(上接D30版)
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:陈康菲
电话:021-50122222
传真:021-50122200
客户服务电话: 4008209898
公司网站:www.cnhbstock.com
(77)名称:英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
电话:0755-83007069
传真:0755-83007167
客户服务电话: 4008-698-698
公司网站:www.ydsc.com.cn
(78)名称:中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人:赵大建
联系人:姜建平
联系电话:010-59355543
客服电话:40088-95618
公司网站:www.e5618.com
(79)名称:华龙证券有限责任公司
注册地址: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
联系人:李昕田
电话:0931-4890100
传真:0931-4890118
客户服务电话: 0931-4890100、4890619、4890618
公司网站:www.hlzqgs.com
(80)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客户服务电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
(81)名称:厦门证券有限公司
注册地址: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:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161642
传真:0592-5161640
客户服务电话: 0592-5163588
公司网站:www.xmzq.cn
(82)名称:南京证券有限责任公司
住所:江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人:张华东
联系人:徐翔
电话:025-83367888-4201
传真:022-83320066
客户服务热线:400 828 5888
公司网址:www.njzq.com.cn
(83)名称: 华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区 月坛北街26号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
法定代表人:丁之锁
联系人:林长华
电话:010-58568181
传真:010-58568062
客户服务电话:010-58568118
公司网址: www.hrsec.com.cn
(84)名称:浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
法定代表人:吴承
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客户服务电话:0571-967777
公司网址:www.stocke.com.cn
(85)名称:西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
联系人:陈诚
电话:023-63786464
传真:023-63786311
客户服务电话:4008 096 096
公司网址:www.swsc.com.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记人
名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
法定代表人:马庆泉
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:国浩律师集团(广州)事务所
住所: 广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真:020-38799335
经办律师:程秉、章小炎
联系人:程秉

(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:德勤华永会计师事务所有限公司
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
联系人:胡小骏
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:胡小骏、洪锐明

四、基金的名称

广发策略优选混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式混合型基金

六、基金的投资目标

通过综合运用多种投资策略优选股票,分享中国经济和资本市场高速增长的成果,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

七、基金的投资方向

具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金股票资产的配置比例为30%-95%, 债券资产的配置比例为0-65%,权证的配置比例为0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券大于等于5%。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略

本基金将主要根据下述因素的判断,确定资产配置策略:

1. 宏观经济因素

宏观经济形势从两个方面影响股市,一是对上市公司的业绩产生影响,二是改变投资者的投资行为。由于股市往往对宏观经济进行提前反映,因此,本基金管理人将重点关注一些宏观先行指标。

2. 政策因素

我国政府对经济体系的宏观调控能力很强,可以说,政策是影响股市运行的核心因素之一。本基金管理人将重点关注的政策因素包括:财政政策、货币政策和证券市场宏观管理政策。

3. 资金供求因素

资金供求是决定我国证券市场运行的重要因素。

4. 市场波动周期

市场脉动节奏呈现明显的周期特征,投资进出时机的把握对提高投资收益有着极为重要的作用。

(二)股票投资策略

本基金股票投资策略主要通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合。

具体的投资策略包括:

1. 主题投资策略:此种投资策略就是通过对宏观经济中制度性、结构性或周期性的发展趋势或发展动力进行前瞻性的研究与分析,挖掘并投资于集中代表整个市场阶段发展趋势的上市公司。

本基金使用主题投资分析框架(Thematic Investing Analysis Frame)进行主题投资的分析研究,所遵循的步骤如下:

(1)首先寻找经济社会发展变化的趋势:即明确经济结构或产业即将发生的根本性变化,分析这些根本性变化的内涵和寓意。

(2)继而认清使该种趋势产生和持续的内在驱动因素:即有效分析经济运行中真正起作用的驱动因素,客观清楚的认识证券市场的发展规律与发展趋势。

(3)最后将能够从这种趋势中受惠的公司纳入投资范围:即找出充分代表或体现该投资主题的公司,经过全方位的周密调查研究后建立主题投资组合。

(4)重复以上过程,不断的寻找、发现、研究新的主题投资机会。

2. 买入持有策略:此种投资策略主要投资的对象为相对价值被低估的成长型股票,通过长期持有分享高成长性所带来的收益。具体应用GARP(Growth at Reasonable Price)选股法进行股票选择。

GARP选股法重视股票投资价值与成长潜力的平衡,既规避投资标的价格高企的风险,又具备高速成长的优势。应用GARP选股法选择出的股票,会有潜在的两个收益渠道:没有考虑成长潜力下,价值回归中的投资收益;成长潜力释放带来的价值增长。

3. 逆向投资策略:此种投资策略主要投资的对象为相对价值被低估的价值型股票,待其价值回归后沽出获利。主要通过以下两方面因素的考察来选取股票:

(1)低市盈率或市净率

首先采用定量工具定期计算库中个股的市盈率和市净率,找出市盈率或市净率较低的公司股票。造成股票市盈率(市净率)较低可能有宏观、微观、产业三个方面的原因,因此需要进一步分析其基本面是否存在某些向好因素以支撑公司价值回归,并挖掘其投资机会。

(2)定性分析

然后基金管理人将对选出股票的“低价因素”进行合理分析,从中找到基本面素质较好,股价可望在短时间内回归的公司。

(三)债券投资策略

1. 利率预测

债券投资策略的关键是对未来利率走向的预测, 并及时调整债券组合使其保持对利率波动的合理敏感性。本基金将在利率合理预期的基础上,通过久期管理,稳健地进行债券投资,控制债券投资风险。尤其是在预期利率上升的时候,严格控制,保持债券投资组合较短的久期,降低债券投资风险。

2. 收益曲线策略

收益曲线策略是以对收益率曲线形状变动的预期为依据建立或改变组合头寸。要运用收益曲线策略,必须先确定收益曲线变动的类型以及各种变动对组合收益率变动的影响。

3. 债券类别配置

(1)一、二级市场配置

随着国债发行市场化的增强,本基金管理人将充分考量一级、二级市场的风险收益,并拟订配置策略。

(2)银行间债券市场和交易所市场配置

就目前而言,银行间债券市场流动性不如交易所市场。本基金将在均衡流动性和收益性的基础上合理配置两个市场的投资比例。

(3)债券品种配置

我国债券市场目前发展较为成熟且流动性较好的是国债与金融债市场, 这将是本基金债券投资的主要品种;随着未来企业债与可转债市场的发展,本基金将在控制投资风险的基础上合理增加其投资比重。

(四)权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。根据有关规定,本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制:

1. 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。
2. 本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。
3. 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。

若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,不受上述条款限制。

(五)投资决策依据和决策程序

1. 决策依据

以《基金法》、本基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2. 决策程序

(1)投资决策委员会制定整体投资战略。

(2)研究发展部根据自身或者其他研究机构的研究成果,构建股票备选库,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供个股、债券决策支持。

(3)基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,在研究部门研究报告的指引下,结合对证券市场、上市公司、投资时机的分析,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、行业配置、重仓个股投资方案。

(4)投资决策委员会对基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

(5)根据决策纪要,基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易室执行。

(6)中央交易室按有关交易规则执行,并将有关信息反馈基金经理小组。

(7)金融工程小组定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

(8)风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,尤其重点关注基金投资组合的风险状况;金融工程小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

九、业绩比较基准

75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数

十、风险收益特征

较高风险,较高收益

十一、投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定, 于2010年12月1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2010年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)基金资产配置组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,345,186,027.40	89.52
	其中:股票	11,345,186,027.40	89.52
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,226,817,472.09	9.68
6	其他各项资产	101,404,996.17	0.80
7	合计	12,673,408,495.66	100.00

(二)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	-	-
B	采掘业	193,975,910.91	1.54
C	制造业	6,927,275,149.29	55.07
C0	食品、饮料	1,670,283,654.81	13.28
C1	纺织、服装、皮毛	623,338,336.61	4.95
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	51,194,920.70	0.41
C4	石油、化学、塑胶、塑料	375,022,006.17	2.98
C5	电子	155,160,840.59	1.23
C6	金属、非金属	65,596,961.84	0.52
C7	机械、设备、仪表	1,435,253,152.03	11.41
C8	医药、生物制品	2,402,096,019.54	19.09
C99	其他制造业	149,329,257.00	1.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	634,193,372.04	5.04
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	634,842,950.01	5.05
H	批发和零售贸易	1,796,401,708.60	14.28
I	金融、保险业	228,522,472.41	1.82
J	房地产业	537,697,442.16	4.27
K	社会服务业	115,930,190.21	0.92
L	传播与文化产业	159,733,123.29	1.27
M	综合类	116,613,708.48	0.93
	合计	11,345,186,027.40	90.18

(二)期末基金投资前十名股票明细

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	002024	苏宁电器	37,552,777	599,717,848.69	4.77
2	002073	软控股份	22,734,688	477,655,794.88	3.80
3	600048	保利地产	37,953,942	469,110,723.12	3.73
4	601607	上海医药	18,714,510	418,269,298.50	3.32
5	000869	张 裕 A	3,409,432	409,097,745.68	3.25
6	002304	洋河股份	1,843,257	377,849,252.43	3.00
7	600519	贵州茅台	2,124,308	358,434,488.84	2.85
8	002029	七 匹 狼	9,196,778	308,459,934.12	2.45
9	600690	青岛海尔	13,086,355	307,660,206.05	2.45
10	002154	报 喜 鸟	9,964,079	274,012,172.50	2.18

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(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

本基金本报告期末未持有债券。

(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. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

4. 其他资产的构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,582,437.86
2	应收证券清算款	62,563,910.63
3	应收股利	-
4	应收利息	273,708.52
5	应收申购款	33,984,939.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,404,996.17

5. 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换期的可转换债券。

6. 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未存在流通受限情况。

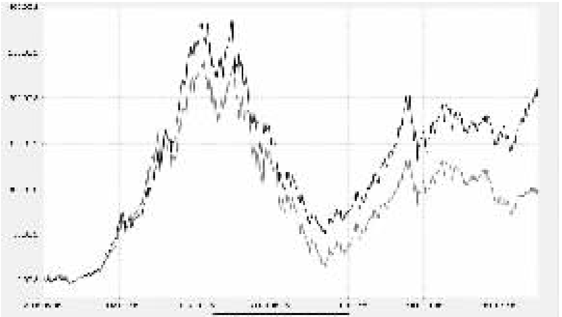
十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。基金业绩数据截至2010年9月30日。

1. 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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)
2006.05.17-2006.12.31	45.61%	0.0090	38.00%	0.0111	7.61%	-0.0021
2007.01.01-2007.12.31	144.03%	0.0204	117.09%	0.0173	26.94%	0.0031
2008.01.01-2008.12.31	-53.27%	0.0211	-46.58%	0.0229	-6.69%	-0.0018
2009.01.01-2009.12.31	70.75%	0.0181	72.50%	0.0153	-1.75%	0.0028
2010.01.01-2010.09.30	9.37%	0.0117	-8.95%	0.0113	18.32%-	0.0004
2006.05.17-2010.09.30	210.09%	0.0177	99.90%	0.0169	110.19%	0.0008

2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注:(1)业绩比较基准:75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数
(2)本基金图示时间段为2006年5月16日至2010年9月30日。

十三、基金的费用

(一)基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 销售服务费;
4. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
5. 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
6. 基金份额持有人大会费用;
7. 基金的证券交易费用;
8. 银行汇划费用;
9. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

管理费的计算方法如下:

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,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3. 销售服务费

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

由于相关法律法规未正式颁布,本基金暂时不收取销售服务费。若相关法律法规允许本类型基金提取销售服务费或者增加销售服务费作为投资者可以选择的收费方式,则本基金可以提取销售服务费,在相关法律法规允许的费率范围内,与托管人协商一致并履行适当程序后收取。基金管理人依据本基金合同及届时有效的有关法律法规公告收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的,无须召开基金份额持有人大会。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×F÷当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

F为销售服务费费率

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。若相关法律法规或监管机构对销售服务费的计算方法、提取方式或者其他事项另有规定,则从其规定。

上述“一、基金费用的种类”中第4-8项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金财产中支付。

(三)本基金不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1. 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;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)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协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率、基金销售费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告并报中国证监会备案。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求, 结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对《广发策略优选混合型证券投资基金招募说明书》(更新)【2010年第1号】的内容进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在“第四部分 基金托管人”部分,根据托管行人员变动情况和基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。

2. 在“第五部分 相关服务机构”部分,增加了相关的代销机构,对原有销售机构的资料进行更新,相关事宜均已公告。

3. 在“第九部分 基金的投资”部分,更新了截至2010年9月30日的基金投资组合报告。

4. 在“第十部分 基金的业绩”部分,对截至2010年9月30日的基金业绩表现情况予以披露。

5. 根据最新公告对“第二十二部分 其他应披露的事项”进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一〇年十二月三十一日

(上接D34版)
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
法定代表人:王丽
联系电话:010-66575888
传真:010-65232181
联系人:李娜
经办律师:李志宏、李娜

(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:华夏收入股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:本基金在严格执行投资风险管理的前提下,主要投资于盈利增长稳定的红利股,追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

七、基金的投资方向

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公司股票、债券、资产支持证券、权证以及中国证监会批准的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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)决策依据

1、国家有关法律、法规和基金合同的规定。

2、宏观经济环境、国家政策和市场周期分析。

3、上市公司财务品质和管理能力、分红历史、分红价值、分红意愿和分红预期,以及对公司盈利增长能力的预测。

(二)投资管理办法

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,通过自下而上的方法精选个股获得股息收入和资本的长期增值。以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具,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为股票60%~95%、债券0%~35%、短期金融工具5%~40%、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主动调整, 以求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,但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

本基金不作主动的行业资产配置,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作相应的行业调整。

2、股票投资策略

本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,通过品质检验、红利股筛选和盈利增长预测三个立体选股流程,精选出兼具良好财务品质、稳定分红能力、高股息和持续盈利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80%。

(1)品质检验

剔除风险股、庄股和流动性差的股票,对上市公司进行定期量化筛选,通过体系内表征企业盈利能力、财务健康状况、资产管理运作效率和企业成长性四类13个量化指标筛选出在财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司,构成本基金初选股票库。

(2)红利股筛选

在初选股票库基础上,我们综合考察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确定本基金备选股票库。具体选股标准包括满足以下一项或多项特征的股票: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具有较好的分红价值:最近一年股息率(每股现金分红/最近1年内经复权调整的股价)市场排名进入前30%。C具有较强的分红意愿:最近一年度股利分配率(分红除以前一年度税后净利润)市场排名进入前30%。D具有很好的分红预期:将会推出较优厚分红方案。

本基金同时对具有投资价值的新股进行申购。

(3)盈利增长预测

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、出众的竞争优势、较好的盈利增长前景等特征条件,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池。

3、债券投资策略

债券投资管理的目标是在保持投资组合稳定收益和充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。债券投资组合的构建将通过全面的宏观、市场和品种的研究分析,在各种定量辅助手段的支持下综合运用利率预测、价值评估、利率期限结构分析等投资策略,积极主动地预期市场变化,寻找各种市场机会,获得超过市场水平的平均收益。

4、短期金融工具投资策略

在控制风险的前提下,通过对政策调控和资金面的精确把握,结合股票和债券资产的动态配置,并充分考虑基金资产的流动性要求,获得短期金融工具的稳定收益同时,为基金的动态资产配置提供有效的缓冲。结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行短期货币工具投资,以便在保证基金资产的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,结合多种期权定价模型,在确定权证合理价值的基础上,以主动投资为主,结合资产和组合特性,谨慎进行权证投资。

主要投资策略包括但不限于:①在标的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利用权证的损失有限性,运用权证作为组合管理工具;③运用权证组合技术,构建新的投资回报模式。

九、基金的业绩比较基准

80%富时中国A股红利150指数+20%富时中国国债指数

将来如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,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金,遵循积极主动的投资理念,以盈利增长稳定的高股息和连续分红股票类资产为主要投资工具,在股票型证券投资基金中属于中等风险的基金产品。本基金力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的中长期稳定增值。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定, 于2010年10月22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2010年9月30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	3,211,320,091.37	73.63
	其中:股票	3,211,320,091.37	73.63
2	固定收益投资	249,152,909.70	5.71
	其中:债券	249,152,909.70	5.71
	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	893,311,801.30	20.48
6	其他各项资产	7,596,533.30	0.17
7	合计	4,361,381,335.67	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	284,689,002.17	6.62
C	制造业	1,275,624,596.49	29.67
C0	食品、饮料	65,727,073.55	1.53
C1	纺织、服装、皮毛	30,241,309.15	0.70
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	121,427,408.24	2.82
C4	石油、化学、塑胶、塑料	97,811,825.30	2.28
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	168,995,877.04	3.93
C7	机械、设备、仪表	625,158,221.28	14.54
C8	医药、生物制品	166,262,881.93	3.87
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	85,682,114.93	1.99
E	建筑业	77,678,999.91	1.81
F	交通运输、仓储业	101,897,652.36	2.37
G	信息技术业	360,486,412.51	8.39
H	批发和零售贸易	275,075,240.28	6.40
I	金融、保险业	472,628,117.91	10.99
J	房地产业	134,062,565.24	3.12
K	社会服务业	83,320,255.62	1.94
L	传播与文化产业	34,030,133.95	0.79
M	综合类	26,145,000.00	0.61
	合计	3,211,320,091.37	74.70

(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	000063	中兴通讯	6,402,738	157,827,491.70	3.67
2	600028	中国石化	16,999,876	139,398,983.20	3.24
3	600582	天地科技	6,488,467	114,521,442.55	2.66
4	601328	交通银行	19,384,943	112,432,669.40	2.62
5	000527	美的电器	7,249,980	110,924,694.00	2.58
6	600500	中化国际	9,866,032	105,467,882.08	2.45
7	601166	兴业银行	4,238,935	98,004,177.20	2.28
8	600036	招商银行	7,000,000	90,650,000.00	2.11
9	000537	广宇发展	7,434,990	81,413,140.50	1.89
10	600581	八一钢铁	6,410,430	79,809,853.50	1.86

(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	5,661,165.60	0.13
2	央行票据	197,710,000.00	4.60
3	金融债券	20,070,000.00	0.47
	其中:政策性金融债	20,070,000.00	0.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	25,711,744.10	0.60
7	其他	-	-
8	合计	249,152,909.70	5.80

(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	1001056	10央行票据56	1,500,000	146,910,000.00	3.42
2	0801062	08央行票据62	500,000	50,800,000.00	1.18
3	113002	工行转债	221,830	24,762,882.90	0.58
4	080303	08进出03	200,000	20,070,000.00	0.47
5	010107	21国债(7)	52,770	5,661,165.60	0.13

(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未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,024,588.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,744,644.87
4	应收利息	1,755,053.44
5	应收申购款	72,246.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,596,533.30

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、投资组合报告附注的其他文字描述部分

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资产,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	基金净值增长率①	基金净值增长率标准差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
2005年11月17日至2005年12月31日	0.52%	0.03%	5.79%	0.67%	-5.27%	-0.64%
2006年1月1日至2006年12月31日	139.55%	1.32%	70.55%	1.17%	69.00%	0.15%
2007年1月1日至2007年12月31日	146.38%	1.97%	150.76%	2.14%	-4.38%	-0.17%
2008年1月1日至2008年12月31日	-43.27%	1.93%	-52.67%	2.56%	9.40%	-0.63%
2009年1月1日至2009年12月31日	78.76%	1.64%	84.16%	1.85%	-5.40%	-0.21%
2010年1月1日至2010年9月30日	-11.33%	1.21%	-7.31%	1.21%	-4.02%	0.00%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括:基金管理人的管理费;基金托管人的托管费;基金财产拨划支付的银行费用;基金合同生效后的基金信息披露费用;基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;基金份额持有人大会费用;基金的证券交易费用;以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

1、基金管理费

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×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

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3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、基金托管费

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×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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,经基金托管人复核后于次月首日起3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。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费与赎回费

(1)本基金的申购费率按申购金额递减。投资人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(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上(含100万元)-200万元以下	1.2%
200万元以上(含200万元)-500万元以下	0.8%
500万元以上(含500万元)	每笔500元

(2)本基金赎回费率不超过赎回金额的0.5%,赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

持有期限	一年以内	满一年(含)不满二年	满二年(含)不满三年	三年(含)以上
赎回费率	0.5%	0.35%	0.2%	0

(3)本基金的申购费用由基金申购人承担,归基金管理人及代销机构所有,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担,赎回费将按照赎回当时适用的费率收取,所收取赎回费的25%归入基金资产,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

(4)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式,并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。

(5)基金管理人可以在不违背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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易等)等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、赎回费率。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

(1)基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

(注:申购费用为固定金额时,净申购金额=申购金额-申购费用)

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

例一:假定T日的基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100万元、200万元,则各笔申购负担的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	2,000,000.00
适用申购费率(B)	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额(C=A/(1+B))	985.22	988,142.29	1,984,126.98
申购费用(D=A-C)	14.78	11,857.71	15,873.02
申购份额(E=C/1.200)	821.02	823,451.91	1,653,439.15

若申购金额为500万元,则申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购4
申购金额(元,A)	5,000,000.00
申购费用(B)	500.00
净申购金额(C=A-B)	4,999,500.00
申购份额(D=C/1.200)	4,166,250.00

(2)基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中,

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

例二:假定T日的基金份额净值为1.250元,投资者分别赎回本基金1,000份、10,000份、10万份和100万份,持有期分别为6个月、1年、2年和3年,则其获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3	赎回4
赎回份额(A)	1,000.00	10,000.00	100,000.00	1,000,000.00
赎回总金额(元,B=A*1.250)	1,250.00	12,500.00	125,000.00	1,250,000.00
适用赎回费率(C)	0.5%	0.35%	0.2%	0
赎回费用(D=B*C)	6.25	43.75	250.00	0
赎回金额(E=B-D)	1,243.75	12,456.25	124,750.00	1,250,000.00

(3)基金份额资产净值的计算公式

T日基金份额资产净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(4)申购份额余额的处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

(5)赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

(6)本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏收入股票型证券投资基金招募说明书(更新)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2010年7月1日刊登的本基金招募说明书(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”相关内容。
(二)更新了“四、基金托管人”相关内容。
(三)更新了“五、相关服务机构”相关信息。
(四)更新了“八、基金份额的申购、赎回与转换”相关内容。
(五)更新了“十、基金的投资”相关内容,该部分内容均按有关规定编制。
(六)更新了“十一、基金的业绩”,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核。
(七)更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”相关内容。
(八)更新了“二十三、其他应披露事项”,披露了自上次招募说明书更新后涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二〇一〇年十二月三十一日

股票简称:中航动控 股票代码:000738 公告编号:临2010-026

中航动力控制股份有限公司
关于股东股权变动的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2010年8月23日,本公司公告了《中航动力控制股份有限公司关于股东股权变动的提示性公告》,公告提及本公司股东中国南方航空工业(集团)有限公司(以下简称"南方工业")的股东中国航空工业集团公司(以下简称"中航工业集团")、中国华融资产管理公司(以下简称"华融公司")、中国东方资产管理公司(以下简称"东方公司")拟以合计持有南方工业的100%股权作为标的资产认购西安航空动力股份有限公司(以下简称"航空动力",股票代码"600893")定向发行的股份的事宜。

2010年12月30日, 航空动力召开第六届董事会第十二次会议审议通过了本次发行股份购买资产的方案。同日,航空动力与中航工业集团、华融公司、东方公司、西安航空发动机(集团)有限公司、贵州黎阳航空发动机(集团)有限公司签署了《关于西安航空动力股份有限公司定向发行股份购买资产协议》。此次发行股份购买资产的相关事宜尚需提交航空动力股东大会审议。本公司将密切关注相关工作的进展并及时履行相应的信息披露义务。

特此公告。

中航动力控制股份有限公司
董事会
二〇一〇年十二月三十日

股票代码:000686 股票简称:东北证券 公告编号:2010-060

东北证券股份有限公司
关于警惕假冒东北证券网站进行诈骗的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

近日,公司发现有网站(www.gp65599.com),假借与东北证券股份有限公司相近的名称"东北证券理财投资有限公司"和"上海东北证券理财投资有限公司",冒用我公司标识和英文名称,开展非法投资理财活动,此类行为严重违反《证券法》的相关规定,侵害了我公司的合法权利,同时也严重侵害了广大投资者的合法权益。为此,公司郑重提示如下:

一、东北证券股份有限公司唯一的官方网址是:www.nesc.cn。

二、东北证券股份有限公司严格依法合规从事证券投资咨询业务,未授权任何机构或个人开展代客炒股业务。

三、对于这种假冒与东北证券股份有限公司相近名称欺诈投资者的恶劣行为,一经发现,我公司将在第一时间向当地监管部门报告、备案,同时保留进一步追究其法律责任的权利。

我公司提醒广大投资者明辨真伪,警惕此类诈骗活动,切实保护自身利益,谨防上当受骗。同时欢迎广大投资者积极举报有关不法侵权行为, 公司客服电话为4006000686, 投资者服务电话为0431-85096806。

特此公告。

东北证券股份有限公司
董事会
2010年12月31日

证券代码:000638 证券简称:万方地产 公告编号:2010-056

万方地产股份有限公司
关于出售资产的进展公告

本公司董事会、监事会及高级管理人员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

万方地产股份有限公司(以下简称"万方地产"或"公司")与北京宏途建设工程有限公司(以下简称"宏途建设")于2010年11月11日签订了《股权转让合同》,宏途建设以人民币5,900万元的价格收购万方地产全资子公司中辽国际工业总公司(以下简称"工业公司")持有的沈阳超力钢筋有限公司(以下简称"超力钢筋")48.9%的股权。

本次交易已经公司第六届董事会第五次会议和公司2010年第四次临时股东大会审议通过,内容详见公司于2010年11月13日、2010年11月30日在公司指定媒体披露的《第六届董事会第五次会议决议公告》、《2010年第四次临时股东大会决议公告》。

公司于2010年12月29日收到沈阳市工商行政管理局下发的《公司变更登记核准通知书》和变更登记后的《企业法人营业执照》,工业公司持有的超力钢筋48.9%的股权已正式过户至北京宏途建设工程有限公司名下,同时公司已收到宏途建设支付的全部股权转让款合计5,900万元。至此,本次资产出售已履行完毕。

特此公告

万方地产股份有限公司
董事会
二〇一〇年十二月三十日

股票代码:600290 股票简称:华仪电气 编号:临2010-052

华仪电气股份有限公司
关于项目预中标的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

近日本公司全资子公司华仪风能有限公司(以下简称"华仪风能")收到华能吉林发电有限公司通榆团结风电厂发出的《预中标通知书》1份,确定华仪风能为通榆团结风电厂A、B风电场主机设备的预中标单位之一,预中标 20台1.5MW风电机组,预中标总价为125,699,997.00元。

华仪风能将尽快与上述项目业主进行合同洽谈,公司将对上述项目进展履行持续披露义务。

特此公告。

华仪电气股份有限公司
董事会
2010年12月30日

股票代码:600290 股票简称:华仪电气 编号:临2010-053

华仪电气股份有限公司
关于项目预中标的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

近日本公司收到中国机械进出口(集团)有限公司发出的《预中标通知书》1份,确定本公司为华能通榆新华风电项目风力发电设备采购招标项目的预中标人,预中标 132台1.5MW风电机组。

本公司将尽快与上述项目业主进行合同洽谈,公司将对上述项目进展履行持续披露义务。

特此公告。

华仪电气股份有限公司
董事会
2010年12月30日