华夏天利货币市场基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏天利货币
基金主代码	002894
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月13日
报告期末基金份额总额	9,865,786,509.04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、资产支持证券投资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	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	华夏天利货币A	华夏天利货币B
下属分级基金的交易代码	002894	002895
报告期末下属分级基金的份额总额	9,604,410,295.84份	261,376,213.20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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	华夏天利货币A	华夏天利货币B
1.本期已实现收益	52,870,703.99	2,984,653.62
2.本期利润	52,870,703.99	2,984,653.62
3.期末基金资产净值	9,604,410,295.84	261,376,213.20

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 本报告期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

华夏天利货币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	0.6662%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.3333%	0.0008%

华夏天利货币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	0.7254%	0.0008%	0.3329%	0.0000%	0.3925%	0.0008%

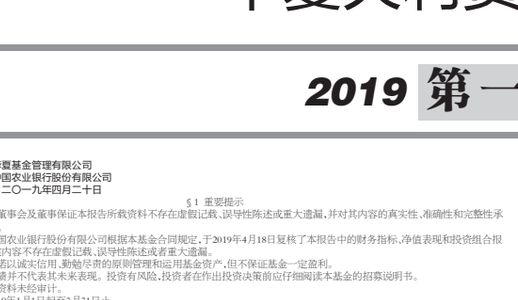
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏天利货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年10月13日至2019年3月31日)

华夏天利货币A



华夏天利货币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、董事总经理	2016-10-13	-	16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,曾任定量研究部副总监、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,华夏安心增利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)、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)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》等法律法规和基金合同,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

1季度,美联储前两次议息会议均决定不加息,且决定于同年9月末停止缩表计划,这些决定释放出鸽派的信号。同时中美贸易谈判取得一定进展,海外其他央行政策也普遍偏鸽派。

1季度,国内降息预期提升,市场流动性宽松,隔夜利率再次向下突破2%,后因缴税影响资金面阶段性收紧,利率回升到2.21%-2.25%,紧张时隔夜利率反弹至2.5%以上。存单一级发行方面,1Y期下行5BP至3%,3M从2.85%下行20BP至2.65%。

报告期内,本基金主要投资于同业存单、回业存款。期限搭配以短持型策略为主,主要配置3M存款和存单,杠杆水平降低至较低水平,组合整体的流动性较好。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月31日,华夏天利货币A本报告期份额净值收益率为0.6662%;华夏天利货币B本报告期份额净值收益率为0.7254%。同期业绩比较基准收益率为0.3329%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,183,151,088.46	45.85
	其中:债券	5,183,151,088.46	45.85
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,267,001,045.50	28.90
	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	2,827,296,816.33	25.01
4	其他资产	26,693,422.56	0.24
5	合计	11,304,142,372.85	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	9.76
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 (元) / 占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,030,914,564.54 / 10.45
	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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120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	34.51	14.50
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天 (含)-60天	16.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天 (含)-90天	30.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天 (含)-120天	1.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天 (含)-397天 (含)	32.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.31	14.50

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	532,259,825.88	5.40
	其中:政策性金融债	532,259,825.88	5.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,650,891,262.58	47.14
8	其他	-	-
9	合计	5,183,151,088.46	52.54
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6报告期末按摊余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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111993977	19广州农村商业银行CD040	8,000,000	782,278,262.66	7.93
2	111918108	19华夏银行CD108	6,800,000	675,640,000.02	6.85
3	111921029	19浦海银行CD029	5,000,000	498,371,548.85	5.05
4	111908043	19中信银行CD043	5,000,000	496,794,831.27	5.04
5	111921089	19浦海银行CD089	3,200,000	318,011,543.31	3.22
6	111913001	19新商银行CD001	3,000,000	299,022,867.78	3.03
7	111921058	19浦海银行CD058	2,500,000	248,783,562.31	2.52
8	111813155	18新商银行CD155	2,000,000	199,398,797.15	2.02
9	111991484	19厦门国际银行CD002	2,000,000	199,351,043.39	2.02
10	111991412	19上海农商银行CD011	2,000,000	199,348,717.12	2.02

5.7 "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	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中,中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	26,320,927.73
4	应收申购款	372,494.83
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,693,422.56

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9.4.1本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.9.4.2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	华夏天利货币A	华夏天利货币B
本报告期期初基金份额总额	5,717,364,793.18	622,450,889.40
报告期基金总申购份额	47,701,052,630.83	51,583,238.87
报告期基金总赎回份额	43,814,007,128.17	412,657,915.07
报告期期末基金份额总额	9,604,410,295.84	261,376,213.20

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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内披露的主要事项

2019年3月2日发布华夏基金管理有限公司公告。

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、深圳、上海设有子公司。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、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至2019年3月31日数据),华夏移动互联混合(QDII)、华夏全球科技先锋混合(QDII)在"QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金(A类)"中分别排序2/34和7/34;华夏稳增混合在"混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A类)"中排序3/27;华夏兴华混合(H类)在"混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非A类)"中排序5/23;华夏可转债增强债券(A类)在"债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金(A类)"中排序6/28;华夏鼎沛债券(A类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级A类)"中排序3/230;华夏聚利债券在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债A类)"中排序3/174;华夏债券(C类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债非A类)"中排序7/107;华夏中小板ETF在"股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金"中排序7/62;华夏中小企业板ETF联接(A类)在"股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(A类)"中排序6/47。

1季度,公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。2019年3月,在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报权益债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。

在客户服务方面,1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)直销电子交易平台开通华夏惠利货币A的快速赎回业务,为广大投资者的资金使用提供便利;(2)微信公众号上线基金分红通知和净值查询功能,让客户及时掌握分红信息和净值变动情况,提升客户体验;(3)与华融湘江银行、微众银行等代销机构合作,为投资者提供更多便捷的理财渠道;(4)开展"四人拼团瓜分红包"、"今天能赢亿么?"、"你的今年收益知否?知否?"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏天利货币市场基金基金合同》;

9.1.3《华夏天利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
二〇一九年四月二十日

华夏现金宝货币市场基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏现金宝货币
基金主代码	003077
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月28日
报告期末基金份额总额	10,057,179,537.56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	基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征,决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。
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

下属分级基金的基金简称	华夏现金宝货币A	华夏现金宝货币B
下属分级基金的交易代码	003077	001078
报告期末下属分级基金的份额总额	9,823,402,508.34份	233,777,029.22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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	华夏现金宝货币A	华夏现金宝货币B
1.本期已实现收益	55,293,016.48	1,749,414.79
2.本期利润	55,293,016.48	1,749,414.79
3.期末基金资产净值	9,823,402,508.34	233,777,029.22

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②基金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》等法律法规和基金合同,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

1季度,美联储前两次议息会议均决定不加息,且决定于同年9月末停止缩表计划,这些决定释放出鸽派的信号。同时中美贸易谈判取得一定进展,海外其他央行政策也普遍偏鸽派。

1季度,国内降息预期提升,市场流动性宽松,隔夜利率再次向下突破2%,后因缴税影响资金面阶段性收紧,利率回升到2.21%-2.25%,紧张时隔夜利率反弹至2.5%以上。存单一级发行方面,1Y期下行5BP至3%,3M从2.85%下行20BP至2.65%。

报告期内,本基金主要投资于同业存单、回业存款。期限搭配以短持型策略为主,主要配置3M存款和存单,杠杆水平降低至较低水平,组合整体的流动性较好。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月31日,华夏现金宝货币A本报告期份额净值收益率为0.6708%;华夏现金宝货币B本报告期份额净值收益率0.7301%。同期业绩比较基准收益率为0.3329%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,664,064,936.87	32.83
	其中:债券	3,664,064,936.87	32.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,000,392,899.49	35.84
	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	3,469,497,883.10	31.08
4	其他资产	28,211,382.42	0.25
5	合计	11,162,167,101.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	12.15
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 (元) / 占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,054,929,632.54 / 10.49
	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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120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	38.37	10.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天 (含)-60天	15.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天 (含)-90天	13.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天 (含)-120天	1.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天 (含)-397天 (含)	41.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.71	10.91

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

5.5报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	582,249,024.06	5.79
	其中:政策性金融债	582,249,024.06	5.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	380,013,567.17	3.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,701,802,345.64	26.86
8	其他	-	-
9	合计	3,664,064,936.87	36.43
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6报告期末按摊余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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111914035	19江苏银行CD035	5,000,000	490,858,914.68	4.88
2	111991170	19广州银行CD004	3,000,000	297,030,657.09	2.95
3	180410	18农发10	2,600,000	260,194,314.92	2.59
4	111889059	18北京农商银行CD093	2,000,000	199,339,950.77	1.98
5	111888434	18杭州银行CD082	2,000,000	196,245,961.34	1.95
6	111870180	18长沙银行CD213	1,800,000	179,054,952.09	1.78
7	180207	18国开07	1,700,000	170,064,903.29	1.69
8	011802236	18北辰电力SCP009	1,500,000	150,350,126.21	1.49
9	180202	18国开02	1,200,000	121,980,706.25	1.21
10	111817179	18光大银行CD179	1,000,000	99,683,454.44	0.99

5.7 "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	0.00%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国光大银行股份有限公司,江苏银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	26,088,896.30
4	应收申购款	2,122,486.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	28,211,382.42

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9.4.1本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.9.4.2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	华夏现金宝货币A	华夏现金宝货币B
本报告期期初基金份额总额	6,222,522,048.26	276,334,791.68
报告期基金总申购份额	47,870,094,896.74	80,145,291.44
报告期基金总赎回份额	44,269,214,436.66	122,703,053.90
报告期期末基金份额总额	9,823,402,508.34	233,777,029.22

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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.报告期内披露的主要事项

2019年3月2日发布华夏基金管理有限公司公告。

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、深圳、上海设有子公司。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、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、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。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至2019年3月31日数据),华夏移动互联混合(QDII)、华夏全球科技先锋混合(QDII)在"QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金(A类)"中分别排序2/34和7/34;华夏稳增混合在"混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A类)"中排序3/27;华夏兴华混合(H类)在"混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非A类)"中排序5/23;华夏可转债增强债券(A类)在"债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金(A类)"中排序6/28;华夏鼎沛债券(A类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级A类)"中排序3/230;华夏聚利债券在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债A类)"中排序3/174;华夏债券(C类)在"债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债非A类)"中排序7/107;华夏中小板ETF在"股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金"中排序7/62;华夏中小企业板ETF联接(A类)在"股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(A类)"中排序6/47。

1季度,公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。2019年3月,在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报权益债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。

在客户服务方面,1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