
华夏现金增利证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

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：二〇一一年八月二十四日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	8
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	8
6.1 资产负债表.....	8
6.2 利润表.....	10
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	10
6.4 报表附注.....	11
§7 投资组合报告.....	22
7.1 期末基金资产组合情况.....	22
7.2 债券回购融资情况.....	22
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	23
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	23
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	24
7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	24
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	24
7.8 投资组合报告附注.....	24
§8 基金份额持有人信息.....	25
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	25
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	26
§9 开放式基金份额变动.....	26
§10 重大事件揭示.....	26
§11 备查文件目录.....	28

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏现金增利证券投资基金
基金简称	华夏现金增利货币
基金主代码	003003
交易代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月7日
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
报告期末基金份额总额	16,235,317,543.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的较高收益。
投资策略	积极判断短期利率变动，合理安排期限，细致研究，谨慎操作，以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“同期7天通知存款利率”。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	尹东
	联系电话	400-818-6666	010-67595003
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		范勇宏	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 3 层
--------	------------	-----------------------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	263,824,844.23
本期利润	263,824,844.23
本期净值收益率	1.9045%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末基金资产净值	16,235,317,543.19
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
累计净值收益率	21.5783%

注：①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

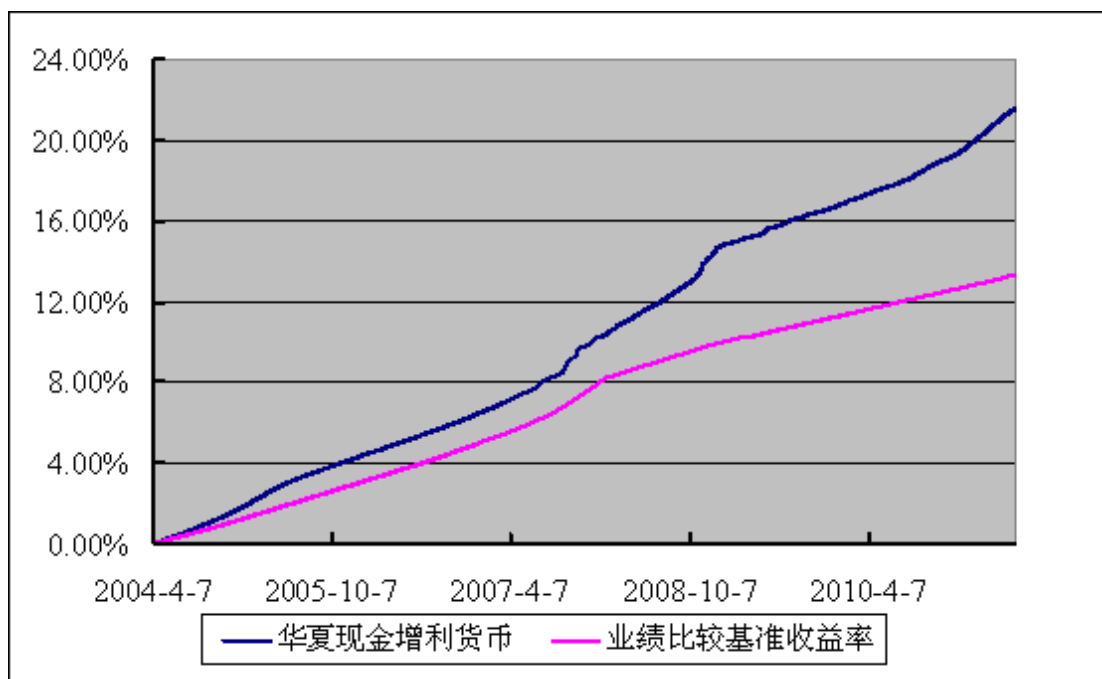
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2672%	0.0024%	0.1225%	0.0000%	0.1447%	0.0024%
过去三个月	0.9592%	0.0043%	0.3701%	0.0001%	0.5891%	0.0042%
过去六个月	1.9045%	0.0040%	0.7086%	0.0002%	1.1959%	0.0038%
过去一年	3.1799%	0.0049%	1.3891%	0.0002%	1.7908%	0.0047%
过去三年	8.6070%	0.0085%	4.2338%	0.0003%	4.3732%	0.0082%
自基金合同生效起至今	21.5783%	0.0067%	13.3572%	0.0015%	8.2211%	0.0052%

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

华夏现金增利证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2004 年 4 月 7 日至 2011 年 6 月 30 日）



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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、成都、南京、杭州和广州设有分公司，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、首批企业年金基金投资管理人、QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人，是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2011 年上半年，在市场震荡的情况下，华夏基金加强风险控制，坚持稳健的投资风格，努力把握投资机会。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2011 年 6 月 30 日数据），华夏收入股票在 217 只标准股票型基金中排名第 10；华夏大盘精选混合、华夏红利混合在 43 只偏股型基金（股票上限 95%）中分别排名第 2 和第 7；华夏策略混合在 48 只灵活配置型基金（股票上限 80%）中排名第 1。

2011 年 3 月，在《证券时报》举办的“第七届中国基金业明星奖颁奖仪式暨中国明星基金论坛”中，华夏基金获得“长期回报明星基金公司奖”；2011 年 4 月，在《上海证券报》主办的中国“金基金”奖颁奖典礼中，华夏基金第六次荣获“金基金 TOP 公司奖”；在《中国证券报》、中央电视台主办的“中国

基金业金牛奖”评选中，华夏基金第六次荣获年度“金牛基金管理公司奖”。

上半年，为更好地满足客户需求，华夏基金恢复办理原中信四只基金的转换业务；并调整了在本公司进行登记结算的基金的分红方式变更规则，从而使投资者可在不同销售机构对持有的同一只基金分别设置分红方式。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
曲波	本基金的基金经理	2008-01-18	-	8 年	清华大学工商管理学硕士。2003 年加入华夏基金管理有限公司，历任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 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

华夏现金增利货币基金与中信现金优势货币基金投资风格相似。报告期内，华夏现金增利货币基金净值收益率为 1.9045%，中信现金优势货币基金净值收益率为 1.8817%，二者的投资业绩无明显差异。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，CPI 屡创新高，央行通过 2 次加息，6 次提高存款准备金率等方式大力回收流动性，资金面前后紧、中间松，且波动频繁剧烈。就产品而言，一年期央票利率上行 50BP，金融债上行 70BP，短期融资券等信用产品上行幅度更大，为 120BP 左右，而以 Shibor 为基准的浮息债券则先涨后跌，整体走平。

报告期内，本基金保持了较高仓位的短期逆回购及短期存款投资，并在短期融资券收益率上行后进行了部分增持。同时，本基金保持了一定比例的以 Shibor 为基准的浮息债券投资以获取较高的持有期利息收入。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为 1.9045%，同期业绩比较基准收益率为 0.7086%，本基金的业绩比较基准为同期 7 天通知存款利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从紧的货币政策效果将逐渐显现，经济“软着陆”的迹象愈发明显。CPI 在 3 季度末开始可能会缓慢走低，通胀压力届时将有所缓解但仍将维持高位，央行有可能继续运用加息及提高存款准备金率等手段巩固反通胀成果，资金面偏紧的状态难以得到根本性缓解。

基于以上判断，本基金将在保持良好流动性的前提下，维持合理久期，并继续滚动投资于短期回购等货币市场工具，同时努力把握资金面阶段性紧张带来的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，

建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然月结转为相应的基金份额。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 263,824,844.23 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏现金增利证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,271,124,925.31	2,122,479,873.10
结算备付金		-	9,463,636.36
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	6,946,049,776.63	5,023,965,021.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,946,049,776.63	5,023,965,021.09
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,724,279,932.81	3,656,006,114.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	155,654,809.04	68,548,427.28
应收股利		-	-
应收申购款		69,195,511.98	66,634,637.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,166,554,955.77	10,947,347,709.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
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		2,916,646,452.11	1,579,498,570.75
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,155,135.37	2,698,778.48
应付托管费		1,562,162.18	817,811.68
应付销售服务费		3,905,405.55	2,044,529.14
应付交易费用	6.4.7.7	230,069.44	134,953.01
应交税费		301,852.46	301,852.46
应付利息		1,496,064.89	243,534.72
应付利润		1,512,168.30	612,592.98
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	428,102.28	364,532.74
负债合计		2,931,237,412.58	1,586,717,155.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	16,235,317,543.19	9,360,630,553.45
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		16,235,317,543.19	9,360,630,553.45
负债和所有者权益总计		19,166,554,955.77	10,947,347,709.41

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

16,235,317,543.19 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏现金增利证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		344,926,754.14	179,958,077.97
1.利息收入		323,739,006.70	153,120,874.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,597,262.99	13,205,290.54
债券利息收入		138,354,472.98	111,199,290.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		103,787,270.73	28,716,293.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,187,747.44	26,837,203.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,187,747.44	26,837,203.54
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		81,101,909.91	53,918,028.58
1.管理人报酬		22,861,636.44	22,186,566.04
2.托管费		6,927,768.55	6,723,201.89
3.销售服务费		17,319,421.49	16,808,004.56
4.交易费用		-	-
5.利息支出		33,763,266.04	7,976,020.05
其中：卖出回购金融资产支出		33,763,266.04	7,976,020.05
6.其他费用	6.4.7.18	229,817.39	224,236.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		263,824,844.23	126,040,049.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		263,824,844.23	126,040,049.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏现金增利证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	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	9,360,630,553.45	-	9,360,630,553.45

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	263,824,844.23	263,824,844.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	6,874,686,989.74	-	6,874,686,989.74
其中: 1.基金申购款	26,485,465,694.51	-	26,485,465,694.51
2.基金赎回款	-19,610,778,704.77	-	-19,610,778,704.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-263,824,844.23	-263,824,844.23
五、期末所有者权益(基金净值)	16,235,317,543.19	-	16,235,317,543.19
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	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)	14,123,273,565.83	-	14,123,273,565.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	126,040,049.39	126,040,049.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,783,246,251.14	-	-3,783,246,251.14
其中: 1.基金申购款	16,907,033,799.17	-	16,907,033,799.17
2.基金赎回款	-20,690,280,050.31	-	-20,690,280,050.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-126,040,049.39	-126,040,049.39
五、期末所有者权益(基金净值)	10,340,027,314.69	-	10,340,027,314.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

范勇宏 崔雁巍 崔雁巍
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏现金增利证券投资基金(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”)证监基金字[2004]23号《关于同意华夏现金增利证券投资基金设立的批复》核准,由基金发起人华夏基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》(于2004年9月16日废止,由2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》取代)、《开放式证券投资基金试点办法》(已废止)等有关规定和《华夏现金增利证券投资基金基金契约》(于2004年

10月15日改为《华夏现金增利证券投资基金基金合同》)发起,于2004年4月7日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集6,423,528,712.34元。业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2004)第058号验资报告予以验证。有关基金设立等文件已按规定向中国证监会备案。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《华夏现金增利证券投资基金基金合同》等有关规定,本基金的投资范围为剩余期限在397天以内的国债、政策性金融债和AAA级企业债等短期债券;期限在1年以内的债券回购和中央银行票据;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会于2010年2月8日发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	21,124,925.31
定期存款	4,250,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	2,150,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	2,100,000,000.00
其他存款	-
合计	4,271,124,925.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,946,049,776.63	6,926,678,000.00	-19,371,776.63	-0.12
	合计	6,946,049,776.63	6,926,678,000.00	-19,371,776.63	-0.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	7,724,279,932.81	-
合计	7,724,279,932.81	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,787.86
应收定期存款利息	45,813,528.03
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	61,243,151.50
应收买入返售证券利息	48,579,341.65
应收申购款利息	-
其他	-
合计	155,654,809.04

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	230,069.44
合计	230,069.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	-
预提费用	178,060.90
其他	41.38
合计	428,102.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,360,630,553.45	9,360,630,553.45
本期申购	26,485,465,694.51	26,485,465,694.51
本期赎回（以“-”号填列）	-19,610,778,704.77	-19,610,778,704.77
本期末	16,235,317,543.19	16,235,317,543.19

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	263,824,844.23	-	263,824,844.23
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-263,824,844.23	-	-263,824,844.23
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	304,325.17
定期存款利息收入	81,212,599.98
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	80,337.84
其他	-
合计	81,597,262.99

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,734,225,795.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,595,411,058.22
减：应收利息总额	117,626,989.40
债券投资收益	21,187,747.44

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	119,012.93
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	47,256.49
合计	229,817.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中信万通证券有限责任公司（“中信万通证券”）	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（“中信金通证券”）	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,861,636.44	22,186,566.04
其中：支付销售机构的客户维护费	5,008,627.50	3,948,136.79

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②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 × 0.33% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,927,768.55	6,723,201.89

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日

累计至每月月底，按月支付。

②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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华夏基金管理有限公司	3,269,187.38	
中国建设银行	3,845,933.84	
中信证券	52,072.04	
中信金通证券	12,989.09	
中信万通证券	7,737.10	
合计	7,187,919.45	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华夏基金管理有限公司	5,323,241.77	
中国建设银行	3,914,339.53	
中信证券	36,389.64	
中信金通证券	10,442.18	
中信万通证券	4,303.70	
合计	9,288,716.82	

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	431,505,974.84	414,951,999.27	-	-	7,270,000,000.00	1,623,438.36
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	125,053,066.71	10,073,652.17	-	-	36,743,550,000.00	1,756,937.44

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	21,124,925.31	304,325.17	61,637,387.70	586,516.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
262,925,268.91	-	899,575.32	263,824,844.23	-

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,916,646,452.11 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
110308	11进出08	2011-07-01	99.92	6,100,000	609,489,532.30

068007	06首都机场债	2011-07-01	98.68	3,200,000	315,778,599.22
1181107	11酒钢CP01	2011-07-01	100.23	2,500,000	250,568,474.84
1181069	11昆钢集CP01	2011-07-01	100.12	1,500,000	150,172,623.79
110217	11国开17	2011-07-01	99.89	1,500,000	149,833,406.21
110212	11国开12	2011-07-01	99.54	1,400,000	139,353,757.70
1181047	11中航重CP01	2011-07-01	100.24	1,000,000	100,237,359.48
1181105	11荣盛CP01	2011-07-01	100.12	1,000,000	100,124,144.93
1081345	10包钢集CP01	2011-07-01	99.94	1,000,000	99,940,962.69
1181234	11山煤CP01	2011-07-01	100.18	740,000	74,132,106.08
1181137	11北部湾CP02	2011-07-01	100.13	700,000	70,090,028.44
1101031	11央行票据31	2011-07-01	99.67	700,000	69,767,061.76
090205	09国开05	2011-07-01	101.75	500,000	50,876,790.14
1081441	10公控CP02	2011-07-01	100.00	500,000	50,000,000.00
1101021	11央行票据21	2011-07-01	99.95	270,000	26,985,237.18
090205	09国开05	2011-07-04	101.75	5,400,000	549,469,333.48
110221	11国开21	2011-07-04	99.38	1,000,000	99,384,642.11
1101031	11央行票据31	2011-07-04	99.67	300,000	29,900,169.32
080222	08国开22	2011-07-04	99.58	300,000	29,873,356.24
合计	-	-	-	29,610,000	2,965,977,585.91

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后, 通过正式报告的方式, 将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会, 协助制定风险控制决策, 实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法, 估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重性; 从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用的金融工具特征, 通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时对各种风险进行监督、检查和评估, 并制定相应决策, 将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金主要投资于银行间市场，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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，本基金管理人通过监测组合久期等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	合计
银行存款	4,271,124,925.31	-	-	4,271,124,925.31
结算备付金	-	-	-	-
债券投资	3,071,784,194.85	3,874,265,581.78	-	6,946,049,776.63
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,724,279,932.81	-	-	7,724,279,932.81
卖出回购金融资产款	2,916,646,452.11	-	-	2,916,646,452.11
上年度末 2010 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	合计
银行存款	2,122,479,873.10	-	-	2,122,479,873.10
结算备付金	9,463,636.36	-	-	9,463,636.36

债券投资	2,788,637,845.06	2,235,327,176.03	-	5,023,965,021.09
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,656,006,114.00	-	-	3,656,006,114.00
卖出回购金融资产款	1,579,498,570.75	-	-	1,579,498,570.75

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,946,049,776.63	36.24
	其中：债券	6,946,049,776.63	36.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,724,279,932.81	40.30
	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	4,271,124,925.31	22.28
4	其他各项资产	225,100,321.02	1.17
5	合计	19,166,554,955.77	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	12.52
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,916,646,452.11	17.96
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	124
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	24.39	17.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.97	-
2	30 天（含）—60 天	11.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.98	-
3	60 天（含）—90 天	13.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.48	-
4	90 天（含）—180 天	43.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天（含）—397 天（含）	24.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	116.67	17.96

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------

			(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	179,595,610.84	1.11
3	金融债券	2,423,357,955.07	14.93
	其中：政策性金融债	2,423,357,955.07	14.93
4	企业债券	558,506,674.70	3.44
5	企业短期融资券	3,784,589,536.02	23.31
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	6,946,049,776.63	42.78
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	2,342,501,741.23	14.43

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	110221	11 国开 21	9,000,000	894,461,779.00	5.51
2	110308	11 进出 08	6,100,000	609,489,532.30	3.75
3	090205	09 国开 05	5,900,000	600,346,123.62	3.70
4	068007	06 首都机场债	3,250,000	320,712,639.83	1.98
5	1181107	11 酒钢 CP01	2,500,000	250,568,474.84	1.54
6	0980147	09 中航工债浮	2,300,000	237,794,034.87	1.46
7	1181235	11 雅戈尔 CP01	1,500,000	150,251,614.03	0.93
8	1181069	11 昆钢集 CP01	1,500,000	150,172,623.79	0.92
9	110217	11 国开 17	1,500,000	149,833,406.21	0.92
10	110212	11 国开 12	1,400,000	139,353,757.70	0.86

7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数	30
报告期内偏离度的最高值	0.33%
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	0.21%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性，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商定利率每日计提应收利息，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，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计

算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用“影子定价”,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重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为“公允价值变动损益”,并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1.00 元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

7.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

7.8.3 报告期内,本基金投资决策程序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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
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

7.8.5 其他需说明的重要事项

7.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

7.8.5.2 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
258,100	62,903.21	1,860,603,204.36	11.46%	14,374,714,338.83	88.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	12,950,821.02	0.08%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 4 月 7 日）基金份额总额	6,426,134,798.32
本报告期期初基金份额总额	9,360,630,553.45
本报告期基金总申购份额	26,485,465,694.51
减：本报告期基金总赎回份额	19,610,778,704.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,235,317,543.19

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2011 年 2 月 9 日，本基金托管人发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。2011 年 1 月 31 日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-

注：①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：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 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。

v 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。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元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交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 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交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
申银万国证券	-	-	9,756,800,000.00	100.00%
中国银河证券	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于设立杭州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-01-05
2	华夏基金管理有限公司关于在中国银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-09

3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信证券股份有限公司办理定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-11
4	华夏基金管理有限公司关于设立广州分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-03-31
5	华夏基金管理有限公司关于在中国农业银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-07
6	关于调整华夏现金增利证券投资基金申购业务限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-04-07
7	关于停止中行广东省分行长城借记卡基金网上交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-05-28
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开办定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2011-06-23

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 11.1.2 《华夏现金增利证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏现金增利证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。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
二〇一一年八月二十四日