

**【上接A18版】**  
 法定代表人:王耀宁  
 电话:0571-87925129  
 传真:0571-8782042  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.ewec.com.cn  
 客户服务电话:0571-96336  
 96 华信证券有限责任公司  
 住所:深圳市福田区益田路4018号平安大厦28层A  
 办公地址:上海中潭路750号  
 法定代表人:王文宇  
 电话:021-64316962  
 传真:021-6433051  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.ewec.com.cn  
 客户服务电话:021-2109999-029-68918888  
**97 鹏华基金管理有限公司**  
 住所:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层15层  
 办公地址:北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层15层  
 法定代表人:邓煜  
 电话:100-58328366/010-58328722  
 传真:100-58328748  
 联系人:邱均玲、刘斌  
 网址:www.allsecurities.com  
 客户服务电话:400-887-8827

**98 中国建银投资证券有限责任公司**  
 住所:深圳市福田区益田路3008号世界金融中心48-49层  
 办公地址:深圳市福田区益田路3008号世界金融中心29层  
 法定代表人:杨小阳  
 电话:0755-8202621  
 传真:0755-8202639  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.cib.com.cn  
 客户服务电话:400-600-8008  
**99 上海证券有限责任公司**  
 住所:上海市虹口区四川路90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:李俊杰  
 电话:0755-2570586  
 传真:0755-8266082  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.shzq.com.cn  
 客户服务电话:400-102-1011  
**100 华泰证券股份有限公司**  
 住所:江苏省南京市中山东路101号  
 办公地址:上海中潭路118号东方企业园24号  
 法定代表人:贾海涛  
 电话:021-3633016  
 传真:021-3633017  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.htsec.com.cn  
 客户服务电话:400-881-1177

**101 信达证券股份有限公司**  
 住所:深圳市福田区益田路18号  
 办公地址:深圳市福田区益田路18号  
 法定代表人:王浩  
 电话:010-88686800-730/010-88686830-737  
 传真:010-66412337  
 联系人:陈书彬、李峻光  
 网址:www.cindasc.com.cn  
 客户服务电话:010-8806830  
**102 方正证券股份有限公司**  
 住所:吉林省长春市解放大路56号  
 办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号  
 法定代表人:李俊杰  
 电话:0451-8233666  
 传真:0451-82827211  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.fund.com.cn  
 客户服务电话:400-666-2288

**103 世纪证券有限责任公司**  
 住所:北京西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层  
 办公地址:北京西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层  
 法定代表人:李勇  
 电话:010-59355941  
 传真:010-66555791  
 联系人:李勇  
 网址:www.secfund.com.cn  
 客户服务电话:400-889-5618  
**104 华安证券股份有限公司**  
 住所:上海浦东新区世纪大道1667-2楼  
 办公地址:上海浦东新区世纪大道1667-2楼  
 法定代表人:李梅  
 电话:021-50122126  
 传真:021-50122398  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.huanan.com.cn  
 客户服务电话:400-820-8898

**105 国元证券股份有限公司**  
 住所:合肥市寿县路17号  
 办公地址:合肥市寿县路2号安徽大厦十七楼  
 法定代表人:李工  
 电话:0552-5161642/15880287470  
 传真:0552-5161140  
 联系人:王耀宁  
 网址:www.guoyuan.com.cn  
 客户服务电话:0552-5163588  
**106 国信证券股份有限公司**  
 住所:上海市南京西路788号23楼  
 办公地址:上海市南京西路788号20-25楼  
 法定代表人:陈佳彬  
 电话:021-3229888  
 传真:021-6278783  
 联系人:李梅  
 网址:www.guoxin.com.cn  
 客户服务电话:021-62340678

**107 华融证券股份有限公司**  
 住所:北京市西城区广安门内大街26号  
 办公地址:北京市西城区广安门内大街26号  
 法定代表人:王刚  
 电话:010-5856007  
 传真:010-5856062  
 联系人:李宇  
 网址:www.hrsec.com.cn  
 客户服务电话:010-58561118  
**108 天风证券股份有限公司**  
 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:李刚  
 电话:027-8718882  
 传真:027-8718853  
 联系人:李梅  
 网址:www.tfsc.com.cn  
 客户服务电话:028-86711410/027-87618882

**109 招商证券股份有限公司**  
 住所:深圳市福田区益田路3008号平安大厦8楼12层  
 办公地址:深圳市福田区益田路3008号平安大厦8楼12层  
 法定代表人:李卫  
 电话:400-818-6666  
 传真:010-61847000  
 联系人:李梅  
**110 华泰联合证券有限责任公司**  
 住所:深圳市福田区华强北路101号国际商会大厦C座11层  
 办公地址:深圳市福田区华强北路101号国际商会大厦C座11层  
 法定代表人:王宇  
 电话:010-5776888  
 传真:010-5776877  
 联系人:杨利  
**111 光大证券股份有限公司**  
 住所:上海市浦东新区世纪大道1318号光大银行大厦6楼  
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1318号光大银行大厦6楼  
 法定代表人:杨信  
 电话:021-2323888  
 传真:021-2323880  
 联系人:李梅  
 经办人:孙海、王桂、李峰

**四、基金的名称**

本基金名称:华夏现金增利证券投资基金。

**五、基金的类型**

本基金类型:契约开放式、货币型基金。

**六、基金的投资目标**

本基金的投资目标: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。

**七、基金的投资方向**

本基金的投资范围:包括现金类资产以及中国证监会和AAA级企业债等短期债券,期限在1年以内的债券和央行票据,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

**八、基金的投资策略**

1. 短期利率预期策略  
 短期利率预期策略是本基金的基本投资策略,根据对宏观经济指标、财政与货币政策、市场预期变化和市场价格供求等因素的研究与分析,对未来一段时期的短期利率走势进行积极的判断,从而确定调整组合的期限品种配置,以选择具有较高预期收益、低风险收益品种。

2. 中期票策略  
 根据对中期利率的预期,在调整组合的平均期限,在预期利率上升时,缩短组合的平均期限,以规避资本损失或获得较高的投资收益;在预期利率下降时,延长组合的平均期限,以获得利率敏感或提前赎回的资本增值。

3. 期限选择和品种选择  
 本基金根据宏观经济、交易所交易品种的期限、企业债品种的期限、信用评级和流动性、金融债、央行票据和债券的期限,以及国债、存单、定期存款的期限,由于上述工具有不同的流动性特性和收益率,本基金将研究它们的市场利率政策变化,参与主体信用等级变化,市场容量和流动性等因素,制定和调整期限品种配置,一方面提高组合的收益率,另一方面提高组合的流动性。

4. 利用短期利率与基金的买卖策略  
 本基金根据宏观经济、交易所交易品种的期限、企业债品种的期限、信用评级和流动性、金融债、央行票据和债券的期限,以及国债、存单、定期存款的期限,由于上述工具有不同的流动性特性和收益率,本基金将研究它们的市场利率政策变化,参与主体信用等级变化,市场容量和流动性等因素,制定和调整期限品种配置,一方面提高组合的收益率,另一方面提高组合的流动性。

5. 基金业绩比较基准  
 本基金业绩比较基准为同期3个月定期存款利率。

在合理的市场化利率基准的前提下,基金管理人可根据投资目标投资策略,确定变更定期存款利率,并及时公告。

**九、基金的风险控制**

本基金投资于货币型基金中低风险品种的,其投资组合投资于低风险基金,组合基金和债券基金。

**十、基金投资组合报告**

基金管理人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。

**五、报告期内按持仓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**

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	041152001	11国债集CP04	5,500,000	550,668,307.1	4.89
2	0205050	11财国债05	5,400,000	530,134,972.94	4.71
3	119905	11国债国债05	3,000,000	294,564,680.23	2.62
4	1181107	11国债CP01	2,500,000	249,008,995.46	2.21
5	1181069	11国债集CP01	1,500,000	149,884,432.13	1.33
6	1181235	11国债艾尔CP01	1,500,000	148,562,667.1	1.32
7	1181047	11中债集CP01	1,000,000	100,142,630.78	0.89
8	1181137	11北部政CP02	1,000,000	99,689,327.83	0.89
9	1181189	11民生中CP01	700,000	69,527,624.98	0.62
10	1181241	11民生中CP01	700,000	69,303,969.78	0.62

① 报告期内前十大持仓债券占基金资产净值的比例

项目	偏离度
报告期内前十大持仓债券占基金资产净值的比例	0%
报告期内前十大持仓债券最高偏离度	-0.00%
报告期内前十大持仓债券最低偏离度	-0.24%
报告期内每个工作日前十大持仓债券的简单平均值	0.08%

**六、报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

**七、投资组合报告附注**

1. 基金计价方法说明  
 鉴于资产市场价格的特性,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利息,并据此利率在计提每个计息期间的摊销其本人的溢价或折价,以摊余成本计算基金资产净值。

为了更准确地反映本基金资产净值与持仓债券公允价值之间的差异,本基金在编制资产负债表时,对基金持有的资产支持证券公允价值与摊余成本之间的差额,即溢价或折价,按照公允价值摊销计入当期损益,以公允价值计量资产支持证券的公允价值变动损益,计入当期损益。

2. 本基金报告期内未持有公允价值占基金资产净值比例超过2%的资产支持证券。

3. 报告期内,本基金投资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、处罚的情况。

4. 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	卖出回购金融资产	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收申购款	168,986,391.87
4	应收利息	2,719,427.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,955,819.74

**八、投资组合报告附注的其他文字描述部分**

1. 报告期内没有影响投资策略的证券投资决策程序。  
 2. 报告期内没有影响投资策略的证券投资决策程序。

**十二、基金的业绩**

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。基金业绩并不构成对基金业绩表现的保证,投资者在做出投资决策前应仔细阅读基金招募说明书。

本基金业绩比较基准:人民币1元。

期间	①	②	③	④	⑤
2004年1月1日至2004年12月31日	1.7896%	0.0012%	1.2081%	0.0003%	0.0009%
2005年1月1日至2005年12月31日	2.4887%	0.0030%	1.8009%	0.0009%	0.6887%
2006年1月1日至2006年12月31日	2.0482%	0.0022%	1.8915%	0.0003%	0.1567%
2007年1月1日至2007年12月31日	3.5428%	0.0028%	2.8162%	0.0019%	0.7269%
2008年1月1日至2008年12月31日	4.0683%	0.0120%	1.8066%	0.0015%	2.2597%
2009年1月1日至2009年12月31日	1.7616%	0.0056%	1.3500%	0.0006%	0.4116%
2010年1月1日至2010年12月31日	2.2010%	0.0045%	1.3500%	0.0009%	0.8510%
2011年1月1日至2011年9月30日	2.6662%	0.0039%	1.0841%	0.0002%	1.5821%

**十三、风险提示**

(一)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. 基金销售服务费  
 4. 基金销售服务费  
 5. 基金销售服务费  
 6. 基金销售服务费  
 7. 基金销售服务费  
 8. 基金销售服务费  
 9. 基金销售服务费  
 10. 基金销售服务费  
 11. 基金销售服务费  
 12. 基金销售服务费  
 13. 基金销售服务费  
 14. 基金销售服务费  
 15. 基金销售服务费  
 16. 基金销售服务费  
 17. 基金销售服务费  
 18. 基金销售服务费  
 19. 基金销售服务费  
 20. 基金销售服务费  
 21. 基金销售服务费  
 22. 基金销售服务费  
 23. 基金销售服务费  
 24. 基金销售服务费  
 25. 基金销售服务费  
 26. 基金销售服务费  
 27. 基金销售服务费  
 28. 基金销售服务费  
 29. 基金销售服务费  
 30. 基金销售服务费  
 31. 基金销售服务费  
 32. 基金销售服务费  
 33. 基金销售服务费  
 34. 基金销售服务费  
 35. 基金销售服务费  
 36. 基金销售服务费  
 37. 基金销售服务费  
 38. 基金销售服务费  
 39. 基金销售服务费  
 40. 基金销售服务费  
 41. 基金销售服务费  
 42. 基金销售服务费  
 43. 基金销售服务费  
 44. 基金销售服务费  
 45. 基金销售服务费  
 46. 基金销售服务费  
 47. 基金销售服务费  
 48. 基金销售服务费  
 49. 基金销售服务费  
 50. 基金销售服务费  
 51. 基金销售服务费  
 52. 基金销售服务费  
 53. 基金销售服务费  
 54. 基金销售服务费  
 55. 基金销售服务费  
 56. 基金销售服务费  
 57. 基金销售服务费  
 58. 基金销售服务费  
 59. 基金销售服务费  
 60. 基金销售服务费  
 61. 基金销售服务费  
 62. 基金销售服务费  
 63. 基金销售服务费  
 64. 基金销售服务费  
 65. 基金销售服务费  
 66. 基金销售服务费  
 67. 基金销售服务费  
 68. 基金销售服务费  
 69. 基金销售服务费  
 70. 基金销售服务费  
 71. 基金销售服务费  
 72. 基金销售服务费  
 73. 基金销售服务费  
 74. 基金销售服务费  
 75. 基金销售服务费  
 76. 基金销售服务费  
 77. 基金销售服务费  
 78. 基金销售服务费  
 79. 基金销售服务费  
 80. 基金销售服务费  
 81. 基金销售服务费  
 82. 基金销售服务费  
 83. 基金销售服务费  
 84. 基金销售服务费  
 85. 基金销售服务费  
 86. 基金销售服务费  
 87. 基金销售服务费  
 88. 基金销售服务费  
 89. 基金销售服务费