

(上接B025版)

客户服务电话:400-600-8008-95532
98)上海证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴光彪
传真:0755-82570586
联系人:李珍网址:www.sseiq.com
客户服务电话:400-102-1021
99)鹏扬同信证券有限责任公司
住所:拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市永和路118号东方企业园24号
法定代表人:崔绍君
电话:021-36533016
传真:021-36533017
联系人:王怡光
网址:www.sseec.com
客户服务电话:400-881-1177
400)日证券有限责任公司
住所:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔庆杰
电话:010-88068030-730、010-8806830-737
传真:010-66412537
联系人:陈希彬、朱晓光
网址:www.rzq.com.cn
客户服务电话:010-88068630
401)江证证券有限公司
住所:哈尔滨市香坊区香山路56号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙长智
电话:0451-82336863
传真:0451-82297211
联系人:张宇宏
网址:www.jhzq.com.cn
客户服务电话:400-666-2288
402)中国民族证券有限责任公司
住所:北京市西城区德胜门内大街6号2-9层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人:赵大建
电话:010-59355941
传真:010-66555791
联系人:李薇
网址:www.cn618.com
客户服务电话:400-889-5618
403)华证券有限责任公司
住所:上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址:上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人:陈林
电话:021-50122128
传真:021-50122398
联系人:徐方亮
网址:www.cnhlstock.com
客户服务电话:400-820-9898
404)厦门证券有限公司
住所:厦门市莲厝西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲厝西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅殿辉
电话:0592-2516162、15880287470
传真:0592-2561140
联系人:余文安
网址:www.xmzq.cn
客户服务电话:0592-5163588
405)爱建证券有限责任公司
住所:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:张建华
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:潘敏
网址:www.ajzq.com
客户服务电话:021-63340678
406)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区月坛北街26号
法定代表人:丁之刚
电话:010-58580007
传真:010-58580062
联系人:吴宇
网址:www.hrsec.com.cn
客户服务电话:010-58568118
407)大证券有限责任公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
电话:027-86718882
联系人:王琛
网址:www.dzq.com.cn
客户服务电话:028-86711401、027-87618882
基金管理人可根据有关法律法规及基金资产净值变化增加或者减少代销机构,并及时公告。销售机构可以根据经营情况增加或者减少其销售城市、网点。

C)注册登记机构
名称:华夏基金管理有限公司
住所:北京市西城区广安门内大街2号远洋大厦B座1012室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1012室
法定代表人:王东明
客户服务电话:400-818-6666
电话:010-63163700
联系人:余志峰
C)增聘事务所
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
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人:王召兴
电话:010-57658888
传真:010-57657777
联系人:杨刚
经办律师:吴冠雄、刘旭
四)会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨劲松
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:申晓峰
经办注册会计师:王津、李峰
本基金名称:华夏投资证券投资基金
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、企业债(包括可转换)、资产支持证券等债券,以及中国证监会认可的境外固定收益类金融工具。本基金还可参与一级市场新股申购,持有可转换转股所形成的股票以及股票派发现金可分离交易可转债分离交易的权证等资产,但股票和权证等资产仅占其投资组合中不超过基金资产的20%。因上述原因持有的非股票和权证等资产,基金在可交易之日起的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,基金管理人将在履行适当程序后,可以将投资本基金的投资范围。

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实施的。
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,以较多地投资于长期债券,以带来较高的资本利得;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)类属配置包括现金类、各市场债券及各债券品种间的配置。类属配置主要根据各品种间的相对投资价值确定,增持相对低估、价格将上升的资产,减持相对高估、价格将下降的类属,以达到取得较高的总回报。
组合构建与调整是自上而下确定投资策略和由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、系统化、量化的管理,通过久期、平均信用等级、个券信用等级等指标,将组合的风险控制在合理范围内。风险收益与业绩分析为基金管理人提供把投资策略、解投资策略的风险敞口进行了支持和独立的视角。本基金通过积极投资策略的决策,有意识地承担有增值的风险,追求组合较长期回报。

八、基金的投资业绩比较基准
本基金业绩评价基准设定为“53%中债标普银行间债券指数+46%中债标普国债指数+1%中债标普企业债指数”。
本基金业绩评价基准由基金合同生效后由基金管理人每半年审核一次,如所采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,新基准在最新签订的说明书中列明。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市场情况,临时确定变更基准标准,并及时公告。
九、基金的风险收益特征
本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其长期平均的风险和预期收益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
基金管理人及董事应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。
基金管理人交银理财承诺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。
本投资组合报告所载数据截至2012年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
(一)报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	权益类资产	-	-
4	固定收益类资产	-	-
5	权益类资产	-	-
6	固定收益类资产	-	-
7	权益类资产	-	-
8	固定收益类资产	-	-
9	合计	-	-

二)报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

四)报告期末按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

金额单位:人民币元			
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	175,969,207.00	5.48
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	3,507,305,105.88	109.13
5	企业中期票据	40,207,000.00	1.25
6	中期票据	477,557,000.00	14.85
7	短期融资券	347,035,549.14	10.80
8	合计	4,547,873,662.02	140.51
9	合计	4,547,873,662.02	140.51
10	合计	4,547,873,662.02	140.51
11	合计	4,547,873,662.02	140.51
12	合计	4,547,873,662.02	140.51
13	合计	4,547,873,662.02	140.51
14	合计	4,547,873,662.02	140.51
15	合计	4,547,873,662.02	140.51
16	合计	4,547,873,662.02	140.51
17	合计	4,547,873,662.02	140.51
18	合计	4,547,873,662.02	140.51
19	合计	4,547,873,662.02	140.51
20	合计	4,547,873,662.02	140.51
21	合计	4,547,873,662.02	140.51
22	合计	4,547,873,662.02	140.51
23	合计	4,547,873,662.02	140.51
24	合计	4,547,873,662.02	140.51
25	合计	4,547,873,662.02	140.51
26	合计	4,547,873,662.02	140.51
27	合计	4,547,873,662.02	140.51
28	合计	4,547,873,662.02	140.51
29	合计	4,547,873,662.02	140.51
30	合计	4,547,873,662.02	140.51
31	合计	4,547,873,662.02	140.51
32	合计	4,547,873,662.02	140.51
33	合计	4,547,873,662.02	140.51
34	合计	4,547,873,662.02	140.51
35	合计	4,547,873,662.02	140.51
36	合计	4,547,873,662.02	140.51
37	合计	4,547,873,662.02	140.51
38	合计	4,547,873,662.02	140.51
39	合计	4,547,873,662.02	140.51
40	合计	4,547,873,662.02	140.51
41	合计	4,547,873,662.02	140.51
42	合计	4,547,873,662.02	140.51
43	合计	4,547,873,662.02	140.51
44	合计	4,547,873,662.02	140.51
45	合计	4,547,873,662.02	140.51
46	合计	4,547,873,662.02	140.51
47	合计	4,547,873,662.02	140.51
48	合计	4,547,873,662.02	140.51
49	合计	4,547,873,662.02	140.51
50	合计	4,547,873,662.02	140.51
51	合计	4,547,873,662.02	140.51
52	合计	4,547,873,662.02	140.51
53	合计	4,547,873,662.02	140.51
54	合计	4,547,873,662.02	140.51
55	合计	4,547,873,662.02	140.51
56	合计	4,547,873,662.02	140.51
57	合计	4,547,873,662.02	140.51
58	合计	4,547,873,662.02	140.51
59	合计	4,547,873,662.02	140.51
60	合计	4,547,873,662.02	140.51
61	合计	4,547,873,662.02	140.51
62	合计	4,547,873,662.02	140.51
63	合计	4,547,873,662.02	140.51
64	合计	4,547,873,662.02	140.51
65	合计	4,547,873,662.02	140.51
66	合计	4,547,873,662.02	140.51
67	合计	4,547,873,662.02	140.51
68	合计	4,547,873,662.02	140.51
69	合计	4,547,873,662.02	140.51
70	合计	4,547,873,662.02	140.51
71	合计	4,547,873,662.02	140.51
72	合计	4,547,873,662.02	140.51
73	合计	4,547,873,662.02	140.51
74	合计	4,547,873,662.02	140.51
75	合计	4,547,873,662.02	140.51
76	合计	4,547,873,662.02	140.51
77	合计	4,547,873,662.02	140.51
78	合计	4,547,873,662.02	140.51
79	合计	4,547,873,662.02	140.51
80	合计	4,547,873,662.02	140.51
81	合计	4,547,873,662.02	140.51
82	合计	4,547,873,662.02	140.51
83	合计	4,547,873,662.02	140.51
84	合计	4,547,873,662.02	140.51
85	合计	4,547,873,662.02	140.51
86	合计	4,547,873,662.02	140.51
87	合计	4,547,873,662.02	140.51
88	合计	4,547,873,662.02	140.51
89	合计	4,547,873,662.02	140.51
90	合计	4,547,873,662.02	140.51
91	合计	4,547,873,662.02	140.51
92	合计	4,547,873,662.02	140.51
93	合计	4,547,873,662.02	140.51
94	合计	4,547,873,662.02	140.51
95	合计	4,547,873,662.02	140.51
96	合计	4,547,873,662.02	140.51
97	合计	4,547,873,662.02	140.51
98	合计	4,547,873,662.02	140.51
99	合计	4,547,873,662.02	140.51
100	合计	4,547,873,662.02	140.51

五)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组合
本基金本报告期末未持有股票。

四)报告期末按券种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

五)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资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资组合
本基金本报告期末未持有权证。

八)投资组合报告附注
1.报告期内,本基金投资流程符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2.本基金本报告期未持有股票。
3.期末其他各项资产构成

单位:人民币元			
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	500,000.00	-
2	应收证券清算款	15,548,547.09	-
3	应收利息	-	-
4	应收股利	-	-
5	应收申购款	95,417,901.36	-
6	其他应收款	2,891,374.43	-
7	预付款项	-	-
8	其他资产	-	-
9	合计	114,357,822.88	-

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	公允价值
1	110015	石化转债	175,614,824.00
2	110022	工行转债	95,115,740.00
3	110001	中信转债	55,330,464.00
4	110003	新钢转债	10,253,000.00
5	110013	国投转债	4,152,800.00
6	110007	博汇转债	2,041,816.00
7	125089	新张转债	411,905.14

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
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。

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。
(一)华夏债券(A类)

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2002年10月23日至2003年12月31日	0.60%	0.03%	-0.47%	0.11%	0.43%	-0.08%
2003年1月1日至2004年12月31日	2.71%	0.08%	-0.10%	0.10%	3.11%	-0.02%
2004年1月1日至2005年12月31日	-1.55%	0.18%	-1.78%	0.13%	0.23%	0.05%
2005年1月1日至2006年12月31日	9.07%	0.14%	10.53%	0.08%	-1.46%	0.06%
2006年1月1日至2007年12月31日	10.45%	0.11%	2.36%	0.05%	8.09%	0.06%
2007年1月1日至2008年12月31日	17.25%	0.19%	-1.27%	0.06%	18.52%	0.13%
2008年1月1日至2009年12月31日	11.52%	0.21%	11.91%	0.14%	-0.39%	0.01%
2009年1月1日至2010年12月31日	2.19%	0.15%	-0.18%	0.09%	2.37%	0.12%
2010年1月1日至2011年12月31日	5.81%	0.14%	1.94%	0.09%	3.87%	0.05%
2011年1月1日至2012年12月31日	-1.98%	0.16%	5.12%	0.08%	-7.10%	0.08%
2012年1月1日至2012年9月30日	5.00%	0.09%	2.54%	0.05%	2.46%	0.04%

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2002年10月23日至2003年12月31日	0.60%	0.03%	0.17%	0.11%	0.43%	-0.08%
2003年1月1日至2004年12月31日	2.71%	0.08%	-0.40%	0.10%	3.11%	-0.02%
2004年1月1日至2005年12月31日	-1.55%	0.18%	-1.78%	0.13%	0.23%	0.05%
2005年1月1日至2006年12月31日	9.07%	0.14%	10.53%	0.08%	-1.46%	0.06%
2006年1月1日至2007年12月31日	10.45%	0.11%	2.36%	0.05%	7.79%	0.06%
2007年1月1日至2008年12月31日	16.96%	0.20%	-1.27%	0.06%	18.17%	0.14%
2008年1月1日至2009年12月31日	11.13%	0.21%	11.91%	0.14%	-0.78%	0.02%
2009年1月1日至2010年12月31日	1.85%	0.16%	-0.18%	0.09%	2.03%	0.12%
2010年1月1日至2011年12月31日	5.52%	0.14%	1.94%	0.09%	3.58%	0.05%
2011年1月1日至2012年12月31日	-2.30%	0.16%	5.12%	0.08%	-7.42%	0.08%
2012年1月1日至2012年9月30日	4.82%	0.09%	2.54%	0.05%	2.28%	0.04%

二、费用概览
(一)与基金运作有关的费用
1、与基金运作有关的费用
(1)基金管理人的管理费。
(2)基金托管人的托管费。
(3)销售服务费。
(4)证券交易费用。
(5)基金赎回时支付的大额费用。
(6)基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和信息披露费用。
(7)其他按照国家有关规定可以列入的费用。
2、与基金运作有关费用的计提方法、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
基金管理人向基金管理人按基金资产净值的0.66%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按基金前一日本基金资产净值的0.66%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.66%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日本基金资产净值
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,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(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0.26%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按基金前一日本基金资产净值的0.26%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.26%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日本基金资产净值
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,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(3)销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.3%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。
在通常情况下,销售服务费按前一日C类基金资产净