

华夏大盘精选证券投资基金 2006 年年度报告摘要

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

重要提示

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。本基金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。

基金托管人为中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，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基金，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。投资人面临风险，投资人应当在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。德勤华永会计师事务所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。

本年度报告摘要请见年度报告正文，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

一、基金简介

(一) 基金基本情况

1. 基金名称：华夏大盘精选证券投资基金

2. 基金简称：华夏大盘精选

3. 交易代码：160205(前端收费模式)；000012(后端收费模式)

4. 基金运作方式：契约型开放式

5. 基金合同生效日：2004 年 3 月 11 日

6. 报告期末基金份额：0.92,520,027.15 份

7. 基金合同存续期限：不定期

(二) 基金产品类型

1. 基金投资目标：追求基金资产的长期增值

2. 基金投资策略：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的研究，精选出业绩增长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，基金经理将在资金配置比例以风险管理策略，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，监控总资产仓位、债券收益率的配置比例，以避免市场系统性风险，保证基金所承担的风险水平。

3. 业绩比较基准：新華富時中國 A 股指數 ×80%+ 新華富時中國債指數 ×20%

4. 风险收益特征：本基金属股票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货币基金和债券基金，低于大型股票基金。

(三) 基金管理人：有关情况

1. 基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO., LTD.

2. 注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 F 区

3. 办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

4. 邮政编码：100002

5. 电子邮箱：chinaAMC@chinaAMC.com

9. 国际互联网址：<http://www.ChinaAMC.com>

10. 电子信箱：chinaAMC@chinaAMC.com

(四) 基金托管人有关情况

1. 基金托管人名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

2. 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

3. 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

4. 邮政编码：100043

6. 信息披露负责人：宁欣

7. 联系电话：(010) 66594977

8. 传真：(010) 66594962

9. 国际互联网址：<http://www.BOCcn>

10. 电子信箱：tgxppl@bank-of-china.com

(五) 信息披露事宜

登载年度报告正文的管理人网址：www.ChinaAMC.com

基金年度报告置备地点：基金管理人办公地址

二、主要财务指标、净值表现及收益分配情况

重要提示：下述基金业绩指标并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列示的业绩指标。

(一) 主要财务指标

1. 基金份额净值增长率及其业绩比较基准收益率的对比情况

2. 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

3. 自基金合同生效以来基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(2004 年 8 月 11 日至 2006 年 12 月 31 日)

4. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

5. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

6. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

7. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

8. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

9. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

10. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

11. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

12. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

13. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

14. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

15. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

16. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

17. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

18. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

19. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

20. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

21. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

22. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

23. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

24. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

25. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

26. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

27. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

28. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

29. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

30. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

31. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

32. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

33. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

34. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

35. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

36. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

37. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

38. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

39. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

40. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)

41. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图

华夏大盘精选证券投资基金累计划份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的柱状图对比图
(与业绩比较基准收益率的柱状图对比)