

华夏回报证券投资基金

2008 年年度报告摘要

重要提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员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。在年度报告编制之日前三月之内，以上人员未因违法违规行为受到行政、刑事处罚，或涉及与经济纠纷有关的重大诉讼情况；未受到中国证监会及其派出机构的行政处罚，未受到其他部门的处罚，未涉及与基金财产、利用未公开信息交易、内幕交易、泄露未公开信息等相关的民事诉讼，没有损害投资者利益记录。

基金管理人、基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担责任。

本报告中的财务数据未经审计。基金管理人对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。

基金简介

基金名称：华夏回报证券投资基金

基金简称：华夏回报

基金代码：060001(前端收费模式) 060002(后端收费模式)

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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 上一年度末 2007年12月31日

银行存款 1,713,423,813.38 2,300,040,639.45

结算备付金 10,773,729.53 26,403,400.17

保证金 2,249,677.01 8,978,735.86

交易性金融资产 12,132,770,171.21 17,037,735,626.02

其中：股票投资 4,068,033,219.07 11,966,385,203.81

债券投资 - -

基金投资 8,064,736,951.50 5,079,360,476.81

货币市场基金 - -

应收利息 1,130,579.41 7,718,615.14

买入返售金融资产 - -

应收证劵清算款 56,613,114.37 67,572,606.46

应付利息 149,433,914.40 71,218,709.37

应交税费 4,272,400.00 1,000,792,074.16

应付申购款 3,923,526.44 13,377,711.13

应付赎回款 - -

应付股利 - -

应付利润 14,069,318,526.75 20,643,142,160.27

负债合计 11,969,385,203.81 17,037,735,626.02

所有者权益 56,613,114.37 67,572,606.46

应付利息 149,433,914.40 71,218,709.37

应交税费 4,272,400.00 1,000,792,074.16

应付申购款 3,923,526.44 13,377,711.13

应付赎回款 - -

应付股利 - -

应付利润 14,069,318,526.75 20,643,142,160.27

负债和所有者权益总计 11,969,385,203.81 17,037,735,626.02

3.2 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 中国银行股份有限公司

姓名 陈立新 宁宇

信息披露负责人 联系电话 040-8816-0006 010-00694077

电子邮件 电子邮箱 info@chinaAMC.com 010-00694077@china.com

客户服务电话 040-8816-0006

传真 010-89066511 010-00694042

网站 www.ChinaAMC.com

基金业协会备案地点 华夏基金管理有限公司住所

2.5 其他相关当事人

项目 注册登记机构

名称 安华明华注册登记服务中心 华夏基金管理有限公司

办公地址 北京市东城区建国门大街33号通泰大厦B座16层

3.3 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.3.1 期间数据和指标 2008年 2007年

本期初至报告期末收益 -2,472,377,980.00 3,056,397,962.01

本期平均 收益率 -4,676,196,734.01 4,321,069,238.45

加权平均基金份额本期利润 -0.3261 0.0607

本期基金份额总额增加 -242,624 122,131.50

期末基金资产净值 20,643,142,160.27 20,643,142,160.27

期末基金份额净值 0.9999 0.9999

期末基金资产净值 -0.0276 0.0073

期末基金份额净值增长率 11.4% 13.0%

期末基金份额净值增长率标准差 0.306% 0.264%

期末基金份额净值增长率系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数 1.0436 1.0436

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.0067

期末基金份额净值增长率系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数系数标准差 0.0073 0.00