# 华夏希望债券型证券投资基金

## 【2009】第四季度报告

**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**
**报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日**

### §1 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2010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。

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2009年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华夏希望债券 | |
| 基金主代码 | 001011 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年3月10日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 6,737,704,620.58份 | |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报。 | |
| 投资策略 | 基金将坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求较高的当期收入和总回报。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为“中信标普全债指数”。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华夏希望债券A | 华夏希望债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 001011 | 001013 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 3,021,109,815.19份 | 3,716,594,805.39份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标　　单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月1日-2009年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 华夏希望债券A | 华夏希望债券C |
| 1.本期已实现收益 | 24,491,100.54 | 28,636,682.88 |
| 2.本期利润 | 124,856,503.20 | 159,581,211.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0417 | 0.0395 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,378,554,920.48 | 4,132,579,504.34 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.118 | 1.112 |

注：①所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。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现

3.2.1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

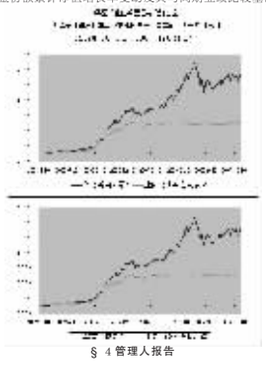
华夏希望债券A：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.56% | 0.31% | 0.36% | 0.04% | 3.20% | 0.27% |

华夏希望债券C：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.49% | 0.30% | 0.36% | 0.04% | 3.13% | 0.26% |

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



### §4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 韩会永 | 本基金的基金经理、固定收益副总监 | 2008-3-10 | - | 9年 | 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、华夏债券基金基金经理（2005年4月12日至2006年1月24日期间，2007年1月6日至2008年2月4日期间）。 |

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2不同投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金的业绩表现说明

截至2009年12月31日，华夏希望债券A基金份额净值为1.118元，本报告期份额净值增长率为3.56%；华夏希望债券C基金份额净值为1.112元，本报告期份额净值增长率为3.49%，同期业绩比较基准增长率为0.36%。

### §5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,475,101,369.69 | 16.63 |
| | 其中：股票 | 1,475,101,369.69 | 16.63 |
| 2 | 固定收益投资 | 6,253,972,465.13 | 70.52 |
| | 其中：债券 | 6,253,972,465.13 | 70.52 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 250,596,427.05 | 2.83 |
| 6 | 其他资产 | 888,586,175.75 | 10.02 |
| 7 | 合计 | 8,868,256,437.62 | 100.00 |

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 12,060,984.89 | 0.16 |
| B | 采掘业 | 95,623,838.54 | 1.27 |
| C | 制造业 | 572,427,268.77 | 7.62 |
| C0 | 食品、饮料 | 12,491,980.85 | 0.17 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,097,193.90 | 0.01 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 87,232,475.93 | 1.16 |
| C5 | 电子 | 21,008,892.70 | 0.28 |
| C6 | 金属、非金属 | 168,757,230.21 | 2.25 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 224,040,397.52 | 2.98 |
| C8 | 医药、生物制品 | 41,888,688.86 | 0.56 |
| C99 | 其他制造业 | 15,910,408.80 | 0.21 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,906,359.02 | 0.03 |
| E | 建筑业 | 1,646,904.40 | 0.02 |
| F | 交通运输、仓储业 | 8,689,973.93 | 0.12 |
| G | 信息技术业 | 81,173,976.48 | 1.08 |
| H | 批发和零售贸易 | 35,551,039.63 | 0.47 |
| I | 金融、保险业 | 633,712,124.84 | 8.44 |
| J | 房地产业 | 10,302,045.90 | 0.14 |
| K | 社会服务业 | 17,099,479.06 | 0.23 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 4,907,374.23 | 0.07 |
| | 合计 | 1,475,101,369.69 | 19.64 |

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 11,399,748 | 205,765,451.40 | 2.74 |
| 2 | 601988 | 中国银行 | 23,999,910 | 103,919,610.30 | 1.38 |
| 3 | 601328 | 交通银行 | 10,499,667 | 98,171,886.45 | 1.31 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 10,499,999 | 64,994,993.81 | 0.87 |
| 5 | 601299 | 中国北车 | 9,655,634 | 59,189,036.42 | 0.79 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 6,207,527 | 49,101,538.57 | 0.65 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 2,800,000 | 39,452,000.00 | 0.53 |
| 8 | 601989 | 中国重工 | 5,023,259 | 39,231,652.79 | 0.52 |
| 9 | 600000 | 浦发银行 | 1,749,980 | 37,957,066.20 | 0.51 |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 2,850,000 | 27,531,000.00 | 0.37 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 1,399,354,793.70 | 18.63 |
| 2 | 央行票据 | 552,060,000.00 | 7.35 |
| 3 | 金融债券 | 1,813,024,000.00 | 24.14 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,813,024,000.00 | 24.14 |
| 4 | 企业债券 | 2,284,795,315.54 | 30.42 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,060,000.00 | 0.80 |
| 6 | 可转债 | 144,678,355.89 | 1.93 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 6,253,972,465.13 | 83.26 |

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 090404 | 09农发04 | 7,000,000 | 699,230,000.00 | 9.31 |
| 2 | 020017 | 09贴债17 | 4,600,000 | 457,010,000.00 | 6.08 |
| 3 | 020016 | 09贴现国债16 | 3,000,000 | 296,760,000.00 | 3.95 |
| 4 | 0901048 | 09央行票据48 | 3,000,000 | 294,570,000.00 | 3.92 |
| 5 | 090021 | 09附息国债21 | 2,000,000 | 200,020,000.00 | 2.66 |

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,568,939.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | 818,376,119.94 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 59,100,930.87 |
| 5 | 应收申购款 | 9,540,185.71 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 888,586,175.75 |

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 125709 | 唐钢转债 | 76,443,055.95 | 1.02 |
| 2 | 110003 | 新钢转债 | 13,467,706.20 | 0.18 |
| 3 | 125960 | 锡业转债 | 4,117,130.60 | 0.05 |
| 4 | 110598 | 大荒转债 | 2,535,346.40 | 0.03 |
| 5 | 110567 | 山鹰转债 | 1,959,711.60 | 0.03 |

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601299 | 中国北车 | 59,189,036.42 | 0.79 | 新发流通受限 |
| 2 | 601989 | 中国重工 | 39,231,652.79 | 0.52 | 新发流通受限 |

5.8.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华夏希望债券A | 华夏希望债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,365,060,800.63 | 4,435,423,071.38 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 462,265,740.07 | 483,420,074.64 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 806,216,725.51 | 1,202,248,340.63 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,021,109,815.19 | 3,716,594,805.39 |

### §7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1报告期内披露的主要事项

2009年10月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告。

2009年12月21日发布华夏希望债券型证券投资基金第三次分红公告。

2009年12月29日发布华夏基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡基金网上交易定期定额申购业务的公告。

2009年12月29日发布华夏基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡网上交易的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告。

7.2其他相关信息

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，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、特定客户资产管理人以及境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至2009年12月31日，公司管理资产规模超过3000亿元，基金份额持有人户数超过1300万，是境内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理着2只封闭式基金、23只开放式基金、亚洲债券基金二期中国子基金及多只全国社保基金投资组合，公司已经被超过130家大中型企业确定为年金投资管理人，并被多家客户确定为特定客户资产管理人。

2009年4季度，华夏基金继续坚持“为信任奉献回报”的企业宗旨，将基金份额持有人利益放在首位，尽力为投资人创造满意的回报。截至2009年12月31日，在最星开放式基金业绩排行榜中，华夏基金旗下参与3年期评价的11只主动型开放式基金中，华夏优势增长股票、中信红利股票、华夏大盘精选混合、华夏红利混合、华夏回报混合、华夏回报二号混合等6只基金获得五星级评价，华夏成长混合、中信经典配置混合、华夏债券、中信稳定双利债券等4只基金获得四星级评价。

2009年4季度，华夏基金凭借良好的业绩、稳健的经营和优秀的品牌，连续获得多个奖项：

1、2009年10月，华夏基金荣获亚洲地区著名英文财经月刊《财资The?Asset》评选的2009年“3A投资奖”中的“中国最佳基金管理公司”奖项。

2、2009年10月，在新浪网主办的2009新浪金麒麟奖评选中，华夏基金荣获“2009年度最佳基金公司”奖项。

3、2009年11月，在“2009第一财经金融峰会暨2009第一财经金融价值榜”颁奖典礼上，华夏基金荣获年度金融机构(大奖)“年度基金公司”奖项。

### §8 备查文件目录

8.1备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

8.1.2《华夏希望债券型证券投资基金合同》；

8.1.3《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》；

8.1.4法律意见书；

8.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

8.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2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。

8.3查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人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**
**二〇一〇年一月二十一日**

# 华夏债券投资基金

## 【2009】第四季度报告

**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**
**报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日**

### §1 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010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。

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2009年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华夏债券 | |
| 基金主代码 | 001001 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2002年10月23日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,445,370,431.82份 | |
| 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。 | |
| 投资策略 | 本基金将在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上，通过价值分析，结合自上而下确定投资策略和自下而上个券选择的程序，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。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金整体的业绩比较基准为“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”。 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 华夏债券A/B | 华夏债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 001001、001002 | 001003 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 1,853,684,893.35份 | 2,591,685,538.47份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标　　单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月1日-2009年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 华夏债券A/B | 华夏债券C |
| 1.本期已实现收益 | 25,822,916.07 | 28,869,106.56 |
| 2.本期利润 | 52,240,184.59 | 58,270,406.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0236 | 0.0209 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,033,366,161.44 | 2,802,715,021.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.097 | 1.081 |

注：①所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。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现

3.2.1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

华夏债券A/B：

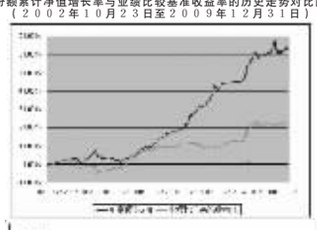
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.02% | 0.14% | 0.48% | 0.07% | 1.54% | 0.07% |

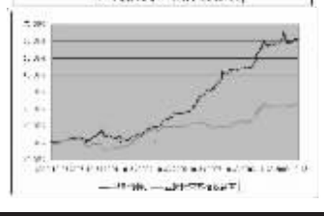
华夏债券C：

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.86% | 0.13% | 0.48% | 0.07% | 1.38% | 0.06% |

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**华夏债券投资基金**
**份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图**
**（2002年10月23日至2009年12月31日）**





### §4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 韩会永 | 本基金的基金经理、固定收益副总监 | 2004-2-27 | - | 9年 | 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12日至2006年1月24日期间，2007年1月6日至2008年2月4日期间）。 |

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2不同投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日，华夏债券A/B基金份额净值为1.097元，本报告期份额净值增长率为2.02%；华夏债券C基金份额净值为1.081元，本报告期份额净值增长率为1.86%，同期业绩比较基准增长率为0.48%。

### §5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 261,290,359.64 | 4.41 |
| | 其中：股票 | 261,290,359.64 | 4.41 |
| 2 | 固定收益投资 | 4,721,541,267.68 | 79.77 |
| | 其中：债券 | 4,704,218,664.39 | 79.48 |
| | 资产支持证券 | 17,322,603.29 | 0.29 |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 126,029,690.31 | 2.13 |
| 6 | 其他资产 | 809,727,608.15 | 13.68 |
| 7 | 合计 | 5,918,588,925.78 | 100.00 |

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,793,887.06 | 0.08 |
| B | 采掘业 | 1,791,828.00 | 0.04 |
| C | 制造业 | 107,988,920.76 | 2.23 |
| C0 | 食品、饮料 | 6,244,185.75 | 0.13 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 2,833,990.84 | 0.06 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 9,297,293.68 | 0.19 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 4,531,510.64 | 0.09 |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 5,959,881.09 | 0.12 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 72,553,532.62 | 1.50 |
| C8 | 医药、生物制品 | 6,568,526.14 | 0.14 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,906,359.02 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 99,238,799.68 | 2.05 |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 9,998,203.29 | 0.21 |
| H | 批发和零售贸易 | 4,478,307.75 | 0.09 |
| I | 金融、保险业 | 32,094,054.08 | 0.66 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 261,290,359.64 | 5.40 |

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601668 | 中国建筑 | 20,676,249 | 97,591,895.28 | 2.02 |
| 2 | 601788 | 光大证券 | 1,257,604 | 32,094,054.08 | 0.66 |
| 3 | 601299 | 中国北车 | 4,631,485 | 28,391,003.05 | 0.59 |
| 4 | 601989 | 中国重工 | 2,511,629 | 19,615,822.49 | 0.41 |
| 5 | 600312 | 平高电气 | 1,132,006 | 17,444,212.46 | 0.36 |
| 6 | 600567 | 山鹰纸业 | 1,179,245 | 7,075,470.00 | 0.15 |
| 7 | 300022 | 吉峰农机 | 73,717 | 4,478,307.75 | 0.09 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 33,407 | 3,808,063.93 | 0.08 |
| 9 | 300020 | 银江股份 | 79,601 | 3,182,447.98 | 0.07 |
| 10 | 300033 | 同花顺 | 43,177 | 3,059,522.22 | 0.06 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 819,073,641.60 | 16.94 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,258,357,000.00 | 26.02 |
| | 其中：政策性金融债 | 807,681,000.00 | 16.70 |
| 4 | 企业债券 | 2,144,513,649.04 | 44.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 49,955,000.00 | 1.03 |
| 6 | 可转债 | 432,319,373.75 | 8.94 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 4,704,218,664.39 | 97.27 |

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 050603 | 05中行02浮 | 4,100,000 | 410,656,000.00 | 8.49 |
| 2 | 010110 | 21国债(0) | 1,614,370 | 165,133,907.30 | 3.41 |
| 3 | 110003 | 新钢转债 | 1,130,000 | 155,465,400.00 | 3.21 |
| 4 | 126001 | 06马钢债 | 1,544,650 | 148,749,795.00 | 3.08 |
| 5 | 010112 | 21国债(2) | 1,400,880 | 143,660,244.00 | 2.97 |

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 119009 | 宁建04 | 180,000 | 17,322,603.29 | 0.36 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - | - |
| 8 | - | - | - | - | - |
| 9 | - | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - | - |

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 457,912.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 750,513,340.76 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 47,353,428.19 |
| 5 | 应收申购款 | 11,402,926.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 809,727,608.15 |

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110003 | 新钢转债 | 155,465,400.00 | 3.21 |
| 2 | 125709 | 唐钢转债 | 135,436,402.14 | 2.80 |
| 3 | 110598 | 大荒转债 | 53,903,810.80 | 1.11 |
| 4 | 125960 | 锡业转债 | 7,116,560.99 | 0.15 |
| 5 | 110567 | 山鹰转债 | 7,014,000.00 | 0.15 |
| 6 | 110078 | 澄星转债 | 1,293,212.90 | 0.03 |

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601299 | 中国北车 | 28,391,003.05 | 0.59 | 新发流通受限 |
| 2 | 601989 | 中国重工 | 19,615,822.49 | 0.41 | 新发流通受限 |
| 3 | 300022 | 吉峰农机 | 4,478,307.75 | 0.09 | 新发流通受限 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 3,808,063.93 | 0.08 | 新发流通受限 |
| 5 | 300020 | 银江股份 | 3,182,447.98 | 0.07 | 新发流通受限 |
| 6 | 300033 | 同花顺 | 3,059,522.22 | 0.06 | 新发流通受限 |

5.8.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华夏债券A/B | 华夏债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,864,917,780.31 | 3,032,688,655.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 223,970,503.41 | 436,260,089.89 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 1,235,203,390.37 | 877,263,206.58 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,853,684,893.35 | 2,591,685,538.47 |

### §7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1报告期内披露的主要事项

2009年10月23日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告。

2009年12月21日发布华夏债券投资基金第二十一次分红公告。

2009年12月29日发布华夏基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡基金网上交易定期定额申购业务的公告。

2009年12月29日发布华夏基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡网上交易的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告。

2009年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告。

7.2其他相关信息

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，在香港设有子公司。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、企业年金基金投资管理人、QDII基金管理人、特定客户资产管理人以及境内首只ETF基金管理人、境内唯一的亚债中国基金投资管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

截至2009年12月31日，公司管理资产规模超过3000亿元，基金份额持有人户数超过1300万，是境内管理基金资产规模最大的基金管理公司。公司管理着2只封闭式基金、23只开放式基金、亚洲债券基金二期中国子基金及多只全国社保基金投资组合，公司已经被超过130家大中型企业确定为年金投资管理人，并被多家客户确定为特定客户资产管理人。

2009年4季度，华夏基金继续坚持“为信任奉献回报”的企业宗旨，将基金份额持有人利益放在首位，尽力为投资人创造满意的回报。截至2009年12月31日，在最星开放式基金业绩排行榜中，华夏基金旗下参与3年期评价的11只主动型开放式基金中，华夏优势增长股票、中信红利股票、华夏大盘精选混合、华夏红利混合、华夏回报混合、华夏回报二号混合等6只基金获得五星级评价，华夏成长混合、中信经典配置混合、华夏债券、中信稳定双利债券等4只基金获得四星级评价。

2009年4季度，华夏基金凭借良好的业绩、稳健的经营和优秀的品牌，连续获得多个奖项：

1、2009年10月，华夏基金荣获亚洲地区著名英文财经月刊《财资The?Asset》评选的2009年“3A投资奖”中的“中国最佳基金管理公司”奖项。

2、2009年10月，在新浪网主办的2009新浪金麒麟奖评选中，华夏基金荣获“2009年度最佳基金公司”奖项。

3、2009年11月，在“2009第一财经金融峰会暨2009第一财经金融价值榜”颁奖典礼上，华夏基金荣获年度金融机构(大奖)“年度基金公司”奖项。

### §8 备查文件目录

8.1备查文件目录

8.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

8.1.2《华夏债券投资基金合同》；

8.1.3《华夏债券投资基金托管协议》；

8.1.4法律意见书；

8.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

8.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2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。

8.3查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人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**
**二〇一〇年一月二十一日**

# 华夏成长证券投资基金

## 【2009】第四季度报告

**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**
**报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日**

### §1 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2010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。

基金管理人承诺以