# 华夏财富宝货币市场基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年三月二十九日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3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。

根据基金管理人2016年12月27日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订华夏财富宝货币市场基金基金合同的公告》及《关于财富宝货币市场基金增加B类基金份额类别的公告》,本基金自2016年12月27日起增加B类基金份额类别。

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。

本报告中的财务资料经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 华夏财富宝货币市场基金 | |
| 基金简称 | 华夏财富宝货币 | |
| 基金主代码 | 000343 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年10月25日 | |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 22,776,326,225.42份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000343 | 004201 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,081,197,558.55份 | 4,695,128,666.87份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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 | 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华夏基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张静 | 郭明 |
| | 联系电话 | 400-818-6666 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-818-6666 | 95588 |
| 传真 | | 010-63136700 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016年 | | 2015年 | | 2014年 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B |
| 本期已实现收益 | 1,195,431,596.96 | 1,294,214.04 | 2,299,934,265.78 | - | 2,922,488,097.15 | - |
| 本期利润 | 1,195,431,596.96 | 1,294,214.04 | 2,299,934,265.78 | - | 2,922,488,097.15 | - |
| 本期净值收益率 | 2.8025% | 0.0308% | 4.0773% | - | 5.0161% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末 | | 2015年末 | | 2014年末 | |
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B |
| 期末基金资产净值 | 18,081,197,558.55 | 4,695,128,666.87 | 54,542,495,466.66 | - | 41,324,693,552.10 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | - | 1.0000 | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016年末 | | 2015年末 | | 2014年末 | |
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B |
| 累计净值收益率 | 13.5654% | 0.0308% | 10.4694% | - | 6.1417% | - |

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。

④根报“关于华夏财富宝货币市场基金增加B类基金份额类别的公告”,本基金自2016年12月27日起增加B级基金份额类别。

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

华夏财富宝货币A:

| 3.1.1 期间数据和指标 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.6347% | 0.0017% | 0.3393% | 0.0000% | 0.2954% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 1.3803% | 0.0033% | 0.6787% | 0.0000% | 0.7016% | 0.0033% |
| 过去一年 | 2.8025% | 0.0025% | 1.3500% | 0.0000% | 1.4525% | 0.0025% |
| 过去三年 | 12.3611% | 0.0042% | 4.0500% | 0.0000% | 8.3111% | 0.0042% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.5654% | 0.0043% | 4.3015% | 0.0000% | 9.2639% | 0.0043% |

华夏财富宝货币B:

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2016年12月28日至2016年12月31日 | 0.0308% | 0.0007% | 0.0148% | 0.0000% | 0.0160% | 0.0007% |

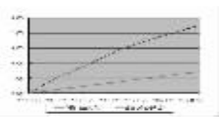
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏财富宝货币市场基金

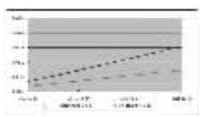
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年10月25日至2016年12月31日)

华夏财富宝货币A



华夏财富宝货币B



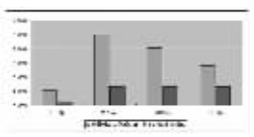
注:根据“关于华夏财富宝货币市场基金增加B类基金份额类别的公告”,本基金自2016年12月27日起增加B级基金份额类别。本基金B级基金份额的每万份基金净收益和7日年化收益率自2016年12月28日起计算。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

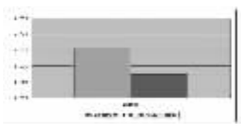
华夏财富宝货币市场基金

自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏财富宝货币A



华夏财富宝货币B



注:①本基金合同于2013年10月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。 ②根据“关于华夏财富宝货币市场基金增加B类基金份额类别的公告”,本基金自2016年12月27日起增加B级基金份额类别。本基金B级基金份额的每万份基金净收益和7日年化收益率自2016年12月28日起计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

华夏财富宝货币A:

单位:人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016年 | 1,195,431,596.96 | - | - | 1,195,431,596.96 | - |
| 2015年 | 2,299,934,265.78 | - | - | 2,299,934,265.78 | - |
| 2014年 | 2,922,488,097.15 | - | - | 2,922,488,097.15 | - |
| 合计 | 6,417,853,959.89 | - | - | 6,417,853,959.89 | - |

华夏财富宝货币B:

单位:人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2016年 | 1,294,214.04 | - | - | 1,294,214.04 | - |
| 合计 | 1,294,214.04 | - | - | 1,294,214.04 | - |

注:根据“关于华夏财富宝货币市场基金增加B类基金份额类别的公告”,本基金自2016年12月27日起增加B级基金份额类别。

## §4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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,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2016年12月30日数据),华夏策略混合在75只灵活配置混合型基金(股票上限80%)中排名第7,华夏医疗健康混合A及华夏兴华混合A分别在58只偏股型基金(股票上限95%)中排名第10和第13,华夏沪深300指数增强A在39只增强指数股票型基金中排名第12;固定收益类产品中,华夏理财30天债券在38只短期理财债券型基金中排名第9,华夏薪金宝货币在194只货币型基金中排名第13。

2016年,在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中,华夏基金获得“2015年度被动投资金牛基金公司”奖;在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中,华夏基金获得“2015年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面,2016年,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)改进业务流程,客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务,还可自助办理资产证明和盖章对账单,业务处理更加高效便捷;(2)增加交易渠道,与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财,并上线华夏财富网上交易系统,增加直销定投通等功能,为客户提供更多优惠便捷的理财渠道,提高交易便利性;(3)开展“你定,我投”、“客户个性化白皮书”、“2016活期通年底晒账单”、2016北京马拉松等系列宣传活动,为客户提供多样化的关怀服务。

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 | 2013-10-25 | - | 13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《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》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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,本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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 管理人对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

2016年,由于经济增长压力较大,通胀持续处于低位,央行通过降准和公开市场操作等方式在九月之前维持了较为宽松的货币政策,回购利率维持在较低水平。九月之后,由于汇率压力掣肘、资产泡沫问题逐步显著,叠加金融去杠杆要求,货币政策逐步收紧,十一月开始资金面变得十分紧张,至十二月紧张程度堪比2013年钱荒时期,货币市场利率大幅度上行,幅度在200bp以上。全年来看,各种短期资产在十月之前基本呈现利率逐步走低的态势,十月开始收益率大幅度上行,幅度在200-300bp不等。

报告期内,本基金规模波动较大,在资产的类别配置上绝大部分为同业存款及存单,获取了较为稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,华夏财富宝货币A本报告期份额净值收益率为2.8025%,同期业绩比较基准收益率为1.3500%;华夏财富宝货币B本报告期(2016年12月28日至2016年12月31日)份额净值收益率为0.0308%,同期业绩比较基准收益率为0.0148%。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,预计经济基本面偏温和,受制于汇率压力及金融去杠杆要求,货币政策将偏紧,流动性管理难度有所增大。由于2016年4季度短期利率大幅上行,货币市场收益率处于较高水平,投资价值相对于中长期债券更加显著。

本基金将加强投资中的现金流匹配管理,在确保基金流动性的基础上适当挖掘市场机会,努力获取稳定收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面,公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度,修订了保密管理制度和员工培训制度,进一步完善合规制度建设;公司开展多种形式的合规培训,重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育,不断提升员工的合规守法意识;强化事前事中合规风险管理,严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料,加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核,防范各类合规风险。在风险管理方面,公司秉承全员风险管理的理念,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;在监察稽核方面,公司定期和不定期开展多项内部稽核,对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查监督,促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业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开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等,以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,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。

4.8 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)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人,当日收益参与下一日的收益分配,并按日支付且结转为相应的基金份额。

4.9 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

本报告期内,本基金托管人在对华夏财富宝货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,华夏财富宝货币市场基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏财富宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏财富宝货币市场基金2016年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明(2017)审字第60739337_B24号

华夏财富宝货币市场基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华夏财富宝货币市场基金财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表和2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华夏财富宝货币市场基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 汤骏 马剑英

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2017年3月10日

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华夏财富宝货币市场基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | | | |
|---|---|---|---|---|
| 资产: | | | | |
| 银行存款 | | | | |
| 结算备付金 | | | | |
| 存出保证金 | | | | |
| 交易性金融资产 | | | | |
| 其中:股票投资 | | | | |
| 基金投资 | | | | |
| 债券投资 | | | | |
| 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 | | | | |
| 应收股利 | | | | |
| 应收申购款 | | | | |
| 递延所得税资产 | | | | |
| 其他资产 | | | | |
| 资产总计 | | | | |
| 负债和所有者权益 | | | | |
| 负债: | | | | |
| 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 | | | | |
| 应付证券清算款 | | | | |
| 应付赎回款 | | | | |
| 应付管理人报酬 | | | | |
| 应付托管费 | | | | |
| 应付销售服务费 | | | | |
| 应付交易费用 | | | | |
| 应交税费 | | | | |
| 应付利息 | | | | |
| 应付利润 | | | | |
| 递延所得税负债 | | | | |
| 其他负债 | | | | |
| 负债合计 | | | | |
| 所有者权益: | | | | |
| 实收基金 | | | | |
| 未分配利润 | | | | |
| 所有者权益合计 | | | | |
| 负债和所有者权益总计 | | | | 26,703,233,266.17 |

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额22,776,326,225.42份(其中A类 18,081,197,558.55份,B类 4,695,128,666.87份)。

7.2 利润表

会计主体:华夏财富宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | | | |
|---|---|---|---|---|
| 一、收入 | | | | |
| 1.利息收入 | | | | |
| 其中:存款利息收入 | | | | |
| 债券利息收入 | | | | |
| 资产支持证券利息收入 | | | | |
| 买入返售金融资产收入 | | | | |
| 其他利息收入 | | | | |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | | | |
| 其中:股票投资收益 | | | | |
| 基金投资收益 | | | | |
| 债券投资收益 | | | | |
| 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.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 | | | | |
| 1.管理人报酬 | | | | |
| 2.托管费 | | | | |
| 3.销售服务费 | | | | |
| 4.交易费用 | | | | |
| 5.利息支出 | | | | |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | | | |
| 6.其他费用 | | | | |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | | | |
| 减:所得税费用 | | | | |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | | | 1,196,725,811.00 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏财富宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 54,542,495,466.66 | - | 54,542,495,466.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,196,725,811.00 | 1,196,725,811.00 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -31,766,169,241.24 | - | -31,766,169,241.24 |
| 其中:1.基金申购款 | 119,979,279,797.07 | - | 119,979,279,797.07 |
| 2.基金赎回款 | -151,745,449,038.31 | - | -151,745,449,038.31 |
| 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) | - | -1,196,725,811.00 | -1,196,725,811.00 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 22,776,326,225.42 | - | 22,776,326,225.42 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 41,324,693,552.10 | - | 41,324,693,552.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,299,934,265.78 | 2,299,934,265.78 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 13,217,801,914.56 | - | 13,217,801,914.56 |
| 其中:1.基金申购款 | 216,581,730,434.95 | - | 216,581,730,434.95 |
| 2.基金赎回款 | -203,363,928,520.39 | - | -203,363,928,520.39 |
| 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) | - | -2,299,934,265.78 | -2,299,934,265.78 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 54,542,495,466.66 | - | 54,542,495,466.66 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

杨明辉 汪贵华 汪贵华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华夏基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人 |
| 中信证券股份有限公司(“中信证券”) | 基金管理人的股东 |
| 南方工业资产管理有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 山东省农村经济开发投资公司 | 基金管理人的股东 |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 基金管理人的股东 |
| 青岛海鹏科技投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海华夏财富投资管理有限公司(“华夏财富”) | 基金管理人的全资子公司 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

无。

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

无。

7.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 116,368,072.52 | 161,105,345.57 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 11,154.96 | - |

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算,从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 21,549,643.09 | 29,834,323.19 |

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|---|---|---|---|
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 合计 |
| 华夏基金管理有限公司 | 107,634,910.58 | 3,165.04 | 107,638,065.62 |
| 华夏财富 | 31,412.31 | 120.66 | 31,532.97 |
| 合计 | 107,666,322.89 | 3,285.70 | 107,669,598.59 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 合计 |
| 华夏基金管理有限公司 | 122,022,342.83 | - | 122,022,342.83 |
| 合计 | 122,022,342.83 | - | 122,022,342.83 |

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | 3,714,875,790.23 | 299,060,264.84 | - | - | 141,066,801,000.00 | 16,820,040.57 |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | | | |
| | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | - | 844,522,324.83 | - | - | 199,765,275,000.00 | 25,950,689.32 |

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B | 华夏财富宝货币A | 华夏财富宝货币B |
| 期初持有的基金份额 | 781,704,896.43 | - | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | 187,598,252.20 | - | 1,466,704,896.43 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | 969,000,000.00 | - | 685,000,000.00 | - |
| 期末持有的基金份额 | 303,148.63 | - | 781,704,896.43 | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | - | 1.43% | - |

注:①本基金管理人于本报告期申购/赎回本基金,适用费率为0%。

②本报告期“期间申购/买入总份额”包含红利再投资所获得的基金份额。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行活期存款 | 6,075,266.36 | 765,809.61 | 4,668,063.02 | 513,336.41 |
| 中国工商银行定期存款 | - | - | - | 168,300,243.54 |

注:本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本报告期其他收入中12,723,590.35 元来自基金管理人。

7.4.5 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,912,241,730.02元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 111615267 | 16民生CD267 | 2017-01-12 | 99.33 | 14,000,000 | 1,390,643,911.48 |
| 111617249 | 16光大CD249 | 2017-01-12 | 99.33 | 4,000,000 | 397,326,831.85 |
| 111695732 | 16盛京银行CD086 | 2017-01-12 | 99.08 | 8,595,000 | 851,566,447.86 |
| 111607173 | 16招行CD173 | 2017-01-05 | 99.47 | 5,263,000 | 523,515,123.55 |
| 160309 | 16进出09 | 2017-01-04 | 98.84 | 7,737,000 | 764,740,576.91 |
| 130212 | 13国开12 | 2017-01-04 | 101.03 | 2,400,000 | 242,473,466.91 |
| 合计 | - | - | - | 41,995,000 | 4,170,266,358.56 |

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层次:

第一层次:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至2016年12月31日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为0,第二层次的余额为 16,970,917,181.89 元,第三层次的余额为0元。(截至2015年12月31日止:第一层次的余额为0元,第二层次的余额为26,476,283,755.90元,第三层次的余额为0元。)

7.4.6.3 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4