

华夏回报证券投资基金2007年年度报告摘要

(上接 D145) 本报告期内累计卖出价值超出期初基金净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期买入金额, 占期初基金资产净值比例, 本期卖出金额, 占期初基金资产净值比例. Lists top 20 stocks bought and sold.

3. 本报告期内买入股票的成本总额为 25,327,808,413.08 元; 卖出股票的收入总额为 20,174,010,408.78 元.

4. 本报告期内未持有债券品种的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例. Lists bond holdings.

(六) 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前五名债券明细

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例. Lists top 5 bonds by value.

(七) 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的所有资产支持证券明细

(八) 报告期末及报告期内权证明细

1. 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的所有权证明细

Table with columns: 序号, 权证名称, 市值(元), 占净值比例. Lists warrant holdings.

2. 报告期内获得的权证

Table with columns: 权证名称, 数量(份), 期末总成本, 占净值比例. Lists warrants acquired.

(九) 投资组合报告附注

1. 报告期内本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. 基金的其他资产构成

Table with columns: 类别, 期末余额, 占基金总资产比例. Lists other assets.

4. 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 债券名称, 债券面值, 市值, 占净值比例. Lists convertible bonds.

5. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

八、基金持有人户数及持有人结构

截至 2007 年 12 月 31 日华夏回报基金持有人情况如下:

(一) 持有人户数

Table with columns: 报告期末持有人户数, 基金份额总额, 占基金总资产比例.

(二) 持有人结构

Table with columns: 持有人类型, 持有份额, 基金份额比例, 占基金总资产比例.

(三) 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

Table with columns: 项目, 期末持有本基金基金份额(份), 占基金总资产比例(%).

九、开放式基金份额变动

Table with columns: 基金份额变动, 基金份额, 占基金总资产比例.

十、重大事件提示

(一) 本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

(三) 本报告期内,本基金托管人的托管资格原经核准设立并于 2007 年 11 月 27 日调任其他职务,目前由副托管人代行托管职责。

(四) 本报告期内涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(五) 本报告期内基金投资策略未发生重大变化。

(六) 本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

(七) 本基金收益分配情况: 本基金向截至 2007 年 1 月 12 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 1 月 18 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 1 月 22 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 1 月 29 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 1 月 31 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 2 月 7 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 2 月 12 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 3 月 9 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 3 月 13 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 4 月 16 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 4 月 20 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.279 元。

根据 2007 年 5 月 11 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 5 月 15 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.279 元。

根据 2007 年 6 月 6 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 8 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 1.224 元。

根据 2007 年 6 月 13 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 13 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.286 元。

根据 2007 年 6 月 16 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 20 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.612 元。

根据 2007 年 6 月 27 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 18 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.286 元。

根据 2007 年 7 月 5 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 7 月 9 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.612 元。

根据 2007 年 7 月 18 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 7 月 18 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.333 元。

根据 2007 年 8 月 2 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 8 月 27 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.333 元。

(上接 D147) 持有基金份额

(八) 关联方持有的基金份额

Table with columns: 关联方名称, 基金份额(份), 占基金总资产比例, 期末卖出(份), 占基金总资产比例.

本基金关联方在本报告期内将代机构投资者买入或卖出基金份额 0 股,申购金额为 0 元。

本基金关联方及基金管理人主要股东的控制机构在 2006 年度末持有本基金份额,华夏证券投资基金管理人在 2006 年度未持有基金份额。

6. 承诺事项引致本基金的潜在资产

(1) 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而未流通受限的证券

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 认购日期, 可流通日期, 承诺受限类型, 期末公允价值, 期末公允价值占基金总资产比例.

(三) 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前十名股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末公允价值, 占净值比例. Lists top 10 stocks by value.

注:投资者了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应登陆本基金管理人网站 www.ChinaAMC.com

(四) 报告期末买入价值超出期初基金净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期买入金额, 占期初基金资产净值比例, 本期卖出金额, 占期初基金资产净值比例.

3. 本报告期内买入股票的成本总额为 566,094,623.16 元; 卖出股票的收入总额为 401,329,620.89 元.

4. 本报告期内未持有债券品种的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例. Lists bond holdings.

(六) 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前五名债券明细

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例. Lists top 5 bonds by value.

(七) 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的所有资产支持证券明细

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例. Lists asset-backed securities.

(八) 报告期末及报告期内权证明细

1. 报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的所有权证明细

Table with columns: 序号, 权证名称, 市值(元), 占净值比例. Lists warrant holdings.

2. 报告期内获得的权证

Table with columns: 权证名称, 数量(份), 期末总成本, 占净值比例. Lists warrants acquired.

九、投资组合报告附注

1. 报告期内本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. 基金的其他资产构成

Table with columns: 类别, 期末余额, 占基金总资产比例. Lists other assets.

4. 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 债券名称, 债券面值, 市值, 占净值比例. Lists convertible bonds.

5. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

八、基金持有人户数及持有人结构

截至 2007 年 12 月 31 日华夏回报基金持有人情况如下:

(一) 持有人户数

Table with columns: 报告期末持有人户数, 基金份额总额, 占基金总资产比例.

(二) 持有人结构

Table with columns: 持有人类型, 持有份额, 基金份额比例, 占基金总资产比例.

(三) 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

Table with columns: 项目, 期末持有本基金基金份额(份), 占基金总资产比例(%).

九、开放式基金份额变动

Table with columns: 基金份额变动, 基金份额, 占基金总资产比例.

十、重大事件提示

(一) 本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

(三) 本报告期内,基金托管人的托管资格原经核准设立并于 2007 年 11 月 27 日调任其他职务,目前由副托管人代行托管职责。

(四) 本报告期内涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(五) 本报告期内基金投资策略未发生重大变化。

(六) 本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

(七) 本基金收益分配情况: 本基金向截至 2007 年 1 月 12 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 1 月 18 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 1 月 22 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 1 月 29 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 1 月 31 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 2 月 7 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 2 月 12 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 3 月 9 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 3 月 13 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.54 元。

根据 2007 年 4 月 16 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 4 月 20 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.279 元。

根据 2007 年 5 月 11 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 5 月 15 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.279 元。

根据 2007 年 6 月 6 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 8 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 1.224 元。

根据 2007 年 6 月 13 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 13 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.286 元。

根据 2007 年 6 月 16 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 20 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.612 元。

根据 2007 年 6 月 27 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 6 月 18 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.286 元。

根据 2007 年 7 月 5 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 7 月 9 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.612 元。

根据 2007 年 7 月 18 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 7 月 18 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.333 元。

根据 2007 年 8 月 2 日本基金的收益分配公告,本基金向截至 2007 年 8 月 27 日止在华夏基金管理公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额派发人民币 0.333 元。

理人有限公司登记在册的本基金全体持有人每 10 份基金份额分配人民币 304.00 元。

(八) 本基金报告年度支付给德勤华永会计师事务所有限责任公司的报酬为 85,000.00 元人民币,目前该事项已由董事会审议通过。

(九) 选择证券经纪商和托管机构的情况

为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

1. 经营行为规范,在过去一年内无重大违规行为;

2. 公司财务状况良好;

3. 有良好的内部控制制度,并能及时提供准确的资讯信息服务;

4. 有较强的研究能力,能及时、全面、提供深层次较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特点,提供专项研究报告;

5. 建立了完善的网上系统,能及时提供准确的资讯信息服务。

1. 对席位选择券商的研究服务进行评估

2. 对席位选择券商的研究服务进行评估

3. 对席位选择券商的研究服务进行评估

4. 对席位选择券商的研究服务进行评估

5. 对席位选择券商的研究服务进行评估

6. 对席位选择券商的研究服务进行评估

7. 对席位选择券商的研究服务进行评估

8. 对席位选择券商的研究服务进行评估

9. 对席位选择券商的研究服务进行评估

10. 对席位选择券商的研究服务进行评估

11. 对席位选择券商的研究服务进行评估

12. 对席位选择券商的研究服务进行评估

13. 对席位选择券商的研究服务进行评估

14. 对席位选择券商的研究服务进行评估

15. 对席位选择券商的研究服务进行评估

16. 对席位选择券商的研究服务进行评估

17. 对席位选择券商的研究服务进行评估

18. 对席位选择券商的研究服务进行评估

19. 对席位选择券商的研究服务进行评估

20. 对席位选择券商的研究服务进行评估

21. 对席位选择券商的研究服务进行评估

22. 对席位选择券商的研究服务进行评估

23. 对席位选择券商的研究服务进行评估

24. 对席位选择券商的研究服务进行评估

25. 对席位选择券商的研究服务进行评估

26. 对席位选择券商的研究服务进行评估

27. 对席位选择券商的研究服务进行评估

28. 对席位选择券商的研究服务进行评估

29. 对席位选择券商的研究服务进行评估

30. 对席位选择券商的研究服务进行评估

31. 对席位选择券商的研究服务进行评估

32. 对席位选择券商的研究服务进行评估

33. 对席位选择券商的研究服务进行评估

34. 对席位选择券商的研究服务进行评估

35. 对席位选择券商的研究服务进行评估

36. 对席位选择券商的研究服务进行评估

37. 对席位选择券商的研究服务进行评估

38. 对席位选择券商的研究服务进行评估

39. 对席位选择券商的研究服务进行评估

40. 对席位选择券商的研究服务进行评估

41. 对席位选择券商的研究服务进行评估

42. 对席位选择券商的研究服务进行评估

43. 对席位选择券商的研究服务进行评估

44. 对席位选择券商的研究服务进行评估

45. 对席位选择券商的研究服务进行评估

46. 对席位选择券商的研究服务进行评估

47. 对席位选择券商的研究服务进行评估

48. 对席位选择券商的研究服务进行评估

49. 对席位选择券商的研究服务进行评估

50. 对席位选择券商的研究服务进行评估

51. 对席位选择券商的研究服务进行评估

52. 对席位选择券商的研究服务进行评估

53. 对席位选择券商的研究服务进行评估

54. 对席位选择券商的研究服务进行评估

55. 对席位选择券商的研究服务进行评估

56. 对席位选择券商的研究服务进行评估

57. 对席位选择券商的研究服务进行评估

58. 对席位选择券商的研究服务进行评估

59. 对席位选择券商的研究服务进行评估

60. 对席位选择券商的研究服务进行评估

61. 对席位选择券商的研究服务进行评估

62. 对席位选择券商的研究服务进行评估

63. 对席位选择券商的研究服务进行评估

64. 对席位选择券商的研究服务进行评估

65. 对席位选择券商的研究服务进行评估

66. 对席位选择券商的研究服务进行评估

67. 对席位选择券商的研究服务进行评估

68. 对席位选择券商的研究服务进行评估

69. 对席位选择券商的研究服务进行评估

70. 对席位选择券商的研究服务进行评估

71. 对席位选择券商的研究服务进行评估

72. 对席位选择券商的研究服务进行评估

73. 对席位选择券商的研究服务进行评估

74. 对席位选择券商的研究服务进行评估

75. 对席位选择券商的研究服务进行评估

76. 对席位选择券商的研究服务进行评估

77. 对席位选择券商的研究服务进行评估

78. 对席位选择券商的研究服务进行评估

79. 对席位选择券商的研究服务进行评估

80. 对席位选择券商的研究服务进行评估

81. 对席位选择券商的研究服务进行评估

82. 对席位选择券商的研究服务进行评估

83. 对席位选择券商的研究服务进行评估

84. 对席位选择券商的研究服务进行评估

85. 对席位选择券商的研究服务进行评估

86. 对席位选择券商的研究服务进行评估

87. 对席位选择券商的研究服务进行评估

88. 对席位选择券商的研究服务进行评估

89. 对席位选择券商的研究服务进行评估

90. 对席位选择券商的研究服务进行评估

91. 对席位选择券商的研究服务进行评估

92. 对席位选择券商的研究服务进行评估

93. 对席位选择券商的研究服务进行评估

94. 对席位选择券商的研究服务进行评估