

信息披露 Disclosure

中信现金优势货币市场基金

[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：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年七月二十日

基金管理人的董事会对本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人对本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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。

本基金报告中财务数据未经审计。

本基金报告日期2011年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 中信现金优势货币

基金主代码 288101

交易代码 288101

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2005年4月20日

报告期末基金份额总额 1,404,092,472.11份

投资目标 在保持安全性、流动性的前提下获得高于投资基准的回报。

投资策略 结合货币市场利率的预测与现金需求安排，采取现金流管理策略进行货币市场上场投资，以便在保证基金财产的安全性和流动性的基础上，获得较高的收益。

业绩比较基准 本基金以中国人民币银行公布的一年期定期存款的税后收益率作为业绩比较基准。

风险收益特征 基金投资于货币工具，属于低风险品种。

基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 11,697,653.31

2.本期利润 11,697,653.31

3.期末基金资产净值 1,404,092,472.11

(注：本基金无持有人认购或交易基金份额的费用。

本基金已实现的收益指扣除本期利息收入，不含公允价值变动收益，扣除相关费用后的余额，即为基金的本期利润。收益以人民币计算。

本基金的过去收益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。

本基金报告中财务数据未经审计。

本基金报告日期2011年4月1日起至6月30日止。

§ 4.1 基金经理(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

李广云 本基金的基金经理 2007-7-12 - 10年 英国华威大学管理科学与运筹学硕士，曾任招商证券研究员，原中信基金研究员，基金经理助理等职。2009年1月加入华夏基金管理有限公司。

(注：①上任职日期、离任日期均指基金管理人员对外披露的任免日期。

②本基金从业人员从过去10个完整会计年度起至今未持有过证券从业资格。

4.2 本期期内本基金无变更基金经理的情况。

4.3 本期期内本基金无变更投资决策委员会成员、基金经理、督察长、监察稽核负责人的决定。

4.4 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.5 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.6 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.7 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.8 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.9 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.10 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.11 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.12 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.13 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.14 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.15 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.16 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.17 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.18 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.19 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.20 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.21 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.22 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.23 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.24 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.25 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.26 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.27 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.28 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.29 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.30 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.31 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.32 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.33 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.34 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.35 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.36 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.37 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.38 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.39 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.40 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.41 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.42 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.43 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.44 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.45 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.46 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.47 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.48 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.49 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.50 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.51 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.52 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.53 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.54 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.55 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.56 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.57 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.58 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.59 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.60 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.61 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.62 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.63 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.64 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.65 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.66 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.67 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.68 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.69 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.70 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.71 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.72 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.73 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.74 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.75 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.76 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.77 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.78 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.79 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.80 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.81 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.82 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.83 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.84 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.85 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.86 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.87 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.88 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.89 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.90 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.91 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.92 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.93 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.94 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.95 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.96 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.97 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.98 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

4.99 本期期内本基金无变更基金经理的决定。

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 固定收益投资 561,112,468.22 39.37

其中：债券 561,112,468.22 39.37

资产支持证券 -

2 买入返售金融资产 507,811,681.73 35.63

其中：买断式回购的买入返售金融资产 -

3 银行存款和结算备付金合计 341,121,955.08 23.93

4 其他各项资产 15,299,191.64 1.07

5 合计 1,425,345,296.67 100.00

(注：本基金无持有以摊余成本计量的金融资产的说明。

5.2 报告期末基金资产净值及其与同期业比较基准收益率变动的比较

中信现金优势货币基金份额净值增长率与同期业比较基准收益率走势图

(2005年4月20日至2011年6月30日)

注：本基金未定期披露净值增长率。

5.3 报告期内基金资产净值及其与同期业比较基准收益率变动的比较

中信现金优势货币基金份额净值增长率与同期业比较基准收益率走势图

(2005年4月20日至2011年6月30日)

注：本基金未定期披露净值增长率。

5.4 管理人报告

报告期内，本基金严格遵守《基金法