华夏债券投资基金

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:交通银行股份有限公司
2007年第2号

重要提示

华夏债券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]61号文批准公开发售。本基金基金合同于2002年10月23日正式生效。

基金管理人保证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。

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。

投资有风险,投资人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。

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10月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司,是经中国证监会证监基字[1998]16号文批准,于1998年4月9日成立的中国第一批基金管理公司之一。基本信息如下:

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
组织形式:有限责任公司
成立时间:1998年4月9日
注册资本:13800万元
存续期间:100年
客户服务电话:400-818-6666
传真:(010)88066511
联系人:廖为
股权结构:

持股单位	占总股本比例
中信证券股份有限公司	60.725%
西南证券有限责任公司	35.725%
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。曾任北京证券有限责任公司董事长、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。曾任北京证券有限责任公司资产保全部总经理,北京市财政局外事财务处处长。

王邦志先生:董事,硕士。曾任中国科技证券有限责任公司副总经理,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》、《基金法》3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公司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。现任太平洋证券股份有限公司党委书记。曾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。

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,高级经济师,学士。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。曾任北京证券有限公司投资银行部执行总经理、财务总监、华夏证券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总经理助理。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

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)。现任华夏债券基金经理(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:魏镇江先生,北京大学经济学硕士。2003年加入华夏基金管理有限公司,曾任华夏基金固定收益分析师,现任华夏债券基金经理助理(2007年1月起任职)。

本基金历任基金经理:2002年10月至2004年2月期间,朱爱林任基金经理。

3、本公司固定收益投资委员会成员:

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。
杨爱斌先生:华夏基金管理有限公司固定收益总监。
刘文动先生:华夏基金管理有限公司投资总监、共同担任兴安证券投资基金、兴华证券投资基金、华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)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

1、基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:蒋超良
住所:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:489.94亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:张咏东
电话:(021)68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行,自1987年重新组建以来,交通银行各项业务和机构建设持续健康发展,目前在我国143个大中城市设有分支行,全行员工近6万人。截至2007年6月末,资产总额为21358.80亿元人民币,实现净利润85.58亿元人民币。2005年6月23日,交通银行成功在香港主板市场上市,成为首家在境外上市的内地商业银行。2007年5月15日,交通银行成功在上海证券交易所上市。2006年,由世界品牌实验室(WBL)举办的2006年第三届《Brand China品牌中国》大型调查的调查结果,交通银行再次蝉联"中国品牌年度大奖(No.1)"(银行类),同时荣获2006年"中国最具影响力品牌"(TOP 10)(银行类)排名第二,并获得2006年"中国十大诚信品牌"(唯一入选银行)。英国《银行家》杂志公布的2007年全球1000家银行的最新排名中,按一级资本排序,交行列第68位;按总资产排序,交行的排名则从去年的第73位上升到第69位。

交通银行总行设资产托管部,现有员工80余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

李军先生,交通银行行长,华中理工大学经济学硕士,高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长,交通银行总稽核、董事、常务董事、执行董事、副行长;2006年9月担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士,交通银行资产托管部副总经理,主持工作。大学学历,经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长;2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理,2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止2007年6月末,交通银行共托管证券投资基金36只,包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、科瑞基金、华安创新基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、泰达荷银合丰系列基金(成长、周期、稳定)、鹏华普天系列基金(债券、收益)、海富通精选基金、博时现金收益基金、易方达50指数基金、融通行业景气基金、鹏华中国50基金、金鹰中小盘精选基金、富国天益价值基金、华安宝利基金、中海优质成长基金、银河银富货币市场基金、银华货币市场基金、泰达荷银预算风险基金、万家公用事业基金、天治核心成长基金、汇丰晋信2016生命周期基金、巨田货币市场基金、汇丰晋信龙腾基金、长城久富核心成长基金、汇丰晋信动态策略基金、华夏蓝筹核心基金。此外,还托管了包括全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金等11类产品。托管资产规模近两千亿元。

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
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-88066511
联系人:吴志军

2、代销机构:

(1)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
法定代表人:蒋超良
客户服务电话:95559
传真:(021)58408483
联系人:曹榕

(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)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、(0755)82090817
联系人:朱虹、刘薇

(4)上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:(021)61618888
传真:(021)63602431
联系人:徐伟、汤嘉惠

(5)深圳发展银行股份有限公司
住所:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼
电话:(0755)82088888
传真:(0755)82080714
联系人:周勤

(6) 中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所:北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:陶礼明
电话:11185
传真:(010) 66415194
联系人:陈春林

(7)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

(8)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:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌

(9)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:张佑君
电话:400-8888-108
传真:(010)65182261
联系人:权唐

(10)海通证券股份有限公司
住所:上海淮海中路98号
办公地址:上海淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)23219000
传真:(021)53858549
联系人:金芸、李笑鸣

(11)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

(12)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

(13)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

(14)中国银河证券股份有限公司
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:肖时庆
电话:800-820-1868
传真:(010)66568536
联系人:李洋

(15)长江证券有限责任公司
住所:湖北省武汉市江汉区新华下路特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:(021)63219781
传真:(021)51062920
联系人:李良

(16)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:丁国荣
电话:(021)54033888
传真:(021)54030294
联系人;李清怡

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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)84457777-893
传真:(025)84579879
联系人:程高峰

(21)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
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)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:林建闽

(22)天同证券有限责任公司
住所:山东省济南市泉城路180号齐鲁国际大厦5层
办公地址:济南市泉城路180号齐鲁国际大厦5层
法定代表人:段虎
电话:(0531)5689690
传真:(0531)5689900
联系人:罗海涛

(23)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

(24)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
联系人:黄健

(25)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
联系电话:(0351)8686766、(0351)8686708
传真:(0351)8686709
联系人:张治国

(26)东方证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区浦东大道720号20楼
办公地址:上海市巨鹿路756号
法定代表人:王益民
电话:(021)58550028
传真:(021)50366868
联系人:盛云

(27)安信证券股份有限公司
住所: 深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址: 北京市西城区金融街28号院盈泰中心二号楼三层
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)23982913
传真:(0755)23982970
联系人:张茜萍

(28)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

(29)长城证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:魏云鹏
电话:(0755)83516094
传真:(0755)83516199
联系人:高峰

(30)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:钟康鶯

(31)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

(32)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、(0510)82588168
传真:(0510)82831589
联系人:袁丽萍

(33)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

(34)东北证券有限责任公司
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、(0431)5096733
传真:(0431)5680032
联系人:高新宇

(35)金元证券股份有限公司
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:陆涛
电话:(0755)83025666
传真:(0755)83025625
联系人:金春

(36)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)83025046
传真:(0755)83025991
联系人:张有德

(37)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)81283728
传真:(0531)81283735
联系人:傅咏梅

(38)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) 37865026
传真:(020) 38765054
联系人:李俊

(39)中信金通证券有限责任公司
住所:杭州市中河南路11号万凯商务楼A座
办公地址:杭州市中河南路11号万凯商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:(0571) 85783750
传真:(0571) 85783771
联系人:龚晓军

(40)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

(41)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
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
传真:(0755)82400862
联系人:袁月

(42)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

(43)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:郑国强

(44)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

(45)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) 25832494
传真:(0755) 25831718
联系人:王立洲

(46) 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:(0769)22119426
传真:(0769)22119423
联系人:张建平

(47)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)65585670
传真:(0371)65585670
联系人:陈利民

(48) 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:(0551)2207936
传真:(0551)2634400-1171
联系人: 程维

(49)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)28451861
传真:(022)28451892
联系人:王兆权

(50)东海证券有限责任公司
住所:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
电话:(021)50586660
传真:(021)50586660-8880
联系人:邵一明

(51)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
法人代表:林义相
电话:(010)84533151-822
传真:(010)84533162
联系人:陈少震

(52)国盛证券有限责任公司
住所:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
电话:(0791)6285337
传真:(0791)6289395
联系人:徐美云

(53)上海证券有限责任公司
住所:上海市九江路111号
办公地址:上海市临平北路19号
法定代表人:蒋元真
电话:(021)65081063
传真:(021)65081069
联系人:谢秀峰

(54)德邦证券有限责任公司
住所:沈阳市沈河区小西路49号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路588号浦发大厦26楼
法定代表人:王军
电话:(021)68590808
传真:(021)68596077
联系人:罗芳

(55)华林证券有限责任公司
住所:广东省江门市港口路1号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼
法定代表人:姚桥盛
电话:(0755)82707855
传真:(0755)82707850
联系人:杨玲

(56)新时代证券有限责任公司
住所:北京市海淀区成府路方正大厦
办公地址:北京市西城区月坛大厦15层
法定代表人:李文义
电话:(010)68083578
传真:(010)68084986
联系人:秦予

(57)西部证券股份有限公司
住所:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:(029)87406172
传真:(029)87406387
联系人:黄晓军

(58) 大同证券经纪有限责任公司
住所:山西省大同市大北街13号
办公地址:山西省太原市青年路8号
法定代表人:董祥
电话:(0351) 4167056
传真:(0351) 4192803
联系人:苏妮

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

(二)注册登记机构: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)88066566
联系人:毛伟

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
法定代表人:王立华
电话:(010)88092188
传真:(010)88092150
联系人:杨科
经办律师:吴冠雄、刘艳

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区东昌路568号
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:Kent Watson
电话:(021)61238888
传真:(021)63863300
联系人:陈兆欣
经办注册会计师:汪棣、王鸣宇

四、基金的名称

本基金名称:华夏债券投资基金。

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

本基金的投资目标:在强调本金安全的前提下,追求较高的当期收入和总回报。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、资产支持证券等债券,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有因可转债转股所形成的股票以及股票派发或可分离交易可转债分离交易的权证等资产,但非固定收益类金融工具投资比例合计不超过基金资产的20%。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的60个交易日内卖出。基金不通过二级市场买入股票或权证。此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些积极投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。

1、久期偏离是根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。

2、收益率曲线配置是在确定组合或类属久期后,确定采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3、类属配置包括现金、各市场债券及各债券种类间的配置。类属配置主要根据各部分的相对投资价值确定,增持相对低估、价格将上升的类属,减持相对高估、价格将下降的类属,借以取得较高的总回报。

组合构建与调整是自上而下确定投资策略和自下而上个券选择相互结合的过程。在研究、决策、组合构建与调整过程中,我们重视对投资风险的管理。我们运用结构化、严格的方法管理风险,通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标,将组合的风险控制在合理的水平。风险报告与业绩分析则为基金经理把握投资风险、了解投资策略的效果提供了支持和独立的视角。在此基础上,通过各种积极投资策略的实施,有意识地承担有价值的风险,追求组合较高的回报。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩评价基准设定为 "53%中信标普银行间债券指数+46%中信标普国债指数+1%中信标普企业债指数"。

本基金业绩评价基准自基金合同生效后由基金管理人每半年审核一次,如所用基准不再符合本基金的投资政策和投资目标,将对其进行调整,新基准在最新的招募说明书中列示。在更具代表性的新债券市场指数推出、债券市场发生重大变动等情况下,本基金管理人还可根据投资目标和投资政策,临时确定变更基准指数,并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中相对低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金和平衡型基金,高于货币市场基金。

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。

基金托管人交通银行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。

本投资组合报告所载数据截至2007年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	401,988,859.91	5.37%
债券	4,935,409,652.81	65.90%
权证	-	-
资产支持证券	180,790,874.57	2.41%
银行存款和清算备付金合计	1,885,129,693.40	25.17%
其他资产	86,058,885.40	1.15%
合计	7,489,377,966.09	100.00%

2、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	141,821,880.00	2.37%
C	制造业	88,706,869.35	1.48%
C0	其中:食品、饮料	1,490,418.07	0.02%
C1	纺织、服装、皮毛	1,193,843.28	0.02%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,755,095.46	0.08%
C5	电子	3,490,308.98	0.06%
C6	金属、非金属	69,262,950.71	1.16%
C7	机械、设备、仪表	6,592,411.73	0.11%
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	-	-
E	建筑业	1,360,314.41	0.02%
F	交通运输、仓储业	139,686,000.00	2.33%
G	信息技术业	2,067,070.43	0.03%
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	23,907,600.00	0.40%
J	房地产业	1,831,900.00	0.03%
K	社会服务业	2,607,225.72	0.04%
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	401,988,859.91	6.71%

3、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	601919	中国远洋	3,100,000	139,686,000.00	2.33%
2	601088	中国神华	2,942,000	108,824,580.00	1.82%
3	000717	韶钢松山	4,794,657	64,248,403.80	1.07%
4	601808	中海油服	827,000	32,997,300.00	0.55%
5	002142	宁波银行	1,044,000	23,907,600.00	0.40%
6	002172	澳洋科技	60,403	2,851,021.60	0.05%
7	002140	东华科技	23,421	2,607,225.72	0.04%
8	002152	广电运通	28,275	2,233,159.50	0.04%
9	002146	荣盛发展	52,340	1,831,900.00	0.03%
10	002171	精诚铜业	46,723	1,689,970.91	0.03%

4、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	1,580,321,115.80	26.38%
2	金融债	1,411,713,000.00	23.57%
3	企业债	933,167,914.58	15.58%
4	央行票据	931,688,000.00	15.55%
5	可转债	78,519,622.43	1.31%
	合　计	4,935,409,652.81	82.39%

3、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	05国债⒁	544,722,750.00	9.09%
2	07央行票据18	349,668,000.00	5.84%
3	07国债02	299,725,000.00	5.00%
4	05中行02浮	258,180,000.00	4.31%
5	07国债14	247,425,000.00	4.13%

4、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	网通09	109,284,604.93	1.82%
2	浦建收益	22,185,135.09	0.37%
3	澜电01	20,029,584.66	0.33%
4	天电收益	19,292,522.74	0.32%
5	宁建04	9,999,027.15	0.17%
6	-	-	-
7	-	-	-
8	-	-	-
9	-	-	-
10	-	-	-
	合　计	180,790,874.57	3.02%

5、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)基金的其他资产构成

单位:元

应收利息	47,339,847.36
应收申购款	36,534,942.91
应收证券清算款	1,685,498.67
存出保证金	423,596.46
其他	75,000.00
合计	86,058,885.40

(3)持有的处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市值(元)	占净值比例
128031	巨轮转债	23,475,810.75	0.39%
100236	桂冠转债	19,377,320.00	0.32%
110232	金鹰转债	12,615,000.00	0.21%

(4)报告期内获得的权证

本基金本报告期内未获得权证。

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

1、华夏债券(A/B类)

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
2002年10月23日至2002年12月31日	0.60%	0.03%	0.17%	0.11%	0.43%	-0.08%
2003年1月1日至2003年12月31日	2.71%	0.08%	-0.40%	0.10%	3.11%	-0.02%
2004年1月1日至2004年12月31日	-1.55%	0.18%	-1.78%	0.13%	0.23%	0.05%
2005年1月1日至2005年12月31日	9.07%	0.14%	10.53%	0.08%	-1.46%	0.06%
2006年1月1日至2006年12月31日	10.45%	0.11%	2.36%	0.05%	8.09%	0.06%
2007年1月1日至2007年6月30日	7.84%	0.17%	-2.11%	0.06%	9.95%	0.11%
2007年7月1日至2007年9月30日	4.72%	0.15%	0.52%	0.07%	4.20%	0.08%

2、华夏债券(C类)

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
2002年10月23日至2002年12月31日	0.60%	0.03%	0.17%	0.11%	0.43%	-0.08%
2003年1月1日至2003年12月31日	2.71%	0.08%	-0.40%	0.10%	3.11%	-0.02%
2004年1月1日至2004年12月31日	-1.55%	0.18%	-1.78%	0.13%	0.23%	0.05%
2005年1月1日至2005年12月31日	9.07%	0.14%	10.53%	0.08%	-1.46%	0.06%
2006年1月1日至2006年12月31日	10.15%	0.11%	2.36%	0.05%	7.79%	0.06%
2007年1月1日至2007年6月30日	7.67%	0.18%	-2.11%	0.06%	9.78%	0.12%
2007年7月1日至2007年9月30日	4.65%	0.14%	0.52%	0.07%	4.13%	0.07%

(下转D7版)