

(上接B087版)

网站:www.ctsec.com
客户服务电话:0671-96336
(104)中国银河证券股份有限公司
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层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
电话:0755-82022442
传真:0755-82026583
联系人:刘璇
网站:www.china-invs.cn
客户服务电话:400-600-8008、96532
(105)江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人:孙名石
电话:0451-58863719
传真:0451-82227211
联系人:刘璇
网站:www.jhzq.com.cn
客户服务电话:400-666-2288

(106)国金证券股份有限公司
住所:成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:成都市青羊区东城根上街50号
法定代表人:冉云
电话:028-86960070
传真:028-86960126
联系人:李傲
网站:www.gjzq.com.cn
客户服务电话:96105111(四川地区)、400-660-0109(全国)
(107)中国民族证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-8层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人:赵大建
电话:010-50565941
传真:010-66565791
联系人:李傲
网站:www.mzjz.com
客户服务电话:400-889-5618
(108)宏信证券有限责任公司
住所:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉刚
电话:028-86199278
传真:028-86199382
联系人:陈敬松
网站:www.hxzq.cn
客户服务电话:400-836-6366
(109)太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址:北京市西城区北城根15号企业公馆D座309号
法定代表人:李伟伟
电话:010-88231771、1850056235
传真:010-88231763
联系人:唐田田
网站:www.tpyw.com
客户服务电话:400-666-0999

基金管理人可依据有关法律法规规定及情况变化增加或者减少代销机构,并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。
(二)注册登记机构
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号新大厦B座12层
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
联系人:宋薇
(三)律师事务所
名称:北京市谢邦佳律师事务所
住所:北京市西城区金融大街10号富都大厦B座十二层
办公地址:北京市西城区金融大街19号富都大厦B座十二层
负责人:王丽
联系电话:010-52682288
传真:010-52682259
联系人:李娜
经办律师:李娜、李娜
(四)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:北京市东城区长安街1号东方广场东塔楼安永大楼(三层)办公楼16层
办公地址:北京市长安街1号东方广场东塔楼安永大楼16层
执行事务合伙人:吴港平
联系电话:010-58153000
传真:010-58189286
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、魏建波

基金名称:华夏收入混合型证券投资基金

基金类型:混合型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:本基金在严格控制投资风险的前提下,主要投资于盈利增长稳定的红利股,追求长期的股东回报和资产增值。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证以及中国证监会批准并允许基金交易的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)决策依据
1.国家有关法律、法规和基金合同的约定。
2.宏观经济环境、国家政策和市场周期分析。
3.上市公司财务状况和管理能力、历史分红、分红政策、分红效率和分红期,以及对公司盈利增长能力的预测。

(二)投资组合管理办法
1.资产配置策略
本基金遵循积极主动的投资理念,以红利股为主要投资对象,通过自上而下的方法精选个股取得股票收入和资本增值。以债券和货币金融工具作为降低组合风险

的辅助性配置工具,通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。基金的波动范围限制在0%-35%,债券类资产、中期票据类资产、现金资产支持证券0%-20%、权证0%-3%。具体配置比例由基金管理人根据对市场走势的判断做出动态调整,以基金资产在三类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述规定范围。在法律法规允许的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

本基金不从事证券资产配置,为控制个别行业投资过于集中的风险,基金管理人根据业绩比较基准制定相应的行业配置。

2.股票投资策略
本基金采用定量和定性相结合的几个股票筛选,通过品质检验、红利股筛选和盈利增长驱动三个独立选股标准,精选出具有良好品质、稳定分红能力、高盈利和持续增长的上市公司股票作为主要投资对象,这类股票占全部股票市值的比例不低于70%。

(1)品质检验
剔除除流动性、正股和流动性的差的股票,对上市公司进行定期质量筛选,通过财务、内部企业盈利能力、财务健康状况、资产管理效率和资产回报率及未来三到五年综合指标筛选出财务状况良好且符合基金投资理念的上市公司,构成本基金初始股票库。

(2)红利股筛选
在初始股票库基础上,我们综合考虑上市公司历史分红政策、分红价值、分红意愿和分红预期等特征来筛选本基金备选股票。具体选股标准包括满足以下一项或多项条件的股票:A具有稳定的分红历史;过去两年内连续分红,其中分红包括现金股利和股票股利;B具有较好的分红比例;最近一年股息率(每股现金分红/最近一年内每股加权平均股价)市场排名进入前50%;C具有较高分红率;最近一年股利支付率;D分红除权前一年度股利(净利润)市场排名进入前30%;D具有很好的分红预期;将会推出分红预期分红的股票。

本基金同时对于具有投资价值的新股进行申购。

(3)盈利增长驱动
在备选股票库的基础上,通过实地调研考察上市公司,精选盈利增长稳定的个股。重点考量上市公司是否具备精英管理团队,出色的竞争优势,较好的盈利增长前景等特征,综合研究团队对这些企业未来盈利增长驱动因素的研究判断,建立本基金的核心股票库。

3.债券投资策略
债券投资策略的目标是在保持投资组合稳定性及充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。债券投资策略的构建将通过全面的宏观、市场和品种的研究分析,在各种不同辅助手段的支持下综合考虑利率预期、价值评估、利率期限结构分析等投资策略,积极主导市场利率变化,寻找有利市场环境,获得超过市场平均水平的收益。

4.短期金融工具投资策略
在控制风险的前提下,通过对政策预期和资金面的精确把握,结合股票和债券资产的动态调整,并充分考虑基金资产的投资要求,获得短期金融工具的稳定性同时,为基金的动态资产配置提供有效的保障。符合符合市场利率的预测和现金流要求,采取积极投资策略进行风险管理并优化投资,以便在保持资产安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。

5.权证投资策略
在有效进行风险管理的前提下,通过对权证标的证券的基本面研究,结合多期限期权定价模型,在确定权证合理价值的前提下,以主动投资行为,结合仓位和组合净值,谨慎进行权证投资。

主要投资策略包括但不限于:①在分析证券价值和趋势判断的基础上,利用权证的杠杆性进行趋势投资;②利用权证的风险局限性,运用权证作为组合管理工具;③运用权证组合技术,构建新的投资组合。

九、基金业绩比较基准
80%富时中国A股红利150指数+20%富时中国国债指数

当未来有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定更合适的基准或权重比例。业绩比较基准的调整须经基金管理人向基金持有人协商,并在更新的招募说明书中披露。

十、基金的风险收益特征
本基金风险收益高于债券基金与货币市场基金。本基金遵循积极主动的投资理念,以盈利增长稳定的股息和连续分红股票类资产为主要投资工具,力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的长期增值。

十一、基金投资组合报告
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 2,294,560 81.13

其中:股票 2,294,560 81.13

2 固定收益投资 135,335,596.40 4.79

其中:债券 135,335,596.40 4.79

资产支持证券 -- --

3 贵金属投资 -- --

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 391,084,120.51 13.86

7 其他各项资产 6,440,017.89 0.23

8 合计 2,828,310.44 100.00

6.3 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 300070 碧水源 4,474,133 196,474,870.77 6.97

2 600887 银星股份 11,362,708 174,604,649.04 6.23

3 000069 华侨城A 21,067,826 149,721,142.86 5.34

4 601888 中国国旅 1,537,620 80,386,773.60 2.87

5 600518 康美药业 5,417,566 73,245,357.12 2.61

6 002865 南航节能 2,778,271 67,789,812.40 2.42

7 600011 华能国际 7,700,000 66,605,000.00 2.38

8 002436 兴森科技 6,309,800 65,685,018.00 2.34

9 000826 泰德环境 1,869,227 62,992,949.90 2.25

10 601166 兴业银行 4,000,000 68,240,000.00 2.08

6.4 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 60,174,000.00 2.15

2 央行票据 -- --

3 金融债券 74,731,165.40 2.67

其中:政策性金融债 74,731,165.40 2.67

4 企业债券 -- --

5 企业短期融资券 -- --

6 中期票据 -- --

7 可转债 430,430,000.00 0.02

8 同业资产 -- --

9 其他 -- --

10 合计 135,335,596.40 4.83

6.5 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

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 019501 15国债01 600,000 60,174,000.00 2.15

2 019001 国开1301 641,940 54,687,165.40 1.96

3 140230 14附开30 200,000 20,044,072.00

4 132002 15天集B 3,860 430,430,000.00 0.02

6.6 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

基金名称 报告期末持有资产支持证券

6.7 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贵金属投资明细

基金名称 报告期末持有贵金属

6.8 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

基金名称 报告期末持有权证

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.11 投资组合报告附注

6.12 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

6.13 本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况的说明

6.14 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 1,218,153.37

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 --

4 应收利息 4,366,026.76

5 应收申购款 866,840.77

6 其他应收款 --

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 6,440,017.89

信息披露

基金名称:华夏收入混合型证券投资基金

基金类型:混合型开放式

七、基金的投资目标

本基金的投资目标:本基金在严格控制投资风险的前提下,主要投资于盈利增长稳定的红利股,追求长期的股东回报和资产增值。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证以及中国证监会批准并允许基金交易的金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)决策依据
1.国家有关法律、法规和基金合同的约定。
2.宏观经济环境、国家政策和市场周期分析。
3.上市公司财务状况和管理能力、历史分红、分红政策、分红效率和分红期,以及对公司盈利增长能力的预测。

(二)投资组合管理办法
1.资产配置策略
本基金遵循积极主动的投资理念,以红利股为主要投资对象,通过自上而下的方法精选个股取得股票收入和资本增值。以债券和货币金融工具作为降低组合风险

的辅助性配置工具,通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。基金的波动范围限制在0%-35%,债券类资产、中期票据类资产、现金资产支持证券0%-20%、权证0%-3%。具体配置比例由基金管理人根据对市场走势的判断做出动态调整,以基金资产在三类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述规定范围。在法律法规允许的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

本基金不从事证券资产配置,为控制个别行业投资过于集中的风险,基金管理人根据业绩比较基准制定相应的行业配置。

2.股票投资策略
本基金采用定量和定性相结合的几个股票筛选,通过品质检验、红利股筛选和盈利增长驱动三个独立选股标准,精选出具有良好品质、稳定分红能力、高盈利和持续增长的上市公司股票作为主要投资对象,这类股票占全部股票市值的比例不低于70%。

(1)品质检验
剔除除流动性、正股和流动性的差的股票,对上市公司进行定期质量筛选,通过财务、内部企业盈利能力、财务健康状况、资产管理效率和资产回报率及未来三到五年综合指标筛选出财务状况良好且符合基金投资理念的上市公司,构成本基金初始股票库。

(2)红利股筛选
在初始股票库基础上,我们综合考虑上市公司历史分红政策、分红价值、分红意愿和分红预期等特征来筛选本基金备选股票。具体选股标准包括满足以下一项或多项条件的股票:A具有稳定的分红历史;过去两年内连续分红,其中分红包括现金股利和股票股利;B具有较好的分红比例;最近一年股息率(每股现金分红/最近一年内每股加权平均股价)市场排名进入前50%;C具有较高分红率;最近一年股利支付率;D分红除权前一年度股利(净利润)市场排名进入前30%;D具有很好的分红预期;将会推出分红预期分红的股票。

本基金同时对于具有投资价值的新股进行申购。

(3)盈利增长驱动
在备选股票库的基础上,通过实地调研考察上市公司,精选盈利增长稳定的个股。重点考量上市公司是否具备精英管理团队,出色的竞争优势,较好的盈利增长前景等特征,综合研究团队对这些企业未来盈利增长驱动因素的研究判断,建立本基金的核心股票库。

3.债券投资策略
债券投资策略的目标是在保持投资组合稳定性及充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。债券投资策略的构建将通过全面的宏观、市场和品种的研究分析,在各种不同辅助手段的支持下综合考虑利率预期、价值评估、利率期限结构分析等投资策略,积极主导市场利率变化,寻找有利市场环境,获得超过市场平均水平的收益。

4.短期金融工具投资策略
在控制风险的前提下,通过对政策预期和资金面的精确把握,结合股票和债券资产的动态调整,并充分考虑基金资产的投资要求,获得短期金融工具的稳定性同时,为基金的动态资产配置提供有效的保障。符合符合市场利率的预测和现金流要求,采取积极投资策略进行风险管理并优化投资,以便在保持资产安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。

5.权证投资策略
在有效进行风险管理的前提下,通过对权证标的证券的基本面研究,结合多期限期权定价模型,在确定权证合理价值的前提下,以主动投资行为,结合仓位和组合净值,谨慎进行权证投资。

主要投资策略包括但不限于:①在分析证券价值和趋势判断的基础上,利用权证的杠杆性进行趋势投资;②利用权证的风险局限性,运用权证作为组合管理工具;③运用权证组合技术,构建新的投资组合。

九、基金业绩比较基准
80%富时中国A股红利150指数+20%富时中国国债指数

当未来有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定更合适的基准或权重比例。业绩比较基准的调整须经基金管理人向基金持有人协商,并在更新的招募说明书中披露。

十、基金的风险收益特征
本基金风险收益高于债券基金与货币市场基金。本基金遵循积极主动的投资理念,以盈利增长稳定的股息和连续分红股票类资产为主要投资工具,力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的长期增值。

十一、基金投资组合报告
6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 2,294,560 81.13

其中:股票 2,294,560 81.13

2 固定收益投资 135,335,596.40 4.79

其中:债券 135,335,596.40 4.79

资产支持证券 -- --

3 贵金属投资 -- --

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 391,084,120.51 13.86

7 其他各项资产 6,440,017.89 0.23

8 合计 2,828,310.44 100.00

6.3 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 300070 碧水源 4,474,133 196,474,870.77 6.97

2 600887 银星股份 11,362,708 174,604,649.04 6.23

3 000069 华侨城A 21,067,826 149,721,142.86 5.34

4 601888 中国国旅 1,537,620 80,386,773.60 2.87

5 600518 康美药业 5,417,566 73,245,357.12 2.61

6 002865 南航节能 2,778,271 67,789,812.40 2.42

7 600011 华能国际 7,700,000 66,605,000.00 2.38

8 002436 兴森科技 6,309,800 65,685,018.00 2.34

9 000826 泰德环境 1,869,227 62,992,949.90 2.25

10 601166 兴业银行 4,000,000 68,240,000.00 2.08

6.4 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 60,174,000.00 2.15

2 央行票据 -- --

3 金融债券 74,731,165.40 2.67

其中:政策性金融债 74,731,165.40 2.67

4 企业债券 -- --

5 企业短期融资券 -- --

6 中期票据 -- --

7 可转债 430,430,000.00 0.02

8 同业资产 -- --

9 其他 -- --

10 合计 135,335,596.40 4.83

6.5 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

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 019501 15国债01 600,000 60,174,000.00 2.15

2 019001 国开1301 641,940 54,687,165.40 1.96

3 140230 14附开30 200,000 20,044,072.00

4 132002 15天集B 3,860 430,430,000.00 0.02

6.6 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

基金名称 报告期末持有资产支持证券

6.7 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贵金属投资明细

基金名称 报告期末持有贵金属

6.