

汉盛证券投资基金

2012年第四季度报告

整体上,判断国内经济处于长期期缓慢下行阶段,但短周期内受益于库存周期变化而有望带来反弹机会。未来,本基金将继续根据形势变化,对组合资产配置作出动态调整。

4.4.2报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本报告期,本基金净值增长率为3.46%。

5.1 报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,460,216,569.84	66.28
	其中:股票	1,460,216,569.84	66.28
2	固定收益投资	474,970,772.00	21.56
	其中:债券	474,970,772.00	21.56
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	2.27
5	其他资产	23,000,000.00	1.05
6	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
7	其他资产	16,109,913.29	0.73
7	合计	2,202,943,973.06	100.00

5.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,048,000.00	0.09
B	采矿业	92,973,641.13	4.27
C	制造业	800,473,067.99	37.66
C0	食品饮料	25,598,280.70	1.18
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	88,954,973.38	4.09
C5	电子	59,555,161.84	2.80
C6	金属、非金属	55,211,839.40	2.54
C7	机械、设备、仪表	384,772,109.47	16.56
C8	医药、生物制品	240,680,613.20	11.06
C9	其他制造业	9,700,000.00	0.45
D	电力、煤气、水和热力生产和供应业	4,278,783.90	0.20
E	交通运输、仓储业	91,957,779.31	4.23
G	信息技术业	-	-
H	房地产业	88,514,293.28	4.07
H	其他房地产业	105,480,410.20	4.85
I	金融、保险业	56,697,607.57	2.59
J	其他金融业	16,697,507.57	0.76
K	社会服务业	38,331,450.00	1.69
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	28,808,864.76	1.32
	合计	1,460,216,569.84	67.11

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10名股票投资明细			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)
1	600521	华海药业	9,793,098
2	600418	江淮汽车	14,278,645
3	000625	长安汽车	12,609,837
4	000423	东阿阿胶	2,051,709
5	601699	皖安环保	1,931,984
6	600284	浦东建设	4,060,465
7	000028	中国石化	1,000,000
8	600511	国药股份	2,275,000
9	002482	广田股份	1,600,000
10	600546	山煤国际	1,546,700

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600521	华海药业	9,793,098	111,641,317.20	5.13
2	600418	江淮汽车	14,278,645	97,523,145.35	4.48
3	000625	长安汽车	12,609,837	83,855,416.05	3.85
4	000423	东阿阿胶	2,051,709	82,909,560.69	3.81
5	601699	皖安环保	1,931,984	42,129,129.76	1.94
6	600284	浦东建设	4,060,465	35,610,279.05	1.64
7	000028	中国石化	1,000,000	35,300,000.00	1.62
8	600511	国药股份	2,275,000	33,146,750.00	1.52
9	002482	广田股份	1,600,000	33,040,000.00	1.52
10	600546	山煤国际	1,546,700	31,475,345.00	1.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
B	采矿业	60,073,569.19	2.14
C	制造业	929,513,536.40	33.06
C0	食品饮料	102,594,731.18	3.68
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	138,250,452.51	4.07
C5	电子	130,682,308.64	2.65
C6	金属、非金属	57,969,820.96	1.96
C7	机械、设备、仪表	254,860,779.11	9.07
C8	医药、生物制品	254,795,444.00	8.36
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气、水和热力生产和供应业	164,766,400.22	5.86
E	交通运输、仓储业	82,032,021.25	2.92
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	180,480,939.71	6.42
H	房地产业	121,659,402.92	4.30
I	金融、保险业	772,119,964.54	13.24
J	房地产业	230,479,626.25	8.23
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	10,862,324.08	0.39
	合计	2,151,787,774.63	76.54

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10名股票投资明细			
代码	股票代码	股票名称	数量(股)
1	601318	中国平安	2,340,158
2	600011	华能国际	13,847,825
3	002482	广田股份	3,972,495
4	000002	万科A	7,112,954
5	600030	中信证券	5,157,989
6	002422	科信药业	1,213,290
7	300146	汤臣倍健	1,158,415
8	600570	恒生电子	6,505,967
9	600208	浙新中宝	15,211,534
10	600048	保利地产	4,524,771

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	115,477.32	0.01
B	采矿业	13,333,818.37	0.34
C	制造业	23,082,821.69	0.31
C0	食品饮料	1,183,724.12	0.02
C1	纺织服装、皮毛	200,001.00	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,311,356.18	0.03
C5	电子	1,188,250.45	0.02
C6	金属、非金属	6,157,243.03	0.16
C7	机械、设备、仪表	12,600,441.19	0.27
C8	医药、生物制品	186,753.11	0.02
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气、水和热力生产和供应业	1,855,792.68	0.19
E	交通运输、仓储业	3,240,046.76	0.08
F	交通运输、仓储业	5,757,821.98	0.15
G	信息技术业	120,156.00	0.01
H	房地产业	7,238,068.67	0.20
I	金融、保险业	96,166,390.88	2.09
J	房地产业	183,292.00	0.01
K	社会服务业	90,254.07	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	712,560.21	0.02
	合计	151,517,712.17	15.17

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10名股票投资明细			
代码	股票代码	股票名称	数量(股)
1	600036	招商银行	6,235,389
2	601166	招商银行	6,402,705
3	000008	中国平安	2,340,158
4	600030	中信证券	5,157,989
5	600090	华电电力	4,702,938
6	600288	中国石化	4,413,278
7	600688	华泰证券	814,438
8	600019	浦发银行	5,798,075
9	601186	中国铁建	4,030,182
10	000783	长春证券	2,232,610

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	115,477.32	0.01
B	采矿业	13,333,818.37	0.34
C	制造业	23,082,821.69	0.31
C0	食品饮料	1,183,724.12	0.02
C1	纺织服装、皮毛	200,001.00	0.02
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,311,356.18	0.03
C5	电子	1,188,250.45	0.02
C6	金属、非金属	6,157,243.03	0.16
C7	机械、设备、仪表	12,600,441.19	0.27
C8	医药、生物制品	186,753.11	0.02
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气、水和热力生产和供应业	1,855,792.68	0.19
E	交通运输、仓储业	3,240,046.76	0.08
F	交通运输、仓储业	5,757,821.98	0.15
G	信息技术业	120,156.00	0.01
H	房地产业	7,238,068.67	0.20
I	金融、保险业	96,166,390.88	2.09
J	房地产业	183,292.00	0.01
K	社会服务业	90,254.07	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	712,560.21	0.02
	合计	151,517,712.17	15.17

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10名股票投资明细			
代码	股票代码	股票名称	数量(股)
1	600036	招商银行	6,235,389
2	601166	招商银行	6,402,705
3	000008	中国平安	2,340,158
4	600030	中信证券	5,157,989
5	600090	华电电力	4,702,938
6	600288	中国石化	4,413,278
7	600688	华泰证券	814,438
8	600019	浦发银行	5,798,075
9	601186	中国铁建	4,030,182
10	000783	长春证券	2,232,610

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定收益投资	565,528,400.00	19.96
3	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.79
4	银行存款和结算备付金合计	260,646,717.93	9.15
5	其他资产	23,000,000.00	0.82
6	其他资产	16,109,913.29	0.58
7	合计	2,833,756,876.24	100.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,151,787,774.63	75.80
2	固定		