

(上接B031版)

联系人:罗春霞、武明坤

网址:www.wysec.com

客户服务电话:010-65051166

96 网通证券有限责任公司

住所:杭州市解放路111号钱金大厦

办公地址:杭州市解放路111号钱金大厦

法定代表人:沈晓明

电话:0571-87925129

传真:0571-87828042

联系人:李俊

网址:www.wysec.com

客户服务电话:0571-96336

97 华鑫证券有限责任公司

住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、6单元

办公地址:上海市锦州路759号

法定代表人:吕瑞明

电话:021-64330001

传真:021-64330507

联系人:李俊

网址:www.wysec.com

客户服务电话:021-32109999、029-68918888、400-109-0918

98 麒麟证券有限责任公司

住所:深圳市福田区金田路7号英皇国际金融中心12层、15层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英皇国际金融中心12层、15层

法定代表人:刘弘

电话:010-58321112

传真:010-58320586

联系人:李俊

网址:www.wysec.com

客户服务电话:400-887-8827

99 中国中投证券有限责任公司

住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及

20层012、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23、24单元;深圳市南山区益田

路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人:龙增来

电话:0755-82032442

传真:0755-82032442

联系人:李俊

网址:www.citic-invs.cn

客户服务电话:400-600-8008、95552

100 上海证券有限责任公司

住所:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

办公地址:深圳市福田区福田路6009号新世界中心29层

法定代表人:吴永良

电话:0755-8250586

传真:0755-82506852

联系人:李俊

网址:www.wzsq.com

客户服务电话:400-102-1011

001 西藏国际信托有限责任公司

住所:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市和平路118弄东方企业园24号

法定代表人:贾留君

电话:021-36533016

传真:021-36533017

联系人:王作光

网址:www.zsqc.com

客户服务电话:400-881-1177

002 中信证券有限责任公司

住所:深圳市福田区中心区红岭中路1013号

办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人:孔佑佐

电话:010-88068630-730、010-88068630-737

传真:010-66412537

联系人:陈希才、宋晓光

网址:www.wzsq.com

客户服务电话:010-88068630

003 招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路5033号

办公地址:上海市浦东新区世纪大道56号

法定代表人:孙树培

电话:0451-8236863

传真:0451-82387211

联系人:张宏斌

网址:www.jiayun.com

客户服务电话:400-666-2288

004 鑫泰证券有限责任公司

住所:成都市青羊区文成路111号5号

办公地址:成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人:冉云

电话:028-6660070

传真:028-66600126

联系人:刘一寒

网址:www.gjzq.com

客户服务电话:95105111 四川地区:1400-660-0109 (全国)

005 中银国际证券股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街201号新银大厦A座6层-9层

办公地址:北京市西城区金融大街201号新银大厦A座6层-9层

法定代表人:赵建

电话:010-59355441

传真:010-66553791

联系人:李俊

网址:www.c618.com

客户服务电话:400-889-5618

006 华安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区世纪大道1669号27楼

办公地址:上海市陆家嘴环路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.cnabstock.com

客户服务电话:400-820-9898

007 厦门证券有限公司

住所:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人:傅博敏

电话:0592-5166162、1588028740

传真:0592-5161140

联系人:王文文

网址:www.xmzq.cn

客户服务电话:0592-5163588

008 世纪证券有限责任公司

住所:上海市南京西路758号23-25楼

办公地址:上海市南京西路758号23-25楼

法定代表人:张建华

电话:021-32220888

传真:021-6287873

联系人:陈海斌

网址:www.wjzq.com

客户服务电话:021-63340678

009 华融证券股份有限公司

住所:北京市西城区月坛北街26号

办公地址:北京西城区金融大街A座5层、5层

法定代表人:宋海潮

电话:010-58562231

传真:010-58560602

联系人:李俊

网址:www.wysec.com

客户服务电话:010-58568118

010 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:余磊

电话:027-87618882

传真:027-87618863

联系人:李俊

网址:www.wfzq.com

客户服务电话:028-86711410 027-87618882

011 太平洋证券股份有限公司

住所:北京市朝阳区东三环北路28号太平洋保险大厦10层

办公地址:北京市朝阳区东三环北路28号太平洋保险大厦10层

法定代表人:王立华

电话:010-57763888

传真:010-57763777

联系人:李俊

经办律师:吴冠雄、刘旭

012 会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市朝阳区东三环东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦(第三办公楼)

16层

办公地址:北京市朝阳区东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦16层

执行事务合伙人:吴港平

联系电话:010-58115300

传真:010-58158298

联系人:徐皓

经办注册会计师:徐皓、魏晓洁

四、基金名称

本基金名称:华夏大盘精选证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:追求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围:具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行

上市的股票、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、基金的投资策略

本基金主要采取“自上而下”的个股投资策略,根据细致的财务分析筛选入

上市公司财报,精选出业绩增长良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。

考虑到我国证券市场的不成熟,基金经理将在资产配置时兼顾分散投资,即股

票仓位不超过80%,政策研究和宏观经济分析占比较低,不超过15%。根据股票、债券、货币

和现金的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险与回报相

匹配。

(一)资产配置策略

本基金主要投资于股票,股票资产比例范围为40%-95%,为了满足不同投资者的

需求,基金经理将根据以往业绩表现,将基金资产配置比例适当调整,但股票资产

比例不低于40%。本基金将根据一定时期内整个证券市场系统性风险

和流动性水平配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险与回

报相匹配。

(二)个股精选策略

1.构建备选股票池

本基金备选股票池主要包括大盘股,对大盘股的投资将占基金股票资产的80%

以上。除此之外,基金还可分散投资于市值、流动性及估值(包括市盈率)、具

有成长性的股票,政策研究和宏观经济分析占比较低,不超过15%。根据股票、

债券、货币和现金的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风

险与回报相匹配。

2.进行财务指标分析

主要分析公司的成本收入、现金流、资产负债率等指标,并同行业内的其

他公司进行了对比,从中筛选出盈利状况或可能存在问题的公司,以确认实地调

研的必要性和投资价值的合理性,对基金管理和投资决策委员会提供参考。

3.进行上市公司调研

实地调研是考察公司的财务信息是否真实可靠,并对公司的核心竞争

力、经营管理和外部经营环境进行全面考察,从而形成对公司经营风险和业绩成

果的综合评价和估值进行排序。

根据公司的考察结果,对上市公司公开财务数据进行分析验证和成长性

评估,并计算调整后的P/E、P/B、B/S、P/E、ROE、PEG等指标。由于公司经营状况和

市场环境不断变化,基金管理人将根据上市公司公开数据和成长性评估的变

化,对以上几项指标和估值指标,进行动态调整。基金管理人将根据一定时期内

特定行业及不同公司的行业特征,对上述估值指标设置不同的权重,并根据综合考

虑后的个股估值情况进行排序。

5.个股投资组合

本基金投资组合中持有的股票,基金投资组合的持股个股一般不超过100只

新股申购不计入在内。在上述排序过程中,排名前100的个股将进入基金的

股票投资组合,其中排名最靠前的个股投资比例最高。

在未來基金规模大幅扩大或是上市公司数量大幅扩张,导致持股个股数量严重影

响基金的投资策略和收益能力时,本基金可以在不改变集中持股策略的前提下适当

调整投资组合个股,并适时调整。

(三)债券投资策略

本基金债券投资的主要目标是保持基金流动性的基础上,提高基金收益水

平,并分散股票投资风险。本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转债),具

有良好流动性,基金管理人可根据市场变化,将基金资产配置比例适当调整,但

债券资产比例不低于40%。本基金将根据一定时期内整个证券市场系统性风

险和流动性水平配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险与

回报相匹配。

4.信用债投资策略

本基金信用债投资策略主要是在保持基金流动性的基础上,提高基金收益水

平,并分散股票投资风险。本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转债),具

有良好流动性,基金管理人可根据市场变化,将基金资产配置比例适当调整,但

债券资产比例不低于40%。本基金将根据一定时期内整个证券市场系统性风

险和流动性水平配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险与

回报相匹配。

(四)基金管理人

本基金管理人:华夏基金管理有限公司

住所:北京市朝阳区东三环东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦(第三办公楼)

16层

办公地址:北京市朝阳区东长安街1号东方广场东塔楼安永大厦16层

执行事务合伙人:吴港平

联系电话:010-58115300

传真:010-58158298

联系人:徐皓

经办注册会计师:徐皓、魏晓洁

此外,基金还将积极参与与风险低且可控的新股申购、债券回购投资,以增加收益。基金管理人将在确保与基金投资目标一致的前提下,本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于权证。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×40%+国债收益率。未来,如所用基准指数不再符合本基金的投资策略和投资需求,或有更合适的基准指数推出,基金管理人可与基金托管人协商一致后,确定采用其他基准指数并及时公告。

另外,本基金将遵守法律法规和监管部门对债券投资比例的相关规定。为此,基金管理人将根据法律法规和监管部门对债券投资比例的相关规定,并参照基金资产配置比例,将权重比例按权重调整为:债券资产占基金资产净值的40%-95%,同时中国国债资产占基金资产净值的20%-95%。未来,在更合适的债券指数推出后,法律法规或监管部门调整投资比例的相关规定等情况下,基金管理人可与基金托管人协商一致后,确定采用其他债券指数或调整整体业绩比较基准的构成并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金在证券投资基金中属于中至高风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和货币型基金,低于成长型股票基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人、基金托管人及会计师事务所均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对内容的准确性、完整性和及时性承担个别及连带法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司,于2013年7月17日复核了本报告中财务指标、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。

本投资组合报告数据截至2013年6月30日,本报告中列示财务数据未经审计。

一、报告期末基金资产组合情况

财务资料,包括资产负债表、利润表、现金流量表等,并披露报告期内所从事的基金投资、基金资产估值、基金费用、基金收益分配、基金资产净值、基金份额净值、基金资产规模、基金资产周转率、基金资产收益率、

二、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	-	-
C	制造业	1,584,342,546.80	43.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,469,272.80	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	35,093,494.71	0.96
H	信息传输和计算机服务业	142,670,814.06	3.89
I	金融业	-	-
K	房地产业	34,299,691.30	0.94
L	租赁和商务服务业	39,207,085.39	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	46,966,827.15	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		1,920,049,732.21	51.89

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		股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002570	贝因美	6,946,904	194,165,966.80	5.30
2	300032	金禾实业	11,032,084	187,324,786.32	5.11
3	002022	山东黄金	10,822,361	160,279,166.41	4.37
4	000835	华鲁恒升	118,389,581.20	160,279,166.41	4.37
5	000999	贵州茅台	4,347,302	115,420,118.00	3.15
6	600527	江南高科	19,024,136	104,346,926.44	2.90
7	000639	西王食品	7,528,134	105,619,728.00	2.88
8	600517	信发集团	9,829,764	102,792,811.68	2.79
9	600572	康美药业	6,302,281	69,892,296.29	1.91
10	600486	长海医院	1,902,231	66,806,352.73	1.82

四、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	9,970,000.00	0.27	
2	央行票据	—	—	
3	金融债券	199,196,000.00	5.43	
	其中:政策性金融债	199,196,000.00	5.43	
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	—	—	

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

(五) 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

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	130201	13国债01	1,200,000	119,340,000.00	3.25
2	120228	12国债28	600,000	59,970,000.00	1.64
3	130218	13国债18	200,000	19,886,000.00	0.54
4	019302	13国债02	100,000	9,970,000.00	0.27
5					