华夏薪金宝货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十七日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏薪金宝货币
基金主代码	000645
交易代码	000645
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月26日
报告期末基金份额总额	13,633,627,463.82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	同期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	中信银行股份有限公司

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	96,536,235.86
2.本期利润	96,536,235.86
3.期末基金资产净值	13,633,627,463.82

注:①本基金大额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。

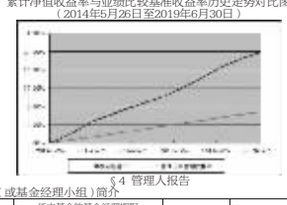
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长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	0.6027%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.2661%	0.0006%

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

华夏薪金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年5月26日至2019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		
曲波	本基金的基金经理,董事总经理	2014-07-25	-	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、现金管理部总经理,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)、华夏货币市场基金经理(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《华夏基金管理有限公司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

2季度,人民银行执行了较为宽松的货币政策,货币市场利率选创新低,6月份隔夜回购一度下行至1%以下,创出十年来的新低。基于此,本基金操作上以高久期、适当杠杆为主,获取了较为良好的利息回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,本基金本报告期份额净值收益率为0.6027%,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	6,323,904,169.32	40.32
	其中:债券	6,323,904,169.32	40.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,616,501,275.50	10.31
	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	7,724,525,709.20	49.25
4	其他各项资产	20,508,171.70	0.13
5	合计	15,685,439,325.72	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	9.84	
	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	2,039,831,805.16	14.96
	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	107
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	41

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	21.77	14.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	45.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.34	-
3	60天(含)-90天	12.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	31.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.90	14.96

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	727,845,964.17	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	692,092,547.60	5.08
	其中:政策性金融债	692,092,547.60	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,903,965,657.55	35.97
8	其他	-	-
9	合计	6,323,904,169.32	46.38
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	592,225,867.06	4.34

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	111914061	19江苏银行CD061	15,000,000	1,464,379,869.76	10.74
2	111912032	19北京银行CD032	10,000,000	976,338,490.73	7.16
3	111882118	18东莞农村商业银行CD071	6,500,000	647,736,858.01	4.75
4	160309	16进出09	6,000,000	592,225,867.06	4.34
5	111997066	19北京农商银行CD077	5,000,000	498,383,673.86	3.66
6	111994923	19广州银行CD012	4,900,000	477,801,339.34	3.50
7	111994966	19重庆农村商行CD041	4,000,000	390,552,367.59	2.86
8	019611	19国债01	3,900,000	389,241,564.46	2.86
9	111882095	18厦门国际银行CD179	2,500,000	249,161,779.72	1.83
10	111813117	18浙商银行CD117	2,000,000	199,611,278.54	1.46

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	0.03%

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,浙商银行股份有限公司、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	104,634.19
2	应收证券清算款	81,669.56
3	应收利息	18,910,356.83
4	应收申购款	1,411,511.12
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,508,171.70

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

本报告期期初基金份额总额	18,090,470,506.66
报告期基金总申购份额	15,730,758,819.90
报告期基金总赎回份额	20,187,601,862.74
报告期期末基金份额总额	13,633,627,463.82

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	89,807,281
报告期期间买入/申购总份额	541.76
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	90,349,041
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	-	541.76	541.76	0.00%
合计			541.76	541.76	

注:本基金的收益分配按日结转份额,列示在"红利再投资"项下一并披露。

§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5月9日发布华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场内外账户对应关系维护业务的公告。

2019年6月4日发布华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告。

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、境内首批中日互通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,目前旗下管理华夏上证50ETF、华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改ETF、华夏战略新兴成指ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏央企ETF、华夏中证500ETF联接(QDII)、华夏中小板ETF联接(QDII)、华夏中证央企ETF联接(QDII)、华夏中证四川国改ETF联接(QDII)、华夏战略新兴成指ETF联接(QDII)、华夏消费ETF联接(QDII)、华夏金融ETF联接(QDII)、华夏医药ETF联接(QDII)、华夏创蓝筹ETF联接(QDII)、华夏创成长ETF联接(QDII)、华夏央企ETF联接A(QDII)、华夏央企ETF联接C(QDII)、华夏中证500ETF联接A(LOF)、华夏中证500ETF联接C(LOF)、华夏中证500ETF联接(LOF)、华夏中证500ETF发起式联接基金、华夏中证500ETF联接发起式A、华夏中证500ETF联接发起式C、华夏中证500ETF联接(QDII)A、华夏中证500ETF联接(QDII)C、华夏中证500ETF联接(LOF)A、华夏中证500ETF联接(LOF)C、华夏上证50ETF联接(LOF)A、华夏上证50ETF联接(LOF)C、华夏中证1000ETF发起式联接基金、华夏中证1000ETF发起式联接A、华夏中证1000ETF发起式联接C、华夏中证1000ETF联接(QDII)A、华夏中证1000ETF联接(QDII)C、华夏中证1000ETF联接(LOF)A、华夏中证1000ETF联接(LOF)C、华夏上证科创板50成份ETF、华夏上证科创板50成份ETF联接(LOF)A、华夏上证科创板50成份ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通50ETF、华夏中证港股通50ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通50ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通非银主题ETF、华夏中证港股通非银主题ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通非银主题ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通消费主题ETF、华夏中证港股通消费主题ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通消费主题ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通科技ETF、华夏中证港股通科技ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通科技ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通50ETF发起式联接基金、华夏中证港股通50ETF发起式联接A、华夏中证港股通50ETF发起式联接C、华夏中证港股通医药ETF、华夏中证港股通医药ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通医药ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通汽车ETF、华夏中证港股通汽车ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通汽车ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通互联网ETF、华夏中证港股通互联网ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通互联网ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通高股息ETF、华夏中证港股通高股息ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通高股息ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通央企红利ETF、华夏中证港股通央企红利ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通央企红利ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通50成长ETF、华夏中证港股通50成长ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通50成长ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通50ETF、华夏中证港股通50ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通50ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通央企ETF、华夏中证港股通央企ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通央企ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通红利ETF、华夏中证港股通红利ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通红利ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通红利低波ETF、华夏中证港股通红利低波ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通红利低波ETF联接(LOF)C、华夏中证港股通央企红利低波ETF、华夏中证港股通央企红利低波ETF联接(LOF)A、华夏中证港股通央企红利低波