

华夏货币市场基金

【2013】半年度报告摘要

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:二〇一三年八月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2013年8月22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。

本报告期自2013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	
基金简称	华夏货币
基金代码	288101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月20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
报告期末基金份额总额	2,251,044,853.76份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基本情况	华夏货币A 华夏货币B
下属分级基金的交易代码	288101 288201
报告期末下属分级基金的份额总额	1,183,152,883.67份 1,067,891,970.09份

2.2 基金产品说明	
投资目标	在保持安全性、高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。
投资策略	结合货币市场利率的预测与现金流需求安排,采取现金资产管理策略进行货币市场工具投资,以便在确保基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。
业绩比较基准	本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款税后收益率作为业绩比较基准。
风险收益特征	本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。

2.3 基金管理人	基金托管人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
姓名	崔胤蓓	张燕
联系电话	400-818-6666	0755-83199084
电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-818-6666	95555
传真	010-63136700	0755-83195201

2.4 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	基金管理人和本基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)	华夏货币A	华夏货币B
本期已实现收益	33,577,019.98	43,983,300.51	43,983,300.51
本期利润	33,577,019.98	43,983,300.51	43,983,300.51
本期净值收益率	1.8852%	2.0071%	2.0071%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	华夏货币A	华夏货币B
期末基金资产净值	1,183,152,883.67	1,067,891,970.09	1,067,891,970.09
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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。由于货币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 基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
华夏货币A:

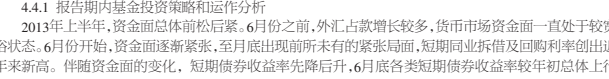
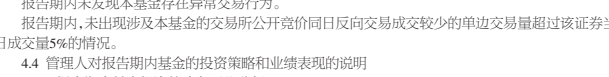
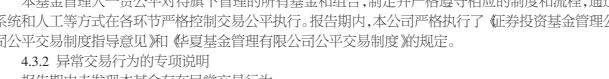
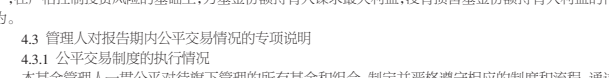
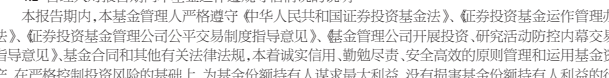
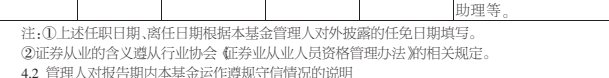
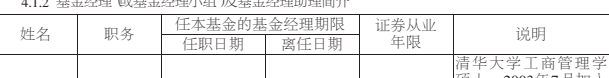
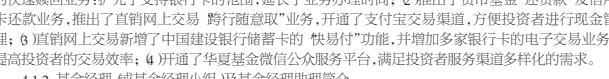
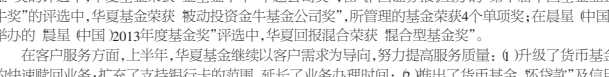
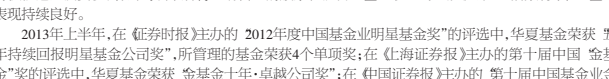
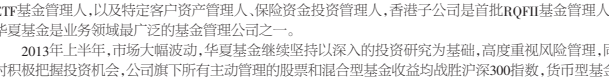
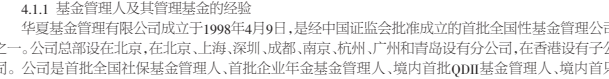
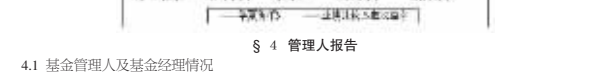
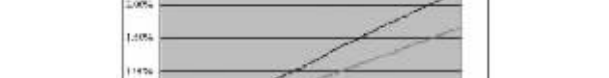
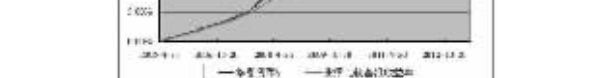
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3145%	0.0046%	0.2466%	0.0000%	0.0679%	0.0046%
过去三个月	0.9525%	0.0037%	0.7479%	0.0000%	0.2046%	0.0037%
过去六个月	1.8852%	0.0035%	1.4877%	0.0000%	0.3975%	0.0035%
过去一年	3.7051%	0.0032%	2.9993%	0.0001%	0.7058%	0.0031%
过去三年	11.5706%	0.0059%	9.1925%	0.0011%	2.3781%	0.0048%
自基金合同生效起至今	28.7846%	0.0096%	22.4083%	0.0020%	6.3763%	0.0076%

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3346%	0.0046%	0.2466%	0.0000%	0.0880%	0.0046%
过去三个月	1.0130%	0.0037%	0.7479%	0.0000%	0.2651%	0.0037%
过去六个月	2.0071%	0.0035%	1.4877%	0.0000%	0.5194%	0.0035%
2012年12月11日至2013年6月30日	2.2538%	0.0036%	1.6598%	0.0000%	0.5940%	0.0036%

注:自2012年12月10日起,本基金增加B级基金份额类别。本基金A级基金份额的每万份基金净收益和7日年化收益率自2012年12月11日起计算。

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

华夏货币市场基金
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
2005年4月20日至2013年6月30日)



后收益率。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行6月份并未采取较强烈的紧缩措施,甚至可以说公开市场操作力度比较温和,在此情况下整个银行体系出资金的极度紧张,表明金融体系的流动性错配相当严重,大量空转的资金并未对实体经济发展起到正面作用,反而带来了巨大的杠杆风险。通过这次教训,未来一段时间金融体系将以缩减杠杆为主,银行间业务扩张步伐将减缓甚至收缩,而货币市场利率将维持在较高水平。

下半年,本基金将维持较高仓位的高流动性短期存款投资,在保证流动性的前提下争取获得较好的投资收益。

珍惜基金份额持有人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 管理人对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,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所负责估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规执行,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括督察长、投资风险管理人、证券研究/作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中,近三分之二的具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理人制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对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”有关约定,本基金每日将基金净收益按当日基金份额持有人应收益参与下—日的收益分配),并按自然月结转为相应的基金份额。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人投资运作、基金资产净值的增长、利润分配、基金份额申购赎回价格的操作,基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.1 资产负债表

会计主体:华夏货币市场基金
报告截止日:2013年6月30日

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
银行存款		1,401,212,870.97	1,491,518,741.50
结算备付金		9,096.59	584,236.37
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,197,861,220.16	1,478,886,054.42
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,197,861,220.16	1,478,886,054.42
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		18,951,366.43	31,486,512.34
应收股利		-	-
应收申购款		2,292,849.30	292,951,730.52
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,620,327,403.45	3,295,427,275.15

负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		365,606,255.71	26,979,866.51
应付证券清算款		43,469.98	20,488,781.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,171,018.61	592,535.38
应付托管费		354,854.09	179,556.18
应付销售服务费		376,121.46	373,457.35
应付交易费用		41,576.37	30,487.45
应交税费		19,740.00	19,740.00
应付利息		151,626.93	2,916.17
应付短期融资款		1,297,333.16	282,206.10
其他负债		220,553.38	304,608.99
负债合计		369,282,549.69	49,254,155.50
所有者权益:		-	-
实收基金		2,251,044,853.76	3,246,173,119.65
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,251,044,853.76	3,246,173,119.65
负债和所有者权益总计		2,620,327,403.45	3,295,427,275.15

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,251,044,853.76份(其中A类1,183,152,883.67份,B类1,067,891,970.09份)。

6.2 利润表

会计主体:华夏货币市场基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		95,978,149.72	48,440,242.42
1.利息收入		92,297,205.42	43,355,145.31
其中:存款利息收入		64,599,323.33	19,834,944.01
债券利息收入		24,982,055.11	22,161,103.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,715,826.98	1,359,097.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,680,944.30	5,085,097.10
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,680,944.30	5,085,097.10
资产支持证券投资		-	-
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.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减:二、费用		18,417,829.23	7,683,783.57
1.管理人报酬		6,699,885.88	2,914,320.41
2.托管费		2,030,268.40	883,127.44
3.销售服务费		2,378,976.17	2,207,818.57
4.交易费用		-	-
5.利息支出		7,092,817.57	1,470,474.06
其中:卖出回购金融资产支出		7,092,817.57	1,470,474.06
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		215,881.21	208,043.09
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		77,560,320.49	40,756,458.85
6.3 所有者权益(基金净值)变动表		-	-
会计主体:华夏货币市场基金		-	-
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日		-	-

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		3,246,173,119.65	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	77,560,320.49
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-995,128,265.89	-995,128,265.89
其中:1.基金申购款		10,427,238,179.85	-
2.基金赎回款		-11,422,366,445.74	-11,422,366,445.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		2,251,044,853.76	-

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		3,246,173,119.65	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	77,560,320.49
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-995,128,265.89	-995,128,265.89
其中:1.基金申购款		10,427,238,179.85	-
2.基金赎回款		-11,422,366,445.74	-11,422,366,445.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		2,251,044,853.76	-

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		3,246,173,119.65	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	77,560,320.49
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-995,128,265.89	-995,128,265.89
其中:1.基金申购款		10,427,238,179.85	-
2.基金赎回款		-11,422,366,445.74	-11,422,366,445.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		2,251,044,853.76	-

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		3,246,173,119.65	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-	77,560,320.49
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)		-995,128,265.89	-995,128,265.89
其中:1.基金申购款		10,427,238,179.85	-
2.基金赎回款		-11,422,366,445.74	-11,422,366,445.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)		-	-
五、期末所有者权益(基金净值)		2,251,044,853.76	-

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)		3,246,173,119.65	-