

华夏保证金理财货币市场基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明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约定，于2014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，保留下存目不存虚假记载、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2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华夏保证金货币
基金代码	519800
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月1日
报告期末基金份额总额	120,526,131.97份

投资目标 在保持低风险、高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳定回报。

投资策略 本基金主要通过采取货币市场类久期管理策略、利率期限结构策略以及资产配置策略等方法，在严格控制风险的前提下获取稳定的收益。

投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的货币市场工具，包括国债、央行票据、短期融资券、回购协议、短期债券、货币市场基金、银行存款、同业存放、票据投资、债券回购、短期债券回购、资产支持证券、权证、股票、国债期货等法律法规允许投资的金融工具。

业绩比较基准 七天通知存款利率后加0.2%。

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

下属分级基金的基金简称

华夏保证金货币A

华夏保证金货币B

报告期末下属分级基金的份额总额

71,959,922.82份

48,932,209.145份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
华夏保证金货币A	华夏保证金货币B
1.本期已实现收益	9,580,823.21
2.本期利润	9,589,823.22
3.期末未分配利润	71,959,922.82

注:1.本基金无持有人认购或交易基金的申购赎回费用。

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。

3.2.基金额度表现

3.2.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.2.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.3409% 0.031% -0.322% 0.0161% -0.003%

3.2.3.基金额度表现

3.2.3.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.4.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.5.基金额度表现

3.2.5.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.6.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.7.基金额度表现

3.2.7.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.8.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.9.基金额度表现

3.2.9.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.10.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.11.基金额度表现

3.2.11.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.12.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.13.基金额度表现

3.2.13.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.14.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.15.基金额度表现

3.2.15.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.16.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.17.基金额度表现

3.2.17.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.18.基金额度同生效以来基金额度累计净值收益率及其与同期业比较基准收益率的比较

华夏保证金货币A

(2013年2月1日至2014年3月31日)

华夏保证金货币A

阶段 净值 净值收益率(%) 业比较基准净值收益率(%) 业比较基准差额(%)

过去三个月 1.2021% 0.030% -0.332% 0.0161% -0.003%

3.2.19.基金额度表现

3.2.19.1基金额度净值收益率及其与同期业比较基准