

华夏回报证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现，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。
本报告中财务资料未经审计。本报告自2006年7月1日起至9月30日止。

石波先生，法学硕士。曾任君安证券股份有限公司投资银行部上海总部副总经理，上海实业股份有限公司常务副总经理。1999年加入华夏基金管理有限公司，历任兴科证券投资基金基金经理、兴华证券投资基金基金经理。现任华夏回报基金基金经理、股票投资部执行副总经理。
华夏回报证券投资基金基金经理，华夏回报二号证券投资基金基金经理。
2、报告期内本基金运作遵守法律法规，不存在违法违规或损害基金份额持有人利益的行为。对于市场变化等客观原因导致的基金投资组合期间内出现了个别偏离投资指标不符合规定的现象，在基金托管人提示后，基金管理人进行了调整。我们继续坚持以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。
3、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2006年9月30日，本基金份额净值为1.399元，本报告期份额净值增长率为0.01%，同期上证综指上涨4.80%，深圳成指上涨0.58%。

Table with columns: 代码, 名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists various assets like 国债, 金融债, 央行票据, etc.

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、报告期内基金的其他资产构成
单位:元
交易保证金 2,560,615.62
应收证券清算款 25,649,339.15
应收利息 8,881,124.49
应收申购款 446,063.61
合计 37,527,138.77

三、主要财务指标和基金净值表现
下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。
(一)主要财务指标
基金本期净收益 31,740,841.80元
基金本期净收益占基金资产净值 0.0181%
期末基金资产净值 2,425,585,582.47元
期末基金份额净值 1.399元

Table with columns: 项目, 金额(元), 占净资产比例. Lists assets like 股票, 债券, 权证, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 10 stocks.



华夏大盘精选证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现，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。
本报告中财务资料未经审计。本报告自2006年7月1日起至9月30日止。

王亚伟先生，经济学硕士。曾任中信国际投资公司业务经理，华夏证券有限公司研究经理。1998年加入华夏基金管理有限公司，历任兴华证券投资基金基金经理助理、基金精选证券投资基金基金经理。
2、报告期内本基金运作遵守法律法规，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。
3、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2006年9月30日，本基金份额净值为1.780元，本报告期份额净值增长率为5.58%，同期上证综指上涨4.80%，深圳成指上涨0.58%。

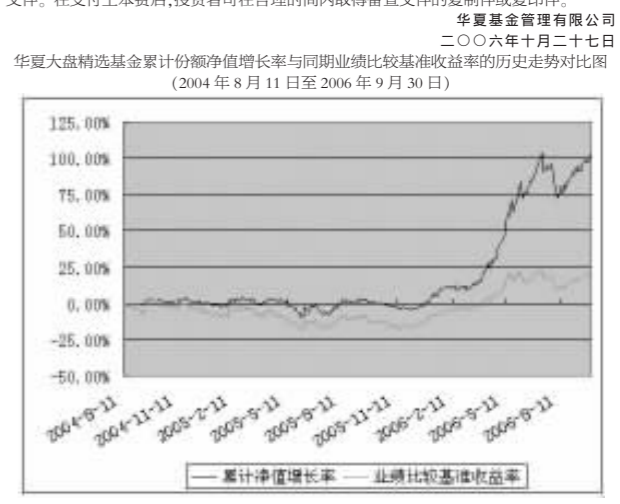
Table with columns: 代码, 名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists various assets like 其中:食品、饮料, 农林、牧、渔业, etc.

4、报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期内本基金未持有权证。
六、开放式基金份额变动
单位:份
期初基金份额总额 680,425,023.22
报告期间基金总申购份额 477,641,877.47
报告期间基金总赎回份额 276,420,131.91
报告期末基金份额总额 879,646,768.88

三、主要财务指标和基金净值表现
下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。
(一)主要财务指标
基金本期净收益 107,727,256.37元
基金本期净收益占基金资产净值 0.1259%
期末基金资产净值 1,565,962,975.60元
期末基金份额净值 1.780元

Table with columns: 项目, 金额(元), 占净资产比例. Lists assets like 股票, 债券, 权证, etc.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 10 stocks.



华夏现金增利证券投资基金 2006年第三季度报告

一、重要提示
基金管理人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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现，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。
本报告中财务资料未经审计。本报告自2006年7月1日起至9月30日止。

2、本基金投资于债券、回购、票据等短期金融工具的比例不低于基金资产总值的80%；由本基金管理人管理的其他基金持有该证券，不得超过该证券的10%；投资符合法律法规规定的其他基金合同规定。
四、管理人报告
王亚伟先生，上海大学经济信息管理专业学士。历任上海银行资金营运部交易员、资金营运部中心业务助理、经理。2005年加入华夏基金管理有限公司，现任华夏现金增利证券投资基金基金经理。
2、报告期内本基金运作遵守法律法规，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情况。
3、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2006年9月30日，基金七日年化收益率为2.075%，季度总回报率为0.5077%，折年收益率超越业绩比较基准一年期人民币定期存款税后收益率约1.04个百分点。

Table with columns: 序号, 日期, 天数. Lists various metrics like 平均赎回期限, 报告期末投资组合平均剩余期限, etc.

Table with columns: 序号, 资产支持证券品种, 市值(元), 占净值比例. Lists top 10 assets.

Table with columns: 阶段, 基金净值收益率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准差. Shows performance metrics over time.

Table with columns: 项目, 金额(元), 占净资产比例. Lists assets like 债券, 资产支持证券, 买入返售证券, etc.

Table with columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 成本(元), 占基金资产净值的比例. Lists top 10 bonds.

Table with columns: 序号, 其他资产, 金额(元). Lists other assets like 交易保证金, 应收利息, etc.

注:1.本基金合同于2004年4月7日生效,2004年4月13日开始办理申购、赎回业务。

注:1.本基金合同于2004年8月11日生效,2004年9月10日开始办理申购、赎回业务。