# 上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

## 2007年第三季度报告

一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 10 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2007 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称: | 50ETF |
| 基金运作方式: | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2004年12月30日 |
| 报告期末基金份额总额: | 2,025,566,757 份 |
| 投资目标: | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略: | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。 |
| 业绩比较基准: | 本基金的业绩比较基准为“上证 50 指数”。 |
| 风险收益特征: | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 50 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。 |
| 基金管理人: | 华夏基金管理有限公司 |
| 基金托管人: | 中国工商银行股份有限公司 |

三、主要财务指标和基金净值表现

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。

（一）主要财务指标

| | |
|---|---|
| 本期利润 | 3,006,057,873.94 元 |
| 本期利润扣减公允价值变动损益后的净额 | 1,334,364,690.87 元 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 1.3535 元 |
| 期末基金资产净值 | 8,513,079,335.16 元 |
| 期末基金份额净值 | 4.203 元 |
| 期末基金累计份额净值 | 5.048 元 |

注：1、2007 年 7 月 1 日基金实施《企业会计准则》后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”= 本期利润扣减公允价值变动损益后的净额 /(本期利润 / 加权平均基金份额本期利润)。

2、50ETF 已于 2005 年 2 月 4 日进行了基金份额折算，折算比例为 1.18384087。基金累计份额净值 =（基金份额净值 + 基金份额累计分红金额）× 折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买 50ETF 后的实际份额净值变动情况。

（二）本报告期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

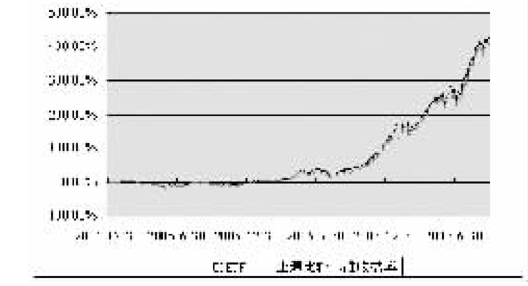
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 45.23% | 2.01% | 47.72% | 2.09% | –2.49% | –0.08% |

（三）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

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

（2004 年 12 月 30 日至 2007 年 9 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2004 年 12 月 30 日生效，2005 年 2 月 23 日在上海证券交易所上市并开始办理申购、赎回业务。

2、本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金按规定在基金合同生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。

四、管理人报告

1、基金经理简介

方军先生，硕士。1999 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员，华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。现任金融工程部副总经理、上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2004年12月起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2006年6月起任职）。

2、本报告期内，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。

3、报告期内的业绩表现和投资策略

（1）本基金业绩表现

截至2007年9月30日，本基金份额净值为4.203元，本报告期份额净值增长率为45.23%，同期上证50指数累计增长率为47.72%。本基金本报告期累计跟踪偏离度为–2.51%。

（2）行情回顾及运作分析；

2007年第3季度，A股市场在地产、煤炭、钢铁、有色、航空等行业的轮番带动下一路上扬，9月28日上证综指收于历史高点5552.30，季度涨幅高达45.32%，而上证50指数涨幅达到47.72%，优于上证综指。

第3季度上证50ETF平均仓位在95%以上。在操作中，我们严格按照基金合同和公司投资决策委员会制定的有关投资策略，根据尽量降低成本、减少市场冲击的原则及完全复制指数的策略对组合进行微调，紧密跟踪标的指数。

（3）市场展望和投资策略

在未来相当长一段时间内，我国的国民经济依然会持续稳定地增长，市场面临的以流动性充裕、人民币持续升值为主要特征的宏观环境没有发生根本的改变；并且随着大型国企的海外回归和股指期货、融资融券等制度的变革，证券市场的规模还将保持快速增长，结构也会得以逐步改善。长期来看，市场将在健康的轨道上呈现理性的繁荣，但短期涨幅过快，也使得市场面临的调整风险加大。

我们将继续有效控制上证50ETF的跟踪偏离度和误差，实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利机会的投资目标。同时，我们也在积极开发及推动产品的进一步创新，以促进ETF功能的完善和充分发挥，为各类投资者提供更多、更好的投资及盈利模式。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，上证50ETF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。

五、投资组合报告

（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 | 8,304,760,944.17 | 95.48% |
| 债券 | 3,507,906.00 | 0.04% |
| 权证 | – | – |
| 资产支持证券 | – | – |
| 银行存款和清算备付金合计 | 334,196,223.99 | 3.84% |
| 其他资产 | 55,873,677.23 | 0.64% |
| 合计 | 8,698,338,751.39 | 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 | – | – |
| B | 采掘业 | 337,878,176.26 | 3.97% |
| C | 制造业 | 2,121,115,599.89 | 24.92% |
| C0 | 其中：食品、饮料 | 265,508,084.35 | 3.12% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 136,224,696.42 | 1.60% |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 211,315,160.54 | 2.48% |
| C5 | 电子 | – | – |
| C6 | 金属、非金属 | 1,087,782,405.06 | 12.78% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 419,895,253.52 | 4.93% |
| C8 | 医药、生物制品 | – | – |
| C99 | 其他制造业 | 390,000.00 | 0.00% |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 665,044,564.82 | 7.81% |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 交通运输、仓储业 | 859,468,321.81 | 10.10% |
| G | 信息技术业 | 416,437,729.30 | 4.89% |
| H | 批发和零售贸易 | – | – |
| I | 金融、保险业 | 3,539,780,471.64 | 41.58% |
| J | 房地产业 | 124,804,803.72 | 1.47% |
| K | 社会服务业 | – | – |
| L | 传播与文化产业 | 91,887,438.37 | 1.08% |
| M | 综合类 | 148,343,838.36 | 1.74% |
| | 合计 | 8,304,760,944.17 | 97.55% |

（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 | 600036 | 招商银行 | 19,446,911 | 744,233,283.97 | 8.74% |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 13,344,739 | 700,598,797.50 | 8.23% |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 33,716,786 | 533,062,386.66 | 6.26% |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 4,378,184 | 423,414,174.64 | 4.97% |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 3,094,126 | 417,552,303.70 | 4.90% |
| 6 | 600019 | 宝钢股份 | 21,584,374 | 392,619,763.06 | 4.61% |
| 7 | 600050 | 中国联通 | 33,493,823 | 312,832,306.82 | 3.67% |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 14,362,832 | 277,489,914.24 | 3.26% |
| 9 | 601600 | 中国铝业 | 5,715,050 | 272,893,637.50 | 3.21% |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 14,064,330 | 266,378,410.20 | 3.13% |

（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 | – | – |
| 2 | 金 融 债 | – | – |
| 3 | 央行票据 | – | – |
| 4 | 企 业 债 | – | – |
| 5 | 可 转 债 | 3,507,906.00 | 0.04% |
| | 合　计 | 3,507,906.00 | 0.04% |

（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 | 中海转债 | 3,507,906.00 | 0.04% |
| 2 | – | – | – |
| 3 | – | – | – |
| 4 | – | – | – |
| 5 | – | – | – |

（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、本报告期基金的其他资产构成

单位：元

| | |
|---|---|
| 其他应收款 | 50,309,496.00 |
| 应收证券清算款 | 5,231,218.90 |
| 存出保证金 | 250,000.00 |
| 应收利息 | 82,962.33 |
| 合计 | 55,873,677.23 |

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

本基金本报告期内未获得权证。

六、开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 期初基金份额总额 | 2,066,566,757 |
| 报告期间基金总申购份额 | 1,546,000,000 |
| 报告期间基金总赎回份额 | 1,587,000,000 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,025,566,757 |

七、基金管理人简介

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、深圳和成都设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、中国内地首只 ETF 基金管理人及国内首批 QDII 基金管理人。华夏基金还是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 3 季度末，华夏基金管理资产规模超过 2000 亿元，累计分红超过 230 亿元，是国内基金业管理资产规模最大的基金公司之一，也是为投资人分红最多的基金公司之一。

目前，华夏基金旗下共管理着 17 只证券投资基金，1 只亚洲债券独立组合以及多只全国社保基金投资组合和企业年金投资组合。从低风险的货币市场基金到高收益的股票型基金，华夏基金已经初步建立了完善的产品线，可以满足各类风险偏好投资者的需求，是国内管理基金数目最多的基金管理公司之一。

华夏基金始终坚持维护基金份额持有人利益，不断提高客户服务水平。今年3季度：

● 华夏基金继续通过增加软硬件系统投入、扩充服务人员等手段，努力为客户提供稳定的人工电话服务、便捷的自助电话、网站服务、短信服务等全方位服务，并新推出电子对账单服务和净值短信订制服务，进一步提高了自助服务水平。

● 华夏基金网上交易目前可支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发卡、招行卡、浦发卡/活期账户一本通、ChinaPay CD卡等多种银行卡支付，方便投资人进行网上交易。

为帮助投资人培养健康、理性的基金投资观念，华夏基金在投资者理财服务方面做了大量工作，今年3季度：

● 华夏基金继续举办“华夏基金理财大讲堂”、“华夏基金理财365”等投资者教育系列活动。

● 中秋佳节之际，华夏基金特举办中秋团拜暨投资者教育报告会，在传递中秋祝福的同时，与广大投资人分享了国内外资本市场的发展及投资机会。

● 为满足投资人对海外投资知识的渴求，华夏基金在公司网站进一步丰富了与基金投资有关的理财服务内容，特别是开辟了QDII专区。同时在多家报纸开辟《QDII专栏》，以帮助投资者了解海外投资。

今年以来，华夏基金荣获多家权威机构评选的多种奖项：

● 2007年1月，在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中，华夏基金获“2006年度十大金牛基金公司奖”。

● 2007年1月26日，华夏基金获得由《21世纪经济报道》评选的“中国基金管理公司综合实力奖”。

● 2007年1月27日，公司获得由和讯网评选出的“2006年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006年度中国基金业杰出创新奖”。

● 2007年2月，在香港《亚洲资产管理》杂志2006年评选活动中，华夏基金获得了“亚洲地区最佳客户服务奖”及“中国最佳社会服务奖”。

● 2007年4月，在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选”活动中，成为唯一一家荣获“中国最佳基金公司TOP大奖”的基金管理公司。

● 2007年5月，在《证券时报》2006年度明星基金评选中获得“明星基金管理公司奖”。

● 2007年8月，在《中国证券报》评选的“2006年度投资者关系管理表现最佳单项奖”中，华夏基金获得“最佳机构投资人奖”。

八、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和 / 或基金托管人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人和 / 或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇〇七年十月二十五日

---

# 华夏现金增利证券投资基金

## 2007年第三季度报告

一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 10 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2007 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称: | 华夏现金增利 |
| 基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2004年4月7日 |
| 报告期末基金份额总额: | 7,555,132,272.54 份 |
| 投资目标: | 在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的较高收益。 |
| 投资策略: | 积极判断短期利率变动，合理安排期限，细致研究，谨慎操作，以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。 |
| 业绩比较基准: | 本基金的业绩比较基准为“一年定期存款利率（税后）”。 |
| 风险收益特征: | 本基金属于证券投资基金中低风险的品种，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。 |
| 基金管理人: | 华夏基金管理有限公司 |
| 基金托管人: | 中国建设银行股份有限公司 |

三、主要财务指标和基金净值表现

本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。按日结转基金份额。

（一）主要财务指标

| | |
|---|---|
| 本期利润 | 95,019,311.82 元 |
| 期末基金资产净值 | 7,555,132,272.54 元 |

注：2007 年 7 月 1 日基金实施《企业会计准则》后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润”。

（二）本报告期基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

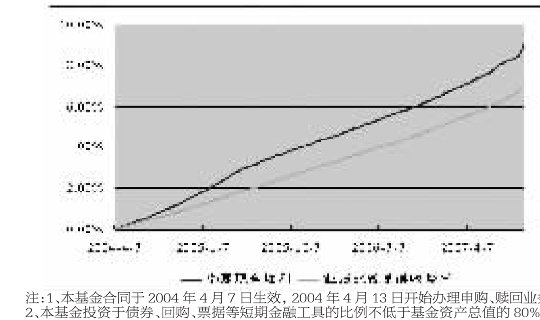
| 阶段 | 基金净值收益率① | 基金净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.1586% | 0.0106% | 0.7656% | 0.0013% | 0.3930% | 0.0093% |

（三）自基金合同生效以来基金累计净值收益率的变动情况，并与同期业绩比较基准收益率的变动的比较

华夏现金增利证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004 年 4 月 7 日至 2007 年 9 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2004 年 4 月 7 日生效，2004 年 4 月 13 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资于债券、回购、票据等短期金融工具的比例不低于基金资产总值的 80%；与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；投资组合的平均剩余期限不超过 180 天；法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。本基金按规定在合同生效后三个月内达到上述规定的投资比例。

四、管理人报告

1、基金经理简介

基金经理：韩会永先生，经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000 年加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部副总经理、基金经理助理、华夏现金增利证券投资基金基金经理（2005 年 4 月至 2006 年 1 月期间）。现任固定收益部副总经理、华夏债券投资基金基金经理（2004 年 2 月起任职），华夏现金增利证券投资基金基金经理（2007 年 1 月起任职）。

基金经理助理：曲波先生，清华大学经济学学士。2003 年加入华夏基金管理有限公司，曾任交易管理部交易员。现任华夏现金增利证券投资基金基金经理助理（2006 年 10 月起任职）；

2、本报告期内，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。报告期内，因基金规模变动导致本基金于个别交易日债券融资回购余额占基金净值比例高于 20%；个别交易日持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计超过当日基金资产净值的 20%，上述指标已于合理期限内调整，未违反法律法规及基金合同的规定，也未对基金份额持有人利益造成实际影响。

3、报告期内的业绩表现和投资策略

（1）本基金业绩表现

截至 2007 年 9 月 30 日，基金七日年化收益率达到了 12.199%，季度总回报率为 1.1586%，折年收益率超越业绩比较基准——一年期人民币定期存款税后收益率约 1.87 个百分点。

（2）行情回顾及运作分析

2007 年 3 季度，货币市场利率经历了先降后升的过程，9 月份大盘新股的连续发行、央行加息、提高法定存款准备金率及发行定向票据使得市场资金面非常紧张，回购利率大幅上升，继续呈随大盘新股发行而高波动的特点；同时，伴随央行加息及新股市场低风险收益率的高企，央行票据、短期融资券等短期债券资产的利率也逐步走高。

华夏现金增利基金在本季度保持了相对较短久期，在一定程度上规避了利率上升的不利影响。同时，针对回购利率波动有所加大的特点，华夏现金增利基金对新股发行等短期流动性冲击进行了提前安排，利用交易所回购利率上升的时机，进行了逆回购和跨市场套利操作。

（3）市场展望和投资策略

2007 年 4 季度，货币市场仍然会受到大盘新股发行、央行可能加息及实施其他紧缩性政策、银行贷款增长放缓的多重影响。我们将继续保持资产的流动性，根据不同投资品种的利率变动趋势，合理配置资产，综合运用各种套利策略，在大盘新股发行之前以及升息预期偏强时保持组合低久期，重点通过回购市场提高收益，在信贷收缩、加息预期下降以及大盘新股发行减少后，适当提高组合久期，提高组合的静态收益率。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，华夏现金增利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。

五、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

| 资产组合 | 金额（元） | 占总资产比例 |
|---|---|---|
| 债券 | 5,387,838,383.73 | 70.40% |
| 资产支持证券 | 55,199,135.08 | 0.72% |
| 买入返售证券 | 1,620,900,000.00 | 21.18% |
| 其中：买断式回购的买入返售证券 | – | – |
| 银行存款和清算备付金合计 | 434,047,576.09 | 5.67% |
| 其他资产 | 155,247,566.64 | 2.03% |
| 合计 | 7,653,232,661.54 | 100.00% |

（二）报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项　目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 90,695,061,653.85 | 11.61% |
| | 其中：买断式回购融资 | – | – |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 89,999,745.00 | 1.19% |
| | 其中：买断式回购融资 | – | – |

报告期内债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值的比例 | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2007–7–2 | 23.52% | 大额赎回 | 4个工作日 |
| 2 | 2007–7–3 | 23.26% | 大额赎回 | 3个工作日 |
| 3 | 2007–7–4 | 23.12% | 大额赎回 | 2个工作日 |
| 4 | 2007–7–5 | 22.89% | 大额赎回 | 1个工作日 |

（三）基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

| 项　目 | 天　数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 137 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 172 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 75 |

报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 | 各期限负债占基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 28.27% | 1.19% |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.65% | – |
| 2 | 30天(含)—60 天 | 14.76% | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.11% | – |
| 3 | 60天(含)—90 天 | 7.22% | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.62% | – |
| 4 | 90天(含)—180 天 | 12.72% | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 4.06% | – |
| 5 | 180天(含)—397 天（含） | 37.60% | – |
| | 合　计 | 100.58% | 1.19% |

（四）报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 成本（元） | 占基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 金融债券 | 846,117,138.67 | 11.20% |
| | 其中：政策性金融债 | 746,594,779.06 | 9.88% |
| 3 | 央行票据 | 506,009,777.75 | 6.70% |
| 4 | 企业债券 | 4,035,711,467.31 | 53.42% |
| | 合　计 | 5,387,838,383.73 | 71.31% |
| | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 824,060,662.27 | 10.91% |

2、基金投资前十名债券明细

| 序号 | 债券名称 | 债券数量(张) | | 成本(元) | 占基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 自有投资 | 买断式回购 | | |
| 1 | 07央行票据 81 | 4,000,000 | – | 389,303,376.03 | 5.15% |
| 2 | 04国开 17 | 3,300,000 | – | 329,274,771.35 | 4.36% |
| 3 | 07闽高速 CP02 | 2,400,000 | – | 240,367,689.22 | 3.18% |
| 4 | 07澜沧江 CP01 | 2,200,000 | – | 220,715,055.03 | 2.92% |
| 5 | 07首钢 CP01 | 2,100,000 | – | 210,992,365.03 | 2.79% |
| 6 | 05首都机场债 | 2,000,000 | – | 207,181,675.66 | 2.74% |
| 7 | 07浙交投 CP02 | 2,100,000 | – | 207,000,761.87 | 2.74% |
| 8 | 07大唐 CP01 | 2,000,000 | – | 200,139,217.78 | 2.65% |
| 9 | 07太不锈 CP02 | 2,000,000 | – | 200,000,000.00 | 2.65% |
| 10 | 05国开 07 | 2,000,000 | – | 198,077,065.08 | 2.62% |

（五）“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项　目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25%（含）–0.5% 间的次数 | 1次 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.26% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.01% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.10% |

（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

| 序号 | 资产支持证券品种 | 市值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 澜电 03 | 40,198,989.44 | 0.53% |
| 2 | 网通 04 | 15,000,145.64 | 0.20% |
| 3 | – | – | – |
| 4 | – | – | – |
| 5 | – | – | – |
| 6 | – | – | – |
| 7 | – | – | – |
| 8 | – | – | – |
| 9 | – | – | – |
| 10 | – | – | – |
| | 合　计 | 55,199,135.08 | 0.73% |

（七）投资组合报告附注

1、本基金的计价方法说明。

债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

货币市场基金存续期间，基金管理人应定期计算货币市场基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的（偏离度超过 0.5%），应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

2、本基金于 2007 年 8 月 31 日存在持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

3、本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

4、其他资产的构成

单位：元

| | |
|---|---|
| 应收证券清算款 | 100,875,000.00 |
| 应收利息 | 40,065,828.92 |
| 应收申购款 | 13,298,723.88 |
| 其他应收款 | 758,013.84 |
| 存出保证金 | 250,000.00 |
| 合计 | 155,247,566.64 |

六、开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 期初基金份额总额 | 9,643,079,778.75 |
| 报告期间基金总申购份额 | 13,825,248,636.39 |
| 报告期间基金总赎回份额 | 15,913,196,142.60 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,555,132,272.54 |

七、基金管理人简介

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、深圳和成都设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、中国内地首只 ETF 基金管理人及国内首批 QDII 基金管理人。华夏基金还是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 3 季度末，华夏基金管理资产规模超过 2000 亿元，累计分红超过 230 亿元，是国内基金业管理资产规模最大的基金公司之一，也是为投资人分红最多的基金公司之一。

目前，华夏基金旗下共管理着 17 只证券投资基金，1 只亚洲债券独立组合以及多只全国社保基金投资组合和企业年金投资组合。从低风险的货币市场基金到高收益的股票型基金，华夏基金已经初步建立了完善的产品线，可以满足各类风险偏好投资者的需求，是国内管理基金数目最多的基金管理公司之一。

华夏基金始终坚持维护基金份额持有人利益，不断提高客户服务水平。今年 3 季度：

● 华夏基金继续通过增加软硬件系统投入、扩充服务人员等手段，努力为客户提供稳定的人工电话服务、便捷的自助电话、网站服务、短信服务等全方位服务，并新推出电子对账单服务和净值短信订制服务，进一步提高了自助服务水平。

● 华夏基金网上交易目前可支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发卡、招行卡、浦发卡 / 活期账户一本通、ChinaPay CD 卡等多种银行卡支付，方便投资人进行网上交易。

为帮助投资人培养健康、理性的基金投资观念，华夏基金在投资者理财服务方面做了大量工作，今年 3 季度：

● 华夏基金继续举办“华夏基金理财大讲堂”、“华夏基金理财 365”等投资者教育系列活动。

● 中秋佳节之际，华夏基金特举办中秋团拜暨投资者教育报告会，在传递中秋祝福的同时，与广大投资人分享了国内外资本市场的发展及投资机会。

● 为满足投资人对海外投资知识的渴求，华夏基金在公司网站进一步丰富了与基金投资有关的理财服务内容，特别是开辟了 QDII 专区。同时在多家报纸开辟《QDII 专栏》，以帮助投资者了解海外投资。

今年以来，华夏基金荣获多家权威机构评选的多种奖项：

● 2007 年 1 月，在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中，华夏基金获“2006 年度十大金牛基金公司奖”。

● 2007 年 1 月 26 日，华夏基金获得由《21 世纪经济报道》评选的“中国基金管理公司综合实力奖”。

● 2007 年 1 月 27 日，公司获得由和讯网评选出的“2006 年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006 年度中国基金业杰出创新奖”。

● 2007 年 2 月，在香港《亚洲资产管理》杂志 2006 年评选活动中，华夏基金获得了“亚洲地区最佳客户服务奖”及“中国最佳社会服务奖”。

● 2007 年 4 月，在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选”活动中，成为唯一一家荣获“中国最佳基金公司 TOP 大奖”的基金管理公司。

● 2007 年 5 月，在《证券时报》2006 年度明星基金评选中获得“明星基金管理公司奖”。

● 2007 年 8 月，在《中国证券报》评选的“2006 年度投资者关系管理表现最佳单项奖”中，华夏基金获得“最佳机构投资人奖”。

八、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《华夏现金增利证券投资基金基金合同》；

3、《华夏现金增利证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和 / 或基金托管人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人和 / 或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇〇七年十月二十五日

---

# 华夏大盘精选证券投资基金

## 2007年第三季度报告

一、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。

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 10 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2007 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

二、基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称: | 华夏大盘精选 |
| 基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2004年 8 月 11 日 |
| 报告期末基金份额总额: | 826,843,868.04 份 |
| 投资目标: | 追求基金资产的长期增值 |
| 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调研，精选出业绩增长前景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，基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例，以避免市场系统性风险，保证基金所承担的风险水平合理。 |
| 业绩比较基准: | 本基金整体的业绩比较基准为“新华富时中国 A200 指数 ×80%+ 新华富时中国国债指数 ×20%”。 |
| 风险收益特征: | 本基金在证券投资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债券基金和混合基金，低于成长型股票基金。 |
| 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 |

三、主要财务指标和基金净值表现

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。

（一）主要财务指标

| | |
|---|---|
| 本期利润 | 1,942,099,946.47 元 |
| 本期利润扣减公允价值变动损益后的净额 | 1,564,036,604.79 元 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 2.3207 元 |
| 期末基金资产净值 | 5,798,318,112.21 元 |
| 期末基金份额净值 | 7.013 元 |

注：2007 年 7 月 1 日基金实施《企业会计准则》后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”= 本期利润扣减公允价值变动损益后的净额 /(本期利润 / 加权平均基金份额本期利润)。

（二）本报告期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

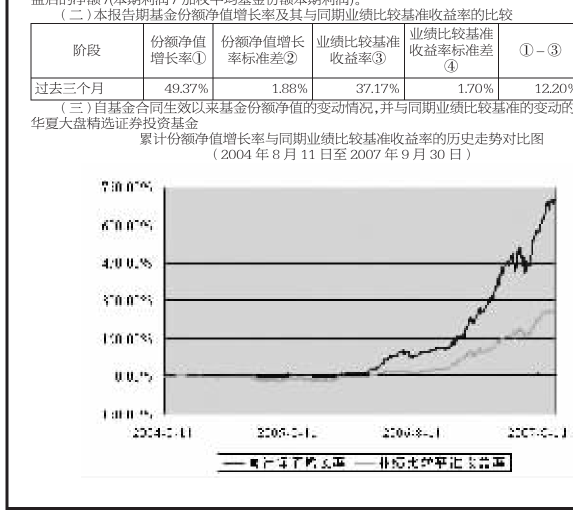
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 49.37% | 1.88% | 37.17% | 1.70% | 12.20% | 0.18% |

（三）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

华夏大盘精选证券投资基金

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004 年 8 月 11 日至 2007 年 9 月 30 日）



注：1、本基金合同于 2004 年 8 月 11 日生效，2004 年 9 月 15 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金主要投资于股票，股票资产比例范围为 40%~95%。为了满足投资者的赎回要求，基金保留的现金以及投资于到期日在 1 年以内的国债、政策性金融债、债券回购、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于 5%。本基金其余资产可投资于债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，如法律法规或监管部门对债券投资比例有相关规定的，则从其规定。本基金按规定在合同生效后三个月内达到上述规定的投资比例。

四、管理人报告

1、基金经理简介

王亚伟先生，经济学硕士。曾任中信国际合作公司业务经理，华夏证券有限公司研究经理。1998 年加入华夏基金管理有限公司，历任兴华证券投资基金基金经理助理、基金经理（1998 年 4 月至 2002 年 1 月期间），华夏成长证券投资基金基金经理（2001 年 12 月至 2005 年 4 月期间）。现任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（2005 年 12 月起任职）。

2、本报告期内，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。报告期内本基金持有的单只流通受限证券数量与在二级市场买入的该证券数量之和超过该证券流通股本的 5%。

3、报告期内的业绩表现和投资策略

（1）本基金业绩表现

截至 2007 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 7.013 元，本报告期份额净值增长率为 49.37%，同期业绩比较基准增长率为 37.17%。

（2）行情回顾及运作分析

经历了 2 季度的大幅震荡调整后，在超出预期的上市公司中期业绩以及持续流入的资金推动下，3 季度股票市场出现了几乎单边上涨的行情，但在指数不断创新高的同时，成交量却有所减少。虽然央行收缩流动性的力度不断加大，但在 CPI 不断走高、实际利率为负以及人民币持续升值的的背景下，资产价格上涨的局面难以逆转。具有资产注入题材的个股成为资金追逐的热点，周期性行业如煤炭、钢铁、有色、航空航运等表现突出。随着指数的上涨，市场的风险在不断积累。扣除投资收益后，上市公司的业绩增长并不足以支撑目前市场整体的高估值水平。美国次级债危机的爆发增加了未来世界经济增长的不确定性，也为金融体系防范风险提供了警示。华夏大盘精选基金在 3 季度降低了股票仓位，以控制系统性风险。

（3）市场展望和投资策略

4 季度市场面临诸多的不确定性。随着 QDII 产品的陆续推出，境内资金的投资渠道有所拓宽，对国内股市的资金构成分流。如果投资境外市场的财富效应显现，对国内股市将产生明显的抑制作用。股指期货的推出短期内将加剧市场的震荡，长期而言有助于促使市场整体估值向合理水平回归。投资策略上华夏大盘精选基金将着眼于在控制风险的基础上为明年的投资布局，选择未来成长性有望超出预期而估值合理的长线品种。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，华夏大盘精选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。

五、投资组合报告

（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 | 3,814,277,000.39 | 63.39% |
| 债券 | 289,074,513.60 | 4.80% |
| 权证 | – | – |
| 资产支持证券 | – | – |
| 银行存款和清算备付金合计 | 1,790,709,182.08 | 29.76% |
| 其他资产 | 123,082,846.39 | 2.05% |
| 合计 | 6,017,143,542.46 | 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 | 338,024,429.80 | 5.83% |
| B | 采掘业 | 272,310,386.72 | 4.70% |
| C | 制造业 | 1,655,148,424.83 | 28.55% |
| C0 | 其中：食品、饮料 | 20,837,602.88 | 0.36% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 40,553,843.28 | 0.70% |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | 105,981,758.56 | 1.83% |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 509,658,675.66 | 8.79% |
| C5 | 电子 | 2,629,841.88 | 0.05% |
| C6 | 金属、非金属 | 611,652,602.88 | 10.55% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 361,912,258.57 | 6.24% |
| C8 | 医药、生物制品 | 245,390.60 | 0.00% |
| C99 | 其他制造业 | 1,676,450.52 | 0.03% |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 191,114,032.00 | 3.30% |
| E | 建筑业 | 408,427.11 | 0.01% |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | 253,377,603.14 | 4.37% |
| H | 批发和零售贸易 | 157,944,931.74 | 2.72% |
| I | 金融、保险业 | 4,250,240.00 | 0.07% |
| J | 房地产业 | 578,027,120.54 | 9.97% |
| K | 社会服务业 | 231,124,404.51 | 3.99% |
| L | 传播与文化产业 | 112,827,000.00 | 1.95% |
| M | 综合类 | 19,720,000.00 | 0.34% |
| | 合计 | 3,814,277,000.39 | 65.78% |

（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 | 600598 | 北大荒 | 16,906,151 | 238,545,790.61 | 4.11% |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 10,957,388 | 207,532,928.72 | 3.58% |
| 3 | 600215 | 长春经开 | 15,713,898 | 194,066,640.30 | 3.35% |
| 4 | 000888 | 峨眉山 A | 10,724,411 | 181,349,790.01 | 3.13% |
| 5 | 000819 | 岳阳兴长 | 6,006,681 | 177,257,156.31 | 3.06% |
| 6 | 000877 | 天山股份 | 10,281,043 | 151,645,384.25 | 2.62% |
| 7 | 600823 | 世茂股份 | 4,200,000 | 120,078,000.00 | 2.07% |
| 8 | 600240 | 华业地产 | 7,005,940 | 117,489,613.80 | 2.03% |
| 9 | 600408 | 安泰集团 | 5,289,766 | 115,422,694.12 | 1.99% |
| 10 | 600067 | 冠城大通 | 4,809,584 | 109,225,652.64 | 1.88% |

（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 | 192,244,513.60 | 3.32% |
| 2 | 金 融 债 | – | – |
| 3 | 央行票据 | 96,830,000.00 | 1.67% |
| 4 | 企 业 债 | – | – |
| 5 | 可 转 债 | – | – |
| | 合　计 | 289,074,513.60 | 4.99% |

（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 | 20国债⑽ | 142,322,691.00 | 2.45% |
| 2 | 07央行票据 81 | 96,830,000.00 | 1.67% |
| 3 | 07国债 02 | 29,947,500.00 | 0.52% |
| 4 | 02国债⒁ | 14,803,122.60 | 0.26% |
| 5 | 21国债⑶ | 5,171,200.00 | 0.09% |

（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、本报告期基金的其他资产构成

单位：元

| | |
|---|---|
| 应收证券请算款 | 112,719,208.85 |
| 存出保证金 | 5,186,753.64 |
| 应收利息 | 5,176,883.90 |
| 合计 | 123,082,846.39 |

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

本基金本报告期内未获得权证。

六、开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 期初基金份额总额 | 847,628,013.94 |
| 报告期间基金总申购份额 | – |
| 报告期间基金总赎回份额 | 20,784,145.90 |
| 报告期末基金份额总额 | 826,843,868.04 |

七、基金管理人简介

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、深圳和成都设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、中国内地首只 ETF 基金管理人及国内首批 QDII 基金管理人。华夏基金还是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 3 季度末，华夏基金管理资产规模超过 2000 亿元，累计分红超过 230 亿元，是国内基金业管理资产规模最大的基金公司之一，也是为投资人分红最多的基金公司之一。

目前，华夏基金旗下共管理着 17 只证券投资基金，1 只亚洲债券独立组合以及多只全国社保基金投资组合和企业年金投资组合。从低风险的货币市场基金到高收益的股票型基金，华夏基金已经初步建立了完善的产品线，可以满足各类风险偏好投资者的需求，是国内管理基金数目最多的基金管理公司之一。

华夏基金始终坚持维护基金份额持有人利益，不断提高客户服务水平。今年 3 季度：

● 华夏基金继续通过增加软硬件系统投入、扩充服务人员等手段，努力为客户提供稳定的人工电话服务、便捷的自助电话、网站服务、短信服务等全方位服务，并新推出电子对账单服务和净值短信订制服务，进一步提高了自助服务水平。

● 华夏基金网上交易目前可支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发卡、招行卡、浦发卡 / 活期账户一本通、ChinaPay CD 卡等多种银行卡支付，方便投资人进行网上交易。

为帮助投资人培养健康、理性的基金投资观念，华夏基金在投资者理财服务方面做了大量工作，今年 3 季度：

● 华夏基金继续举办“华夏基金理财大讲堂”、“华夏基金理财 365”等投资者教育系列活动。

● 中秋佳节之际，华夏基金特举办中秋团拜暨投资者教育报告会，在传递中秋祝福的同时，与广大投资人分享了国内外资本市场的发展及投资机会。

● 为满足投资人对海外投资知识的渴求，华夏基金在公司网站进一步丰富了与基金投资有关的理财服务内容，特别是开辟了 QDII 专区。同时在多家报纸开辟《QDII 专栏》，以帮助投资者了解海外投资。

今年以来，华夏基金荣获多家权威机构评选的多种奖项：

● 2007 年 1 月，在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中，华夏基金获“2006 年度十大金牛基金公司奖”。

● 2007 年 1 月 26 日，华夏基金获得由《21 世纪经济报道》评选的“中国基金管理公司综合实力奖”。

● 2007 年 1 月 27 日，公司获得由和讯网评选出的“2006 年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006 年度中国基金业杰出创新奖”。

● 2007 年 2 月，在香港《亚洲资产管理》杂志 2006 年评选活动中，华夏基金获得了“亚洲地区最佳客户服务奖”及“中国最佳社会服务奖”。

● 2007 年 4 月，在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选”活动中，成为唯一一家荣获“中国最佳基金公司 TOP 大奖”的基金管理公司。

● 2007 年 5 月，在《证券时报》2006 年度明星基金评选中获得“明星基金管理公司奖”。

● 2007 年 8 月，在《中国证券报》评选的“2006 年度投资者关系管理表现最佳单项奖”中，华夏基金获得“最佳机构投资人奖”。

八、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《华夏大盘精选证券投资基金基金合同》；

3、《华夏大盘精选证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇〇七年十月二十五日