方企业园24号  
法定代表人:贾绍华  
电话:021-36533016  
联系人:王作光  
网址:www.txsec.com  
客户服务电话:400-881-1177  
93)信信证券有限责任公司  
住所:呼和浩特市新城区锡林南路18号  
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号  
法定代表人:孔佑杰  
电话:010-80806830-730、010-80806830-737  
传真:010-64612537  
联系人:陈永彬、宋晓光  
网址:www.xzqj.com.cn  
客户服务电话:010-80806830  
94)江海证券有限公司  
住所:哈尔滨市香坊区赣水路56号  
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号  
法定代表人:孙名扬  
电话:0451-82376663  
传真:0451-82287514  
联系人:张宇平  
网址:www.jhzq.com.cn  
客户服务电话:400-666-2288  
95)国民钱业证券有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层2-9层  
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层2-9层  
法定代表人:赵大建  
电话:010-59559441  
传真:010-66553791  
联系人:李微  
网址:www.5618.com  
客户服务电话:400-889-5618  
96)华安证券股份有限公司  
住所:上海市陆家嘴环南路166号27楼  
办公地址:上海市陆家嘴环南路166号27楼  
法定代表人:陈林  
电话:021-50122128  
传真:021-50122398  
联系人:陈方亮  
网址:www.cnhtstock.com  
客户服务电话:400-820-9898  
97)厦门证券有限公司  
住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼  
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼  
法定代表人:傅利权  
电话:0592-5161642、15880284740  
传真:0592-5161440  
联系人:卢金文  
网址:www.xmzqj.com  
客户服务电话:0592-5163588  
98)爱建证券有限责任公司  
住所:上海市南京西路758号23楼  
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼  
法定代表人:陈建伟  
电话:021-32229888  
联系人:021-62287873  
联系人:陈婉娟  
客户服务电话:021-63340678  
99)华能证券有限责任公司  
住所:北京市西城区月坛北街26号  
办公地址:北京市西城区月坛北街26号  
法定代表人:丁辉  
电话:010-56560077  
传真:010-58506802  
联系人:梁宇  
网址:www.hnsec.com.cn  
客户服务电话:010-58568118  
100)天风证券股份有限公司  
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
法定代表人:余晖  
电话:027-87618882  
传真:027-87618863  
联系人:郝刚  
网址:www.tfzq.com  
客户服务电话:028-86711410、027-87618882  
基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并增加或者减少其销售机构,以根据最新情况及时更新。  
(一)经纪结算机构  
名称:华夏基金管理有限公司  
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区  
办公地址:北京市西城区金融大街33号泰康大厦12层  
法定代表人:王亚平  
联系人:余晖  
电话:400-818-6666  
传真:010-63316700  
联系人:张金峰  
(二)律师事务所  
名称:北京市德恒律师事务所  
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层  
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层  
负责人:王雷  
联系电话:010-52628388  
传真:010-52682999  
经办律师:徐建军、李晓明  
(三)会计师事务所  
名称:安永华明会计师事务所  
住所:北京市东长安街1号东方广场东塔楼16层A1616层  
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东塔楼水城大厦16层  
法定代表人:葛明  
联系电话:010-58133000  
传真:010-85182898  
联系人:徐皓  
经办注册会计师:徐皓、蒋燕华

基金名称:华夏盛世精选股票型证券投资基金

基金类型:契约开放式

基金的投资目标

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,实现增值目标。

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,如股指期货期货等金融衍生产品,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资策略

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。

(一)周期优选策略  
周期优选投资策略,主要基于对我国经济周期及变化趋势等特征的研究和判断,确定不同经济周期阶段下的资产配置策略,并根据经济周期阶段及经济周期阶段及经济周期阶段进行资产配置。此外,本基金还将通过产业结构、市场趋势、资金流动方向等方式辅助周期优选策略的决策。

1.经济周期阶段的判断  
经济周期阶段的判断是周期优选策略的基础。经济周期分为复苏、过热、滞胀以及衰退四个阶段,本基金以长期增长趋势、相对中长期增长水平以及相对通胀趋势,相对于通胀率水平作为核心指标对经济周期阶段进行判断。

(二)个股投资策略  
本基金重点关注优势行业中获益程度较高的优势个股。优势个股的评价标准主要包括:

1.公司在行业中占据优势地位,如在行业中市场占有率较高,或公司在行业中具有资源优势、技术优势、渠道优势、品牌领先优势等。

2.公司盈利能力较强,如公司收入增长态势良好,或公司通过提高生产效率、

节约成本提高利润率,或公司通过业务扩张、技术革新等增加新的利润增长点。

3.公司治理规范,经营稳健,如公司治理结构规范,发展战略清晰,管理团队稳定。

4.公司股票估值合理,如公司静态市盈率较低,或公司未来盈利改善将大幅降低动态市盈率。

(三)积极债券管理策略  
本基金采取多积极债券管理策略,结合不同通货膨胀率走势下的市场利率预期和收益率曲线特征,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的投资组合。

(四)权证投资策略  
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用成本效益模型分析其合理价值的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳定的超额收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布,或沪深300指数或上证国债指数或其他指数替代,或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数,或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,取得基金托管人同意后,变更本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险控制特征

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。

十一、基金信息披露

基金管理人本着诚实信用原则,保证本报告所登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。

基金管理人中国建设银行根据本基金合同规定,于2012年10月24日发布了本报告期内财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证该部分内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2012年9月30日,本报告期内所列财务数据未经审计。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	5,888,673,856.61	83.28
2	其中:股票	5,888,673,856.61	83.28
3	固定收益投资	454,257,780.20	6.42
4	其中:债券	454,257,780.20	6.42
5	其中:资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	388,000,782.00	5.49
7	其中:买入返售金融资产	388,000,782.00	5.49
8	银行存款和结算备付金合计	299,863,122.51	4.24
9	其他资产	39,958,869.79	0.57
10	合计	7,070,754,411.11	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	146,187,399.06	2.08
B	采矿业	2,218,530,997.12	31.58
C	制造业	197,084,171.47	2.81
C1	纺织服装、鞋帽	93,489,801.34	1.33
C2	木材、家具	24,008,773.50	0.34
C3	造纸、印刷	-	-
C4	化学、石化、塑胶、塑料	63,169,371.04	0.90
C5	电子	284,572,247.64	4.05
C6	金属、非金属	218,678,433.90	3.10
C7	机械、设备、仪表	907,789,109.44	12.92
C8	医药、生物制品	403,399,478.29	6.24
C9	其他制造业	-	-
D	建筑业	153,397,024.02	2.18
E	建筑业	140,391,123.16	2.00
F	交通运输、仓储	81,038,890.42	1.15
G	交通运输、仓储	288,072,608.39	4.06
H	信息技术和贸易	254,235,161.07	3.59
I	金融、保险业	1,591,375,897.38	22.65
J	房地产业	644,295,774.71	9.10
K	其他服务业	56,519,215.10	0.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	23,315,565.72	0.36
N	其他	5,888,673,856.61	83.81

(三)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

代码	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	600036	招商银行	27,699,809	281,430,059.44	4.01
2	000002	万科A	29,999,716	252,897,605.88	3.60
3	601688	华泰证券	25,765,452	248,378,957.28	3.54
4	601788	光大证券	16,400,579	206,319,283.82	2.94
5	600048	保利地产	19,078,670	236,489,201.20	2.92
6	600994	大成股份	5,195,871	220,248,868.34	2.85
7	600960	青岛海尔	17,558,193	198,934,326.69	2.83
8	002024	苏宁电器	27,059,367	187,795,476.98	2.67
9	600116	华仪股份	30,633,826	173,081,116.50	2.46
10	600887	伊利股份	8,041,328	171,280,286.40	2.44

(四)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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	56,316,370.20	0.80
2	央行票据	96,700,000.00	1.38
3	金融债券	280,293,000.00	3.99
4	企业债券	280,293,000.00	3.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他债	20,948,410.00	0.30
9	合计	454,257,780.20	6.47

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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国债(5)	2,300,000	230,253,000.00	3.28
2	1101094	11央行票据94	1,000,000	96,700,000.00	1.38
3	001017	21国债(7)	529,140	56,316,370.20	0.80
4	120216	12国债16	500,000	50,040,000.00	0.71
5	111002	工行转债	207,410	20,948,410.00	0.30

(六)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。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

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、处罚的情况。

2.本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

3.期末其他各项资产构成

序号	资产名称	金额	占基金资产净值比例(%)
2	应收证券清算款	2,043,618.77	-
3	应收利息	120,067.25	-
4	应收股利	8,106,521.60	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,958,869.79	-

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111002	工行转债	20,948,410.00	0.30

5.报告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。

6.投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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下列所列数字。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2009年12月11日至2009年12月31日	1.50%	0.24%	-0.02%	1.30%	-0.76%
2010年1月1日至2010年12月31日	-3.94%	1.58%	-0.12%	1.26%	-5.18%
2011年1月1日至2011年12月31日	-30.05%	1.31%	-19.67%	1.04%	-10.38%
2012年1月1日至2012年12月31日	1.91%	1.24%	-1.06%	1.02%	2.97%

十一、费用概览

(一)基金运作费用  
1.基金费用的种类  
2.基金费用的计提方法  
(二)基金费用的管理  
(三)基金费用的支付  
(四)基金费用的追偿  
(五)基金费用的追偿  
(六)基金费用的追偿  
(七)基金费用的追偿  
(八)基金费用的追偿  
(九)基金费用的追偿  
(十)基金费用的追偿  
(十一)基金费用的追偿  
(十二)基金费用的追偿  
(十三)基金费用的追偿  
(十四)基金费用的追偿  
(十五)基金费用的追偿  
(十六)基金费用的追偿  
(十七)基金费用的追偿  
(十八)基金费用的追偿  
(十九)基金费用的追偿  
(二十)基金费用的追偿  
(二十一)基金费用的追偿  
(二十二)基金费用的追偿  
(二十三)基金费用的追偿  
(二十四)基金费用的追偿  
(二十五)基金费用的追偿  
(二十六)基金费用的追偿  
(二十七)基金费用的追偿  
(二十八)基金费用的追偿  
(二十九)基金费用的追偿  
(三十)基金费用的追偿  
(三十一)基金费用的追偿  
(三十二)基金费用的追偿  
(三十三)基金费用的追偿  
(三十四)基金费用的追偿  
(三十五)基金费用的追偿  
(三十六)基金费用的追偿  
(三十七)基金费用的追偿  
(三十八)基金费用的追偿  
(三十九)基金费用的追偿  
(四十)基金费用的追偿  
(四十一)基金费用的追偿  
(四十二)基金费用的追偿  
(四十三)基金费用的追偿  
(四十四)基金费用的追偿  
(四十五)基金费用的追偿  
(四十六)基金费用的追偿  
(四十七)基金费用的追偿  
(四十八)基金费用的追偿  
(四十九)基金费用的追偿  
(五十)基金费用的追偿  
(五十一)基金费用的追偿  
(五十二)基金费用的追偿  
(五十三)基金费用的追偿  
(五十四)基金费用的追偿  
(五十五)基金费用的追偿  
(五十六)基金费用的追偿  
(五十七)基金费用的追偿  
(五十八)基金费用的追偿  
(五十九)基金费用的追偿  
(六十)基金费用的追偿  
(六十一)基金费用的追偿  
(六十二)基金费用的追偿  
(六十三)基金费用的追偿  
(六十四)基金费用的追偿  
(六十五)基金费用的追偿  
(六十六)基金费用的追偿  
(六十七)基金费用的追偿  
(六十八)基金费用的追偿  
(六十九)基金费用的追偿  
(七十)基金费用的追偿  
(七十一)基金费用的追偿  
(七十二)基金费用的追偿  
(七十三)基金费用的追偿  
(七十四)基金费用的追偿  
(七十五)基金费用的追偿  
(七十六)基金费用的追偿  
(七十七)基金费用的追偿  
(七十八)基金费用的追偿  
(七十九)基金费用的追偿  
(八十)基金费用的追偿  
(八十一)基金费用的追偿  
(八十二)基金费用的追偿  
(八十三)基金费用的追偿  
(八十四)基金费用的追偿  
(八十五)基金费用的追偿  
(八十六)基金费用的追偿  
(八十七)基金费用的追偿  
(八十八)基金费用的追偿  
(八十九)基金费用的追偿  
(九十)基金费用的追偿  
(九十一)基金费用的追偿  
(九十二)基金费用的追偿  
(九十三)基金费用的追偿  
(九十四)基金费用的追偿  
(九十五)基金费用的追偿  
(九十六)基金费用的追偿  
(九十七)基金费用的追偿  
(九十八)基金费用的追偿  
(九十九)基金费用的追偿  
(一百)基金费用的追偿

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并增加或者减少其销售机构,以根据最新情况及时更新。

(一)经纪结算机构  
名称:华夏基金管理有限公司  
住所:北京市顺义区天竺空港工业区A区  
办公地址:北京市西城区金融大街33号泰康大厦12层  
法定代表人:王亚平  
联系人:余晖  
电话:400-818-6666  
传真:010-63316700  
联系人:张金峰  
(二)律师事务所  
名称:北京市德恒律师事务所  
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层  
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层  
负责人:王雷  
联系电话:010-52628388  
传真:010-52682999  
经办律师:徐建军、李晓明  
(三)会计师事务所  
名称:安永华明会计师事务所  
住所:北京市东长安街1号东方广场东塔楼16层A1616层  
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东塔楼水城大厦16层  
法定代表人:葛明  
联系电话:010-58133000  
传真:010-85182898  
联系人:徐皓  
经办注册会计师:徐皓、蒋燕华

基金名称:华夏盛世精选股票型证券投资基金

基金类型:契约开放式

基金的投资目标

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,实现增值目标。

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,如股指期货期货等金融衍生产品,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资策略

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。

(一)周期优选策略  
周期优选投资策略,主要基于对我国经济周期及变化趋势等特征的研究和判断,确定不同经济周期阶段下的资产配置策略,并根据经济周期阶段及经济周期阶段及经济周期阶段进行资产配置。此外,本基金还将通过产业结构、市场趋势、资金流动方向等方式辅助周期优选策略的决策。

1.经济周期阶段的判断  
经济周期阶段的判断是周期优选策略的基础。经济周期分为复苏、过热、滞胀以及衰退四个阶段,本基金以长期增长趋势、相对中长期增长水平以及相对通胀趋势,相对于通胀率水平作为核心指标对经济周期阶段进行判断。

(二)个股投资策略  
本基金重点关注优势行业中获益程度较高的优势个股。优势个股的评价标准主要包括:

1.公司在行业中占据优势地位,如在行业中市场占有率较高,或公司在行业中具有资源优势、技术优势、渠道优势、品牌领先优势等。

2.公司盈利能力较强,如公司收入增长态势良好,或公司通过提高生产效率、

节约成本提高利润率,或公司通过业务扩张、技术革新等增加新的利润增长点。

3.公司治理规范,经营稳健,如公司治理结构规范,发展战略清晰,管理团队稳定。

4.公司股票估值合理,如公司静态市盈率较低,或公司未来盈利改善将大幅降低动态市盈率。

(三)积极债券管理策略  
本基金采取多积极债券管理策略,结合不同通货膨胀率走势下的市场利率预期和收益率曲线特征,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的投资组合。

(四)权证投资策略  
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用成本效益模型分析其合理价值的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳定的超额收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布,或沪深300指数或上证国债指数或其他指数替代,或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数,或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,取得基金托管人同意后,变更本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险控制特征

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。

十一、基金信息披露

基金管理人本着诚实信用原则,保证本报告所登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。