华夏理财 21 天债券型证券投资基金

2014 第二季度 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	华夏理财 21 天债券	
基金主代码	001077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年 1 月 22 日	
报告期末基金份额总额	138,142,704.30 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	本基金将采用积极管理型的投资策略,在尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
下属两级基金的交易代码	001077	001078
报告期末下属两级基金的份额总额	138,142,704.30 份	–

§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)	
	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
1.本期已实现收益	1,910,787.88	58,805.05
2.本期利润	1,910,787.88	58,805.05
3.期末基金资产净值	138,142,704.30	–

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本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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

华夏理财 21 天债券 A:

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	1.1423%	0.0093%	0.3366%	0.0000%	0.8057%	0.0093%

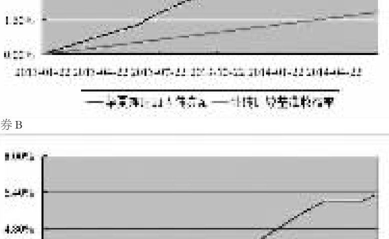
华夏理财 21 天债券 B:

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	0.3641%	0.0058%	0.3366%	0.0000%	0.0275%	0.0058%

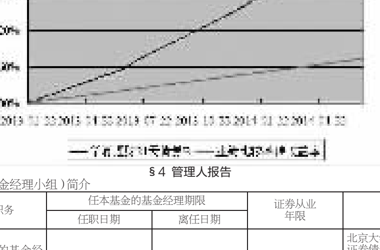
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财 21 天债券型证券投资基金
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
(2013 年 1 月 22 日至 2014 年 6 月 30 日)

华夏理财 21 天债券 A



华夏理财 21 天债券 B



§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		
魏镇江	本基金的基金经理	2013–04–26	–	11年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005 年 3 月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员等。

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,国内经济增长动能仍然疲弱,通胀保持平稳低位。央行货币政策转向宽松,通过公开市场、再贷款和定向降准等方式放松流动性,融资环境有所改善。

在宽松货币政策影响下,货币市场利率下降,银行间 7 天回购利率的均值处于低位,短期存款利率也有较大幅度回落,AAA 级短期融资券的到期收益率下行至 4.8%左右。

报告期内,本基金主要滚动投资于利率较高的短期同业存款和逆回购,增持了部分短期融资券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日,华夏理财 21 天债券 A 本报告期份额净值收益率为 1.1423%;华夏理财 21 天债券 B 本报告期份额净值收益率为 0.3641%。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,经济增长有望企稳,通胀仍不会构成明显压力,货币供应 M2 增速将反弹至央行的目标增速之上。但整体融资环境不会明显改善,央行可能继续维持相对宽松的货币政策,通过正回购利率和逆回购利率形成的“利率走廊”来稳定货币市场的利率。

3 季度,本基金将增加对短期债券的投资,适当提高组合久期,在控制好流动性风险的前提下力争提高组合收益。

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	50,042,399.72	35.87
	其中:债券	50,042,399.72	35.87
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	6,984,130.48	5.01
	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	81,255,323.96	58.24
4	其他各项资产	1,224,762.17	0.88
5	合计	139,506,616.33	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	0.84	
	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	999,879.50	0.72
	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情况的说明

本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

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:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 141 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	40.71	0.72
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60 天	10.13	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90 天	20.25	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180 天	7.24	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397 天(含)	21.77	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
6	合计	100.10	0.72

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	20,030,667.67	14.50
	其中:政策性金融债	20,030,667.67	14.50
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	30,011,732.05	21.73
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	50,042,399.72	36.23
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	–	–

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	041458027	14苏广电 CP001	100,000	10,037,935.37	7.27
2	140207	14国开 07	100,000	10,035,034.44	7.26
3	011415005	14中铝业 SCP005	100,000	10,000,136.24	7.24
4	130227	13国开 27	100,000	9,995,633.23	7.24
5	041372006	13中金黄金 CP001	100,000	9,973,660.44	7.22
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

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	0.16%
报告期内偏离度的最低值	0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.11%

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

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	1,115,065.27
4	应收申购款	109,696.90
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	1,224,762.17

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

项目	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
本报告期期初基金份额总额	170,518,760.79	32,640,978.96
本报告期基金总申购份额	98,079,405.75	10,505,245.80
减:本报告期基金总赎回份额	130,455,462.24	43,146,224.76
本报告期期末基金份额总额	138,142,704.30	–

注:上述“本报告期基金总申购份额”、“本报告期基金总赎回份额”包含 A 级基金份额、B 级基金份额间升降级的基金份额。

§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 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

2014 年 5 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

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。

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《华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏理财 21 天债券型证券投资基金托管协议》;

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

华夏理财 30 天债券型证券投资基金

2014 第二季度 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华夏理财 30 天债券	
基金主代码	001057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年 10 月 24 日	
报告期末基金份额总额	1,277,918,221.07 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	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
下属两级基金的交易代码	001057	001058
报告期末下属两级基金的份额总额	1,179,934,873.11 份	97,983,347.96 份

§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)	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
1.本期已实现收益	18,102,414.91	2,891,600.42
2.本期利润	18,102,414.91	2,891,600.42
3.期末基金资产净值	1,179,934,873.11	97,983,347.96

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本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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

华夏理财 30 天债券 A:

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	1.1580%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.8214%	0.0008%

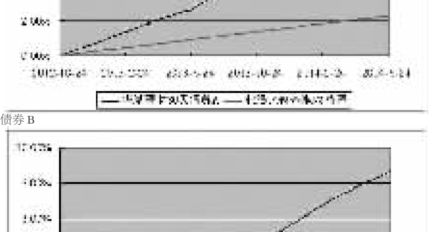
华夏理财 30 天债券 B:

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	1.2187%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.8821%	0.0008%

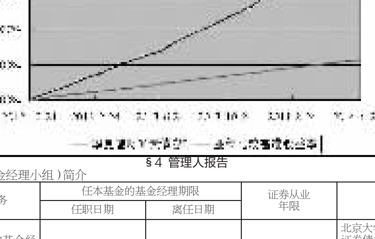
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财 30 天债券型证券投资基金
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
(2012 年 10 月 24 日至 2014 年 6 月 30 日)

华夏理财 30 天债券 A



华夏理财 30 天债券 B



§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		
魏镇江	本基金的基金经理	2013–04–26	–	11年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005 年 3 月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员等。

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,国内经济增长动能仍然疲弱,通胀保持平稳低位。央行货币政策转向宽松,通过公开市场、再贷款和定向降准等方式放松流动性,融资环境有所改善。

在宽松货币政策影响下,货币市场利率下降,银行间 7 天回购利率的均值处于低位,短期存款利率也有较大幅度回落,AAA 级短期融资券的到期收益率下行至 4.8%左右。

报告期内,本基金主要滚动投资于利率较高的短期同业存款和逆回购,增持了部分短期融资券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日,华夏理财 30 天债券 A 本报告期份额净值收益率为 1.1580%;华夏理财 30 天债券 B 本报告期份额净值收益率为 1.2187%。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,经济增长有望企稳,通胀仍不会构成明显压力,货币供应 M2 增速将反弹至央行的目标增速之上。但整体融资环境不会明显改善,央行可能继续维持相对宽松的货币政策,通过正回购利率和逆回购利率形成的“利率走廊”来稳定货币市场的利率。

3 季度,本基金将增加对短期债券的投资,适当提高组合久期,在控制好流动性风险的前提下力争提高组合收益。

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	330,502,730.04	25.40
	其中:债券	330,502,730.04	25.40
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	50,000,195.00	3.84
	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	912,778,318.91	70.15
4	其他各项资产	7,903,352.91	0.61
5	合计	1,301,184,596.86	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	0.40	
	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	19,999,870.00	1.57
	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情况的说明

本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	115
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	22

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:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 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	26.20	1.57
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60 天	20.89	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90 天	15.72	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180 天	18.77	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397 天(含)	19.62	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
6	合计	101.20	1.57

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	100,130,845.23	7.84
	其中:政策性金融债	100,130,845.23	7.84
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	230,371,884.81	18.03
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	330,502,730.04	25.86
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	–	–

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	140207	14国开 07	400,000	40,139,700.06	3.14
2	041460014	14鲁商 CP001	300,000	30,158,577.24	2.36
3	041451010	14浙物产 CP001	300,000	30,153,757.37	2.36
4	041462005	14天药集 CP001	300,000	30,091,287.03	2.35
5	011437006	14中建材 SCP006	300,000	30,052,354.76	2.35
6	041458049	14中铝业 CP003	300,000	30,000,148.01	2.35
7	071415005	14申万 CP005	300,000	29,995,324.96	2.35
8	110413	11农发 13	200,000	20,009,640.28	1.57
9	130227	13国开 27	200,000	19,998,728.00	1.56
10	130243	13国开 43	200,000	19,982,776.89	1.56

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	0.05%
报告期内偏离度的最低值	0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.03%

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

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	7,019,630.98
4	应收申购款	883,721.93
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	7,903,352.91

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

项目	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
本报告期期初基金份额总额	1,903,737,149.51	243,244,780.89
本报告期基金总申购份额	413,132,045.53	118,411,154.63
减:本报告期基金总赎回份额	1,136,934,321.93	263,672,587.56
本报告期期末基金份额总额	1,179,934,873.11	97,983,347.96

注:上述“本报告期基金总申购份额”、“本报告期基金总赎回份额”包含 A 级基金份额、B 级基金份额间升降级的基金份额。

§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 16 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

2014 年 5 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加申购及定期定额申购费率优惠的公告。

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。

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《华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏理财 30 天债券型证券投资基金托管协议》;

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

上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 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	华夏上证 50ETF
基金主代码	510050
交易代码	510050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2004年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	14,128,566,757 份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为“上证 50 指数”。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证 50 指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。
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	–173,410,285.56
2.本期利润	463,493,985.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0337
4.期末基金资产净值	21,132,290,535.65
5.期末基金份额净值	1.496

注:①所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。

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。

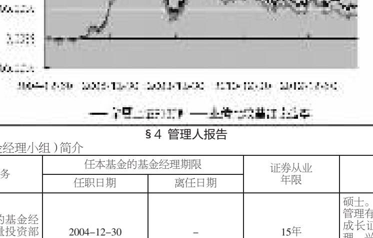
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	2.19%	0.93%	1.13%	0.95%	1.06%	–0.02%

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

上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004 年 12 月 30 日至 2014 年 6 月 30 日)



§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		
方军	本基金的基金经理、数量投资部副总经理	2004–12–30	–	15年	硕士。1999 年 7 月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员,华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理等。

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,本基金出现 3 次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,为本基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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

本基金跟踪的标的指数为上证 50 指数,上证 50 指数由上海证券市场规模大、流动性好、最具代表性的 50 只股票组成,自 2004 年 1 月 2 日起正式发布,以综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体状况,其目标是建立一个成交活跃、规模较大、主要作为衍生金融工具基础的投资指数。本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2 季度,国际方面,美国经济继续复苏,美联储稳步削减量化宽松规模;欧央行则宣布降息,实施货币宽松。国内方面,经济整体仍偏弱,固定资产投资增速继续下滑,居民消费价格指数(CPI)维持在较低水平,资金面相对宽松,而稳增长政策的出台则在一定程度上提振了市场信心。

市场方面,A 股整体呈窄幅震荡走势:4 月初,受稳增长政策出台及资金面好转影响,市场出现一波上涨行情;4 月中旬,受经济数据表现不佳和地产泡沫破灭预期影响,市场出现一轮调整,随后则在低位不断震荡;5 月下旬至 6 月初,在经济数据逐步企稳的背景下,市场呈现反弹趋势;6 月中旬开始,受 IPO 重启等因素影响,市场出现下跌,其后,市场在低位盘整后略有反弹。本报告期,上证 50 指数上涨 1.13%,总体表现略高于市场平均水平。

报告期内,本基金严格按照基金合同要求,在指数权重及成份股变动时,努力降低成本、减少市场冲击,逐步调整组合至目标结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.496 元,本报告期份额净值增长率为 2.19%,同期上证 50 指数增长率为 1.13%。本基金本报告期跟踪偏离度为 +1.06%,与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用以及替代性策略等产生的差异。

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,国际方面,仍需继续关注美联储退出量化宽松政策及人民币汇率变动的影响。国内方面,经济运行仍将面临诸多挑战,政府为实现全年经济增长目标,可能加大定向稳增长力度,经济有可能逐步企稳;通胀仍将处于较低水平;资金面维持相对宽松的概率较大。市场不确定性较大,但金融及大盘蓝筹股等权重股的风险已得到较大释放,估值处于历史较低水平,如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革政策,上证 50 指数或将有相对较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差,以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时,我们也积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥 ETF 的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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。

§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	权益投资	20,734,489,761.94	98.06
	其中:股票	20,734,489,761.94	98.06
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	408,359,548.00	1.93
7	其他各项资产	2,105,340.80	0.01
8	合计	21,144,954,650.74	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	66,466,838.52	0.31
B	采矿业	1,386,055,724.76	6.56
C	制造业	4,010,490,681.48	18.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	487,059,110.86	2.30
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	539,255,791.87	2.55
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	636,059,990.27	3.01
J	金融业	12,942,174,711.53	61.24
K	房地产业	666,916,334.05	3.16
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	20,734,479,183.34	98.12

5.3 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股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	44,609,953	1,754,955,551.02	8.30
2	600036	招商银行	156,386,227	1,601,394,964.48	7.58
3	600016	民生银行	257,526,405	1,599,238,975.05	7.57
4	601166	兴业银行	109,578,550	1,099,072,856.50	5.20
5	600000	浦发银行	105,410,362	953,963,776.10	4.51
6	600837	海通证券	96,937,248	886,975,819.20	4.20
7	601288	农业银行	242,317,775	610,640,793.00	2.89
8	600519	贵州茅台	4,285,227	608,416,529.46	2.88
9	601328	交通银行	147,336,419	571,665,305.72	2.71
10	601601	中国太保	30,499,196	542,580,696.84	2.57

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 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	490,873.07
2	应收证券清算款	1,544,487.40
3	应收股利	–
4	应收利息	69,980.33
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,105,340.80

5.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	13,942,566,757
本报告期基金总申购份额	4,560,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	4,374,000,000
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	14,128,566,757

§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

本基金本报告期无已披露的重大事项。

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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理 9 只 ETF 产品,分别为华夏沪深 300ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏能源 ETF、华夏材料 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF 和华夏恒生 ETF,初步形成了覆盖综合指数、权重股指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

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《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

9.1.3《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

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