

华夏薪金宝货币市场基金

2019年半年度报告摘要

2019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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日
§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏薪金宝货币市场基金
基金简称	华夏薪金宝货币
基金代码	000045
交易代码	000045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月26日
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
截至期末基金份额总额	13,633,627,463.92份
基金份额持有人数	不定期

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、短期回购和中期票据的投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率和银行活期存款利率
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。

2.2 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
负责人姓名	李彬	李伟强
联系电话	400-818-6666	400-650-0000
电子邮箱	service@ChinaAMC.com	hxtian@citibank.com
客户服务电话	400-818-6666	95588
传真	010-63201200	010-63200024
注册地址	北京市西城区金融大街23号A区	北京市东城区朝内大街188号9层
办公地址	北京市西城区金融大街23号A区	北京市东城区朝内大街188号9层
邮政编码	100033	100010
法定代表人	杨明辉	李庆萍

2.3 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	金额单位:人民币元
3.1.1 本期利润总额和净利润	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期3次实现收益	246,261,363.59
本期利润	246,261,363.59
本期净利润	246,261,363.59
3.1.2 本期基金费用率	1.3688%
3.1.3 本期基金资产净值	报告期期末(2019年6月30日)
期末基金资产净值	13,633,627,463.92
3.1.4 期末基金份额净值	1.0000
3.1.5 期末净值增长率	报告期(2019年6月30日)
净值增长率	19.0333%

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。

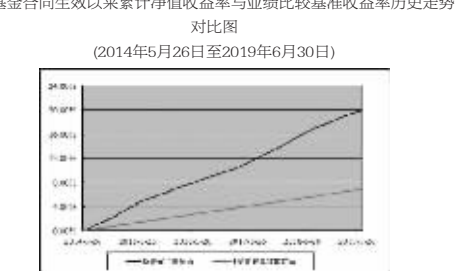
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	①-④
过去一个月	0.1980%	0.0000%	0.1110%	0.0000%	0.0870%	0.0000%
过去三个月	0.6027%	0.0000%	0.3360%	0.0000%	0.2667%	0.0000%
过去六个月	1.3688%	0.0023%	0.6095%	0.0000%	0.6093%	0.0023%
过去一年	3.0208%	0.0024%	1.3060%	0.0000%	1.6708%	0.0024%
过去三年	10.8226%	0.0038%	4.0481%	0.0000%	6.7745%	0.0038%
自基金合同生效起至今	19.0333%	0.0058%	6.9832%	0.0000%	13.0507%	0.0058%

3.2.2 基金自成立以来的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

华夏薪金宝货币市场基金
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金治理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
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ODII基金管理人、境内首批ETF基金管理人、境内首批沪港通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基金公司、首批公募POP基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互认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ROPII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、华夏沪深港恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、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、华夏金鑫ETF、华夏医药ETF、华夏创新蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快线货币ETF及华夏3-5年中期可质押信用债ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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6月30日数据),华夏移动式联接基金(ODII)在“ODII基金-ODII联接基金-ODII混合基金(A类)”中排序9/34;华夏稳增混合在“混合基金-股票平衡型基金-股票平衡型基金(A类)”中排序8/27;华夏回报混合(H类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非A类)”中排序8/89;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1/228;华夏回报30天债券(A类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A类)”中排序10/40;华夏恒顺定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A类)”中排序7/19;华夏上证50AH优选指数(LOF)(A类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A类)”中排序8/29;华夏上证50AH优选指数(LOF)(C类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非A类)”中排序4/11;华夏上证50ETF在“股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金”中排序6/61;华夏消费ETF在“股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金”中排序3/31;华夏沪深300ETF联接(C类)在“股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金”中排序9/34。

上半年,公司及旗下基金披露由基金评价机构颁发的多项奖项。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金明星基金颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(ODII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极投资明星基金、三年持续回报ODII明星基金和2018年度普通债券投资明星基金,在中国证券报举办的第十六届中国基金金鹰奖评选活动中,华夏基金荣获“被动投资金牛基金”奖,华夏鼎沛债券(000402)荣获“2018年度开放式债券型基金金牛基金”奖,华夏中小板ETF(159902)荣获“2018年度开放式指数型基金金牛基金”奖。

在客户服务方面,2019年上半年度,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)华夏基金客服电话系统上线智能语音功能,客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金

信息,同时系统还可以进行身份信息认证,主动告知业务办理进度,为客户提供全面、准确、便捷的服务,提升客户体验;(2)直销客户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;(3)与微众银行、华融湘江银行、紫金农商银行等代销机构合作,拓宽了客户交易的渠道,提高了交易便利性;(4)开展“你的今年收益知否?知否?”、“你的户口本更新了”、“户龄”等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任期日期	离任日期	
曲波	本基金的基金经理、董事总经理	2014-07-26	-	16年

注:①上述任职日期、离任日期指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》、《基金管理人开展投资、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 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

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,制定并严格执行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《证券投资基金管理人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情况。

报告期内,未出现涉及本基金的交易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5%的情况。

4.4 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,央行继续执行了宽信松的货币政策,资金面整体宽裕,市场利率中低位逐步下行。但今年与以往不同之处在于虽然资金面整体宽裕,但受信信用违约事件频发以及包商银行被托管等事件的影响,流动性分层现象愈发严重。

本报告期,本基金仍以银行存款、存单为主,且由于市场利率趋势性下行,基金大部分时间保持了较高仓位。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至2019年6月30日,本基金本报告期份额净值收益率为1.3688%,同期业绩比较基准收益率为0.6805%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对外宏观政策、证券市场及行业走势的简要展望
展望下半年,市场资金面仍将整体偏宽松,同时流动性分层情况短期内难以根本解决,因此,基金投资上仍将以往存款、存单投资为主,以期获得稳定的利息收益。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任,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 管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价,制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度,建立了估值委员会,使用可靠的估值业务系统,设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术,并复核、审查基金资产净值和基金份额净值,及时反馈对估值结果的意见。本估值委员会由基金估值委员会成员组成,负责制定估值政策,并对估值结果进行复核,确保估值结果的准确性和公允性。

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明
根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关约定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人,当日收益基金支付下一日的收益分配,并按日支付且结转为相应的基金份额。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对华夏薪金宝货币市场基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为,华夏基金管理有限公司在华夏薪金宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值及基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人认为,华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制的和披露的2019年上半年报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华夏薪金宝货币市场基金
报告截止日:2019年6月30日

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款	7,646,893,775.46	6,003,638,070.18	
结算备付金	70,676,932.74	56,586,262.64	
存出保证金	104,624.39	1,271,620.40	
交易性金融资产	6,323,904,169.32	15,567,479,063.60	
其中:股票投资	-	-	-
债券投资	6,323,904,169.32	15,567,479,063.60	
资产支持证券投资	-	-	-
应收款项	-	-	-
买入返售金融资产	1,616,501,278.50	500,000,000.00	
其他资产	81,669.69	-	-
应收利息	18,019,360.63	54,144,828.30	
应收股利	-	-	-
应收申购款	1,411,511.12	423,826.18	
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	15,686,439,325.72	22,182,602,490.17	
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
应付赎回款	3,966,949.17	5,514,534.16	
应付管理人费	1,106,076.47	1,161,070.86	
应付销售服务费	2,997,680.70	4,177,672.36	
应付交易费用	91,698.18	122,061.12	
应交税费	-	-	-
应付债券	703,916.76	3,963,300.00	
应付利息	2,906,306.76	6,473,424.71	
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	115,312.12	109,000.00	
负债合计	2,061,811,893.10	2,020,209,066.81	
所有者权益			
实收资本	13,633,627,463.92	19,162,393,683.36	
未分配利润	13,633,627,463.92	19,162,393,683.36	
所有者权益合计	13,633,627,463.92	19,162,393,683.36	
负债和所有者权益总计	15,686,439,325.72	22,182,602,490.17	

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额13,633,627,463.92份。

6.2 利润表

会计主体:华夏薪金宝货币市场基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度 2018年12月31日至2019年6月30日
一、营业收入		325,829,742.40	639,409,316.43
1.利息收入		309,781,889.30	616,709,346.49
其中:存款利息收入		111,067,476.18	269,262,584.44
债券利息收入		134,009,373.79	317,206,262.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		64,704,819.23	31,220,509.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益		16,067,873.10	22,698,969.94
其中:股票投资收益		-	-
债券投资收益		16,067,873.10	22,698,969.94
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
其他业务收入		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
二、营业支出		80,578,388.81	118,399,712.32
1.管理费		29,248,980.76	39,101,276.66
2.托管费		8,953,327.47	11,948,872.36
3.销售服务费		22,158,318.79	29,622,180.86
4.交易费用		-	-
5.利息支出		20,141,363.04	37,581,591.53
其中:卖出回购金融资产支出		20,141,363.04	37,581,591.53
6.其他费用		1,203.97	100,652.18
7.其他费用		165,077.78	130,125.73
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		245,251,353.59	521,009,604.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		245,251,353.59	521,009,604.11

注:①支付基金托管人的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。
②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.4.3 销售服务费

应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	3,966,940.17	5,514,534.41
应付托管费	1,190,075.47	1,671,070.08
应付销售服务费	2,997,680.70	4,177,677.28
应付交易费用	101,606.18	132,006.1
应交税费	—	20,001.28
应付利息	703,916.76	3,963,390.93
应付利润	2,906,308.75	5,473,424.7
递延所得税负债	—	—
其他负债	115,321.72	109,000.00
合计	2,564,931.22	2,329,805.48

6.4.4.2 基金销售费用

本分配款合计		-	
所有者权益合计	13,633,627,463.82	19,362,303,683.28	
负债合计	15,695,439,325.72	22,162,652,690.17	

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额13,633,627,463.82份。

6.2利润表

会计主体:华夏薪金宝货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		325,829,742.40	639,409,316.43
1.利息收入		309,781,889.30	616,709,346.49
其中:存款利息收入		111,067,476.18	269,262,584.44
债券利息收入		134,009,373.79	317,206,262.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		64,704,819.23	31,220,509.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益	(损失以“-”号填列)	16,067,873.10	22,698,969.94
其中:公允价值变动收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		16,067,873.10	22,698,969.94
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.其他业务收入(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
二、费用		80,578,388.81	118,399,712.32
1.管理费用		29,248,980.76	39,101,276.66
2.托管费		8,953,327.47	11,948,872.36
3.销售服务费		22,158,318.79	29,622,180.86
4.交易费用		-	-
5.利息支出		20,141,363.04	37,581,591.53
其中:卖出回购金融资产支出		20,141,363.04	37,581,591,591.53
6.其他及附加		1,203.97	106,654,654.65
7.其他费用		166,077.68	139,139.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		245,251,353.59	521,009,604.11
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		245,251,353.59	521,009,604.11