

华夏现金增利证券投资基金

【2011】 第二季度报告

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：二〇一一年七月二十日

§1 重要提示
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，也不保证基金份额持有人能如期获得赎回，申购或赎回基金份额时均可能发生申购或赎回费，并可能导致基金份额持有人遭受损失。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。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。
注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。
注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。

项目	天数
报告期内投资债券平均剩余期限	129
报告期内投资债券平均剩余期限最高值	154
报告期内投资债券平均剩余期限最低值	122

报告期内投资债券平均剩余期限超过180天情况说明
在本报告期内本基金市场基金不存在投资债券平均剩余期限超过180天的情况。


5.3.2报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.39	17.96
2	30天(含)~60天	6.37	-
3	60天(含)~90天	11.31	-
4	90天(含)~180天	1.98	-
5	180天(含)~397天	13.30	-
6	397天以上	5.48	-
7	合计	61.93	17.96

5.3.2.1报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	179,595,610.84	11.11
2	金融债券	2,423,357,955.07	14.93
3	其中：政策性金融债	2,423,357,955.07	14.93
4	企业债券	558,506,674.70	3.34
5	企业短期融资券	3,784,589,536.02	23.41
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	6,946,409,776.63	42.78
9	报告期内投资债券平均剩余期限	2,342,501,741.23	14.43

5.3.2.2报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

	报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)~0.5%间的次数	2次
	报告期内偏离度的最高值	0.27%
	报告期内偏离度的最低值	-0.12%
	报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.18%
	本基金本报告期未持有资产支持证券。	
5.8.2 投资组合报告摘要		
5.8.2.1 基金计价方法说明		
除货币市场基金外,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或摊余利率每日计提应计利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余成本计算基金资产净值。		
除货币市场基金外,本基金采用公允价值法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的公允价值或公允价值减去折溢价摊销后的公允价值计算基金资产净值。公允价值是指,即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行估值,当基金资产净值与其他可参考公允价值报价存在重大差异的,应采用公允价值计价对象对组合的公允价值进行了调整,调整金额按照公允价值与公允价值报价的差额计入公允价值变动损益。		
货币市场基金按摊余成本法估值,即按照票面利率和计息天数上逐日计提应计利息及基金资产净值。		

§ 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 任职日期 离任日期	证券从业年限 说明
曲波	本基金的基金经理	2008-1-18	-
			8年

清华大学工商管理硕士,2003年加入华夏基金管理有限公司,历任交易管理部交易员,华夏现金

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%含-0.5%之间的次数	2次
报告期内偏离度的最高值	0.27%
报告期内偏离度的最低值	-0.12%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.18%

5.3.2.4报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	155,654,809.04
4	应收申购款	69,195,511.98
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	225,100,321.02

5.3.2.5报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,946,049,776.63	62.24
2	其中：债券	6,946,049,776.63	62.24
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	7,724,279,923.81	40.30
5	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,271,124,925.31	22.28
7	其他金融资产	25,100,321.02	0.17
8	合计	19,166,554,955.77	100.00

5.3.2.6报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.7报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.8报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.9报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.10报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.11报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

华夏大盘精选证券投资基金

【2011】 第二季度报告

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：二〇一一年七月二十日

§1 重要提示
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，也不保证基金份额持有人能如期获得赎回，申购或赎回基金份额时均可能发生申购或赎回费，并可能导致基金份额持有人遭受损失。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。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。
本报告期内基金管理人未发生任何违法违规行为，也未发生任何重大违法违规行为。

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。
注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。
注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例在报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值为0.00%。

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.39	17.96
2	30天(含)~60天	6.37	-
3	60天(含)~90天	11.31	-
4	90天(含)~180天	1.98	-
5	180天(含)~397天	13.30	-
6	397天以上	5.48	-
7	合计	61.93	17.96

5.3.2.1报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	179,595,610.84	11.11
2	金融债券	2,423,357,955.07	14.93
3	其中：政策性金融债	2,423,357,955.07	14.93
4	企业债券	558,506,674.70	3.34
5	企业短期融资券	3,784,589,536.02	23.41
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	6,946,409,776.63	42.78
9	报告期内投资债券平均剩余期限	2,342,501,741.23	14.43

5.3.2.2报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

4.期末基金资产净值	7,804,087,505.28				
5.期末基金份额净值	12.473				

注1:上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可能低于所列数字。

注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。

序号	基金名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	央行票据	413,639,973.40	5.30
2	国家债		
3	金融债		
4	其中:政策性金融债		
5	企业债		
6	企业短期融资券		
7	中期票据		
8	可转债		
9	其他		
10	合计	413,639,973.40	5.30

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 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.87%	1.22%	-4.29%	0.88%	2.42%	0.34%

3.2.2 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

华夏大夏精选证券投资基金
业绩比较基准:业绩比较基准收益率历史走势对比图

项目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在0.25%含-0.5%之间的次数	2次
报告期内偏离度的最高值	0.27%
报告期内偏离度的最低值	-0.12%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.18%

5.3.2.4报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,780,569.58
2	应收证券清算款	1,692,158.39
3	应收利息	45,003,555.55
4	应收申购款	7,546,141.50
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,018,869.47

5.3.2.5报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,946,049,776.63	62.24
2	其中：债券	6,946,049,776.63	62.24
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	7,724,279,923.81	40.30
5	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,271,124,925.31	22.28
7	其他金融资产	25,100,321.02	0.17
8	合计	19,166,554,955.77	100.00

5.3.2.6报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.7报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.8报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.9报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.10报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.11报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-

5.3.2.12报告期内基金资产净值变动情况
在本报告期内本基金资产净值变动情况如下：

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	16.24	-
2	其中：买断式回购融资	-	-
3	其中：买断式回购融资	-	-
4	其中：买断式回购融资	-	-
5	其中：买断式回购融资	-	-
6	其中：买断式回购融资	-	-
7	其中：买断式回购融资	-	-
8	其中：买断式回购融资	-	-
9	其中：买断式回购融资	-	-
10	其中：买断式回购融资	-	-