华夏财富宝货币市场基金
2014 年第 2 季度报告

2014 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏财富宝货币
基金主代码	000343
交易代码	000343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	62,192,954,352.74 份
投资目标	在力求安全性的前提下，追求稳定的绝对回报。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、个券选择策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	981,561,359.78
2.本期利润	981,561,359.78
3.期末基金资产净值	62,192,954,352.74

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，由于本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

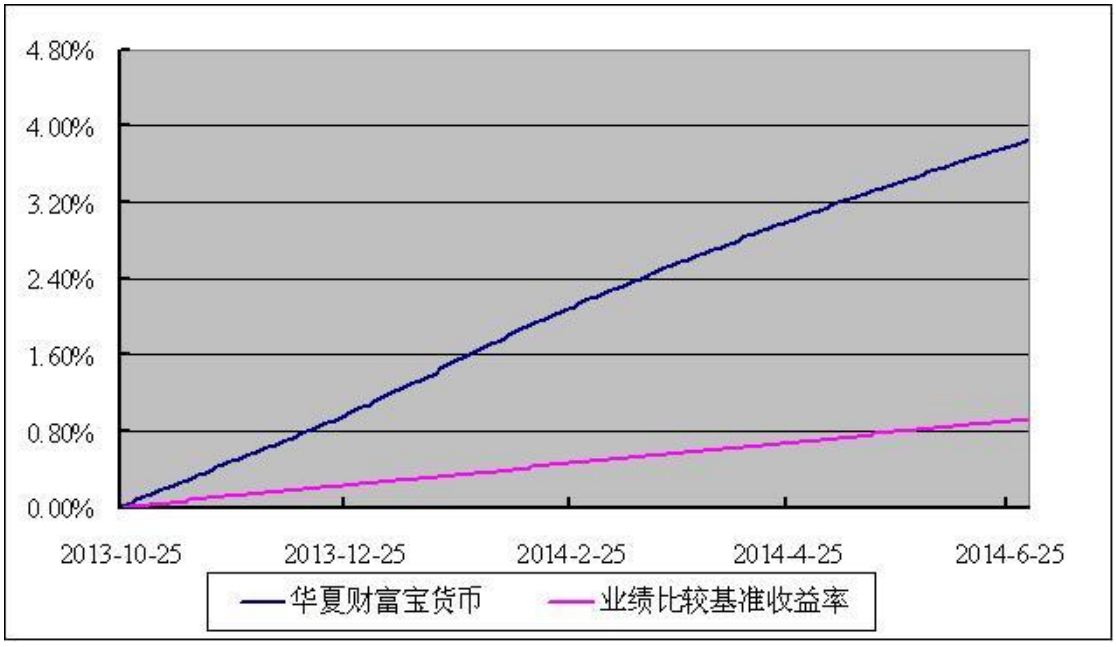
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.1925%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.8559%	0.0010%

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

华夏财富宝货币市场基金

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

（2013 年 10 月 25 日至 2014 年 6 月 30 日）



注：①本基金合同于 2013 年 10 月 25 日生效。

②根据华夏财富宝货币市场基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

§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		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、现金管理部总经理	2013-10-25	-	11 年	清华大学工商管理学硕士。2003 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾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、固定收益部总经理助理等。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格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 公平交易专项说明

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 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。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度，央行通过定向降准等措施实质上执行了较为宽松的货币政策，资金面整体宽裕，银行间 7 天回购利率长期保持在 3%左右的较低水平，且波动性显著下降。各类短期债券表现优异，到期收益率普遍下行 50bp 以上。流动性好、

收益较高的同业存款仍为各货币基金的投资品种首选，但相对于中高评级短期融资券的相对优势有所减弱。

报告期内，本基金规模基本稳定，在资产配置上绝大部分为同业存款。6 月份开始，鉴于短期融资券相对优势有所上升，本基金增加了对短期融资券的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金本报告期份额净值收益率为 1.1925%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%，本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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 3 季度，经济基本面仍不乐观，货币政策仍将偏宽松。在定向降准等各种“微刺激”政策的持续叠加作用下，短端利率仍有下行压力。高流动性的同业存款仍为货币基金投资首选，中高评级短期融资券的吸引力也较为突出。

3 季度，本基金将维持较高仓位的同业存款，同时增加中高评级短期融资券的投资比例。

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。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	7,491,883,453.55	11.45
	其中：债券	7,491,883,453.55	11.45
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,362,421,769.88	5.14
	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	54,400,647,474.08	83.12
4	其他各项资产	190,795,018.72	0.29
5	合计	65,445,747,716.23	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.37	
	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	3,216,958,264.06	5.17
	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。

报告期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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

本基金合同约定：“基金投资组合的平均剩余期限不超过 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告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	8.17	5.17
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	32.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.11	-
4	90 天(含)—180 天	31.82	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	14.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.92	5.17

5.4 报告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	-	-
3	金融债券	3,269,917,305.70	5.26
	其中：政策性金融债	3,269,917,305.70	5.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,892,935,353.65	6.26
6	中期票据	329,030,794.20	0.53
7	其他	-	-
8	合计	7,491,883,453.55	12.05
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	69,828,417.02	0.11

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	140436	14 农发 36	11,600,000	1,159,168,237.81	1.86
2	140207	14 国开 07	8,400,000	840,204,508.97	1.35
3	140204	14 国开 04	6,000,000	601,104,819.42	0.97
4	140212	14 国开 12	5,100,000	509,652,142.33	0.82
5	011437004	14 中建材 SCP004	4,300,000	430,887,914.85	0.69
6	011415005	14 中铝业 SCP005	2,900,000	290,000,136.30	0.47
7	041458048	14 同盛 CP001	2,500,000	249,758,205.50	0.40
8	041462014	14 广晟 CP002	2,000,000	200,564,504.16	0.32
9	041456029	14 大唐新能 CP001	2,000,000	200,000,142.36	0.32
10	041456031	14 陕交建 CP001	2,000,000	200,000,141.91	0.32

5.6 “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	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.02%
报告期内偏离度的最低值	0.00%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.8.4 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	3,547.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	190,404,470.17
4	应收申购款	387,001.19
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	190,795,018.72

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	82,165,470,279.27
本报告期基金总申购份额	62,142,365,909.39
减：本报告期基金总赎回份额	82,114,881,835.92
本报告期期末基金份额总额	62,192,954,352.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014 年 5 月 29 日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告。

2014 年 6 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购中国铝业公司 2014 年度第五期超短期融资券的公告。

2014 年 6 月 11 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购广东粤海控

股有限公司 2014 年度第一期短期融资券的公告。

2014 年 6 月 14 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购江苏宁沪高速公路股份有限公司 2014 年度第二期超短期融资券的公告。

2014 年 6 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购上海同盛投资（集团）有限公司 2014 年度第一期短期融资券的公告。

8.2 其他相关信息

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、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 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、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2014 年 4 月，在《上海证券报》主办的“第十一届中国金基金奖”评选中，华夏基金荣获“金基金·TOP 公司大奖”，所管理的基金荣获 5 个单项奖，为获奖最多的基金公司。2014 年 6 月，在《证券时报》主办的“2013 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏基金荣获“五年持续回报明星基金公司奖”和“2013 年度十大明星基金公司奖”，所管理的基金荣获 3 个单项奖。

在客户服务方面，2 季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户资金管理便利性：（1）在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能，投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询，提高投资者使用的便利性；（2）在网上查询系统、客服热线自助语音系统中新增百度金融及微信理财通平台数据，投资者可以通过本公司网站或客服电话查询相关信息，满足投资者多渠道查询的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《华夏财富宝货币市场基金基金合同》；

9.1.3《华夏财富宝货币市场基金托管协议》；

9.1.4 法律意见书；

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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

二〇一四年七月十九日