华夏经典配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。基金管理人的董事徐刚先生、葛小波先生未能对本报告发表意见。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
报告期末基金份额总额	1,036,010,502.21份
投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,难随积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金属混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金。本基金追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡、风险适中。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	29,826,957.82
2.本期利润	130,841,483.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.1237
4.期末基金资产净值	1,470,397,667.84
5.期末基金份额净值	1.419

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

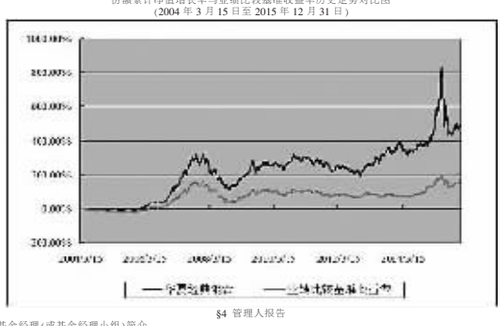
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.41%	1.17%	10.43%	1.00%	-1.02%	0.17%

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

华夏经典配置混合型证券投资基金

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3月15日至2015年12月31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		
李铮汶	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-02-09	-	8年	清华大学管理学硕士。曾任易方达基金研究员等。2010年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任投资研究部研究员、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

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》、《公开募集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,共组合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

4季度,国际方面,美联储在12月宣布加息,正式结束了08年金融危机以来的反危机货币政策。国内方面,宏观经济总体水平仍然维持较弱走势,但局部呈现出一定的变化,宏观量、期限产品、工业品价格等指标显示,工业产出仍然维持低速的状态;商品房和汽车的销售积极,尤其是商品房的销售面积在年月接近2014年底的历史高点,显示出下行的利率和宽松的流动性正在帮助房地产行业去库存,但地产投资数据仍然不见起色;资本流出仍在持续,人民币兑美元汇率重新回到贬值通道,股票市场在本季度经历了较为明显的反弹,新兴成长类股票和主题类股票涨幅居前。

报告期内,本基金整体配置均衡,致力于实现可控回撤下的收益率。具体操作上,在进入10月后提高了股票仓位,并在季度后期增加了金融股和原材料类股票的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.419元,本报告期份额净值增长率为9.41%,同期业绩比较基准增长率为10.43%。

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2016年1季度,由于经济基本面仍不乐观,且降低实体经济融资成本的任务仍然较重,预计货币政策仍将偏友好,利率水平有望继续下行,资金面仍将维持宽松。基于此,本基金将保持适当久期,做好资金期限匹配,在保持较好的流动性的同时努力抓住市场波段机会。

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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	999,127,803.54	67.00
	其中:股票	999,127,803.54	67.00
2	固定收益投资	358,916,200.00	24.07
	其中:债券	358,916,200.00	24.07
	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	78,463,172.67	5.26
7	其他各项资产	54,661,921.81	3.67
8	合计	1,491,169,098.02	100.00

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	-	-
B	采矿业	16,700,000.00	1.14
C	制造业	702,418,985.47	47.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,396,816.51	0.91
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,396,000.00	3.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,025,511.56	5.10
J	金融业	59,799,090.00	4.07
K	房地产业	31,805,000.00	2.16
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	31,774,400.00	2.16
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	16,812,000.00	1.14
	合计	999,127,803.54	67.95

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	601398	工商银行	10,000,000	45,800,000.00	3.11
2	002011	盾安环境	2,000,000	33,440,000.00	2.27
3	300235	方直科技	879,902	28,887,182.66	1.96
4	300202	聚龙股份	874,500	28,150,155.00	1.91
5	002098	浔兴股份	1,600,000	24,736,000.00	1.68
6	300011	鼎汉技术	800,000	23,840,000.00	1.62
7	002537	海立美达	1,534,200	23,519,286.00	1.60
8	300006	莱美药业	519,928	20,797,120.00	1.41
9	300147	香雪制药	800,000	20,008,000.00	1.36
10	002064	华峰氨纶	3,000,000	19,470,000.00	1.32

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	112,767,200.00	7.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,997,000.00	14.01
	其中:政策性金融债	205,997,000.00	14.01
4	企业债券	40,152,000.00	2.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	358,916,200.00	24.41

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140208	14国开08	1,100,000	113,586,000.00	7.72
2	010107	21国债(7)	1,040,000	112,767,200.00	7.67
3	150212	15国开12	500,000	51,080,000.00	3.47
4	068007	06首都机场债	400,000	40,152,000.00	2.73
5	150408	15农发08	300,000	30,495,000.00	2.07

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	2,542,923.04
2	应收证券清算款	43,309,494.13
3	应收股利	-
4	应收利息	8,749,340.87
5	应收申购款	60,163.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,661,921.81

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002011	盾安环境	33,440,000.00	2.27	重大事项
2	300235	方直科技	28,887,182.66	1.96	重大事项
3	300011	鼎汉技术	23,840,000.00	1.62	重大事项
4	002537	海立美达	23,519,286.00	1.60	重大事项

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	1,077,223,751.67
本报告期基金总申购份额	15,211,647.06
减:本报告期基金总赎回份额	56,424,896.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,036,010,502.21

§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

本基金本报告期内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

本基金本报告期末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

2015年10月14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北京银天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告。

2015年10月21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汇付金融服务有限公司为代销机构的公告。

2015年11月4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长量基金销售有限公司为代销机构的公告。

2015年11月13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汇付金融服务有限公司为代销机构的公告。

2015年11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北京中融多源投资咨询有限公司为代销机构的公告。

2015年11月20日发布华夏基金管理有限公司关于成都分公司经营场所变更的公告。

2015年11月24日发布华夏基金管理有限公司关于南京分公司经营场所变更的公告。

2015年11月25日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在杭州数米基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告。

2015年12月1日发布华夏基金管理有限公司关于华夏资本管理有限公司变更相关事项的公告。

2015年12月18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诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告。

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、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、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。

2015年4季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户使用的便利性和服务体验:(1)与苏宁金融、网易理财、聚宝盆等互联网金融平台合作,为客户购买华夏基金提供了更多优惠便捷的交易通道;(2)上线新版华夏基金管家客户端,增加手势密码、定投管理、基金搜索等功能,提高了手机查询和交易的便利性、安全性;(3)开展"感恩情报,速来对号"、"华夏回报送回报,写下寄语得红包"等客户互动活动,倡导和传递投资及生活理念。

§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《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏经典配置混合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
二〇一六年一月二十一日

华夏现金增利证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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:二〇一六年一月二十一日

§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。基金管理人的董事徐刚先生、葛小波先生未能对本报告发表意见。

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2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏现金增利货币	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	268,917,486.685.84份	
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"税前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。	
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	
下属分级基金的基金简称	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	003003	001374
报告期末下属分级基金的份额总额	88,349,770,764.84份	180,567,715,921.00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(2015年10月1日-2015年12月31日)	
	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
1.本期已实现收益	775,510,583.44	1,351,410,676.36
2.本期利润	775,510,583.44	1,351,410,676.36
3.期末基金资产净值	88,349,770,764.84	180,567,715,921.00

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)扣除相关费用后的金额,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

华夏现金增利货币A/E:

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	0.8011%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.4608%	0.0006%

华夏现金增利货币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	0.8622%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.5219%	0.0006%

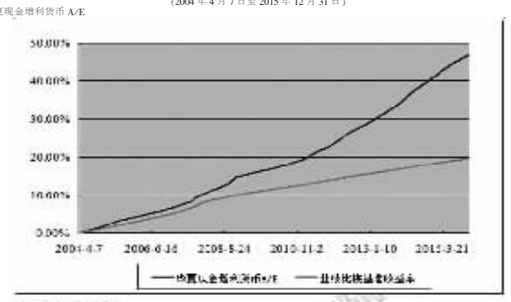
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏现金增利证券投资基金

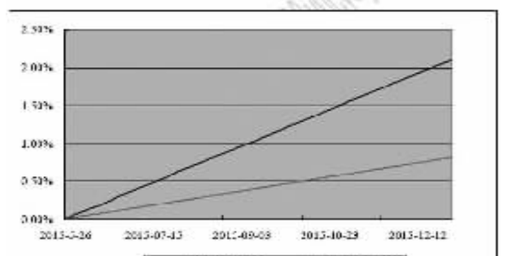
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年4月7日至2015年12月31日)

华夏现金增利货币A/E



华夏现金增利货币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		
曲波	本基金的基金经理、现金管理部执行总经理	2008-01-18	-	12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,曾任公司基金管理部交易员、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、现金管理部总经理。华夏货币市场基金基金经理(2012年8月1日至2014年7月25日期间)、华夏安康信用优选债券型证券投资基金基金经理(2012年9月11日至2014年7月25日期间)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

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》、《公开募集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,共组合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 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度,国际方面,美联储在12月宣布加息,正式结束了08年金融危机以来的反危机货币政策。国内方面,宏观经济总体水平仍然维持较弱走势,但局部呈现出一定的变化,宏观量、期限产品、工业品价格等指标显示,工业产出仍然维持低速的状态;商品房和汽车的销售积极,尤其是商品房的销售面积在年月接近2014年底的历史高点,显示出下行的利率和宽松的流动性正在帮助房地产行业去库存,但地产投资数据仍然不见起色;资本流出仍在持续,人民币兑美元汇率重新回到贬值通道,股票市场在本季度经历了较为明显的反弹,新兴成长类股票和主题类股票涨幅居前。

报告期内,本基金整体配置均衡,致力于实现可控回撤下的收益率。具体操作上,在进入10月后提高了股票仓位,并在季度后期增加了金融股和原材料类股票的配置力度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,华夏现金增利A/E本报告期份额净值收益率为0.8011%;华夏现金增利B本报告期份额净值收益率为0.8622%。同期业绩比较基准收益率为0.3403%。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2016年1季度,由于经济基本面仍不乐观,且降低实体经济融资成本的任务仍然较重,预计货币政策仍将偏友好,利率水平有望继续下行,资金面仍将维持宽松。基于此,本基金将保持适当久期,做好资金期限匹配,在保持较好的流动性的同时努力抓住市场波段机会。

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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	占基金资产净值比例(%)
1	固定收益投资	90,468,613,059.15	28.47
	其中:债券	90,468,613,059.15	28.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,630,006,345.00	1.14
	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	221,485,344,193.42	69.71
4	其他各项资产	2,140,542,200.30	0.67
5	合计	317,724,505,797.87	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	16.14	
	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	48,644,669,421.53	18.09
	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	115
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	115

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。

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	5.53	18.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.15	-
3	60天(含)-90天	44.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.01	-
4	90天(含)-180天	54.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	9.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	117.36	18.09

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	7,207,778,881.56	2.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,215,768,138.94	2.68
	其中:政策性金融债	7,215,768,138.94	2.68
4	企业债券	212,904,504.42	0.08
5	企业短期融资券	6,240,827,039.74	2.32
6	中期票据	-	-
7	同业存单	69,591,334,494.49	25.88
8	其他	-	-
9	合计	90,468,613,059.15	33.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	431,354,616.34	0.16

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	111511239	15平安CD239	50,000,000	4,962,093,275.15	1.85
2	111520079	15广发银行CD079	50,000,000	4,961,570,332.92	1.85
3	111509230	15浦发CD230	50,000,000	4,953,111,967.78	1.84
4	111508154	15中信CD154	50,000,000	4,947,505,819.00	1.84
5	111507095	15招行CD095	48,000,000	4,753,159,236.84	1.77
6	111510333	15兴业CD333	40,000,000	3,963,244,227.68	1.47
7	111512080	15北京银行CD080	40,000,000	3,960,855,929.42	1.47
8	111507110	15招行CD110	36,000,000	3,562,160,515.00	1.32
9	111508143	15中信CD143	35,000,000	3,472,584,738.99	1.29
10	020098	15国债24	30,000,000	2,984,056,322.34	1.11

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	0.07%
报告期内偏离度的最低值	0.04%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.05%

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	623,538,259.56
5	应收申购款	1,516,863,940.74
6	其他应收款	140,000.00
7	待摊费用	-
8	合计	2,140,542,200.30

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	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
本报告期期初基金份额总额	103,250,140,654.70	128,374,335,088.78
本报告期基金总申购份额	94,262,733,662.24	155,952,444,607.18
减:本报告期基金总赎回份额	109,163,103,552.10	103,759,063,774.96
本报告期期末基金份额总额	88,349,770,764.84	180,567,715,921.00

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级基金份额间转换的基金份额。

§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

单位:份

项目	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
报告期期初管理人持有的本基金份额	285,981,862.08	-
报告期期间买入/申购总份额	252,661,714.37	-
报告期期间卖出/赎回总份额	140,000,000.00	-
报告期末管理人持有的本基金份额	398,643,576.45	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.45	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

金额单位:人民币元

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额	适用费率
1	申购	2015-12-02	250,000,000.00	250,000,000.00	0.00%
2	赎回	2015-12-07	-60,000,000.00	-60,000,000.00	0.00%
3	赎回	2015-12-14	-80,000,000.00	-80,000,000.00	0.00%
4	红利再投	-