华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF) 2008年年度报告摘要

2008年12月31日

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 报告送出日期:二〇〇九年三月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2009年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2008年1月1日起至2008年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华夏蓝筹
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007年4月24日
报告期末基金份额总额	16,978,115,188.43份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年5月28日

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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。
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。基准收益率=沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	廖为	张咏东
	联系电话	400-818-6666	021-68888917
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-6666	95559
传真		010-88066511	021-58408842

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年	2007年4月24日至2007年12月31日
本期已实现收益	-1,918,398,386.23	6,056,679,775.34
本期利润	-11,247,150,744.84	11,889,582,275.40
加权平均基金份额本期利润	-0.6210	0.4783
本期基金份额净值增长率	-42.85%	51.37%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年4月24日至2007年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.3819	0.5972
期末基金资产净值	13,762,655,557.98	29,402,271,040.50
期末基金份额净值	0.811	1.419

注:①所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。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

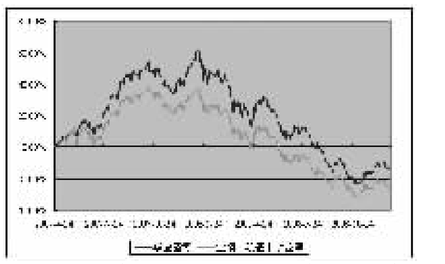
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.70%	1.63%	-9.73%	1.82%	4.03%	-0.19%
过去六个月	-19.70%	1.66%	-19.48%	1.79%	-0.22%	-0.13%
过去一年	-42.85%	1.95%	-44.13%	1.83%	1.28%	0.12%
自基金转型以来至今	-13.49%	1.77%	-26.44%	1.66%	12.95%	0.11%

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年4月24日至2008年12月31日)

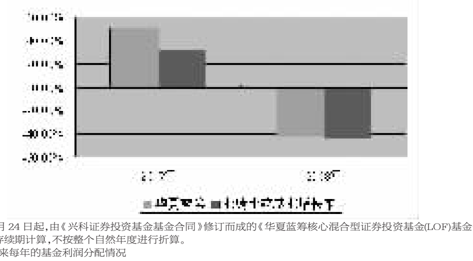


注:自2007年4月24日起,由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,根据华夏蓝筹基金的基金合同规定,本基金自集中申购期结束后1个月内使投资组合比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与比例限制的有关约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金转型以来华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

净值增长率与业绩比较基准收益率对比图



注: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,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金转型以来每年的基金利润分配情况

本基金自基金转型以来无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都设有分公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人以及特定客户资产管理人,是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至2008年12月31日,公司管理资产规模超过2000亿元,基金份额持有人户数超过1200万,是境内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理着基金兴华、基金兴和2只封闭式基金,华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板ETF、华夏回报二号、华夏稳增、华夏优势增长、华夏蓝筹、华夏复兴、华夏全球、华夏行业、华夏希望、华夏策略17只开放式基金,以及亚洲债券基金二期中国子基金、多只全国社保基金投资组合,公司已经被90多家大中型企业确定为年金投资管理人,并被多家客户确定为特定客户资产管理人。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文动	本基金的基金经理、投资总监	2007-6-12	—	11年	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,曾任基金兴安基金经理(2006年5月24日至2007年11月21日期间)、基金兴华基金经理(2007年2月14日至2008年2月27日期间)。
巩怀志	本基金的基金经理、股票投资部副总经理	2007-5-9	—	7年	清华大学MBA。曾任鹏华基金管理有限公司基金经理助理、社保股票组合基金经理。2005年加入华夏基金管理有限公司。
谭琦	本基金的基金经理	2007-9-27	—	5年	CFA,工学硕士。2003年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。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定严格执行。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 本基金业绩表现

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.811元,本报告期份额净值增长率为-42.85%,同期业绩比较基准增长率为-44.13%。

4.4.2 行情回顾及运作分析

2008年,中国经济基本面发生了巨大变化。美国次贷危机通过金融中介传导和实体经济全球化,演化成了一场全球性的金融危机。本次危机的实质是:以美国经济为驱动力的世界经济,通过金融去杠杆化、收缩消费、收缩生产、暂停投资,为过去多年过度借贷、过度消费、过度生产、过度投资产生的过度繁荣买单。在这种大背景下,作为全球最大制造基地的中国,直接面临外需骤降的困境,加之与国内的房地产调整周期叠加,经济增速从年中开始明显下滑。

前3季度,在投资者对复杂经济形势的忧虑中,A股市场持续下跌,其中,年初的下跌主要反映了对高通胀将难以控制的预期。之后,随着经济急转直下,市场持续下跌反映了对经济减速和通缩的担忧。4季度,在政府大力度财政刺激政策出台后,市场开始震荡筑底。

基于对2008年美国经济和中国经济的谨慎判断,我们在1季度降低了股票仓位,并在2季度初继续大力减仓。行业上低配金融、地产、钢铁等强周期行业,超配零售等稳定型行业,一定程度上防范了系统性风险。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为,美国经济在2009年仍将是一个坏消息不断报出、逐步筑底的过程,欧盟也类似。中国经济2009年将继续面对黯淡的出口,但出口增速有可能在下半年企稳。内需方面,庞大的政府投资及其拉动的相关民间投资有可能弥补其他部门的投资下滑。此外,我们认为2009年会呈现宽货币宽信贷的局面,这不仅会通过实体经济的循环最终刺激需求,也会给A股市场带来充裕的资金。

综合经济基本面和资金面的判断,2009年,我们将更加积极地寻找和筛选投资机会,认真研究财政刺激政策带来的特定地区、特定行业的积极变化,谨慎把握周期性行业库存回补带来的阶段性景气回升机会,前瞻性研究新技术、新服务带来的投资机会,争取在合理价位买入能够持续超越行业成长的优秀企业。整体而言,本基金将在不确定的经济中寻找确定,在僵局的经济模式中寻找变局。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,华夏蓝筹基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人在内部监察工作中从合规运作、保障基金持有人利益出发,由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,发现问题及时督促有关部门整改,并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内,本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面:

(1)对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训。

(2)进一步完善了公司相关管理制度。

(3)加强了对投资人员的监察监督,制定并落实了关于防范投资人员道德风险的有关措施。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,保障了基金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心,提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险总监、法律监察总监及基金会计负责人等。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期可不进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2008年度,基金托管人在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2008年度,华夏基金管理有限公司在华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2008年度,由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2009)第20193号

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"华夏蓝筹核心基金")的财务报表,包括2008年12月31日的资产负债表、2008年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华夏蓝筹核心基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;

(2)选择和运用恰当的会计政策;

(3)作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了华夏蓝筹核心基金2008年12月31日的财务状况以及2008年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天 注册会计师:许康玮
会计师事务所有限公司 注册会计师:单 峰
中国 上海市

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产:			
银行存款		–	–
结算备付金		2,126,938,092.10	3,364,763,394.39
存出保证金		1,351,282.05	10,675,142.16
交易性金融资产		11,686,820,286.83	26,251,640,462.15
其中:股票投资		7,772,046,561.98	24,502,125,180.32
基金投资		–	–
债券投资		3,914,773,724.85	1,749,515,281.83
资产支持证券投资		–	–
衍生金融资产		1,004,455.03	9,238,105.11
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		12,983,576.35	68,681,605.88
应收利息		57,185,057.55	25,020,355.92
应收股利		–	–
应收申购款		–	20,095,955.49
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		13,886,282,749.91	29,750,115,021.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		48,788,940.55	11,899,747.76
应付赎回款		3,841,727.39	248,575,197.47
应付管理人报酬		17,837,383.08	36,282,814.10
应付托管费		2,972,897.19	6,047,135.69
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		48,249,562.83	42,174,989.16
应交税费		166,385.89	165,946.29
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		1,770,295.00	2,698,150.13
负债合计		123,627,191.93	347,843,980.60
所有者权益:			
实收基金		7,278,389,877.12	8,882,900,452.48
未分配利润		6,484,265,680.86	20,519,370,588.02
所有者权益合计		13,762,655,557.98	29,402,271,040.50
负债和所有者权益总计		13,886,282,749.91	29,750,115,021.10

注:①报告截止日2008年12月31日,基金份额净值0.811元,基金份额总额16,978,115,188.43份。

②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,华夏蓝筹基金上年度可比期间自2007年4月24日至2007年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年4月24日至2007年12月31日
一、收入		-10,824,751,232.61	12,517,646,846.88
1.利息收入		131,072,019.46	106,996,170.90
其中:存款利息收入		58,715,305.31	77,959,585.42
债券利息收入		71,935,685.11	25,085,583.53
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		421,029.04	3,951,001.95
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,636,377,714.64	6,551,221,561.83
其中:股票投资收益		-1,794,666,934.87	6,458,042,383.93
基金投资收益		–	–
债券投资收益		52,054,660.54	7,906,660.18
资产支持证券投资收益		–	–
衍生工具收益		7,764,954.27	944,839.93
股利收益		98,469,605.42	84,327,677.79
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-9,328,752,358.61	5,832,902,500.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		9,306,821.18	26,526,614.09
二、费用(以"-"号填列)		-422,399,512.23	-628,064,571.48
1. 管理人报酬		-290,515,505.87	-312,898,831.18
2. 托管费		-48,419,251.04	-52,149,805.28
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		-77,738,872.64	-248,148,616.77
5. 利息支出		-5,233,659.17	-14,509,302.69
其中:卖出回购金融资产支出		-5,233,659.17	-14,509,302.69
6. 其他费用		-492,223.51	-358,015.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-11,247,150,744.84	11,889,582,275.40
所得税费用(以"-"号填列)		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-11,247,150,744.84	11,889,582,275.40

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,882,900,452.48	20,519,370,588.02	29,402,271,040.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-11,247,150,744.84	-11,247,150,744.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,604,510,575.36	-2,787,954,162.32	-4,392,464,737.68
其中:1.基金申购款	1,031,578,471.12	2,018,163,597.42	3,049,742,068.54
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,636,089,046.48	-4,806,117,759.74	-7,442,206,806.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	7,278,389,877.12	6,484,265,680.86	13,762,655,557.98

项目	上年度可比期间 2007年4月24日至2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	897,999,526.25	1,397,999,526.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	11,889,582,275.40	11,889,582,275.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	8,382,900,452.48	8,036,788,786.37	16,419,689,238.85
其中:1.基金申购款	15,489,414,235.96	22,126,231,036.39	37,615,645,272.35
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-7,106,513,783.48	-14,089,442,250.02	-21,195,956,033.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-305,000,000.00	-305,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	8,882,900,452.48	20,519,370,588.02	29,402,271,040.50

注:根据2007年4月19日《兴科证券投资基金2006年年度收益分配公告》,兴科证券投资基金向全体持有人按每10份基金份额派发6.10元的现金红利,除息日为2007年4月24日。

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计估计发生变更。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金自2008年9月16日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法,从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调30,835,896.86元,相应调减本基金的净利润30,835,896.86元和基金资产净值30,835,896.86元,对2008年度净利润及2008年末资产净值的影响为减少人民币5,510,460.25元。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投证券有限责任公司("中信建投证券")	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

注:华夏基金管理有限公司股东及持股比例如下:

持股单位	权益比例
中信证券股份有限公司	100%
合计	100%

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券	2,428,023,799.36	9.10%	9,745,783,070.34	15.15%

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券	10,490,750.90	0.48%	209,484,321.00	21.27%

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3.1.3 回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信建投证券	140,000,000.00	4.86%	300,000,000.00	7.51%

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	1,926,065.21	7.92%	–	–

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券	2,063,813.33	9.23%	10,379,182.26	21.52%

关联方名称	上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券	7,987,968.44	15.39%	8,604,967.12	20.41%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日
当期应支付的管理费	290,515,505.87	312,898,831.18
其中:当期已支付	272,678,122.79	276,616,017.08
期末未支付	17,837,383.08	36,282,814.10

注:①支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日
当期应支付的托管费	48,419,251.04	52,149,805.28
其中:当期已支付	45,446,353.85	46,102,669.59
期末未支付	2,972,897.19	6,047,135.69

注:①支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	–	101,885,295.08	–	–	–	–

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
–	–	–	–	–	–	–

注:上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日
期初持有的基金份额	50,000,000.00	49,971,721.00
期间认购总份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分增加的份额	–	66,555,427.00
期间赎回/卖出总份额	–	-66,527,148.00
期末持有的基金份额	50,000,000.00	50,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.29%	0.24%

注:本基金管理人在上年度可比期间经代销机构赎回本基金,适用费率为0.5%。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年4月24日(基金合同生效日)至2007年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	–	243,318.78	–	509,130.78

注:①本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

②本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2008年12月31日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.4 期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.4.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
002024	苏宁电器	2008-05-22	2009-05-22	非公开发行流通受限	45.00	17.91	2,600,000	117,000,000.00	46,566,000.00
002024	苏宁电器	–	2009-05-22	非公开发行转增	–	17.91	2,600,000	–	46,566,000.00
600489	中金黄金	2008-03-03	2009-03-02	非公开发行流通受限	78.00	37.24	1,585,415	123,662,370.00	59,040,854.60
002007	华兰生物	2008-08-01	2009-08-04	非公开发行流通受限	35.00	36.47	853,113	29,858,955.00	31,113,031.11
600583	海油工程	2008-12-31	2009-12-31	非公开发行流通受限	11.55	11.57	914,273	10,559,853.15	10,578,138.61
600251	冠农股份	2008-06-06	2009-06-04	非公开发行流通受限	58.00	29.48	115,032	6,671,856.00	3,391,143.36

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	2008-05-08	拟实施主营业务整体上市	7.35	–	–	759,100	10,646,943.42	5,579,385.00

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止,本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,772,046,561.98	55.97
	其中:股票	7,772,046,561.98	55.97
2	固定收益投资	3,914,773,724.85	28.19
	其中:债券	3,914,773,724.85	28.19
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	1,004,455.03	0.01
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	2,126,938,092.10	15.32
6	其他资产	71,519,915.95	0.52
7	合计	13,886,282,749.91	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	170,361,731.82	1.24
B	采掘业	631,530,971.13	4.59
C	制造业	2,549,891,080.40	18.53
C0	食品、饮料	571,166,795.13	4.15
C1	纺织、服装、皮毛	24,322,217.68	0.18
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	28,233,855.82	0.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	189,570,628.28	1.38
C5	电子	31,987,390.64	0.23
C6	金属、非金属	234,187,716.03	1.70
C7	机械、设备、仪表	974,380,501.31	7.08
C8	医药、生物制品	495,816,556.77	3.60
C99	其他制造业	225,418.74	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	71,519,236.62	0.52
E	建筑业	293,633,021.78	2.13
F	交通运输、仓储业	293,754,314.22	2.13
G	信息技术业	476,788,332.67	3.46
H	批发和零售贸易	1,327,061,478.00	9.64
I	金融、保险业	1,125,645,007.94	8.18
J	房地产业	346,177,952.79	2.52
K	社会服务业	77,687,582.77	0.56
L	传播与文化产业	31,417,488.42	0.23
M	综合类	376,578,363.42	2.74
	合计	7,772,046,561.98	56.47

8.3 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	002024	苏宁电器	43,829,072	784,978,679.52	5.70
2	600036	招商银行	35,891,546	436,441,199.36	3.17
3	600895	张江高科	35,030,676	349,956,453.24	2.54
4	000568	泸州老窖	19,199,373	349,428,588.60	2.54
5	601318	中国平安	11,056,883	294,002,518.97	2.14
6	600517	置信电气	12,155,851	272,169,503.89	1.98
7	002028	思源电气	7,500,903	210,025,284.00	1.53
8	000759	武汉中百	19,243,012	180,884,312.80	1.31
9	000937	金牛能源	12,741,144	178,376,016.00	1.30
10	601006	大秦铁路	22,199,904	178,043,230.08	1.29

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

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初基金资产净值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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	504,031,720.80	1.71
2	600005	武钢股份	440,302,974.33	1.50
3	600748	上实发展	352,034,653.64	1.20
4	000063	中兴通讯	348,060,381.57	1.18
5	000002	万科A	326,888,326.44	1.11
6	000568	泸州老窖	293,648,696.56	1.00
7	600016	民生银行	262,451,539.92	0.89
8	600000	浦发银行	245,680,261.28	0.84
9	600048	保利地产	230,772,731.52	0.78
10	601628	中国人寿	206,635,738.44	0.70
11	000937	金牛能源	205,955,555.71	0.70
12	600036	招商银行	187,610,128.43	0.64
13	600737	中粮屯河	174,821,857.47	0.59
14	601088	中国神华	171,203,652.05	0.58
15	601186	中国铁建	166,552,633.26	0.57
16	601006	大秦铁路	158,455,668.65	0.54
17	002024	苏宁电器	157,548,539.88	0.54
18	601766	中国南车	153,777,999.19	0.52
19	600078	澄星股份	152,236,001.96	0.52
20	600489	中金黄金	152,040,768.78	0.52

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	724,506,662.32	2.46
2	600036	招商银行	680,205,173.60	2.31
3	000002	万科A	610,278,445.54	2.08
4	600005	武钢股份	548,188,285.87	1.86
5	600900	长江电力	520,861,845.26	1.77
6	600489	中金黄金	504,336,012.27	1.72
7	000983	西山煤电	499,314,874.86	1.70
8	000063	中兴通讯	450,489,539.89	1.53
9	000651	格力电器	428,698,936.59	1.46
10	601088	中国神华	372,298,687.82	1.27
11	000568	泸州老窖	340,942,207.16	1.16
12	002024	苏宁电器	281,764,374.08	0.96
13	600087	长航油运	246,434,351.13	0.84
14	600016	民生银行	244,364,858.45	0.83
15	600104	上海汽车	238,146,436.95	0.81
16	600096	云天化	228,656,380.76	0.78
17	000024	招商地产	221,026,362.27	0.75
18	000898	鞍钢股份	214,511,955.02	0.73
19	600089	特变电工	214,481,559.83	0.73
20	600519	贵州茅台	213,695,932.21	0.73

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	10,918,765,910.61
卖出股票收入(成交)总额	16,369,633,226.27

8.5 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	265,218,051.40	1.93
2	央行票据	1,624,648,000.00	11.80
3	金融债券	1,957,085,000.00	14.22
	其中:政策性金融债	1,957,085,000.00	14.22
4	企业债券	51,195,000.00	0.37
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	16,627,673.45	0.12
7	其他	–	–
8	合计	3,914,773,724.85	28.44

8.6 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

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	080309	08进出09	6,000,000	637,980,000.00	4.64
2	0801098	08央行票据98	6,000,000	587,640,000.00	4.27
3	0801041	08央行票据41	5,000,000	534,000,000.00	3.88
4	080218	08国开18	4,000,000	418,840,000.00	3.04
5	080419	08农发19	3,000,000	310,560,000.00	2.26

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	580022	国电CWB1	246,528	565,288.70	0.00
2	031006	中兴ZXC1	48,425	439,166.33	0.00
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,351,282.05
2	应收证券清算款	12,983,576.35
3	应收股利	–
4	应收利息	57,185,057.55
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	71,519,915.95

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110598	大荒转债	6,302,068.50	0.05
2	125709	唐钢转债	5,804,997.23	0.04
3	125528	柳工转债	1,762,182.60	0.01
4	125572	海马转债	939,476.50	0.01
5	110368	五洲转债	919,528.20	0.01
6	110227	赤化转债	406,938.60	0.00
7	125960	锡业转债	293,644.72	0.00
8	110078	澄星转债	198,837.10	0.00

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002024	苏宁电器	93,132,000.00	0.68	非公开发行股票流通受限

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,027,725	16,520.10	617,122,940.02	3.63%	16,360,992,248.41	96.37%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司	76,125,334	10.35%
2	华夏基金管理有限公司	50,000,000	6.79%
3	泰康人寿保险股份有限公司	49,061,724	6.67%
4	中国再保险(集团)公司	12,814,334	1.74%
5	广发证券-招行-广发增强型基金优选集合资产管理计划	6,691,110	0.91%
6	陕西信托解放路证券营业部	4,086,766	0.56%
7	上海美华液化气有限公司	3,617,046	0.49%
8	中国人寿再保险股份有限公司	3,141,755	0.43%
9	丘穗生	2,711,500	0.37%
10	谢秉政	1,829,000	0.25%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	98,624.31	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年4月24日)基金份额总额	500,000,000.00
报告期期初基金份额总额	20,720,650,693.78
报告期期间基金总申购份额	2,406,371,880.85
报告期期间基金总赎回份额	6,148,907,386.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	16,978,115,188.43

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

根据本基金管理人于2008年3月22日、2008年9月13日发布的有关公告,本基金管理人第三届董事会由王东明先生、范勇宏先生、王连洲先生、龙涛先生、涂建先生组成。经本届董事会2008年第一次会议审议通过,选举王东明先生为本基金管理人董事长,凌新源先生不再担任本基金管理人董事长。王东明先生任本基金管理人董事长已获得中国证监会核准。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为110,000.00元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供2年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	4,320,199,834.88	16.19%	3,672,153.76	16.43%	–
东方证券	1	3,823,370,199.47	14.33%	3,249,858.99	14.54%	–
长城证券	1	3,083,418,326.43	11.55%	2,505,299.12	11.21%	–
长江证券	1	2,456,971,656.15	9.21%	2,088,414.43	9.34%	–
中信建投证券	1	2,428,023,799.36	9.10%	2,063,813.33	9.23%	–
联合证券	1	2,098,274,098.96	7.86%	1,783,502.40	7.98%	–
光大证券	1	1,828,386,685.58	6.85%	1,485,578.60	6.65%	–
中国银河证券	1	1,662,824,742.08	6.23%	1,351,055.87	6.04%	–
申银万国证券	1	1,456,113,022.94	5.46%	1,183,101.00	5.29%	–
中金公司	1	1,058,785,246.76	3.97%	899,958.07	4.03%	–
国元证券	1	842,766,254.81	3.16%	716,341.68	3.20%	–
国信证券	1	658,886,077.34	2.47%	535,349.66	2.39%	–
国泰君安证券	1	642,704,467.73	2.41%	546,295.22	2.44%	–
西部证券	2	324,185,055.07	1.21%	275,558.01	1.23%	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购		备注
		债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例	
东方证券	1	1,184,016,986.80	53.91%	2,100,000,000.00	72.89%	–
长江证券	1	900,203,376.60	40.99%	–	–	–
招商证券	1	34,515,562.20	1.57%	235,000,000.00	8.16%	–
申银万国证券	1	21,844,311.87	0.99%	–	–	–
国泰君安证券	1	14,913,460.70	0.68%	–	–	–
中信建投证券	1	10,490,750.90	0.48%	140,000,000.00	4.86%	–
联合证券	1	9,406,744.00	0.43%	406,000,000.00	14.09%	–
国元证券	1	8,256,810.60	0.38%	–	–	–
光大证券	1	7,284,039.67	0.33%	–	–	–
长城证券	1	5,302,414.25	0.24%	–	–	–
中国银河证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	2	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

ⅰ经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度,在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告。

ⅴ建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序:

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中,长江证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元,本期没有剔除的券商交易单元。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金新增民生银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月4日
2	关于中国农业银行开通华夏基金管理有限公司旗下开放式基金定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月9日
3	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月10日
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增安信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月22日
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月25日
6	华夏基金管理有限公司关于华夏蓝筹核心股票型证券投资基金(LOF)新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年1月29日
7	华夏基金管理有限公司关于基金网上交易新增支付渠道暨费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年2月22日
8	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年3月4日
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年3月5日
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年3月22日
11	华夏基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司直销资金专户开户银行名称变更的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年4月3日
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年4月17日
13	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中信银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年5月7日
14	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年5月16日
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年5月24日
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年6月11日
17	关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金在部分销售机构开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年6月12日
18	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司基金定期定额及网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年6月16日
19	关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金在部分销售机构开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年6月17日
20	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国光大银行为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年6月30日
21	关于华夏基金管理有限公司旗下开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年7月15日
22	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国光大银行基金定期定额及网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年7月23日
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年8月5日
24	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年8月9日
25	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月13日
26	华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的提示性公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月16日
27	华夏基金管理有限公司关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》相关影响的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月17日
28	华夏基金管理有限公司关于暂停旗下部分开放式基金申购业务及限制旗下部分开放式基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月23日
29	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增方正证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月23日
30	华夏基金管理有限公司关于调整中国农业银行金穗借记卡基金网上交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年9月27日
31	关于华夏平稳增长混合型证券投资基金、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)暂停申购业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年10月11日
32	关于华夏平稳增长混合型证券投资基金、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)暂停申购业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年10月25日
33	关于华夏平稳增长混合型证券投资基金、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)暂停申购业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年11月8日
34	关于华夏平稳增长混合型证券投资基金、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)暂停申购业务的提示性公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年11月21日
35	华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增兴业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及基金管理人网站	2008年12月18日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2008年,在市场持续调整的情况下,华夏基金以深入的投资研究为基础,加强了市场分析与风险管理,尽力为投资人分散投资风险,旗下基金整体表现在同业中位居前列。

1、截至2008年12月31日,根据中国银河证券基金研究中心2008年的净值增长率排名,公司管理的基金中,华夏债券基金取得了11.47%的正收益,在参与排名的25只债券型基金中位列第3名;华夏希望债券基金于2008年3月成立,当年净值增长率为11.23%;华夏大盘精选基金、华夏复兴基金、华夏成长基金及华夏优势增长基金在参与排名的124只股票型基金中排名位列前20名;华夏红利基金及华夏蓝筹基金在参与排名的59只偏股型基金中分别位列第2名和第8名;华夏回报基金及华夏回报二号基金在参与排名的24只平衡型基金中分别位列第1名和第4名;基金兴华在32只封闭式基金中位列第2名;中小板ETF在参与排名的16只指数型基金中位列第1名。

2、截至2008年12月底,在中国银河证券基金研究中心过去一年的星级评价中,华夏基金旗下参与评价的12只基金中,有10只基金获得了五星级评价。

2008年,华夏基金继续采取多种手段,不断提高客户服务水平,全力打造高质量的客户服务品牌,荣获了"亚太地区最佳客户服务管理奖"、"中国最佳客户服务奖"、"2008中国最佳呼叫中心奖"等客服领域的多项权威奖项。服务质量继续稳步提升:

1、推进业务管理的精细化,提升客服人员的业务能力,提高服务响应速度,更及时、有效地解决客户问题。

2、升级客服电话系统,提供一周七天的人工服务,工作日人工服务时间延长到晚上21点,为客户提供稳定、优质的电话咨询服务。

3、完善客户资料,主动、及时地为客户提供交易通知和基金信息服务。

4、推出短信对账单,增加电子对账单订制渠道,优化纸质对账单,提供更符合客户需要的对账单服务。

为树立理性的基金投资理念,增进与投资者之间的交流,2008年华夏基金在投资者理财服务方面加大投入:

1、在37家都市报及全国媒体开设"华夏基金投资者教育专栏",在网站上开辟投资者教育专区。

2、在全国举办31场"五星基金聚华夏——十年信任十年回报"为主题的全国巡回策略报告会,持续举办投资者教育活动,进行基金理财知识的宣讲。

3、持续免费发放由公司印制的投资者教育丛书《基金投资百问百答》。

4、参展第三届中国中部投资贸易博览会,并在现场开设理财课堂,发放投资者教育书籍,与到场投资者展开充分互动,提供一对一的理财服务。

5、召开主题为"展望2009·蓄势与期待"的年度投资报告会,就我国宏观经济形势、股票和债券市场以及全球经济前景等主题进行了深入探讨。

2008年,华夏基金凭借优异的业绩和稳健的经营,荣获多家机构评选的多个奖项:

1、2008年1月,华夏基金获得由《中国证券报》等机构共同评选的"2007年度十大金牛基金公司"奖。

2、2008年1月,华夏基金在《证券时报》主办的"2007年度中国明星基金暨最佳托管银行评选"中,荣获"中国基金业十年持续回报明星基金奖"、"十大明星基金公司奖"。

3、2008年1月,在《21世纪经济报道》主办的"中国赢基金奖"的评比中,华夏基金获得"2007年中国基金公司综合实力大奖"等四项大奖。

4、2008年1月,在和讯网举办的2007年度财经风云榜评选活动中,华夏基金获得"2007年度中国十大品牌基金公司奖"。

5、2008年3月,在《上海证券报》主办的第五届"中国基金业金基金评选"中,华夏基金获得"中国最佳基金公司TOP大奖"和"中国基金业十年杰出贡献基金公司奖"。

6、2008年3月,在亚洲权威资产管理杂志《亚洲资产管理》(Asia Asset Management)的评选中,华夏基金获得"中国增长最快速基金管理公司"、"亚洲地区最具创新投资者教育"等四项大奖。

7、2008年4月,在亚洲权威财经杂志《亚洲投资者》(Asian Investor)举办的"2008年度投资成就奖"评选中,华夏基金获得唯一的"年度中国最佳基金公司"奖,同时还获得了"一年期最佳投资回报奖"。

8、2008年11月,在美国《机构投资者》(Institutional Investor)杂志评选的"2008中国前20名基金排行榜"中,华夏基金位列榜首。

9、2008年11月,在《第一财经日报》发起的"2008第一财经金融价值榜"评选中,华夏基金荣获"2008年度基金管理公司奖"。

10、2008年12月,在《金融时报》和中国社科院金融研究所主办的"2008中国最佳金融机构排行榜"评选活动中,华夏基金荣获"年度最佳基金管理公司"称号。

华夏基金在勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定回报的同时,也在作为一个负责任的企业公民持续回馈社会:

1、2008年2月,在"抗风雪,献爱心"活动中,华夏基金公司及员工向灾区捐款130万余元。

2、2008年5月,在"5.12"四川汶川地震发生后,华夏基金公司和员工及时向灾区捐赠总计超过350万元,捐赠了80万册《地震灾害心理救助手册》以及大量灾区急需防暑降温用品。同时,华夏基金通过公告、客服电话、网站、在成都设立咨询服务专柜等多种方式,寻找灾区持有人,妥善处理了投资人基金资产的灾后事宜。

3、2008年北京奥运会期间,华夏基金联合搜狐举办了"用爱心温暖2008"公益捐赠活动,为29个省的部分贫困家庭捐赠电视,帮助他们共享奥运盛事。

4、2008年北京奥运会期间,华夏基金成为基金行业唯一的2008年奥运会志愿者服务单位,荣获奥运会、残奥会观众呼叫中心"运行保障突出贡献单位"、"北京奥运会、残奥会志愿者工作优秀组织单位"等荣誉称号,华夏基金客户服务部被北京市妇女联合会评选为"北京市三八红旗集体"。

5、2008年11月,华夏基金荣获2008首届华夏公益慈善论坛组委会颁发的"2008年度中国公益五十强"。

华夏基金管理有限公司
二〇〇九年三月二十六日