

华夏保证金理财货币市场基金

2018年第四季度报告

报告期内,本基金主要投资于季度内到期的同业存单、交易所逆回购,并于季末择机进行了同业存单和高级信用债投资。期限搭配以及杠杆水平合适,组合整体的流动性较好。

4.4.2公告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,华夏保证金货币B本期报告份额净值收益率为0.65530%,华夏保证金货币B本期报告份额净值收益率为0.70203%。同期业绩比较基准收益率为0.34033%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5报告期内本基金持有人数或基金资产净值变动说明

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	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	20,002,633.11	12.08
3	政策性银行金融债	-	-
4	企业短期融资券	-	-
5	企业中期票据	40,022,344.00	24.08
6	企业短期债券	-	-
7	同业存单	49,307,721.40	30.34
8	其他	-	-
9	合计	109,432,696.50	67.69
10	剩余期限超过397天的浮息利率债券	-	-

5.2 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

5.3 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(2018年10月01日-2018年12月31日)	报告期初余额(元)	报告期末余额(元)
1.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
2.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
3.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
4.期末基金余额	127,398,320.00	127,398,320.00	127,398,320.00

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,扣除相关费用后的余额,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本基金基于申购赎回的原则。

3.2 基金的净值表现

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

华夏保证金货币A:

份额类别	净值增长收益率	净值增长收益率	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率
报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)	1.00%	1.00%	1.00%	1.00%
过去三个月	0.0300%	0.0300%	0.0300%	0.0300%

注:①本基金累计净值以份额面值1.00元人民币为基准进行计算。

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,扣除相关费用后的余额,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本基金基于申购赎回的原则。

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

华夏保证金货币基金



注:本基金未规定业绩比较基准。

3.3 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时间 任期截止日 证券从业年限

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	任期截止日	证券从业年限
王海峰	基金经理	2018年05月07日	-	10年

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。

本报告期内基金管理人未审计。

本报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)止。

5.2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)	报告期初余额(元)	报告期末余额(元)
1.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
2.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
3.本期利润	1,000,000.00	100,000.00	1,000,000.00
4.期末基金余额	127,398,320.00	127,398,320.00	127,398,320.00

注:①本基金未规定业绩比较基准。

②本期已实现收益指基金各项费用的摊销后的余额。

③本基金基于申购赎回的原则。

3.2.3 本报告期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

华夏保证金货币B:



注:本基金未规定业绩比较基准。

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。

本报告期内基金管理人未审计。

本报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)止。

5.2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)	报告期初余额(元)	报告期末余额(元)
1.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
2.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
3.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
4.期末基金余额	106,410,312.00	106,410,312.00	106,410,312.00

注:①本基金未规定业绩比较基准。

②本期已实现收益指基金各项费用的摊销后的余额。

③本基金基于申购赎回的原则。

3.2.4 本报告期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

华夏保证金货币C:



注:本基金未规定业绩比较基准。

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。

本报告期内基金管理人未审计。

本报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)止。

5.2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)	报告期初余额(元)	报告期末余额(元)
1.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
2.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
3.本期利润	-11,261,712.00	-10,000,000.00	-11,261,712.00
4.期末基金余额	106,410,312.00	106,410,312.00	106,410,312.00

注:①本基金未规定业绩比较基准。

②本期已实现收益指基金各项费用的摊销后的余额。

③本基金基于申购赎回的原则。

3.2.5 本报告期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

华夏保证金货币D:



注:本基金未规定业绩比较基准。

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。

本报告期内基金管理人未审计。

本报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)止。

5.2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日-2018年12月31日