华夏回报二号证券投资基金

招募说明书(更新)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
日期:二〇〇七年第一号

重要提示

华夏回报二号证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]130 号文批准公开发售。本基金基金合同于 2006 年 8 月 14 日正式生效。

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。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

本基金与华夏回报证券投资基金采用相同的投资目标、投资策略和投资理念,但在投资运作上完全独立。华夏回报证券投资基金的过往业绩不预示本基金的未来表现。本基金与华夏回报证券投资基金的未来业绩可能存在差异。

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 2007 年 2 月 14 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

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 8 层
设立日期:1998 年 4 月 9 日
法定代表人:凌新源
总经理:范勇宏
联系人:张弘弢
联系电话:(010)88066688
传真:(010)88066566

华夏基金管理有限公司注册资本为 13800 万元,公司股权结构如下:

持股单位	占总股本比例
中信证券股份有限公司	40.725%
西南证券有限责任公司	35.725%
北京证券有限责任公司	20%
中国科技证券有限责任公司	3.55%
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

凌新源先生:董事长,硕士。现兼任北京证券有限责任公司董事长,曾任华夏证券股份有限公司副总裁、中国钢铁工贸集团公司总裁助理、中国冶金进出口总公司总裁助理、北京国际信托投资公司业务部副经理。

范勇宏先生:副董事长、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。

王东明先生:董事,硕士,高级经济师。现任中信证券股份有限责任公司董事长、中信基金管理有限责任公司董事长、中国国际信托投资公司董事、协理,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。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,南方证券公司副总裁,华夏证券公司发行部副总经理等职务。

范剑先生:董事,硕士。现任西南证券有限责任公司副总裁。曾任中国煤炭工业进出口集团公司市场部副总经理。

李洋先生:董事,学士。现任北京证券有限责任公司资产保全部总经理。曾任北京市财政局外事财务处处长。

王邦志先生:董事,硕士。现任中国科技证券有限责任公司副总经理。曾任中国科技国际信托投资有限责任公司副总经理、信贷部项目经理、证券总部总经理。

王连洲先生:独立董事,学士。现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》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造币局工作。

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,并兼任深圳证券交易所上市公司专家委员会委员。

鲁明泓先生:独立董事,博士。现任南京大学商学院教授、博士生导师、哥伦比亚大学客座研究员。曾在美国哈佛大学做博士后研究工作。

刘芳勤女士:独立董事,学士,高级经济师。现已退休。曾任中国工商银行北京朝阳支行副行长、吉林省长春市计划委员会副处长。

滕天鸣先生:执行副总经理,硕士。曾任公司总经理助理、工会主席和机构理财部总经理等。

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。现任西南证券有限责任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。现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。曾任华夏证券股份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业务主管。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

基金经理:石波先生,法学硕士。曾任君安证券有限公司投资银行部上海总部副总经理、上海申华实业股份有限公司常务副总经理。1999 年加入华夏基金管理有限公司,历任兴科证券投资基金基金经理(2000 年 12 月至 2004 年 2 月期间)、兴华证券投资基金基金经理(2003 年 8 月至 2004 年 2 月期间)。现任投资副总监、股票投资部执行副总经理、华夏回报证券投资基金基金经理(2004 年 2 月起任职)、华夏回报二号证券投资基金基金经理(2006 年 8 月起任职)。

基金经理助理:罗泽萍女士,经济学硕士。曾任大成基金管理有限公司研究部研究员。2004 年加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理(2005 年 4 月至 2007 年 2 月期间)。现任华夏回报二号证券投资基金基金经理助理(2006 年 8 月起任职)、兴安证券投资基金基金经理(2007 年 2 月起任职)。

3、本公司投资决策委员会成员

范勇宏先生:华夏基金管理有限公司副董事长、总经理。
滕天鸣先生:华夏基金管理有限公司执行副总经理。
王亚伟先生:华夏基金管理有限公司总经理助理,华夏大盘精选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、兴安证券投资基金基金经理、兴华证券投资基金基金经理。
杨爱斌先生:华夏基金管理有限公司固定收益总监。
石波先生:华夏基金管理有限公司投资副总监、股票投资部执行副总经理,华夏回报证券投资基金基金经理、华夏回报二号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基金经理。
张益驰先生:华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理、华夏优势增长混合型证券投资基金基金经理。
韩会永:华夏基金管理有限公司固定收益部副总经理,华夏债券投资基金基金经理,华夏现金增利证券投资基金基金经理。
唐俊:华夏基金管理有限公司基金经理。
乔巍:华夏基金管理有限公司基金经理。

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

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”),基本情况如下:

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
企业类型:股份有限公司
注册资本:人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元
存续期间:持续经营
成立日期:1983 年 10 月 31 日
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门总经理:秦立儒
托管部门联系人:宁敏
电话:(010)66594977
传真:(010)66594942

发展概况:

中国银行业务覆盖传统商业银行、投资银行和保险领域,并在全球范围内为个人客户和公司客户提供全面和优质的金融服务。在近百年的岁月里,中国银行以其稳健的经营、雄厚的实力、成熟的产品和丰富的经验深得广大客户信赖,打造了卓越的品牌,与客户建立了长期稳固的合作关系。

中国银行主营商业银行业务,包括公司业务、个人金融业务和资金业务。中国银行向公司客户提供包括存款、贷款、贸易相关服务和贸易融资、清算、托管等在内的各项金融产品和融资、财务解决方案。中国银行为个人客户提供包括储蓄存款、消费信贷、银行卡、个人理财、汇款等在内的各项金融服务。在多年的发展历程中,中国银行曾创造了中国银行业的许多第一,所创新和研发的一系列金融产品与服务均开创历史之先河,在业界独领风骚,享有盛誉。目前在外汇存贷款、国际结算、外汇资金和贸易融资等领域仍居领先地位。截至 2005 年底,中国银行境内外分支机构共有 11,646 个,其中境内分支机构 11,018 个,境外分支机构 627 个,是中国国际化程度最高的银行。中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进

中国银行有近百年辉煌而悠久的历史,在中国金融史上扮演了十分重要的角色。中国银行于 1912 年由孙中山先生批准成立,至 1949 年中华人民共和国成立的 37 年间,中国银行先后是当时的国家中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行。在动荡的历史年代,中国银行作为民族金融的支柱,以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。

新中国成立后,中国银行成为国家指定的外汇外贸专业银行,继续保持和发扬了顽强创业的企业精神,为国家对外经贸发展、开展经济建设作出了贡献。1994 年随着金融体制改革的深化,中国银行由外汇外贸专业银行向功能完善、服务全面的国有商业银行转化,与其它三家国有商业银行一道成为国家金融业的支柱。1994 年和 1995 年,中国银行先后成为香港地区、澳门地区发钞银行。为提高竞争优势,中国银行从 2000 年初开始围绕建立良好的公司治理机制采取了一系列的改革。2001 年,中国银行成功重组了香港中银集团,将 10 家成员银行合并成当地注册的“中国银行(香港)有限公司”。2002 年 7 月,重组后的中国银行(香港)有限公司在香港联交所成功上市,成为国内首家在境外上市的国有商业银行。

2004 年 7 月 14 日,中国银行在与国际同业和国内同业的激烈竞争中,凭借雄厚的实力和优良的服务,脱颖而出,作为我国银行业的优秀代表携手北京 2008 年奥运会,成为北京奥运会唯一的银行合作伙伴。

中国银行于 2003 年被国务院确定为国有独资商业银行股份制改造试点银行,围绕“资本充足、内控严密、运营安全、服务和效益良好、具有国际竞争力的现代化股份制商业银行”的目标,进一步完善符合现代企业制度要求的公司治理机制,稳步推进国有商业银行的股份制改造工作。2004 年 8 月 26 日,中国银行股份有限公司成立,中国银行成为国家控股的股份制商业银行,标志着中国银行向建立良好公司治理机制的现代化股份制商业银行的目标迈进了一大步,中国银行的历史翻开了新的一页。

2006 年 6 月 1 日,中国银行在香港联交所成功挂牌上市,共集资 754.27 亿港元。继成功发行 H 股并上市之后,2006 年 7 月 5 日,中国银行在上海证券交易所成功发行 A 股,是中国资本市场第一家国有商业银行股,是全流通背景下的第一家“海归”股。在势如破竹的中国金融银行业改革的大潮中,在“新兴 + 转轨”的中国资本市场股权分置改革的大趋势中,中国银行将创造更新的辉煌、谱写更绚丽的篇章!

中国银行多年来围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。从 1990 年以来,中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜;自 1992 年,中国银行八次被《欧洲货币》杂志评为“中国最佳银行”或“中国最佳本地银行”,并于 2005 年被《欧洲货币》评为中国及香港“最佳商业银行”(2005 年房地产奖项);2004 年及 2005 年,中国银行被《环球金融》杂志评为“中国最佳贸易融资银行”和“中国最佳外汇银行”;在中央电视台和《销售与市场》杂志共同主办的“2005 中国营销盛典”中,被评为“2005 年度中国企业营销创新奖”(是获奖企业中唯一的金融企业);2005 年,被《中国人才》(《China Staff》)授予“中国大陆‘最佳人力资源战略奖’”,这是大中华区人力资源管理领域的最高评奖;根据英国《金融时报》2005 年 8 月进行的调查,中国银行是中国的十大国际品牌之一;另外,中国银行被国家工商总局授予“中国驰名商标”。世纪信誉,环球共享。中国银行将秉承“以客户为中心,以市场为导向,强化公司治理,追求卓越效益,创建国际一流大银行”的宗旨,依托其雄厚的实力、遍布全球的分支机构、成熟的产品和丰富的经验,竭诚为客户提供全方位、高品质的银行服务,与广大客户携手共创美好未来。

财务概况:

2005 年,中国银行集团实现营业利润 647.44 亿元,比 2004 年增长 12%;净利润 275 亿元,比 2004 年增长 31%;总资产回报率和权益净回报率分别达到 0.72%和 12.62%,同比提高 0.11 个百分点和 2.58 个百分点;资产质量持续改善,2005 年末不良贷款比率从 2004 年末的 5.12%进一步下降到 4.62%。

(二)证券投资基金托管情况

截止到 2006 年 6 月末,中国银行已托管景宏、同盛、同智、兴安、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达积极成长、易方达货币市场、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列(含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券)、嘉实货币市场、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币市场、海富通股票、天同 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏大盘精选、景顺长城景系列(含景顺长城动力平衡、景顺长城货币市场、景顺长城优选股票)、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、招商先锋、大成蓝筹稳健、湘财荷银行业精选、国泰金鹿保本增值、国泰金鹿保本增值二期、友邦华泰盛世中国、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合股票型基金等 41 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(三)主要人员情况

肖钢先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月,1981 年毕业于湖南财经学院,1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月,1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司执行董事、副行长。自 2000 年 11 月起任中国银行副行长。1993 年 12 月至 2000 年 11 月任中国人民建设银行副行长,1987 年 12 月至 1993 年 12 月历任中国人民建设银行大连市分行行长、中国人民建设银行计算机中心主任、国际业务部总经理。李先生出生于 1955 年 4 月,1978 年毕业于南京气象学院。

秦立儒先生,自 2005 年 10 月起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。2005 年 5 月至 2005 年 10 月任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部负责人。2004 年 4 月至 2005 年 5 月任中国银行股份有限公司全球金融市场部总经理。2002 年 7 月至 2004 年 4 月任中国银行(香港)有限公司资金部总经理;1999 年 6 月至 2002 年 7 月任香港中银集团外汇交易中心总经理;1997 年 9 月至 1999 年 6 月任广东省银行香港分行 (香港中银集团)总经理;1995 年 11 月至 1997 年 9 月任中国银行总行资金部副总经理, 主管全球资金交易;1991 年 5 月至 1995 年 11 月历任中国银行纽约分行资金部经理、助理总经理、副总经理;1987 年 10 月至 1991 年 5 月历任中国银行总行资金部副处长、处长;1982 年 8 月至 1987 年 9 月任中国银行卢森堡分行外汇部经理;1978 年 2 月至 1982 年 7 月,先后在中国银行总行财会部、中国银行伦敦分行、卢森堡分行从事资金交易工作。秦先生出生于 1955 年 5 月,1978 年毕业于北京外贸学院。

(四)基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类,中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队;并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 70 余人,其中硕士学历以上人员 21 人,具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

(五)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系,以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目标是:以完善的内部控制组织体系为保障,以体现制衡原则、健全有效的制度为基础,以精细化的过程为着眼点,以激励约束机制和问责制为引导,以信息科技手段为依托,大力培育合规文化,努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标,中国银行从明确职责入手,完善内部控制组织体系建设;从制度建设入手,夯实内部控制基础;从细节入手,实现精细化的过程控制;从完善激励约束机制和问责制入手,引导内部控制目标的实现;从加强信息技术手段入手,提高内部控制水平和质量;从加强教育培训入手,促进合规文化的形成。

2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 8 月 26 日成立以来,按照国家有关法律法规制定了新的公司章程,形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1)董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会,并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施,以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构,风险管理部拟订风险管理策略及工作计划,并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能,中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动,对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估,负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005 年 11 月,董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程,进一步明确内部稽核职能独立于业务部门,并由董事会的稽核委员会领导,在董事会授权下,稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算,以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门,各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核,向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制,明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任,相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2)中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任,管理本行风险的各个方面,包括风险管理策略、措施和信贷政策,并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行,决定内部控制基本制度,评估内部控制体系的有效性,以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷,督导改进措施的落实,审阅及批准本行主要内部控制政策和相关实施计划,制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度,并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构,该部负责管理法律风险、合规风险,并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理, 以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策,制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构,该部按照资产负债管理委员会制订的政策,管理本行流动性,预测本行流动性的需求和风险,并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策,负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜,法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3)托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求, 以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

4、其他事项

最近一年内,基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(六)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定,托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法,基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项,对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中,如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

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 8 层
法定代表人:凌新源
总经理:范勇宏
电话:(010)88066688
传真:(010)88066508
联系人:吴志军

2、代销机构:

(1)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
客户服务电话:95566
传真:(010)66594946
联系人:客户服务中心

(2)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

(3)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:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕

(4)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:秦晓
客户服务电话:95555
传真:(0755)83195049,82090817
联系人:朱虹、刘薇

(5)中国银河证券有限责任公司
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:朱利
电话:(010)66568613、66568587
传真:(010)66568536
联系人:郭京华

(6)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:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818
传真:(021)62583439
联系人:韩星宇

(7)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:王明权
电话:(021)54033888
传真:(021)54030294
联系人:李清怡

(8)国信证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16–26 层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 21 楼
法定代表人:何如
电话:(0755)82133066
传真:(0755)82133302
联系人:林建闽

(9)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅

(10)中信证券股份有限公司
住所:深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦
办公地址:北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:(010)84588266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠

(11)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:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
电话:400–8888–108
传真:(010)65182261
联系人:权唐

(12)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 39–45 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)82943511
传真:(0755)82943237
客户服务热线:400–8888–111;(0755)26951111
联系人:黄健

(13)联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
办公地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人:马国强
电话:(0755)82493561
传真:(0755)82492062
联系人:盛宗凌

(14)光大证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15–16 楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 室
法定代表人:王明权
电话:(021)68823685
传真:(021)68815009
联系人:刘晨

(15)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:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566
传真:(021)53858549
联系人:金芸、杨薇

(16)兴业证券股份有限公司
住所:福建省福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳

(17)长江证券有限责任公司
住所:湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号
办公地址:上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F
法定代表人:明云成
电话:(027)65799560
传真:(027)85481532
联系人:毕艇

(18)华泰证券有限责任公司
住所:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
办公地址: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)84457777–721/950、84579897
传真:(025)84579879
联系人:袁红彬、李金龙

(19)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
电话:(025)83364032
传真:(025)83364032
联系人:石健

(20)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:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼(深圳总部)
法人代表:张慎修
电话:(0755)83025430
传真:(0755)83025991
联系人:杨玲

(21)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市东海路 28 号
办公地址:青岛市东海西路 28 号
法定代表人:史洁民
电话:(0532)5023457
传真:(0532)5022025
联系人:丁韶燕

(22)国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层
办公地址:北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层
法定代表人:王少华
电话:(010)64482828–390
传真:(010)64482090
联系人:马泽承

(23)平安证券有限责任公司
住所:深圳市八卦三路平安大厦三楼　518029
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法人代表:叶黎成
电话:(0755)82450826 、22622287
传真:(0755)824332794
联系人:余江、庄维佳

(24)信泰证券有限责任公司
住所:南京市长江路 88 号
办公地址:南京市长江路 88 号
法定代表人:钱凯法
电话:(025)84784765
传真:(025)84784830
联系人:舒萌菲

(25)东北证券股份有限公司
住所:长春市人民大街 138－1 号
办公地址:长春市自由大路 1138 号
法定代表人:李树
电话:(0431)96688–99、5096733
传真:(0431)5680032
联系人:高新宇

(26)万联证券有限责任公司
住所:广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 34－34 层
办公地址:广州市东山区东风东路 836 号东峻广场 34－34 层
法定代表人:李舫金
电话:(020)87691530
传真:(020)87691530
联系人:邸亚娟

(27)中信金通证券有限责任公司
住所:杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9–12 楼
办公地址:杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 9–12 楼
法定代表人:应土歌
电话:(0571)85783737
传真:(0571)85783748
联系人:余少南

(28)金元证券有限责任公司
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:郑辉
电话:(0755)83025666
传真:(0755)83025625
联系人:金春

(29)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:李炜
电话:(0531)2024184
传真:(0531)2024197
联系人:付英梅

(30)国海证券有限责任公司
住所:中国广西南宁市滨湖路 46 号
办公地址:中国广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人: 张雅锋
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
联系人:覃清芳

(31)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:段强
电话:(0755)83199511
传真:(0755)83199545
联系人:刘军辉

(32)湘财证券有限责任公司
住所:湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址:上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5 楼
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68865020
传真:(021)68865938
联系人:陈伟

(33)中银国际证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人:平岳
电话:(021)68604866
传真:(021)50372474
联系人:张静

(34)东吴证券有限责任公司
住所:江苏省苏州市十梓街 298 号
办公地址:苏州市石路爱河桥 26 号
法定代表人:吴永敏
电话:(0512)65581136
传真:(0512)65588021
联系人:方晓丹

(35)山西证券有限责任公司
住所:山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心
办公地址:太原市府西街 69 号山西国贸中心
法定代表人:吴晋安
电话:(0351)8686766、8686708
传真:(0351)8686709
联系人:张治国

(36)国联证券有限责任公司
住所:无锡市县前东街 168 号
办公地址:无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼
法定代表人:范炎
电话:(0510)82831662、82588168
传真:(0510)82831589
联系人:袁丽萍

(37)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) 25832686
传真:(0755) 25831718
联系人:杨柳

(38)中原证券股份有限公司
住所:许昌市南关大街 38 号
办公地址:郑州市经三路 15 号广汇国贸大厦 11 楼
法定代表人:张建刚
电话:(0371)967218、(0371)65585256
传真:(0371)65585670
联系人:巴冠华

(39)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:吴张
电话:(020)87320991
传真:(020)87325036
联系人:江欣

(40) 国元证券有限责任公司
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:安徽地区:96888;全国:400–8888–777
传真:(0551)2634400–1171
联系人: 李蔡

(41) 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:周建辉
电话:961130
传真:(0769) 22119423
联系人:童怡腾

(42)渤海证券有限责任公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街 29 号
办公地址:天津市河西区宾水道 3 号
法定代表人:张志军
电话:(022)28451883
传真:(022)28451616
联系人:徐焕强

(43)西南证券有限责任公司
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:蒋辉
电话:(023)63786397
传真:(023)63786312
联系人:杨卓颖

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

(二)登记结算机构

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 8 层
法定代表人:凌新源
总经理:范勇宏
电话:(010)88066688
传真:(010)88066566
联系人:毛伟

(三)律师事务所

名称:北京市德恒律师事务所
住所: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:戴钦公
经办律师:李晓明 戴钦公

(四)会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所有限公司
住所:上海市延安东路 222 号 30 楼
办公地址:北京市东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层
法定代表人:郑树成
联系电话:(010)85207788
传真:(010)85181218
联系人:陈曦
经办注册会计师:景宜青、张扣娣

四、基金的名称

本基金名称:华夏回报二号证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

尽量避免基金资产损失,追求每年较高的绝对回报。

七、基金的投资方向

限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

基金管理人分析判断证券市场走势,在遵守有关投资限制规定的前提下,合理配置基金资产在股票、债券、权证、资产支持证券、现金等各类资产间的投资比例。基金管理人还将采用分析市场价值均衡点等定量方法,辅助判断市场趋势的变动。

(1)在股票市场处于低风险区域或预期股票市场趋于上涨时,基金将采取积极的做法,主要投资于股票市场,分享股票市场上涨带来的收益,实现较高回报。

(2)预期股票市场处于震荡运行时,基金将采取波段操作策略。在市场震荡、调整过程中,经常会出现整个资产类别、部分行业或个股投资价值被低估的短期失衡现象,如投资者因恐慌心理而过度抛售导致股票价值被低估的情况。基金管理人将发现、确认并利用这些市场失衡机会,重点选择被低估的资产类别、行业、个股进行投资,以实现基金的投资目标。

(3)在股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时,基金将采取保守的做法,大幅减少股票投资比例,甚至不再持有股票,而主要投资于债券市场,以回避股票市场下跌的系统性风险,避免组合损失。

(4)在预期利率上升、债券价格将下降时,组合将增加现金持有比例,并将债券资产主要投资于短期债券和浮息债券;在预期利率下降、债券价格将上升时,组合将降低现金持有比例,并将债券资产主要投资于中长期债券,以实现较高的回报。

此外,基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资,以增加收益。基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下,可本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于权证、资产支持证券。

2、股票投资策略

本基金股票投资部分主要采取价值型投资策略。达到以下标准的股票,将是本基金重点关注的对象:

(1)总市值达到 20 亿元及以上、流通市值达到 8 亿元及以上的股票;

(2)市盈率(P/E)低于市场平均水平,尤其是与公司未来的业务发展相比,市盈率水平偏低的股票,具体表现为经过成长性调整后的市盈率(P/E)/G 偏低。

大盘股票占股票市场总值的比重较高,能够更好地体现我国经济的高速增长,投资于大盘股票,可以更充分地分享中国经济成长的成果。此外大盘股票价格的波动性相对较小,可预测性相对较强,有利于分析判断,选择投资。而经过成长性调整后的市盈率偏低的股票具有更高的投资价值,我们预期这些股票能够取得较高的绝对收益,有利于基金实现取得较高绝对回报的投资目标。

3、债券投资策略

本基金债券投资部分主要通过对利率、利差等因素变化趋势的判断采用久期偏离策略、收益率曲线配置策略和类属配置策略提高债券投资收益率。

本基金债券投资部分投资于国债及投资级债券。即具有以下一项或多项特征的债券,将是本组合债券投资重点关注的对象:

(1)有较好流动性的债券;

(2)到期收益率相对类似信用质量和期限债券较高的债券;

(3)风险水平合理、有较好下行保护的债券;

(4)期限结构和收益风险特征符合对市场预期的债券;

(5)同等条件下信用质量较好或预期信用质量将得到改善的债券。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为绝对回报标准,为同期一年期定期存款利率。基金应在以较高的概率水平超过同期一年期定期存款利率的基础上,争取获得较高绝对回报。其中,一年期定期存款利率是指人民银行规定的居民储蓄存款利率。未来,如果商业银行可以自由调整存款利率,管理人将与托管人协商确定基准利率。

本基金追求每年较高的绝对回报,而一年期定期存款利率是普通投资者用来衡量每年投资回报的最基础、最常用的标准,作为本基金业绩比较基准具有合理性。

在合理的市场化利率基准推出的情况下,基金管理人可根据投资目标和投资政策,确定变更业绩比较基准,并及时公告。

十、风险收益特征

本基金是混合型基金,风险高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。本基金以绝对回报为目标,预期风险较低。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 1 月 18 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 2006 年 12 月 31 日。

(一)报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占总资产比例
股票	5,627,809,601.90	76.09%
债券	1,445,555,368.42	19.54%
权证	26,434,988.23	0.36%
资产支持证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	185,754,623.15	2.51%
其他资产	110,589,893.64	1.50%
合计	7,396,144,475.34	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	17,844,823.72	0.25%
B	采掘业	219,094,037.39	3.07%
C	制造业	2,540,112,817.93	35.64%
C0	其中:食品、饮料	840,082,966.54	11.79%
C1	纺织、服装、皮毛	7,347,244.07	0.10%
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	121,975,388.69	1.71%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	235,393,688.99	3.30%
C5	电子	10,209,073.26	0.14%
C6	金属、非金属	938,499,320.88	13.17%
C7	机械、设备、仪表	231,931,460.38	3.25%
C8	医药、生物制品	153,102,875.12	2.15%
C99	其他制造业	1,570,800.00	0.02%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	53,454,111.96	0.75%
E	建筑业	884,304.00	0.01%
F	交通运输、仓储业	3,687,102.38	0.05%
G	信息技术业	123,059,282.31	1.73%
H	批发和零售贸易	624,494,752.27	8.76%
I	金融、保险业	1,005,058,963.83	14.10%
J	房地产业	528,372,454.58	7.41%
K	社会服务业	243,314,383.31	3.41%
L	传播与文化产业	33,047,168.66	0.46%
M	综合类	235,385,399.56	3.30%
	合计	5,627,809,601.90	78.97%

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占净值比例
1	601398	工商银行	68,908,800	427,234,560.00	5.99%
2	600519	贵州茅台	4,469,386	392,546,172.38	5.51%
3	002024	苏宁电器	7,961,957	361,472,847.80	5.07%
4	600036	招商银行	20,622,121	337,377,899.56	4.73%
5	000568	泸州老窖	12,322,804	312,259,853.36	4.38%
6	600005	武钢股份	40,340,574	256,566,050.64	3.60%
7	000402	金 融 街	14,159,340	238,584,879.00	3.35%
8	000069	华侨城 A	10,407,181	229,062,053.81	3.21%
9	000002	万 科 A	12,981,327	200,431,688.88	2.81%
10	600016	民生银行	19,300,803	196,868,190.60	2.76%

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国　　债	256,642,673.00	3.60%
2	金 融 债	1,187,115,000.00	16.66%
3	央行票据	–	–
4	企 业 债	–	–
5	可 转 债	1,797,695.42	0.03%
	合　计	1,445,555,368.42	20.28%

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	06国开 23	592,020,000.00	8.31%
2	06国开 08	299,130,000.00	4.20%
3	06进出 04	295,965,000.00	4.15%
4	20国债(10)	142,523,180.00	2.00%
5	02国债(14)	109,358,070.00	1.53%

(六)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

截至本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

(七)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中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3、报告期末基金的其他资产构成

单位:元

应收证券清算款	79,694,722.64
其他应收款	12,333,600.00
应收申购款	9,504,343.12
应收利息	8,141,020.41
交易保证金	916,207.47
合计	110,589,893.64

4、报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内获得的权证

	权证名称	数量(份)	成本总额(元)
被动持有权证	伊利 CWB1	186,927	–
主动投资权证	–	–	–
因认购新债获配权证	钢钒 GFC1	7,901,750	

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。基金的过往业绩不代表未来表现。

(一)基金业绩

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年6月14日至 2006年12月31日	39.20%	0.92%	0.96%	0.00%	38.24%	0.92%

(二)基金份额收益分配情况表

截至 2006 年 12 月 31 日,本基金无收益分配事项。

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)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);

(4)基金合同生效以后的信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(7)基金的资金汇划费用;

(8)按照国家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。

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:

$H = E \times 1.5\% \div$ 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 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(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:

$H = E \times 0.25\% \div$ 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 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(4)本条第(一)款第 1 项中第(3)至第(8)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

本条第(一)款第 1 项约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。

4、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可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(二)基金销售费用

1、申购费

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	2.0%
100万元以上(含 100 万元)–500 万元以下	1.6%
500万元以上(含 500 万元)–1000 万元以下	1.0%
1000万元以上(含 1000 万元)	每笔 1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

2、赎回费

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、转换费

(1)基金转换费:无。

(2)转出基金费用:按转出基金正常赎回时应收的赎回费收取费用,如该部分基金采用后端收费模式购买,需收取正常赎回时应收的后端申购费。

(3)转入基金费用:对转入基金申购费费率进行优惠,收取优惠申购费,细则如下:

①收取申购、赎回费用的基金之间的转换

第一,前端或后端收费基金 I 转入前端收费基金 II(I→II)

如果 II 基金的前端申购费率最高档比 I 基金的前端申购费率最高档高, 则其差额部分即为转入 II 基金时的申购费率;反之,则转入 II 基金时的申购费率优惠至 0。

特例处理:由于华夏回报二号、华夏优势增长申购金额在 1000 万元以上的前端申购费率为固定费用 1000 元,对于转换金额在 1000 万元以上的 A 类或 B 类华夏债券基金份额转入上述基金,收取固定申购费用 1000 元。

第二,前端或后端收费基金 I 转入后端收费基金 II(I→II)

转入 II 基金的已持有期为 I 基金后端申购费率为 0 的年限。例如,A 类或 B 类华夏债券基金份额转入华夏大盘精选后收费,转入时即视为已持有华夏大盘精选满 5 年。

华夏回报二号、华夏优势增长转入其他可做转换业务的后端收费模式开放式基金免收后端申购费用。

②不收取申购、赎回费用的基金(目前包括华夏现金增利、华夏债券 C 类)与收取申购、赎回费用的基金之间的转换

第一,收取申购、赎回费用的基金转入华夏现金增利、华夏债券 C 类

转入华夏现金增利、华夏债券 C 类不收取申购费用。

第二,华夏现金增利、华夏债券 C 类转入收取申购、赎回费用的基金前端收费,按优惠的申购费率收取,公式如下:

收取的申购费率 = 转入基金的申购费率 – 转出基金的销售服务费率 * 转出基金的持有时间(单位为年),最低为 0。

第三,华夏现金增利、华夏债券 C 类转入收取申购、赎回费用的基金后端收费

在计算转入基金的持有年限时,其持有期从买入华夏现金增利、华夏债券 C 类基金份额的时间开始计算。

上述为处理申(认)购时间不同的多笔基金份额的转出的情况,对转出基金持有时间的确定有特殊规定,即每当有基金新增份额时,均调整持有时间,计算方法如下:

调整后的持有时间 = 原持有时间 * 原份额 /(原份额 + 新增份额)

③不收取申购、赎回费用的基金之间的转换(目前包括华夏现金增利、华夏债券 C 类)不收取转入基金费用。

3、基金管理人可以调整申购费率、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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了“三、基金管理人”的“主要人员情况”信息;

2、更新了“五、相关服务机构”部分的“销售机构”的相关信息;新增了“第一创业证券有限责任公司”、“中原证券股份有限公司”、“广州证券有限责任公司”、“国元证券有限责任公司”、“东莞证券有限责任公司”等代销机构信息,更新了会计师事务所和经办注册会计师信息;

3、更新了“六、基金的募集”章节的内容,概括描述了基金的募集情况;

4、更新了“七、基金合同的生效”章节的内容,概括描述了基金合同生效的情况;

5、更新了“八、基金份额的申购、赎回和转换”直销和代销机构的相关信息,增加了基金份额的转换信息;

6、更新了“十、基金的投资”中基金投资组合报告部分;

7、更新了“十一、基金的业绩”,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核;

8、更新了“十五、基金的费用与税收”中与其他开放式基金的基金转换业务等内容;

9、更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”中网上交易、资讯服务等信息;

10、更新了“二十三、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
二〇〇七年三月三十一日

博时基金管理有限公司 关于督察长离任的公告

经博时基金管理有限公司董事会会议审议通过,刘纯亮先生因个人原因辞去公司督察长职务。上述事项已报告中国证监会及深圳监管局。

特此公告

博时基金管理有限公司
2007年 3 月 31 日

南方基金管理有限公司 关于免去南方稳健成长贰号基金经理的公告

由于谢爱龙先生因个人原因提出辞职,经公司研究并报经公司董事会批准,决定免去谢爱龙南方稳健成长贰号基金经理的职务。王宏远、张雪松将继续担任南方稳健成长贰号基金经理。

上述事项已按有关规定报告深圳证监局机构监管处。

特此公告

南方基金管理有限公司
二〇〇七年三月三十一日

中信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资大亚科技(000910)非公开发行股票的公告

中信基金管理有限责任公司(以下简称 " 本公司 ")根据中国证券监督管理委员会《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》要求,发布公告如下:

本公司管理的中信经典配置证券投资基金、中信红利精选股票型证券投资基金,参加了大亚科技(000910)非公开定向增发,分别认购其股份 300 万股、300 万股(锁定期为本次发行完成后 12 个月)。

截至 3 月 29 日收盘,中信经典配置证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 2115 万元,帐面价值为 2121 万元,分别占基金资产净值的 0.79%和 0.80%;中信红利精选股票型证券投资基金持有该股票本次非公开发行部分的成本为 2115 万元,帐面价值为 2121 万元,分别占基金资产净值的 0.75%和 0.75%。

特此公告。

中信基金管理有限责任公司
2007 年 3 月 31 日