

# 华夏希望债券型证券投资基金 2008 年半年度报告

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

送出日期：二 〇 〇 八年八月二十六日

## 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。本报告期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2008 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

本报告期自 2008 年 3 月 10 日起至 2008 年 6 月 30 日止。本报告中的财务资料未经审计。

## 目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标、基金净值表现.....	2
(一) 主要财务指标.....	2
(二) 基金净值表现.....	3
三、管理人报告.....	5
四、托管人报告.....	9
五、财务会计报告.....	10
(一) 基金会计报表.....	10
(二) 会计报表附注.....	12
六、投资组合报告.....	26
(一) 报告期末基金资产组合情况.....	27
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	27
(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	28
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动.....	28
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合.....	30
(六) 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.....	30
(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细.....	30
(八) 报告期末及报告期内权证明细.....	30
(九) 投资组合报告附注.....	30
七、基金份额持有人户数和持有人结构.....	31
(一) 持有人户数和持有人结构.....	31
(二) 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况.....	31
八、开放式基金份额变动.....	32
九、重大事件揭示.....	32
十、备查文件目录.....	35

## 一、基金简介

### (一) 基金基本情况

基金名称：华夏希望债券型证券投资基金

基金简称：华夏希望（A 类）、华夏希望（C 类）

交易代码：001011（前端收费模式）；001013（C 类收费模式）

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：9,167,973,010.41 份

其中：

华夏希望（A 类）：5,187,028,236.01 份

华夏希望（C 类）：3,980,944,774.40 份

基金合同存续期：不定期

### (二) 基金产品说明

基金投资目标：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。

基金投资策略：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。

### (三) 基金管理人有关情况

基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.

注册地址：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

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

信息披露负责人：廖为

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-88066511

国际互联网址：www.ChinaAMC.com

电子邮箱：service@ChinaAMC.com

(四) 基金托管人有关情况

基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：蒋松云

联系电话：010-66106912

传真：010-66106904

国际互联网址：www.icbc.com.cn

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(五) 信息披露事宜

投资者可通过《中国证券报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅本报告。

本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备，投资者可要求查阅、复制。

(六) 注册登记机构

注册登记机构名称：华夏基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

## 二、主要财务指标、基金净值表现

### (一) 主要财务指标

#### 1、华夏希望（A 类）基金

主要财务指标	2008 年 3 月 10 日（基金合同生效日） 至 2008 年 6 月 30 日
本期利润	47,166,779.66 元
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	58,426,845.74 元

加权平均份额本期利润	0.0090 元
期末可供分配利润	47,267,483.83 元
期末可供分配份额利润	0.0091 元
期末基金资产净值	5,234,295,719.84 元
期末基金份额净值	1.009 元
加权平均净值利润率	0.90%
本月份净值增长率	0.90%
基金份额累计净值增长率	0.90%

## 2、华夏希望（C类）基金

主要财务指标	2008 年 3 月 10 日（基金合同生效日） 至 2008 年 6 月 30 日
本期利润	34,045,773.56 元
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	42,743,113.18 元
加权平均份额本期利润	0.0081 元
期末可供分配利润	32,520,390.33 元
期末可供分配份额利润	0.0082 元
期末基金资产净值	4,013,465,164.73 元
期末基金份额净值	1.008 元
加权平均净值利润率	0.81%
本月份净值增长率	0.80%
基金份额累计净值增长率	0.80%

注：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。

### （二）基金净值表现

#### 1、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

##### （1）华夏希望（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	-	-
过去一个月	-0.10%	0.04%	-0.36%	0.05%	0.26%	-0.01%
过去三个月	0.80%	0.04%	0.01%	0.04%	0.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.04%	0.50%	0.05%	0.40%	-0.01%

##### （2）华夏希望（C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	-	-

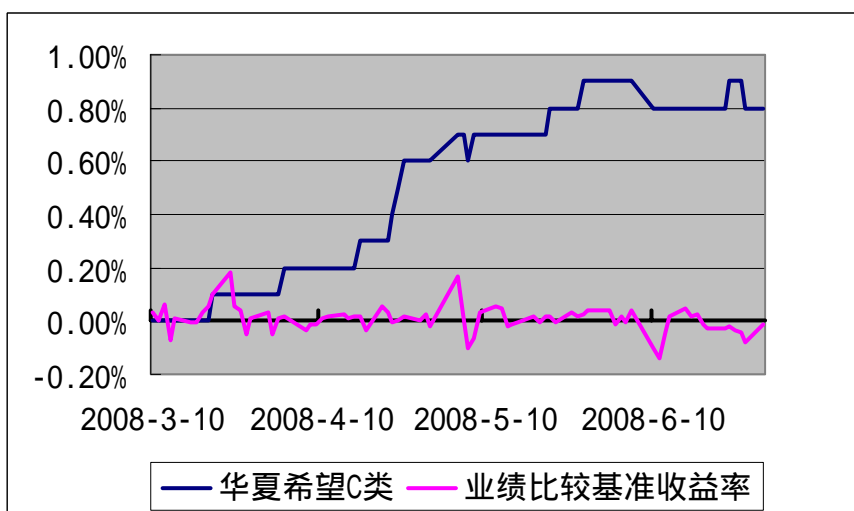
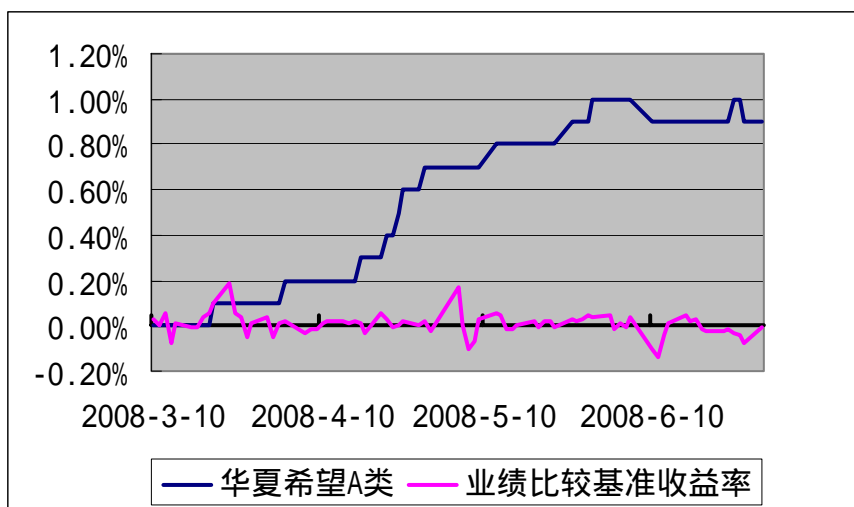
过去一个月	-0.10%	0.04%	-0.36%	0.05%	0.26%	-0.01%
过去三个月	0.70%	0.04%	0.01%	0.04%	0.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.04%	0.50%	0.05%	0.30%	-0.01%

2、自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏希望债券型证券投资基金

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

(2008年3月10日(基金合同生效日)至2008年6月30日)



注： 本基金合同于2008年3月10日生效，2008年4月28日开始办理申购、赎回业务。

根据华夏希望基金合同规定，本基金应自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十一条（二）投资范围、（六）投资限制的有关规定。

### 三、管理人报告

#### (一) 基金管理人及基金经理情况

##### 1、基金管理人及其管理基金的经验

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。华夏基金是首批全国社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人、境内首只 ETF 基金管理人及境内唯一的亚债中国基金投资管理人，华夏基金还于 2008 年 2 月获得了特定资产管理业务资格，是业务领域最广泛的基金管理公司。

截至 2008 年 6 月 30 日，公司管理证券投资基金规模超过 2023 亿元，基金份额持有人户数超过 1200 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、15 只开放式基金、1 只创新封闭式基金、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 60 多家企业确定为年金投资管理人，并被多家特定客户确定为资产管理人。

##### 2、基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩会永	本基金基金经理、固定收益副总监	2008-03-10	—	8 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)。

#### (二) 报告期内基金运作的合规守信情况的说明

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。



### (三) 公平交易专项说明

#### 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,本公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》进一步完善了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》,并严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 2、本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。

#### 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。

### (四) 报告期内基金的业绩表现和投资策略

#### 1、本基金业绩表现

截至 2008 年 6 月 30 日,华夏希望(A类)基金份额净值为 1.009 元,本报告期份额净值增长率为 0.90%,华夏希望(C类)基金份额净值为 1.008 元,本报告期份额净值增长率为 0.80%,同期业绩比较基准增长率为 0.50%。

#### 2、行情回顾及运作分析

本基金于 3 月 10 日合同生效。3 月以来,全球经济增速继续回落,但原油价格超预期上涨加剧了通胀压力。受制于此,美联储停止降息,欧盟等经济体则开始提升基准利率。中国经济增长在外需下降和内部紧缩政策的影响下减速,但受国际通胀上升影响,政府逐渐放松了对成品油、电力等要素的价格管制,通胀预期加强,收益率曲线上升。经济增速回落导致企业盈利能力下降的预期,同时,股票供求方面存在一些不利因素,3 月 10 日至 6 月 30 日,上证指数下跌 36%,中信转债指数跌幅亦达 26%。

本报告期内本基金保持了较低的久期和权益类资产仓位,主要持有央行票据和政策性金融债,增持了部分企业债、国债、可转债及少量一、二市场股票。

#### 3、市场展望和投资策略

预计下半年经济增速和物价涨幅会有所回落,短期内市场资金尚能维持比较宽松的局面,从而对债市形成支持。但国际范围内的通胀压力尚未明显缓解,在

预期债券供应增加的情况下，债券市场仍能感受到比较明显的压力。我们预计下半年信用债供应偏多，债市仍可能存在一定波动，但整体上应能维持平稳并有所上涨。

目前，本基金久期偏低，下半年将根据经济形势及债券市场供求关系的变化，对组合久期进行动态调整，并逐步适度增持高等级信用债券，以提高组合收益。可转债及新股投资方面，基金将保持整体低仓位并选择优势品种进行波段操作。下半年可能的大盘新股的发行有利于适度提高组合收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，华夏希望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）为投资人提供的服务

2008 年上半年，在市场持续调整的情况下，华夏基金以深入的投资研究为基础，加强了市场分析与风险管理，尽力为投资人分散投资风险，旗下基金整体表现在同业中位居前列。

1、根据中国银河证券基金研究中心的统计，截至 2008 年 6 月 30 日，在同期可比的全部股票及混合型开放式基金中，华夏回报基金表现最为抗跌，位列平衡型基金第 1 名，华夏回报二号基金位列平衡型基金第 4 名；华夏基金旗下主动管理的股票型基金中，华夏大盘精选基金、华夏复兴基金、华夏成长基金及华夏优势增长基金排名均在同类基金前 1/10；华夏红利基金及华夏蓝筹基金在偏股型基金中分别位列第 2 名和第 4 名。

2、截至 2008 年 6 月底，在中国银河证券基金研究中心过去一年的星级评价中，华夏基金旗下参与评价的 8 只开放式基金中，有 7 只基金获得了五星级评价，1 只基金获得了四星级评价。

2008 年上半年，华夏基金继续采取多种手段，不断提高客户服务水平，全力打造高质量的客户服务品牌。

1、在服务行业权威评选中获得多项荣誉：

（1）荣获中国信息协会和中国服务贸易协会评选的“中国最佳客户服务奖”和“中国最佳客户服务中心奖”。

（2）荣获中国信息化推进联盟客户关系管理专业委员会评选的“2008 中国最

佳呼叫中心奖”。

2、扩充客户服务团队，强化人员培训，提高人工服务水平。

3、继续采取多种手段，全面提升服务质量：

(1) 升级客服电话系统，改进人工电话接听流程，为客户提供更稳定、更优质的电话咨询服务。

(2) 针对市场变化和客户关心的问题，提供多种形式的网站服务内容，提高服务的针对性和时效性。

(3) 推广电子对账单，推出短信对账单新服务，提供多种订制环保对账单的方式，方便持有人选择更及时、更高效的环保对账单。

(4) 调整对账单内容，使对账单更加通俗易懂，更好地满足持有人的需要。

2008 年上半年，华夏基金凭借优良的业绩和稳健的经营，荣获国内外多家机构评选的多个奖项：

1、2008 年 1 月，华夏基金获得由《中国证券报》等机构共同评选的“2007 年度十大金牛基金公司奖”。

2、2008 年 1 月，在《证券时报》主办的“2007 年度中国明星基金暨最佳托管银行评选”中，华夏基金荣获“中国基金业十年持续回报明星基金奖”及“十大明星基金公司奖”。

3、2008 年 1 月，在《21 世纪经济报道》主办的“中国赢基金奖”的评比中，华夏基金获得“2007 年中国基金公司综合实力大奖”等四项大奖。

4、2008 年 1 月，在和讯网举办的“2007 年度财经风云榜”评选活动中，华夏基金获得“2007 年度中国十大品牌基金公司奖”。

5、2008 年 2 月，在新浪财经“2007 理财产品评选之基金公司评选”中，华夏基金获得“最受网友信赖的十大基金公司奖”。

6、2008 年 3 月，在亚洲权威资产管理杂志《亚洲资产管理》(Asia Asset Management)的评选中，华夏基金获得“中国增长最快速基金管理公司”、“亚洲地区最具创新投资者教育”等四项大奖。

7、2008 年 3 月，在《上海证券报》主办的第五届“中国基金业金基金评选”中，华夏基金获得“中国最佳基金公司 TOP 大奖”和“中国基金业十年杰出贡献基金公司奖”。

8、2008 年 4 月，在亚洲权威财经杂志《亚洲投资者》(Asian Investor) 举办的“2008 年度投资成就奖”评选中，华夏基金获得唯一的“年度中国最佳基金公司奖”，同时还获得了“一年期最佳投资回报奖”。

9、2008 年 4 月，在晨星(中国)和《财富中国》联合举办的基金年度评奖中，华夏基金获得“2007 年最佳持续创富基金公司奖”、“2007 年最佳风险控制基金公司奖”。

10、2008 年 5 月，“百度 2008 亿万网民心目中的理财品牌榜”揭晓，华夏基金被评选为“2008 亿万网民心目中的中国十大品牌基金公司”。

为树立理性的基金投资理念，增进与投资人之间的交流，2008 年上半年，华夏基金在投资者理财服务方面加大投入。华夏基金借公司成立十周年之际，在全国 30 个城市举办了 31 场以“五星基金聚华夏——十年信任十年回报”为主题的全国巡回策略报告会，持续进行基金理财知识的宣讲。

华夏基金在“5.12”四川汶川地震发生后，华夏基金公司和员工及时向灾区捐赠总计超过 350 万元，捐赠了 80 万册《地震灾害心理救助手册》以及大量灾区急需防暑降温用品。同时，华夏基金通过公告、客服电话、网站、在成都设立咨询服务专柜等多种方式，寻找灾区持有人，妥善处理了投资人基金资产的灾后事宜。

#### 四、托管人报告

2008 年上半年，本托管人在华夏希望债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2008 年上半年，华夏希望债券型证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏希望债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在所有重要方面的运作严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

本托管人依法对华夏基金管理有限公司在 2008 年上半年所编制和披露的华夏希望债券型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、

投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2008 年 8 月 19 日

## 五、财务会计报告

### (一) 基金会计报表

华夏希望债券型证券投资基金

资产负债表

2008 年 6 月 30 日

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

项目	附注	本报告期末余额
<b>资产</b>		
银行存款		172,328,826.55
结算备付金		17,002,344.34
存出保证金	a	125,000.00
交易性金融资产	b	9,008,981,299.77
其中：股票投资		52,672,041.59
债券投资		8,956,309,258.18
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	c	-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息	d	80,715,256.73
应收股利		-
应收申购款		9,033,858.03
其他资产		-
<b>资产总计</b>		<b>9,288,186,585.42</b>
<b>负债及所有者权益</b>		
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,491,669.86
应付赎回款		28,451,929.06
应付管理人报酬		5,522,641.72

应付托管费		1,577,897.67
应付销售服务费		1,038,811.52
应付交易费用	e	259,254.51
应交税费		-
应付利息	f	-
应付利润		-
其他负债	g	83,496.51
<b>负债合计</b>		<b>40,425,700.85</b>
所有者权益：		
实收基金	h	9,167,973,010.41
未分配利润		79,787,874.16
<b>所有者权益合计</b>		<b>9,247,760,884.57</b>
(2008 年 6 月 30 日基金份额净值 A 类：1.009 元 C 类：1.008 元)		
<b>负债及所有者权益总计</b>		<b>9,288,186,585.42</b>

华夏希望债券型证券投资基金  
利润表

2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日)  
至 2008 年 6 月 30 日止期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

项目	附注	2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日) 至 2008 年 6 月 30 日止期间
一、收入		
1.利息收入(合计)		105,160,766.72
其中：存款利息收入		5,758,062.38
债券利息收入		98,524,438.65
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		878,265.69
2.投资收益(合计)		36,076,619.74
其中：股票投资收益	i	30,749,606.17
债券投资收益	j	2,359,694.03
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	k	2,913,319.54
股利收益		54,000.00
3.公允价值变动收益/损失	l	(19,957,405.70)
4.其他收入	m	578,208.12
<b>收入合计</b>		<b>121,858,188.88</b>
二、费用		
1.管理人报酬		(20,298,233.74)
2.托管费		(5,799,495.36)
3.销售服务费		(3,859,735.36)

4.交易费用	n	(714,267.21)
5.利息支出		(9,860,471.49)
其中：卖出回购金融资产支出		(9,860,471.49)
6.其他费用	o	(113,432.50)
<b>费用合计</b>		<b>(40,645,635.66)</b>
<b>三、利润总额</b>		<b>81,212,553.22</b>

华夏希望债券型证券投资基金  
 所有者权益(基金净值)变动表  
 2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日)  
 至 2008 年 6 月 30 日止期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

项目	2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日) 至 2008 年 6 月 30 日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,322,690,505.32	-	9,322,690,505.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润总额)	-	81,212,553.22	81,212,553.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	(154,717,494.91)	(1,424,679.06)	(156,142,173.97)
其中：1、基金申购	1,679,159,499.35	13,684,903.42	1,692,844,402.77
2、基金赎回	(1,833,876,994.26)	(15,109,582.48)	(1,848,986,576.74)
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	9,167,973,010.41	79,787,874.16	9,247,760,884.57

注：后附财务报表附注为本基金财务报表的组成部分。

## (二) 会计报表附注

(除特别标明外，金额单位为人民币元)

### 1、基金基本情况

华夏希望债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]114号《关于同意华夏希望债券型证券投资基金募集申请的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金自 2008 年 2 月 14 日至 2008 年 3 月 5 日期间共募集 9,320,985,633.23 元(不含认购资金利息)，业经中瑞岳华会计师事务所有限公司中瑞岳华验字[2008]第 2020 号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 3 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,322,690,505.32 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,704,872.09 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,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、可转换债券、资产支持证券等。本基金 80%以上的基金资产投资于债券类金融工具(含可转债);本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但上述非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。基金持有现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

## 2、财务报表的编制基础

本财务报表按照 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“新会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》(以下简称“指引”)、《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。

## 3、遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2008 年 6 月 30 日的财务状况以及 2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2008 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 4、重要会计政策和会计估计

### (1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2008 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2008 年 6 月 30 日。

### (2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。



### (3) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

### (4) 基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

#### 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易

收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

#### 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

#### 资产支持证券投资

证券交易所大宗交易方式转让的资产支持证券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

银行间同业市场交易的资产支持证券按采用估值技术确定的公允价值估值。

#### 权证投资

从获赠确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,按最近交易日的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值;在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值;因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,本基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

#### (5) 证券投资基金成本计价方法

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

##### (i) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

##### (ii) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资,按附注 4(5) (iv)所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (iii) 资产支持证券投资

买入资产支持证券于交易日确认为资产支持证券投资。资产支持证券投资成本按交易日资产支持证券的公允价值确认,取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益,上述公允价值不包含资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。收到资产支持证券支付的款项时,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分,并将收到的本金部分冲减资产支持证券投资成本。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益/(损失)。出售资产支持证券的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (iv)权证投资

因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

#### 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额,采用实际利率法以摊余成本进行后续计量,终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益,直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法,其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

#### (6) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券成交金额与其

成本的差额确认。

衍生工具收益/(损失)于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。银行次级债利息收入按不扣除个人所得税的全额票面利率计算确认。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额确认，在资产支持证券实际持有期内逐日确认。收到资产支持证券支付款项中的收益部分冲减应计利息后的差额，于收款日记入资产支持证券利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

#### (7) 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率逐日计提。

本基金 C 类基金份额的基金销售服务费按前一日该类基金资产净值 0.3%的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### (8) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分

后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### (9) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### (10) 基金的收益分配政策

本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权。本基金默认的收益分配方式是现金分红,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值转为同一类别的基金份额进行再投资。在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次分配比例不得低于可供分配收益的 20%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。基金当期收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当期收益分配。基金投资当期出现亏损,则不进行收益分配。基金收益分配后,基金份额净值不能低于面值。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

经宣告的基金分配收益于分红除权日从持有人权益转出。

#### 5、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1% 的税率缴纳。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7、重大关联方关系及关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(1) 关联方

关联方名称	与本基金关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构
中信金通证券有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

注：华夏基金管理有限公司股东及持股比例如下：

持股单位	权益比例
中信证券股份有限公司	100%
合计	100%

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本报告期本基金未通过关联方席位进行证券交易。

(3) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易

本报告期				
关联方名称	买卖债券 本期交易量	回购交易 本期交易量	回购利息收入	回购利息支出
中国工商银行股份有限公司	1,186,442,115.06	-	-	-
合计	1,186,442,115.06	-	-	-

(4) 关联方报酬

基金管理人报酬

项目	本报告期
管理费收入	20,298,233.74

注：支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

基金托管费

项目	本报告期
托管费收入	5,799,495.36

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华夏基金管理有限公司，再由华夏基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.3% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付的基金销售服务费为 3,859,735.36 元。

本报告期支付给关联方的基金销售服务费：

关联方名称	本报告期
华夏基金管理有限公司	263,026.25
中国工商银行股份有限公司	1,007,231.35
中信证券股份有限公司	11,620.66
中信建投证券有限责任公司	34,448.56
中信金通证券有限责任公司	1,748.10
中信万通证券有限责任公司	980.33
合计	1,319,055.25

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

项目	本报告期末
基金托管人保管的银行存款余额	172,328,826.55
项目	本报告期
由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入	5,667,510.16



注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

(6) 关联方持有的基金份额

关联方名称	本报告期			
	本报告期末持有的基金份额数(份)	占基金总份额比	本期买入份额(份)	本期卖出份额(份)
华夏基金管理有限公司	100,017,000.00	1.09%	100,017,000.00	-
合计	100,017,000.00	1.09%	100,017,000.00	-

注:本基金管理人在本报告期经代销机构认购华夏希望基金 A 类,认购费用为 1,000.00 元。

本基金管理人主要股东及其控制机构在本报告期期末未持有基金份额。

8、基金会计报表重要项目说明

a、存出保证金

项目	本报告期末
深圳存出保证金	125,000.00
合计	125,000.00

b、交易性金融资产

项目	本报告期末			
	成本	公允价值	估值增值	
股票投资	56,331,670.07	52,672,041.59	(3,659,628.48)	
债券投资	交易所市场	522,372,996.35	515,550,258.18	(6,822,738.17)
	银行间市场	8,450,234,039.05	8,440,759,000.00	(9,475,039.05)
	合计	8,972,607,035.40	8,956,309,258.18	(16,297,777.22)
资产支持证券投资	-	-	-	
合计	9,028,938,705.47	9,008,981,299.77	(19,957,405.70)	

c、衍生金融资产

本报告期末本基金未持有衍生金融资产。

d、应收利息

项目	本报告期末
应收债券利息	80,591,332.73
应收银行存款利息	114,805.89
应收结算备付金利息	7,651.10
应收申购款利息	1,467.01
合计	80,715,256.73

e、应付交易费用

项目	本报告期末
应付交易佣金	193,691.56

应付银行间市场交易费用	65,562.95
合计	259,254.51

注： 应付交易佣金明细如下：

券商名称	本报告期末
中国银河证券	102,925.87
国金证券	90,765.69
合计	193,691.56

f、 应付利息

本报告期末本基金无应付利息余额。

g、 其他负债

项目	本报告期末
预提费用	80,594.20
应付赎回费	2,902.31
合计	83,496.51

h、 实收基金

华夏希望（A类）

项目	基金份额（份）	基金面值
募集期间认购份额	5,166,989,821.14	5,166,989,821.14
募集期间认购资金利息折份额	948,835.92	948,835.92
本期申购	879,934,208.78	879,934,208.78
其中：红利再投资	-	-
本期赎回	(860,844,629.83)	(860,844,629.83)
2008年6月30日	5,187,028,236.01	5,187,028,236.01

华夏希望（C类）

项目	基金份额（份）	基金面值
募集期间认购份额	4,153,995,812.09	4,153,995,812.09
募集期间认购资金利息折份额	756,036.17	756,036.17
本期申购	799,225,290.57	799,225,290.57
其中：红利再投资	-	-
本期赎回	(973,032,364.43)	(973,032,364.43)
2008年6月30日	3,980,944,774.40	3,980,944,774.40

注： 本基金于 2008 年 2 月 14 日起向全社会公开募集，净认购金额为 9,320,985,633.23 元人民币，认购资金在募集期间产生的银行利息共计 1,704,872.09 元人民币。募集资金已于 2008 年 3 月 10 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，设立募集期募集及利息结转的基金份额共计 9,322,690,505.32 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

i、 股票投资收益

项目	本报告期
卖出股票成交总额	134,052,812.54
减：卖出股票成本总额	(103,303,206.37)
股票投资收益	30,749,606.17

注：本报告期本基金未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

#### j、债券投资收益

项目	本报告期
卖出及到期兑付债券结算金额	12,097,865,639.34
减：应收利息总额	(57,342,045.06)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(12,038,163,900.25)
债券投资收益	2,359,694.03

#### k、衍生工具收益

项目	本报告期
卖出权证成交金额	6,795,670.56
减：卖出权证成本总额	(3,882,351.02)
衍生工具收益	2,913,319.54

#### l、公允价值变动收益/损失

项目	本报告期
交易性金融资产	
——股票投资	(3,659,628.48)
——债券投资	(16,297,777.22)
——资产支持证券	-
衍生工具	
——权证投资	-
交易性金融负债	-
合计	(19,957,405.70)

#### m、其他收入

项目	本报告期
赎回基金补偿收入	59,054.90
债券认购手续费返还	20,000.00
其他	499,153.22
合计	578,208.12

注：根据《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》、《华夏希望债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金 A 类、C 类基金份额均收取赎回费，赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取，赎回时份额持有不满 30 天的，收取 0.1% 的赎回费，持有满 30 天以上(含 30 天)的，赎回费为 0。其中，所收取赎回费总额的 25% 归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

#### n、交易费用

项目	本报告期
交易所交易费用	633,129.71
银行间交易费用	81,137.50
合计	714,267.21

o、其他费用

项目	本报告期
审计费用	45,656.52
银行费用	31,438.30
信息披露费	30,437.68
银行间债券账户维护费	4,500.00
其他	1,400.00
合计	113,432.50

9、利润分配

本报告期本基金无利润分配事项。

10、流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的证券

序号	证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
<b>股票</b>										
1	002224	三力士	2008-04-17	2008-07-25	新发流通受限	9.38	13.77	18,444	173,004.72	253,973.88
2	002225	濮耐股份	2008-04-17	2008-07-25	新发流通受限	4.79	6.50	46,153	221,072.87	299,994.50
3	002235	安妮股份	2008-05-08	2008-08-18	新发流通受限	10.91	10.82	22,243	242,671.13	240,669.26
4	002236	大华股份	2008-05-12	2008-08-20	新发流通受限	24.24	36.00	12,573	304,769.52	452,628.00
5	002238	天威视讯	2008-05-14	2008-08-26	新发流通受限	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
6	002240	威华股份	2008-05-15	2008-08-25	新发流通受限	15.70	12.19	79,719	1,251,588.30	971,774.61
7	002242	九阳股份	2008-05-20	2008-08-28	新发流通受限	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
8	002245	澳洋顺昌	2008-05-28	2008-09-05	新发流通受限	16.38	16.02	10,566	173,071.08	169,267.32
9	002246	北化股份	2008-05-29	2008-09-05	新发流通受限	6.95	8.22	37,754	262,390.30	310,337.88
10	002247	帝龙新材	2008-05-30	2008-09-12	新发流通受限	16.05	14.65	13,026	209,067.30	190,830.90
11	002248	华东数控	2008-06-05	2008-09-12	新发流通受限	9.80	10.97	18,001	176,409.80	197,470.97
12	002249	大洋电机	2008-06-10	2008-09-19	新发流通受限	25.60	24.21	29,830	763,648.00	722,184.30
13	002250	联化科技	2008-06-10	2008-09-19	新发流通受限	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
14	002251	步步高	2008-06-11	2008-09-19	新发流通受限	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
15	002252	上海莱士	2008-06-13	2008-09-23	新发流通受限	12.81	24.87	27,141	347,676.21	674,996.67
16	002255	海陆重工	2008-06-18	2008-09-25	新发流通受限	10.46	19.64	19,865	207,787.90	390,148.60
合计									6,529,982.27	8,685,920.26

(2) 报告期末本基金持有的暂时停牌股票

截至 2008 年 6 月 30 日止,本基金未持有因上市公司未能按交易所要求按时披露重要信息、公布的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌股票。

### (3) 报告期末债券正回购交易中作为质押的债券

截至 2008 年 6 月 30 日止,本基金没有因从事交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### (4) 估值方法

报告期本基金流通受限制不能自由转让的基金资产估值方法详见本会计报表附注“重要会计政策和会计估计”部分。

## 11、风险管理

本基金一贯的风险管理政策是保证基金投资风险可测、可控、可承担。基金投资的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险等。市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性。流动性风险是指基金资产不能迅速、低成本地转变成现金,或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。信用风险主要指基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降,造成基金财产损失。

对于上述风险的识别和衡量,我们采用了一系列国际和业内通行的计量方法:通过监测组合标准差、Beta 值(股票投资部分)、久期(债券投资部分)等指标来衡量基金市场风险;对于流动性风险,我们通过投资集中度和变现能力衡量;对于信用风险,公司内部通过专职的信用分析团队、严格的内部评级体系和交易对手库管理,根据各个评级的违约率和损失率,计算总的可能的损失。

风险管理团队在识别、衡量投资风险后,通过正式的报告体系,传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会,从而做出风险控制决策,实现风险管理的目标。

华夏希望基金股票投资比例很小,组合的风险主要由债券投资部分贡献。

华夏希望基金在报告期末的主要风险指标:久期为 1.95,凸性为 8.83,持有债券的平均剩余期限为 2.23 年。

## 12、资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项。

## 六、投资组合报告

### (一) 报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占基金总资产比例
股票	52,672,041.59	0.57%
债券	8,956,309,258.18	96.43%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	189,331,170.89	2.04%
其他资产	89,874,114.76	0.97%
合计	9,288,186,585.42	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)	占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	242,880.00	0.00%
B	采掘业	-	-
C	制造业	34,649,986.19	0.37%
C0	其中：食品、饮料	2,347,020.00	0.03%
C1	纺织、服装、皮毛	220,010.00	0.00%
C2	木材、家具	971,774.61	0.01%
C3	造纸、印刷	240,669.26	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,599,788.66	0.10%
C5	电子	452,628.00	0.00%
C6	金属、非金属	299,994.50	0.00%
C7	机械、设备、仪表	19,142,438.59	0.21%
C8	医药、生物制品	1,184,831.67	0.01%
C99	其他制造业	190,830.90	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,074,994.10	0.01%
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	16,051,492.23	0.17%
K	社会服务业	169,267.32	0.00%
L	传播与文化产业	483,421.75	0.01%

M	综合类	-	-
	合计	52,672,041.59	0.57%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	000651	格力电器	500,000	15,650,000.00	0.17%
2	000002	万科A	960,000	8,649,600.00	0.09%
3	000826	合加资源	545,797	8,350,694.10	0.09%
4	600325	华发股份	696,321	7,401,892.23	0.08%
5	000568	泸州老窖	78,000	2,347,020.00	0.03%
6	002242	九阳股份	47,488	1,920,414.72	0.02%
7	002252	上海莱士	47,641	1,184,831.67	0.01%
8	002251	步步高	22,142	1,074,994.10	0.01%
9	002240	威华股份	79,719	971,774.61	0.01%
10	002249	大洋电机	29,830	722,184.30	0.01%
11	002255	海陆重工	29,865	586,548.60	0.01%
12	002238	天威视讯	39,463	483,421.75	0.01%
13	002236	大华股份	12,573	452,628.00	0.00%
14	002246	北化股份	53,254	437,747.88	0.00%
15	002250	联化科技	26,001	332,812.80	0.00%
16	002225	濮耐股份	46,153	299,994.50	0.00%
17	002248	华东数控	24,001	263,290.97	0.00%
18	002224	三力士	18,444	253,973.88	0.00%
19	002234	民和股份	12,000	242,880.00	0.00%
20	002235	安妮股份	22,243	240,669.26	0.00%
21	002243	通产丽星	28,000	224,560.00	0.00%
22	002239	金飞达	24,500	220,010.00	0.00%
23	002247	帝龙新材	13,026	190,830.90	0.00%
24	002245	澳洋顺昌	10,566	169,267.32	0.00%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	601899	紫金矿业	25,867,640.00	0.28%
2	600325	华发股份	23,962,719.83	0.26%
3	601958	金钼股份	18,906,370.00	0.20%
4	000651	格力电器	16,304,447.95	0.18%
5	000709	唐钢股份	14,008,202.00	0.15%

6	000002	万 科 A	13,758,278.08	0.15%
7	000826	合加资源	9,088,118.29	0.10%
8	000568	泸州老窖	7,506,724.82	0.08%
9	600036	招商银行	5,886,619.00	0.06%
10	002200	绿 大 地	4,608,859.20	0.05%
11	600005	武钢股份	3,623,205.00	0.04%
12	002240	威华股份	2,766,638.30	0.03%
13	002242	九阳股份	2,298,809.52	0.02%
14	002249	大洋电机	1,570,048.00	0.02%
15	002251	步 步 高	1,242,503.36	0.01%
16	002237	恒邦股份	987,240.00	0.01%
17	002236	大华股份	874,409.52	0.01%
18	002233	塔牌集团	707,115.00	0.01%
19	002252	上海莱士	610,281.21	0.01%
20	002235	安妮股份	504,511.13	0.01%

2、报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	601899	紫金矿业	36,813,287.47	0.40%
2	601958	金钼股份	24,298,734.66	0.26%
3	000709	唐钢股份	17,478,647.80	0.19%
4	600325	华发股份	16,928,324.10	0.18%
5	002200	绿 大 地	6,514,948.00	0.07%
6	000568	泸州老窖	6,209,000.00	0.07%
7	600036	招商银行	4,808,900.00	0.05%
8	600005	武钢股份	4,767,000.00	0.05%
9	000002	万 科 A	2,290,000.00	0.02%
10	002237	恒邦股份	2,162,418.69	0.02%
11	002242	九阳股份	2,158,389.10	0.02%
12	002240	威华股份	1,799,172.00	0.02%
13	002251	步 步 高	1,114,406.00	0.01%
14	002236	大华股份	1,098,268.00	0.01%
15	002233	塔牌集团	1,097,608.30	0.01%
16	002249	大洋电机	880,232.00	0.01%
17	002225	濮耐股份	460,481.00	0.00%
18	002238	天威视讯	427,000.00	0.00%
19	002235	安妮股份	375,400.00	0.00%
20	002224	三 力 士	295,282.42	0.00%

3、本报告期内买入的股票成本总额为 159,634,876.44 元；卖出股票的收入总额为 134,052,812.54 元。



(五) 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)	占基金资产净值比例
1	国 债	236,276,060.00	2.55%
2	金 融 债	698,300,000.00	7.55%
3	企 业 债	393,937,608.00	4.26%
4	央行票据	7,537,946,000.00	81.51%
5	可 转 债	89,849,590.18	0.97%
	合 计	8,956,309,258.18	96.85%

(六) 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)	占基金资产净值比例
1	08 央行票据 31	845,504,000.00	9.14%
2	08 央行票据 35	799,200,000.00	8.64%
3	08 央行票据 46	739,816,000.00	8.00%
4	08 央行票据 47	699,020,000.00	7.56%
5	08 央行票据 34	672,560,000.00	7.27%
	08 央行票据 49	672,560,000.00	7.27%

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(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资产净值比例大小排序的所有权证明细

本基金本报告期末未持有权证。

2、报告期内获得的权证

获得方式	权证名称	数量(份)	成本总额(元)
被动持有权证	康美 CWB1	934,620	1,555,033.44
	青啤 CWB1	316,190	1,172,143.73
	国电 CWB1	493,056	1,155,173.85

(九) 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、基金的其他资产构成

单位：元

应收利息	80,715,256.73
应收申购款	9,033,858.03
存出保证金	125,000.00
合计	89,874,114.76

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	市值(元)	占基金资产净值比例
1	125709	唐钢转债	40,268,596.38	0.44%
2	110598	大荒转债	9,225,600.00	0.10%
3	110567	山鹰转债	2,650,606.00	0.03%
4	110971	恒源转债	1,142,910.40	0.01%
5	125960	锡业转债	935,831.16	0.01%

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。

## 七、基金份额持有人户数和持有人结构

截至 2008 年 6 月 30 日华夏希望基金持有人情况如下：

(一) 持有人户数和持有人结构

份额级别	基金份额持有人户数(户)	平均每户持有的基金份额(份)	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额(份)	占总份额比例	持有份额(份)	占总份额比例
A类	82,524	62,854.78	2,223,911,164.80	24.26%	2,963,117,071.21	32.32%
C类	81,335	48,945.04	65,925,984.92	0.72%	3,915,018,789.48	42.70%
合计	163,859	-	2,289,837,149.72	24.98%	6,878,135,860.69	75.02%

(二) 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金	占本基金总份额
----	------------	---------

	份额的总量(份)	的比例
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	1,125,152.87	0.01%

## 八、开放式基金份额变动

单位：份

份额级别	基金合同生效日的基金份额总额	本报告期内基金份额的变动情况			
		期初基金份额总额	本期总申购份额	本期总赎回份额	期末基金份额总额
A类	5,167,938,657.06	5,167,938,657.06	879,934,208.78	860,844,629.83	5,187,028,236.01
C类	4,154,751,848.26	4,154,751,848.26	799,225,290.57	973,032,364.43	3,980,944,774.40
合计	9,322,690,505.32	9,322,690,505.32	1,679,159,499.35	1,833,876,994.26	9,167,973,010.41

注：本报告期内为 2008 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2008 年 6 月 30 日。

## 九、重大事件揭示

(一) 本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 本基金管理人于 2008 年 3 月 22 日发布《华夏基金管理有限公司公告》，第三届董事会由王东明先生、范勇宏先生、王连洲先生、龙涛先生、涂建先生组成。

经本届董事会 2008 年第一次会议审议通过，选举王东明先生为本基金管理人拟任董事长，凌新源先生不再担任本基金管理人董事长。上述变更事项正在履行相关法律程序。

(三) 本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

(四) 本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(五) 本报告期本基金投资策略未发生改变。

(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分。

(七) 本基金收益分配事项：

本报告期内本基金无收益分配。

(八) 本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

(九) 选择证券经营机构交易席位的情况

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，在近一年内无重大违规行为；
- 2、公司财务状况良好；
- 3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- 4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- 5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

券商专用席位选择程序：

1、对席位候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据席位选择标准对席位候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易席位的券商。

2、协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订席位租用协议，并通知基金托管人。

根据以上标准，本期分别选择了中国银河证券、国金证券和国泰君安证券的席位作为华夏希望债券型证券投资基金专用交易席位，其中中国银河证券、国金证券和国泰君安证券的席位为本期新增的券商席位，本期没有剔除券商席位。席位佣金为股票成交金额的 1‰扣除应由券商负担的交易手续费、证管费及结算风险金。

2008 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2008 年 6 月 30 日租用各券商席位的数量、股票交易量及佣金情况如下：

单位：元

序号	券商名称	租用该券商席位的数量（个）	股票交易量	占股票交易总量比例	佣金	占佣金总量比例
1	中国银河证券	2	121,088,790.06	52.01%	102,925.87	53.14%
2	国金证券	1	111,711,196.65	47.99%	90,765.69	46.86%
	合计	3	232,799,986.71	100.00%	193,691.56	100.00%

2008 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2008 年 6 月 30 日各券商债券、回购交易量情况如下：

单位：元

序号	券商名称	债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例
1	中国银河证券	707,197,805.80	79.12%	5,086,700,000.00	100.00%
2	国金证券	186,579,326.59	20.88%	-	-
合计		893,777,132.39	100.00%	5,086,700,000.00	100.00%

#### (十) 其他重大事件

1、本基金管理人于 2008 年 2 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告。

2、本基金管理人于 2008 年 3 月 11 日发布华夏希望债券型证券投资基金基金合同生效公告。

3、本基金管理人于 2008 年 4 月 3 日发布华夏基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司直销资金专户开户银行名称变更的公告。

4、本基金管理人于 2008 年 4 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的通告。

5、本基金管理人于 2008 年 4 月 26 日发布华夏希望债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告。

6、本基金管理人于 2008 年 5 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于开通专户理财专用客户服务电话的公告。

7、本基金管理人于 2008 年 5 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中信银行股份有限公司为代销机构的公告。

8、本基金管理人于 2008 年 5 月 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告。

9、本基金管理人于 2008 年 5 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告。

10、本基金管理人于 2008 年 6 月 16 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银行股份有限公司基金定期定额及网上银行申购费率优惠活动的公告。

11、本基金管理人于 2008 年 6 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于调整招商银行股份有限公司储蓄卡基金网上交易转换优惠费率的公告。

12、本基金管理人于 2008 年 6 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于限制旗下部分开放式基金大额申购业务的公告。

13、本基金管理人于 2008 年 6 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金新增中国光大银行为代销机构的公告。

投资者可通过《中国证券报》和基金管理人网站 [www.ChinaAMC.com](http://www.ChinaAMC.com) 查阅上述公告。

## 十、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、《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏希望债券型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

二〇〇八年八月二十六日