(3)申银万国证券股份有限公司
住所:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人:杨小阳
电话:0755-82026521
传真:0755-82026539
联系人:刘权
网址:www.sjis.cn
客户服务电话:400-600-8008
基金管理人可根据有关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(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号通泰大厦B座3层
法定代表人:凌新源
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-88066511
联系人:廖为
(三)律师事务所
名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
法定代表人:王立华
联系电话:010-88092188
传真:010-88092150
联系人:杨科
经办律师:吴冠雄、刘艳
(四)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号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

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

本基金的投资范围限于限于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“自下而上”的个股精选策略,根据细致的财务分析和深入的上市公司调研,精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性,基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略,即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析,监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险水平合理。

(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%。为了满足投资者的赎回要求,基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的国债、政策性金融债、债券回购、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于5%。根据股票、债券等资产类别的配置计划,为提高投资效率或避险,基金可投资于权证,权证投资比例范围为0%~3%。本基金其余资产可投资于债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,如法律法规或监管部门对债券投资比例有相关规定的,则从其规定。

本基金在基金合同生效后三个月内达到上述规定的投资比例。

(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,基金还可以部分投资于其他具有高成长潜力的股票,这部分股票由研究员提交投资建议报告,经基金经理和投资决策委员会审议后确定。

2、进行财务指标分析

主要分析公司的成本收入、现金流、资产负债结构等指标,并与同行业内其他公司进行对比,从中挑选出指标值较优或可能存在问题的公司,以此确定实地调研的优先顺序和关注重点。

3、进行上市公司调研

实地调研重点考察公司的财务报表信息是否真实可靠,并对公司的核心竞争能力、内部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长性的评估。

4、评估个股价值并进行排序

根据实地调研的考察结果,对上市公司的公开财务数据进行风险调整和成长性调整,并计算调整后的PE、PB、PS、PEG、ROE、PEG等指标。由于公司经营状况和市场环境在不断发生变化,基金将实时跟踪上市公司风险因素和成长性因素的变动,对上述几个指标进行动态调整。然后,基金将根据一段时间内整个证券市场的风险特征以及不同公司的行业特征,对上述估值指标设置不同的权重,并根据综合考察后的个股估值情况进行排序。

5、确定投资组合

本基金采取相对集中的投资策略,基金股票组合的持股个数一般不超过100只(新股申购不计算在内)。在上述排序过程之后,排名前100位的个股将进入基金的股票投资组合,其中排名越靠前的个股投资比重越高。

在未来基金规模扩大或是上市公司数量大幅扩张,导致持股个数限制严重影响基金的投资操作和收益能力时,本基金可在不改变集中持股策略的前提下适当调整组合持股个数,并及时公告。

(三)债券投资策略

本基债券投资的主要目标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)。具有以下一项或多项特征的债券,将是本基金债券投资重点关注的对象:1、有较好流动性的债券;2、在信用质量和剩余期限类似的条件下,到期收益率较高的债券;3、风险水平合理、有较好下行保护的债券;4、在同等条件下信用质量较好的债券。

此外,基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资,以增加收益。基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下,可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

本基金股票投资的业绩比较基准为新华富时中国A200指数。未来,如所用基准指数不再符合本基金的投资风格和投资策略,或有更合适的大盘股指数推出,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,基金采用新华富时中国债指数作为债券投资的业绩比较基准,并根据基金的资产配置范围,将整体业绩比较基准设定为:新华富时中国A200指数×80%+新华富时中国国债指数×20%。未来,在更合适的债券指数推出、法律法规或监管部门调整投资比例限制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变更整体业绩比较基准的构成并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种,其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金,低于成长型股票基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所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。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2009年1月16日复核了本报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至2008年12月31日,本报告中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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,885,021,677.75	60.41
	其中:股票	1,885,021,677.75	60.41
2	固定收益投资	862,743,954.10	27.65
	其中:债券	862,743,954.10	27.65
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	351,607,576.55	11.27
6	其他资产	21,130,510.11	0.68
7	合计	3,120,503,718.51	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	244,730,147.14	8.06
C	制造业	807,927,669.85	26.59
C0	食品、饮料	42,637,064.11	1.40
C1	纺织、服装、皮毛	27,827,779.18	0.92
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,237,015.74	0.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	324,740,369.25	10.69
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	111,762,612.70	3.68
C7	机械、设备、仪表	86,188,089.91	2.84
C8	医药、生物制品	213,534,738.96	7.03
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	99,349,472.00	3.27
F	交通运输、仓储业	52,313,880.10	1.72
G	信息技术业	169,181,021.23	5.57
H	批发和零售贸易	156,576,648.74	5.15
I	金融、保险业	130,945,000.00	4.31
J	房地产业	103,984,297.46	3.42
K	社会服务业	60,413,541.23	1.99
L	传播与文化产业	59,600,000.00	1.96
M	综合类	-	-
	合计	1,885,021,677.75	62.05

(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

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	000937	金牛能源	10,300,025	144,200,350.00	4.75
2	600570	恒生电子	13,407,221	137,155,870.83	4.51
3	000623	吉林敖东	5,803,244	108,404,597.92	3.57
4	600739	辽宁成大	8,504,970	103,420,435.20	3.40
5	600970	中材国际	3,104,671	99,349,472.00	3.27
6	600239	云南城投	3,497,126	62,353,756.58	2.05
7	000888	峨眉山A	10,924,691	60,413,541.23	1.99
8	600831	广电网络	8,000,000	59,600,000.00	1.96
9	600135	乐凯胶片	16,401,644	55,929,606.04	1.84
10	000422	湖北宜化	6,000,000	46,380,000.00	1.53

(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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	118,655,015.70	3.91
2	央行票据	418,557,000.00	13.78
3	金融债券	319,345,000.00	10.51
	其中:政策性金融债	319,345,000.00	10.51
4	企业债券	6,186,938.40	0.20
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	862,743,954.10	28.40

(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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801034	08央行票据34	3,000,000	290,310,000.00	9.56
2	080416	08农发16	2,000,000	212,380,000.00	6.99
3	010004	20国债(4)	961,730	98,183,015.70	3.23
4	0801007	08央行票据07	1,000,000	96,240,000.00	3.17
5	080216	08国开16	500,000	53,800,000.00	1.77

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
2、基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,348,814.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,781,695.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,130,510.11

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
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、由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、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所列数字。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2004年8月11日至2004年12月31日	0.30%	0.48%	-8.47%	1.32%	8.77%	-0.84%
2005年1月1日至2005年12月31日	-0.20%	0.89%	-5.33%	1.03%	5.13%	-0.14%
2006年1月1日至2006年12月31日	154.49%	1.38%	92.14%	1.11%	62.35%	0.27%
2007年1月1日至2007年12月31日	226.24%	1.95%	106.61%	1.83%	119.63%	0.12%
2008年1月1日至2008年12月31日	-34.88%	2.08%	-56.18%	2.40%	21.30%	-0.32%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用
1、与基金运作有关的费用种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)证券交易费用;
(4)基金份额持有人大会费用;
(5)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用;
(6)其他按照国家有关规定可以列入的费用。
2、与基金运作有关费用的计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(2)基金托管人的托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(3)本条第(一)款第1款至(3)至第(6)项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。
3、不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。
4、基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。
(二)与基金销售有关的费用
1、申购与赎回费
(1)申购费
①投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。
②投资者选择交纳前端申购费时,按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额	前端申购费率
100万以下	1.5%
100万以上(含100万)—500万	1.2%
500万以上(含500万)	1.0%

③投资者选择交纳后端申购费时,费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有期	后端申购费率
1年以内	1.8%
满1年不满2年	1.5%
满2年不满3年	1.2%
满3年不满4年	1.0%
满4年不满8年	0.5%
满8年以后	0

④本基金申购费由基金管理人支配使用,不列入基金财产。
(2)赎回费
本基金赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。赎回费率为0.5%。其中,须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产,其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。
(3)基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式,最新的申购费率、赎回费率和收费方式在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式,基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。
(4)基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。
2、申购份额与赎回金额的计算方法
(1)申购份额的计算
如果投资者选择交纳前端申购费,则申购份额的计算方法如下:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值
净申购金额及申购份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位。
如果投资者选择交纳后端申购费,则申购份额的计算方法如下:
申购份额=申购金额/T日基金份额净值
申购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金资产承担,产生的收益归基金资产所有。
例一:假定T日的基金份额净值为1.200元,三笔申购金额分别为1,000元、100万元和500万元,如果投资者选择交纳前端申购费,各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额(元,A)	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00
适用前端申购费率(B)	1.50%	1.20%	1.00%
净申购金额(C=A/(1+B))	985.22	988,142.29	4,950,495.05
前端申购费(D=A-C)	14.78	11,857.71	49,504.95
申购份额(E/1.200)	821.02	823,451.91	4,125,412.54

如果该投资者选择交纳后端申购费,各笔申购获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额(元,A)	1,000.00	1,000,000.00	5,000,000.00
申购份额(E/1.200)	833.33	833,333.33	4,166,666.67

(3)赎回金额的计算
如果投资者在认购/申购时选择交纳前端认购/申购费,则赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
赎回金额=赎回总金额-赎回费用
如果投资者在认购时选择交纳后端认购费,则赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
后端认购费用=赎回份额×基金份额面值×后端认购费率/(1+后端认购费率)
(后端认购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)
赎回金额=赎回总金额-赎回费用-后端认购费用
其中,基金份额面值为1.00元。
如果投资者在申购时选择交纳后端申购费,则赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率/(1+后端申购费率)
(后端申购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)
赎回金额=赎回总金额-赎回费用-后端申购费用
例二:假定某投资者在T日赎回10,000份,该日基金份额净值为1.250元,其在认购/申购时已交纳前端认购/申购费,则其获得的赎回金额计算如下:
赎回总金额=10,000.00×1.250=12,500.00元
赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50元
赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50元
例三:假定某投资者在设立募集期内认购本基金份额时选择交纳后端认购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.025、1.080和1.140元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端认购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
基金份额面值(B)	1.000	1.000	1.000
赎回日基金份额净值(C)	1.025	1.080	1.140
赎回总金额(D=A×C)	10,250.00	10,800.00	11,400.00
赎回费用(E=D×0.5%)	51.25	54.00	57.00
适用后端认购费率(F)	1.2%	0.9%	0.7%
后端认购费(G=A×B×F/(1+F))	118.58	89.20	69.51
赎回金额(H=D-E-G)	10,080.17	10,656.80	11,273.49

例四:假定某投资人申购本基金份额当日的基金份额净值为1.200元,该投资人选择交纳后端申购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.230、1.300和1.360元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端申购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
申购日基金份额净值(B)	1.200	1.200	1.200
赎回日基金份额净值(C)	1.230	1.300	1.3600
赎回总金额(D=A×C)	12,300	13,000	13,600
赎回费用(E=D×0.5%)	61.50	65.00	68.00
适用后端申购费率(F)	1.80%	1.50%	1.20%
后端申购费(G=A×B×F/(1+F))	212.18	177.34	142.29
赎回金额(H=D-E-G)	12,026.32	12,757.66	13,389.71

(3)T日基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。
3、转换费
(1)基金转换费:无。
(2)转出基金费用:按转出基金正常赎回时应收的赎回费收取费用,如该部分基金采用后端收费模式购买,需收取正常赎回时应收的后端申购费。
(3)转入基金费用:对转入基金申购费费率进行优惠,收取优惠申购费,细则如下:
①收取申购、赎回费用的基金之间的转换
第一,前端或后端收费基金I转入前端收费基金II(I→II)
如果II基金的前端申购费率最高档比I基金的前端申购费率最高档高,则其差额部分即为转入II基金时的申购费率;反之,则转入II基金时的申购费率优惠至0。
特例处理:由于华夏红利申购金额在1000万元以上的前端申购费率为固定费用500元,华夏回报二号、华夏优势增长申购金额在1000万元以上的前端申购费率为固定费用1,000元,对于转换金额在1000万元以上的A类或B类华夏债券基金份额转入华夏红利收取固定申购费用500元,对于转换金额在1000万元以上的A类或B类华夏债券基金份额转入华夏回报二号、华夏优势增长收取固定申购费用1,000元。
第二,前端或后端收费基金I转入后端收费基金II(I→II)
转入II基金的已持有期为I基金后端申购费率为0的年限。例如,A类或B类华夏债券基金份额转入华夏大盘精选后收费,转入时因规为已持有华夏大盘精选满5年。
华夏回报二号、华夏优势增长、华夏复兴、华夏策略转入其他可做转换业务的后端收费模式开放式基金免收后端申购费用。
②不收取申购、赎回费用的基金(目前包括华夏现金增利、华夏债券C类)与收取申购、赎回费用的基金之间的转换
第一,收取申购、赎回费用的基金转入华夏现金增利、华夏债券C类
转入华夏现金增利、华夏债券C类不收取申购费用。
第二,华夏现金增利、华夏债券C类转入收取申购、赎回费用的基金前端收费,按优惠的申购费率收取,公式如下:
收取的申购费率=转入基金的申购费率-转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。
特例处理:华夏现金增利或华夏债券C转入华夏红利、华夏回报二号、华夏优势增长,转换金额1000万元以上,实际收取申购费如下:
华夏现金增利或华夏债券C转入华夏红利前,实际收取申购费=500元-转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。
华夏现金增利或华夏债券C转入华夏回报二号、华夏优势增长,实际收取申购费=1,000元-转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。
第三,华夏现金增利、华夏债券C类转入收取申购、赎回费用的基金后端收费
在计算转入基金的持有年限时,其持有期从买入华夏现金增利、华夏债券C类基金份额的时间开始计算。
上述为处理由(4)期间内可的多笔基金份额的转出的情况,对转出基金持有时间的确定有特殊规定,即每当有基金新增份额时,均调整持有时间,计算方法如下:
调整后的持有时间=原持有时间×原份额/(原份额+新增份额)
③不收取申购、赎回费用的基金之间的转换(目前包括华夏现金增利、华夏债券C类)不收取转入基金费用。
4、基金管理人可以在遵守法律法规及基金合同规定的条件下,根据市场情况制定基金促销计划,报中国证监会并给予公告。
(三)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏大盘精选证券投资基金招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他法律法规的要求,对本基金管理人于2008年9月25日刊登的本基金原招募说明书(更新)进行了更新,主要更新内容如下:
(一)更新了“三、基金管理人”的“主要人员情况”等。
(二)更新了“五、相关服务机构”的“销售机构”和“会计师事务所”的相关信息。新增了方正证券有限责任公司、兴业银行股份有限公司为代销机构,删除了泰阳证券有限责任公司相关信息。
(三)更新了“八、基金份额的申购、赎回与转换”直销机构相关信息及“基金份额的转换”、“基金份额的非交易过户与转托管”等相关描述。
(四)更新了“九、基金的投资”中基金的投资组合报告部分。
(五)更新了“十、基金的业绩”,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核。
(六)更新了“十二、基金资产的估值”中估值方法的相关描述。
(七)更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中有关服务提供信息。
(八)更新了“二十二、其他应披露事项”,按露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二〇〇九年三月二十八日

(3)申银万国证券股份有限公司
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	160,603,709.58	160,603,709.58	17.90
2	000063	中兴通讯	140,118,933.33	140,118,933.33	15.62
3	002024	苏宁电器	125,791,591.89	125,791,591.89	14.02
4	600036	招商银行	122,543,170.56	122,543,170.56	13.66
5	600031	三一重工	122,015,350.18	122,015,350.18	13.60
6	000651	格力电器	102,446,540.04	102,446,540.04	11.42
7	600016	民生银行	98,469,726.09	98,469,726.09	10.98
8	601166	兴业银行	96,268,312.33	96,268,312.33	10.73
9	601318	中国平安	89,749,249.80	89,749,249.80	10.00
10	000002	万科A	88,873,811.76	88,873,811.76	9.91
11	600309	烟台万华	88,145,839.45	88,145,839.45	9.82
12	600005	武钢股份	81,563,779.26	81,563,779.26	9.09
13	000983	西山煤电	80,042,217.80	80,042,217.80	8.92
14	600122	宏图高科	75,548,335.43	75,548,335.43	8.42
15	600028	中国石化	70,713,436.71	70,713,436.71	7.88
16	600779	水井坊	69,268,005.68	69,268,005.68	7.72
17	600660	福耀玻璃	65,510,382.53	65,510,382.53	7.30
18	600600	青岛啤酒	61,330,627.59	61,330,627.59	6.84
19	002032	苏泊尔	60,221,292.22	60,221,292.22	6.71
20	000898	鞍钢股份	58,532,851.09	58,532,851.09	6.52
21	600019	宝钢股份	56,880,633.60	56,880,633.60	6.34
22	600030	中信证券	56,610,949.35	56,610,949.35	6.31
23	000024	招商地产	55,704,127.19	55,704,127.19	6.21
24	600266	城建发展	55,169,523.64	55,169,523.64	6.15
25	601328	交通银行	54,066,669.13	54,066,669.13	6.03
26	000792	盐湖股份	53,587,795.19	53,587,795.19	5.97
27	600066	宇通客车	51,947,472.03	51,947,472.03	5.79
28	000157	中联重科	51,877,868.59	51,877,868.59	5.78
29	600009	上海机场	50,036,686.67	50,036,686.67	5.58
30	600519	贵州茅台	49,829,925.19	49,829,925.19	5.55
31	002008	大族激光	48,203,212.77	48,203,212.77	5.37
32	600737	中粮屯河	48,089,641.17	48,089,641.17	5.36
33	600547	山东黄金	46,982,901.63	46,982,901.63	5.24
34	600348	阳泉煤业	46,257,911.93	46,257,911.93	5.16
35	000527	美的电器	45,867,982.55	45,867,982.55	5.11
36	600973	宝胜股份	43,553,340.31	43,553,340.31	4.85
37	000528	柳工	42,768,539.88	42,768,539.88	4.77
38	600456	宝钛股份	42,375,038.13	42,375,038.13	4.72
39	000402	金融街	40,138,064.87	40,138,064.87	4.47
40	600352	浙江龙盛	39,273,028.88	39,273,028.88	4.38
41	600596	新安股份	37,480,770.40	37,480,770.40	4.18
42	600022	山东钢铁	37,048,961.99	37,048,961.99	4.13
43	600216	浙江医药	34,601,458.51	34,601,458.51	3.86
44	002003	伟星新材	33,794,985.68	33,794,985.68	3.77
45	000709	河钢股份	32,483,508.97	32,483,508.97	3.62
46	600011	华能国际	28,281,508.15	28,281,508.15	3.15
47	000538	云南白药	28,065,769.77	28,065,769.77	3.13
48	600886	国投电力	27,455,683.10	27,455,683.10	3.06
49	600271	航天信息	27,375,930.31	27,375,930.31	3.05
50	600026	中海发展	26,900,594.08	26,900,594.08	3.00
51	600143	金发科技	26,402,473.52	26,402,473.52	2.94
52	600276	恒瑞医药	26,056,357.13	26,056,357.13	2.90
53	601001	大同煤业	25,962,844.03	25,962,844.03	2.89
54	600895	张江高科	25,887,831.77	25,887,831.77	2.89
55	600312	平高电气	25,326,118.12	25,326,118.12	2.82
56	601628	中国人寿	25,295,560.08	25,295,560.08	2.82
57	601169	北京银行	23,763,403.13	23,763,403.13	2.65
58	601390	中国中铁	21,961,295.30	21,961,295.30	2.45
59	600795	国电电力	20,753,578.16	20,753,578.16	2.31
60	000800	一汽轿车	19,306,496.11	19,306,496.11	2.15
61	000423	东阿阿胶	19,277,167.35	19,277,167.35	2.15
62	600048	保利地产	18,815,682.28	18,815,682.28	2.10
63	000089	深圳机场	18,573,679.06	18,573,679.06	2.07

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	92,838,819.77	10.35
2	600016	民生银行	85,191,143.00	9.50
3	601166	兴业银行	70,819,614.30	7.89
4	000063	中兴通讯	70,694,117.66	7.88
5	000651	格力电器	66,333,248.43	7.39
6	000983	西山煤电	64,413,708.61	7.18
7	601318	中国平安	60,709,989.98	6.77
8	600005	武钢股份	59,292,829.69	6.61
9	600122	宏图高科	55,733,674.59	6.21
10	000792	盐湖股份	54,660,321.26	6.09
11	600600	青岛啤酒	54,289,314.18	6.05
12	600031	三一重工	52,669,575.87	5.87
13	600036	招商银行	52,046,162.28	5.80
14	002024	苏宁电器	48,028,175.73	5.35
15	600028	中国石化	47,746,077.36	5.32
16	600019	宝钢股份	47,423,282.33	5.29
17	000157	中联重科	46,901,345.27	5.23
18	000024	招商地产	46,254,619.04	5.16
19	601328	交通银行	46,055,845.27	5.13
20	000898	鞍钢股份	44,637,539.42	4.98
21	600348	阳泉煤业	44,325,806.91	4.94
22	600030	中信证券	43,635,389.62	4.86
23	600266	城建发展	41,659,180.31	4.64
24	000402	金融街	41,575,052.04	4.63
25	600309	烟台万华	41,325,860.06	4.61
26	000002	万科A	40,797,023.98