

---

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）  
招募说明书（更新）摘要

2011 年第 1 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

### 重要提示

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）由兴科证券投资基金转型而成。依据中国证监会 2007 年 4 月 13 日证监基金字[2007]107 号文核准的兴科证券投资基金基金份额持有人大会决议，兴科证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）”。自 2007 年 4 月 24 日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2011年4月24日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2011年3月31日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

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

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：范勇宏

联系人：崔雁巍

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	100%
合计	100%

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

王东明先生：董事长，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司董事长、中国中信集团公司董事、总经理助理，中信控股有限责任公司董事、中信国际金融控股有限公司董事、中信资本市场控股有限公司董事、中信证券国际有限公司董事。曾任中信证券有限责任公司副总经理、总经理、董事，北京华远经济建设公司副总经理，加拿大枫叶银行证券公司部门副经理，华夏证券公司发行部副总经理，南方证券公司副总裁等职务。

范勇宏先生：董事、总经理，博士。曾任华夏证券股份有限公司总裁助理、华北业务总监、华夏证券股份有限公司北京东四营业部总经理、中国建设银行总行干部。

王连洲先生：独立董事，学士。现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在全国人大财经委员会和中国人民银行总行印制管理局工作。

龙涛先生：独立董事，硕士。现任海问投资咨询有限责任公司董事长、中央财经大学会计系副教授。曾在毕马威国际会计纽约分部从事审计和财务分析工作。

涂建先生：独立董事，学士。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾任中国国际贸易促进委员会资产监督管理委员会资产管理中心主任。

滕天鸣先生：执行副总经理，硕士。曾任公司总经理助理和机构理财部总经理等。

王亚伟先生：副总经理，硕士。现任华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张后奇先生：副总经理，博士。曾任公司总经理助理。

方瑞枝女士：督察长，硕士。曾在中国金融出版社工作。

周伟明先生：监事，硕士。现任西南证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、市场研究部经理、副总经理。曾任江苏联合信托投资有限公司研究发展部研究员、上海分部经理。

张鸣溪先生：监事，学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任北京证券有限责任公司投资银行部执行总经理、财务总监，华夏证券有限公司并购业务管理部常务副总经理、计划财务部副总经理、投资银行总部副总经理，中华会计师事务所注册会计师。

瞿颖女士：监事，硕士，中国注册会计师协会非执业会员。现任华夏基金管理有限公司稽核部总经理助理。曾就职于安永华明会计师事务所、泰康人寿保险公司。

## 2、本基金基金经理

刘文动先生，硕士。曾任鹏华基金管理有限公司投资总部副总经理兼机构理财部总监，平安保险集团投资管理中心组合经理助理、平安证券有限责任公司研究员。2006年加入华夏基金管理有限公司。历任兴安证券投资基金基金经理（2006年5月24日至2007年11月21日期间），兴华证券投资基金基金经理（2007年2月14日至2008年2月27日期间）。现任华夏基金管理有限公司投资总监，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2007年6月12日起任职）、华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理（2009年7月21日起任职）、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理（2009年12月11日起任职）。

杨泽辉先生，会计学硕士。2004年加入华夏基金管理有限公司，历任行业研究主管、行业研究员，现担任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2009年1月1日起任职）。

王怡欢女士，北京大学经济学硕士。2004年6月加入华夏基金管理有限公司，历任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理，现担任华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2011年2月22日起任职）。

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）历任基金经理：2007年5月9日到2009年1月1日期间，巩怀志先生担任基金经理；2007年9月27日到2009年1月1日期间，谭琦先生担任基金经理；2007年4月24日至2007年9月27日期间，王志华先生担任基金经理。

兴科证券投资基金历任基金经理：2006年2月7日至2007年4月23日、2004年2月27日至2004年9月16日期间，王志华先生担任基金经理；2004年9月16日至2006年2月7日期间，张益驰先生担任基金经理；2001年1月1日至2004年2月27日期间，石波先生担任基金经理；2000年4月8日至2000年12月30日期间，葛基标先生担任基金经理。

## 3、本公司投资决策委员会（股票投资）成员

范勇宏先生：华夏基金管理有限公司董事、总经理。

王亚伟先生：华夏基金管理有限公司副总经理，华夏大盘精选证券投资基金基金经理、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

刘文动先生：华夏基金管理有限公司投资总监，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金

经理、华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理、华夏盛世精选股票型证券投资基金基金经理。

程海泳先生：华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部总经理、国际投资总监，华夏复兴股票型证券投资基金基金经理。

巩怀志先生：华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部副总经理，华夏优势增长股票型证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：562.59亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志公布的2009年全球1000家银行排名，交通银行总资产排名位列第56位，一级资本排名位列第49位。截止2010年12月末，交通银行资产总额超过人民币3.95万亿元，2010年实现净利润人民币390.42亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### （二）主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今

任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止2011年3月末，交通银行共托管证券投资基金52只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票（LOF）、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合（LOF）、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票（LOF）、万家公用事业行业股票（LOF）、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过七千亿元。

## 三、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构：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：范勇宏

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

联系人：吴志军

网址：[www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com)

#### 2、场外代销机构

##### （1）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：刘业伟

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

传真：010-85109219

联系人：滕涛

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

（3）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

联系人：客户服务中心

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

客户服务电话：95566

（4）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

传真：010-66275654

联系人：王琳

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（5）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

客户服务电话：95559

（6）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049、0755-82090817

联系人：邓炯鹏

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

客户服务电话：95555

（7）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

电话：010-65558888

传真：010-65550827

联系人：丰靖

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

客户服务电话：95558

（8）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63602431

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

（9）深圳发展银行股份有限公司



住所：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

电话：0755-82088888

传真：0755-25841098

联系人：张青

网址：www.sdb.com.cn

客户服务电话：95501

（10）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：0591-87839338

传真：0591-87841932

联系人：梁曦

网址：www.cib.com.cn

客户服务电话：95561

（11）中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号 A 座 5 层

法定代表人：唐双宁

客户服务电话：95595

传真：010-68560661

联系人：朱红

网址：www.cebbank.com

（12）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区西单教育街三号西楼 11 层

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

（13）中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

传真：010-68858117

联系人：陈春林

网址：www.psbc.com

（14）华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238670

传真：010-85238680

联系人：李慧

网址：www.hxb.com.cn

客户服务电话：95577

（15）平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南中路 1099 号

办公地址：深圳市深南中路 1099 号

法定代表人：孙建一

电话：0755-22197874、25879591

传真：0755-22197701

联系人：蔡宇洲、霍兆龙

网址：www.pingan.com/bank

客户服务电话：400-669-9999

（16）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528

传真：021-63586215

联系人：胡技勋

网址：www.nbc.com.cn

（17）浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号  
办公地址：浙江省杭州市下城区庆春路 288 号  
法定代表人：张达洋  
客户服务电话：95527  
传真：0571-87659188  
联系人：吴军阳  
网址：www.czbank.com

（18）东莞银行股份有限公司

住所：东莞市运河东一路 193 号  
办公地址：东莞市运河东一路 193 号  
法定代表人：廖玉林  
电话：13316603168  
传真：0769-22117730  
联系人：胡昱  
网址：www.dongguanbank.cn

客户服务电话：0769-96228

（19）杭州银行股份有限公司

住所：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦  
办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦  
法定代表人：吴太普  
电话：0571-85108195  
传真：0571-85106576  
联系人：陈振峰  
网址：www.hzbank.com.cn

客户服务电话：400-888-8508

（20）乌鲁木齐市商业银行股份有限公司

住所：乌鲁木齐市新华北路 8 号  
办公地址：乌鲁木齐市新华北路 8 号  
法定代表人：农惠臣  
电话：0991-8824667  
传真：0991-8824667  
联系人：何佳  
网址：www.uccb.com.cn

客户服务电话：0991-96518

（21）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045446

传真：010-66045500

联系人：潘鸿

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

客户服务电话：010-66045678

（22）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：祝幼一

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：韩星宇

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

客户服务电话：021-962588、400-888-8666

（23）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-888-8108

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（24）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 9 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

客户服务电话：95536

（25）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

客户服务电话：400-888-8111、95565

（26）广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

客户服务电话：95575 或致电各营业网点

（27）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

客户服务电话：95558

（28）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568430

传真：010-66568536

联系人：田薇

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务电话：400-888-8888

（29）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 10 楼

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：金芸、李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

客户服务电话：021-962503、400-888-8001 或拨打各城市营业网点咨询电话

（30）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82493561

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

客户服务电话：95513

（31）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：李清怡

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

客户服务电话：021-962505

（32）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

客户服务电话：400-888-8123

（33）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481100

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务电话：95579、400-888-8999

（34）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

客户服务电话：400-800-1001

（35）西南证券股份有限公司

住所：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 22-25 层

法定代表人：王珠林

客户服务电话：023-63786397

传真：023-63786312

联系人：杨卓颖

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

（36）中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-85783715

传真：0571-85783771

联系人：王勤

网址：www.bigsun.com.cn

客户服务电话：0571-96598

（37）湘财证券有限责任公司

住所：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518-8631

传真：021-68865680

联系人：李梦诗

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：400-888-1551

（38）万联证券有限责任公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

办公地址：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36-37 层

法定代表人：李舫金

电话：020-37865070

传真：020-37865008

联系人：罗创斌

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：400-8888-133

（39）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207938

传真：0551-2634400-1171

联系人：祝丽萍

网址：www.gyzq.com.cn



客户服务电话：全国：400-888-8777、安徽地区：96888

（40）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451892

联系人：王兆权

网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

客户服务电话：400-651-5988

（41）华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-893

传真：025-84579879

联系人：程高峰

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

客户服务电话：400-888-8168、025-84579897

（42）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

联系人：张治国

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

客户服务电话：400-666-1618

（43）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

客户服务电话：0532-96577

（44）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：徐勇力

电话：010-66555316

传真：010-66555246

联系人：汤漫川

网址：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

客户服务电话：400-888-8993

（45）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号

办公地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

客户服务电话：0512-33396288

（46）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人：张志刚

电话：010-88656100

传真：010-88656290

联系人：唐静

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

客户服务电话：400-800-8899

（47）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

客户服务电话：95503

（48）方正证券有限责任公司

住所：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：13857135668

传真：0571-87782011

联系人：邢铁英

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

客户服务电话：95571

（49）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

联系人：匡婷

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

客户服务电话：0755-33680000、400-666-6888

（50）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169089

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

客户服务电话：10108998、400-888-8788

（51）广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼六楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：樊刚正

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

客户服务电话：020-961303

（52）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096709

传真：0431-85096795

联系人：潘锴

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

（53）南京证券有限责任公司

住所：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

办公地址：南京市鼓楼区大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

客户服务电话：025-83364032

传真：025-83364032

联系人：石健

网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

（54）上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：蒋元真

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：谢秀峰

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

客户服务电话：021-962518

（55）新时代证券有限责任公司

住所：北京市西城区月坛大厦 15 层

办公地址：北京市西城区月坛大厦 15 层

法定代表人：马金声

客户服务电话：010-68084591

传真：010-68084986

联系人：戴荻

网址：www.xsdzq.cn

（56）大同证券经纪有限责任公司

住所：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：山西省太原市青年路 8 号

法定代表人：董祥

客户服务电话：0351-4167056

传真：0351-4192803

联系人：苏妮

网址：www.dtsbc.com.cn

（57）国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：徐欣

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：400-888-5288

（58）浙商证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

网址：www.stocke.com.cn

客户服务电话：967777

（59）平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-22626172

传真：0755-82400862

联系人：周璐

网址：www.pingan.com

客户服务电话：400-881-6168

（60）华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：李工

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

联系人：甘霖

网址：www.hazq.com

客户服务电话：0551-96518、400-809-6518

（61）国海证券有限责任公司

住所：广西南宁市滨湖路 46 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0771-5539262

传真：0771-5539033

联系人：覃清芳

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：全国：400-888-8100、广西：96100

（62）财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27、28 楼

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403319

传真：0731-4403349

联系人：郭磊

网址：www.cfzq.com

（63）东莞证券有限责任公司

住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼  
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼  
法定代表人：游锦辉  
电话：0769-22119426、0769-22119351  
传真：0769-22119423  
联系人：张建平、罗绍辉  
网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)  
客户服务电话：0769-961130

（64）中原证券股份有限公司

住所：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦  
办公地址：郑州市经三路15号广汇国贸11楼  
法定代表人：石保上  
电话：0371-65585670  
传真：0371-65585665  
联系人：程月艳、耿铭  
网址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)  
客户服务电话：967218、400-813-9666

（65）国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层  
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层  
法定代表人：常喆  
电话：010-84183389  
传真：010-84183311-3389  
联系人：黄静  
网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)  
客户服务电话：400-818-8118

（66）东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼  
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼  
法定代表人：朱科敏  
电话：0519-88157761  
传真：0519-88157761  
联系人：李涛

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客户服务电话：021-52574550、0519-88166222、0379-64902266、400-888-8588

（67）中银国际证券有限责任公司

住所：上海浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层

法定代表人：徐刚

电话：021-50372474

传真：021-50372474

联系人：张静

网址：[www.bocichina.com.cn](http://www.bocichina.com.cn)

客户服务电话：400-620-8888

（68）国盛证券有限责任公司

住所：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

客户服务电话：0791-6285337

传真：0791-6288690

联系人：徐美云

网址：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

（69）华西证券有限责任公司

住所：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市陕西街 239 号

法定代表人：胡关金

电话：028-86126218

传真：028-86155733

联系人：王京红

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

客户服务电话：400-888-8818

（70）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

电话：010-88085201

传真：010-88085195



联系人：李巍

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

客户服务电话：400-800-0562

（71）齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283906

传真：0531-81283900

联系人：吴阳

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

客户服务电话：95538

（72）世纪证券有限责任公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

客户服务电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

（73）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

电话：0755-25832494

传真：0755-25831718

联系人：王立洲

网址：[www.fcsc.cn](http://www.fcsc.cn)

客户服务电话：0755-25832523

（74）金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

电话：0755-83025666

传真：0755-83025625

联系人：金春

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

客户服务电话：400-888-8228

（75）中航证券有限公司

住所：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

客户服务电话：400-886-6567

（76）华林证券有限责任公司

住所：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5 楼

法定代表人：段文清

电话：0755-82707853

传真：0755-82707850

联系人：骆扬

网址：[www.chinalions.com](http://www.chinalions.com)

客户服务电话：各地营业部客户服务电话

（77）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

客户服务电话：400-888-8128

（78）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼

办公地址：陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼

法定代表人：刘建武

电话：029-87406488

传真：029-87406387

联系人：冯萍

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

客户服务电话：029-95582

（79）广发华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

客户服务电话：0591-96326

（80）华龙证券有限责任公司

住所：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

电话：0931-4890100

联系人：李昕田

网址：[www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

（81）中国国际金融有限公司

住所：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

电话：010-65051166

传真：010-65058065

联系人：罗春蓉

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

客户服务电话：010-65051166

（82）财通证券有限责任公司

住所：杭州市解放路 111 号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87925129

传真：0571-87828042

联系人：乔骏

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

客户服务电话：0571-96336

（83）华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5045 号深业大厦 25 层 2512、2513

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01

法定代表人：王文学

电话：021-64339000-826、021-64374864

传真：021-64374864

联系人：杨小江

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

（84）瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

电话：010-58328752、010-58328725

传真：010-58328748

联系人：谢亚凡

网址：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

客户服务电话：400-887-8827

（85）中国建银投资证券有限责任公司

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 层至 20 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.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

客户服务电话：400-600-8008

（86）中山证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

联系人：李珍

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

客户服务电话：400-102-2011

（87）西藏同信证券有限责任公司

住所：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：王伟光

网址：[www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

客户服务电话：400-881-1177

（88）日信证券有限责任公司

住所：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

电话：010-88086830

传真：010-66412537

联系人：陈韦杉

网址：[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

客户服务电话：010-88086830

（89）江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

联系人：徐世旺

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

客服电话：400-666-2288

（90）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-9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：010-59355941

传真：010-66553791

联系人：李微

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

客户服务电话：400-889-5618

（91）华宝证券有限责任公司

住所：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

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

电话：021-50122107

传真：021-50122078

联系人：楼斯佳

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

客户服务电话：400-820-9898

（92）厦门证券有限公司

住所：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人：傅毅辉

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

联系人：卢金文

网址：[www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

客户服务电话：0592-5163588

（93）爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号23楼

办公地址：上海市南京西路758号20-25楼

法定代表人：张建华

电话：021-32229888

传真：021-62878783

联系人：陈敏

网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

客户服务电话：021-63340678

（94）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：北京市西城区月坛北街 26 号

法定代表人：丁之锁

电话：010-58568007

传真：010-58568062

联系人：梁宇

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

客户服务电话：010-58568118

（95）天风证券有限责任公司

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：翟璟

网址：[www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

客户服务电话：028-86711410、027-87618882

### 3、场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（[www.szse.cn](http://www.szse.cn)）。

基金管理人可依据有关法律法规规定，根据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）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

联系电话：010-59378839

传真：010-59378907

（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：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：王立华

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：杨科

经办律师：吴冠雄、杨科

（四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：汪棣、单峰

#### 四、基金的名称

本基金名称：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）。

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型上市开放式基金。

#### 六、基金的投资目标

本基金的投资目标：追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围：限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品（如股指期货）推出后，本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。



其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 20%~95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0~80%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

## 八、基金的投资策略

### （一）资产配置策略

本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

### （二）股票投资策略

本基金总体上采取“核心—卫星策略”，即将基金股票资产分成两部分，其中核心部分在投资组合中占较大比重（不低于股票资产的 80%），投资较为稳定，对整个投资组合的长期风险收益特征起到决定性作用；卫星部分在投资组合中占权重较小，投资更加主动、积极和灵活，以追求超额收益为目标。

本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股，以分享中国经济成长；卫星组合则采取多种策略，积极投资于新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。由于核心组合与卫星组合之间相关性较低，还能够有效地分散基金整体组合的风险，从而实现在有效控制风险的前提下追求基金资产的稳健、持续增值。

#### 1、核心组合投资策略

本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股。大盘蓝筹股是指市值规模较大（总市值不低于 15 亿元）、且具有以下特征的股票：

（1）公司在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等；

（2）公司经营管理团队稳定、治理结构良好；

（3）公司财务指标健康、收入增长和盈利水平较高；

（4）市场估值相对于公司资产价值和增长潜力而言处于合理区间。

中国经济正处于持续、快速成长的阶段，由于大盘蓝筹股在行业中处于领先地位，具备较高的市场占有率和市场影响力，因而能够获得更多的资源和支持，充分分享经济成长的果实，并将其转化为企业自身的业绩增长动力。而且，在我国证券市场上，随着机构投资者所占比重越来越高，对市场的影响力也越来越大，由于大盘蓝筹股在流动性和风险方面具有比较优势，将成为机构投资者的核心组合，从而获得资金面支持。因此，我们认为，投资于大盘蓝筹股将在较低风险下实现基金资产的稳健

增值。

## 2、卫星组合投资策略

本基金卫星组合将采取多种积极策略，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。目前，基金主要关注新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等机会，通过积极操作，为整个组合扩大增值空间。

（1）新股申购：基金将利用规模优势和定价优势，积极参与新股申购、定向增发等，把握一级市场与二级市场的差价机会，获取低风险收益。

（2）中小盘股：与大盘股相比，中小企业的成长性更高、收益潜力更大，但个股风险也较高。基金将通过深入研究、精选个股，把握中小板块的成长机会，以实现超越市场平均水平的较高收益。

（3）资产重组板块：随着股权分置改革的完成，越来越多的大股东愿意通过整体上市、收购兼并、资产重组等形式，把优质资产注入上市公司，以提升公司业绩，并实现市值的更大增长。重组概念将成为未来一段时间内驱动公司业绩增长的重要因素，基金将积极把握其中机会，获取超额收益。

（4）衍生品板块：随着股指期货等衍生工具的推出和发展，基金将有可能采用组合策略对冲风险，或通过杠杆作用放大收益。基金将以定量分析模型为基础，在严格控制风险的前提下把握衍生品市场机会，追求实现较高收益。

未来，基金管理人还将根据证券市场发展，积极寻求其他投资机会，对卫星组合投资策略进行丰富和调整。

## （三）债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

### 1、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

### 2、收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### 3、债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取超额收益。

## 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沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基

金整体业绩比较基准构成为：

$$\text{基准收益率} = \text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{上证国债指数收益率} \times 40\%$$

未来，如基金变更投资比例范围，或市场中出现代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，基金管理人可在履行适当程序后，变更本基金的基准指数或权重构成。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

## 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 4 月 19 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 2011 年 3 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	9,533,436,232.30	84.01
	其中：股票	9,533,436,232.30	84.01
2	固定收益投资	743,632,829.66	6.55
	其中：债券	743,632,829.66	6.55
	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	1,022,197,315.37	9.01
6	其他各项资产	49,098,410.29	0.43
7	合计	11,348,364,787.62	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	174,706,966.26	1.56
C	制造业	5,096,799,560.45	45.58
C0	食品、饮料	727,282,963.24	6.50
C1	纺织、服装、皮毛	40,048,461.36	0.36
C2	木材、家具	5,909,846.34	0.05

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	695,292,860.63	6.22
C5	电子	548,903,918.19	4.91
C6	金属、非金属	552,544,345.72	4.94
C7	机械、设备、仪表	2,141,614,262.06	19.15
C8	医药、生物制品	361,615,877.69	3.23
C99	其他制造业	23,587,025.22	0.21
D	电力、煤气及水的生产和供应业	98,633,295.55	0.88
E	建筑业	81,969,902.10	0.73
F	交通运输、仓储业	17,616,000.00	0.16
G	信息技术业	883,110,129.85	7.90
H	批发和零售贸易	570,783,383.31	5.10
I	金融、保险业	1,287,604,541.36	11.52
J	房地产业	391,388,319.63	3.50
K	社会服务业	449,917,807.61	4.02
L	传播与文化产业	78,643,889.10	0.70
M	综合类	402,262,437.08	3.60
	合计	9,533,436,232.30	85.27

（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	600016	民生银行	81,691,175	456,653,668.25	4.08
2	000063	中兴通讯	11,543,662	346,309,860.00	3.10
3	601117	中国化学	41,757,030	317,353,428.00	2.84
4	600036	招商银行	22,196,916	312,754,546.44	2.80
5	000559	万向钱潮	21,927,372	301,501,365.00	2.70
6	000895	双汇发展	4,192,562	294,108,224.30	2.63
7	601166	兴业银行	8,316,769	238,774,437.99	2.14
8	000423	东阿阿胶	5,468,546	235,639,647.14	2.11
9	600585	海螺水泥	5,749,869	232,984,691.88	2.08
10	002008	大族激光	9,413,400	202,482,234.00	1.81

（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	149,920,936.60	1.34
2	央行票据	78,024,000.00	0.70
3	金融债券	397,130,000.00	3.55
	其中：政策性金融债	397,130,000.00	3.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	118,557,893.06	1.06
7	其他	-	-
8	合计	743,632,829.66	6.65

（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	100233	10国开33	2,000,000	197,420,000.00	1.77
2	070201	07国开01	1,000,000	100,200,000.00	0.90

3	019021	10国债21	1,000,000	99,920,000.00	0.89
4	100226	10国开26	1,000,000	99,510,000.00	0.89
5	113002	工行转债	809,210	96,910,989.60	0.87

（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、2010年9月6日大族激光受到深交所通报批评。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。

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	11,728,349.69
2	应收证券清算款	28,746,784.54
3	应收股利	5,121.34
4	应收利息	6,555,319.92
5	应收申购款	2,062,834.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,098,410.29

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	96,910,989.60	0.87
2	125709	唐钢转债	5,632,165.92	0.05
3	110009	双良转债	1,312,382.40	0.01
4	110007	博汇转债	828,980.00	0.01
5	128233	塔牌转债	587,033.90	0.01

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	294,108,224.30	2.63	因核实媒体报道的重大事项停牌

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
2007年4月24日至 2007年12月31日	51.37%	1.42%	31.66%	1.36%	19.71%	0.06%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-42.85%	1.95%	-44.13%	1.83%	1.28%	0.12%
2009年1月1日至 2009年12月31日	61.16%	1.84%	52.55%	1.23%	8.61%	0.61%
2010年1月1日至 2010年12月31日	-1.07%	1.20%	-5.83%	0.95%	4.76%	0.25%
2011年1月1日至 2011年3月31日	-2.89%	1.27%	2.37%	0.82%	-5.26%	0.45%

### 十三、费用概览

#### （一）基金运作费用

##### 1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金上市初费及年费；
- （4）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）基金收益分配中发生的费用；
- （9）按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书更新或相关公告中载明。

##### 2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

###### （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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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15个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

(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：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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15个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

(3) 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、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

(4) 本条第（一）款第1项中第（3）至第（9）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

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费用支出或基金资产的损失，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。

(二) 基金销售费用

1、申购费与赎回费

(1) 本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者在申购本基金时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100 万元以下	1.5%
100 万元以上（含 100 万元）-500 万元以下	1.2%
500 万元以上（含 500 万元）-1000 万元以下	0.8%
1000万元以上（含1000万元）	每笔1000元

(2) 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，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

(3) 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。

(4) 经中国证监会允许，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，针对特定期间或符合特定条件的投资者，采取调低基金申购费、赎回费等措施，基金管理人须于该等措施实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

（1）申购份额的计算

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

对于办理场内申购的投资者，申购份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。对于办理场外申购的投资者，申购份额的计算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或收益归入基金资产。

例一：假定T日的基金份额净值为1.200元，若三笔场内申购金额分别为1,000元、100万元、500万元，则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）	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额（C=A/(1+B)）	985.22	988,142.29	4,960,317.46
前端申购费（D=A-C）	14.78	11,857.71	39,682.54
场内申购份额（E=C/1.200）	821	823,451	4,133,597

若场内申购金额为1000万元，则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4
申购金额（元，A）	10,000,000.00
前端申购费（B）	1,000.00
净申购金额（C=A-B）	9,999,000.00
场内申购份额(D=C/1.200)	8,332,500

例二：假定T日的基金份额净值为1.200元，若三笔场外申购金额分别为1,000元、100万元、500万元，则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）	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额（C=A/(1+B)）	985.22	988,142.29	4,960,317.46
前端申购费（D=A-C）	14.78	11,857.71	39,682.54
场外申购份额（E=C/1.200）	821.02	823,451.91	4,133,597.88

若场外申购金额为1000万元，则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4
申购金额（元，A）	10,000,000.00
前端申购费（B）	1,000.00
净申购金额（C=A-B）	9,999,000.00



场外申购份额 (D=C/1.200)	8,332,500.00
--------------------	--------------

## （2）赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

例三：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，则其获得的净赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000.00 \times 1.250 = 12,500.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0.5\% = 62.50 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 62.50 = 12,437.50 \text{元}$$

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。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。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）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12月8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”相关内容。
- （二）更新了“四、基金托管人”的相关内容。
- （三）更新了“五、相关服务机构”相关信息。
- （四）更新了“十、基金份额的申购与赎回”相关内容。
- （五）更新了“十二、基金的投资”中投资组合报告，该部分内容均按有关规定编制。
- （六）更新了“十三、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“二十四、对基金份额持有人的服务”中有关服务提供信息。
- （八）更新了“二十五、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书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

二〇一一年六月八日