华夏经典配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏经典混合
基金主代码	288001
交易代码	288001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年3月15日
报告期末基金份额总额	863,783,898.38份
投资目标	在长期投资的基础上,将战略资产配置与时机选择相结合,积极主动地精选证券,并充分利用短期金融工具作为动态配置的有效缓冲及收益补充,实施全流程的风险管理,力求在风险可控、获取稳定收益的基础上,追求资本最大可能的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数+20%×中证综合债券指数+20%×一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金是混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金。本基金追求资产配置动态平衡,收益和长期资本增值平衡,风险适中。
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

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	38,770,467.53
2.本期利润	-9,020,624.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0101
4.期末基金资产净值	880,082,363.42
5.期末基金份额净值	1.019

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

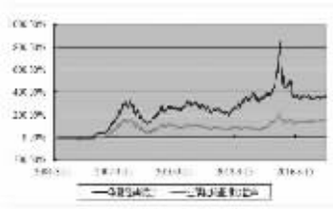
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差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	-0.97%	0.76%	2.99%	0.35%	-3.96%	0.41%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏经典配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年3月15日至2017年9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		
许利明	本基金的基金经理,股票投资部总监	2016-03-25	-	19年	北京工商大学产业经济学硕士。曾任北京国际信托投资公司投资银行总部项目经理,湘财证券有限责任公司资产管理总部总经理助理等。北京能苑天阁投资顾问有限责任公司首席投资顾问,天弘基金管理有限公司投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理(2007年7月27日至2009年3月30日期间)等,中国国际金融有限公司投资经理。2011年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构投资部投资经理,华夏成长证券投资基金基金经理(2015年9月1日至2017年3月28日期间),华夏军工安全灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年3月22日至2017年3月28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 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

3季度,国际方面,全球经济表现平稳。欧洲CPI数据符合预期,市场波动不大。美联储如期宣布缩表计划,今年年底前仍有一次加息预期,美元指数低位企稳。国际原油价格震荡上行,成为未来推升全球CPI的潜在因素。国内方面,在环保限产和供给侧改革政策影响下,大部分资源品价格震荡拾升,PPI和CPI均回升。工业增速和基建投资略低于预期。人民币兑美元持续升值。房地产调控政策进一步加码。股市受益于上市公司盈利改善推动,各行业轮番表现,整体平稳。

报告期内,本基金保持了较高仓位,均衡配置于周期股、消费股和金融股,对成长股的配置较低。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.019元,本报告期份额净值增长率为-0.97%,同期业绩比较基准增长率为2.99%。

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	权益投资	648,873,076.09	73.09
	其中:股票	648,873,076.09	73.09
2	固定收益投资	189,730,717.30	21.37
	其中:债券	189,730,717.30	21.37
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	46,662,885.10	5.26
7	其他各项资产	2,499,496.26	0.28
8	合计	887,766,174.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	122,485,498.79	13.92
C	制造业	317,040,350.96	36.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,336,520.00	0.38
E	建筑业	10,410,800.00	1.18
F	批发和零售业	33,522,380.90	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	2,913,635.91	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,837,180.03	1.00
J	金融业	105,689,922.00	12.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,592,787.00	5.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	648,873,076.09	73.73

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000596	古井贡酒	507,300	31,391,724.00	3.57
2	000069	华侨城A	3,764,200	30,753,514.00	3.49
3	002128	露天煤业	2,300,000	30,199,000.00	3.43
4	601336	新华保险	513,600	29,105,712.00	3.31
5	000968	蓝焰控股	1,732,300	28,981,379.00	3.29
6	000898	鞍钢股份	3,827,700	25,071,435.00	2.85
7	002460	赣锋锂业	279,954	24,439,984.20	2.78
8	601933	永辉超市	2,900,000	23,171,000.00	2.63
9	601166	兴业银行	1,200,000	20,748,000.00	2.36
10	000983	西山煤电	2,000,001	20,620,010.31	2.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	130,128,717.30	14.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,602,000.00	6.77
	其中:政策性金融债	59,602,000.00	6.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	189,730,717.30	21.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债(7)	982,090	100,143,717.30	11.38
2	150414	15农发14	500,000	49,840,000.00	5.66
3	019563	17国债09	300,000	29,985,000.00	3.41
4	160420	16农发20	100,000	9,762,000.00	1.11
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	584,034.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,798,066.85
5	应收申购款	117,406.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,499,496.26

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	911,497,575.06
报告期基金总申购份额	7,391,163.99
减:报告期基金总赎回份额	55,104,840.67
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	863,783,898.38

§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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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

2017年7月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017年9月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年9月29日发布华夏基金管理有限公司公告。

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,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2017年9月29日数据),华夏消费升级混合A在255只灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%)(A类)中排名第8;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在171只绝对收益目标基金(A类)中排名第3和第5;华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金(A类)中排名第5;华夏理财30天债券A在39只短期理财债券型基金(A类)中排名第8;华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金(A类)中排名第3;华夏收益债券(QDII)A及华夏大中华信用债券(QDII)A分别在15只QDII债券型基金(A类)中排名第1和第4。

在客户服务方面,3季度,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)升级华夏基金官网、与支付宝合作上线华夏基金财富号,为客户提供更便捷的基金投资和理财交流平台;(2)升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个渠道的在线客服系统,有效提升客户的服务满意度;(3)与星展银行、民生证券等代销机构合作,提供更多理财渠道,进一步提升客户体验;(4)开展"一门两世界,温差20度"、"华夏回报累计分红78次"、"火热报北马,一触'基'发"等多项活动,为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏经典配置混合型证券投资基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一七年十月二十五日

华夏现金增利证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏现金增利货币
基金主代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月7日
报告期末基金份额总额	72,226,403,698.50份
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下,追求超过基准的较高收益。
投资策略	积极判断短期利率变动,合理安排期限,细致研究,谨慎操作,以实现本金的安全性、流动性和稳定超过基准的较高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为"同期7天通知存款利率"。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险的品种,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金、混合基金和债券基金。
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
下属分级基金的基金简称	华夏现金增利货币A/E 华夏现金增利货币B
下属分级基金的交易代码	003003 001374
报告期末下属分级基金的份额总额	30,591,868,892.06份 41,634,534,806.53份

§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2017年7月1日-2017年9月30日)	
	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
1.本期已实现收益	290,398,394.25	364,440,686.20
2.本期利润	290,398,394.25	364,440,686.20
3.期末基金资产净值	30,591,868,892.06	41,634,534,806.53

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 本报告期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

华夏现金增利货币A/E:

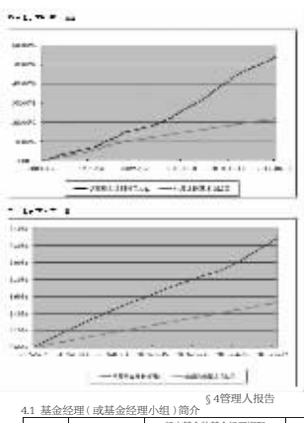
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0076%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.6673%	0.0019%

华夏现金增利货币B:

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	1.0687%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.7284%	0.0019%

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

华夏现金增利证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年4月7日至2017年9月30日)



华夏现金增利货币A/E

§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	2008-01-18	-	14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 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

3季度,央行货币政策继续维持稳健中性水平,操作上继续削峰填谷,保持资金面基本稳定。由于银行体系提前备战3季度考核,同业存单利率在9月初即创出本季度高点,且供需两旺,发行量仍较大。以全国性股份制商业银行三个月存单利率为例,收益率在达到4.65%附近后迅速回落,季末稳定在4.4%附近。

报告期内,本基金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2017年9月30日,华夏现金增利货币A/E本报告期份额净值收益率为1.0076%;华夏现金增利货币B本报告期份额净值收益率为1.0687%。同期业绩比较基准收益率为0.3403%。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	43,101,287,423.57	56.47
	其中:债券	43,101,287,423.57	56.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	170,000,000.00	0.22
	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	32,522,771,561.85	42.61
4	其他资产	532,382,424.18	0.70
5	合计	76,326,441,409.60	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	13.89	
	其中:买断式回购融资	0.04	
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	3,879,698,680.41	5.37
	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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

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	8.27	5.61
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	18.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.58	-
3	60天(含)-90天	27.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	7.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	42.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.94	5.61

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,566,020,592.61	16.01
	其中:政策性金融债	11,566,020,592.61	16.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,239,847,848.76	1.72
6	中期票据	-	-
7	同业存单	30,295,418,982.20	41.95
8	其他	-	-
9	合计	43,101,287,423.57	59.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	7,643,150,025.55	10.58

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	160309	16进出09	42,600,000	4,206,038,972.48	5.82
2	111784224	17广州农村商业银行CD159	37,000,000	3,625,457,748.96	5.02
3	160305	16进出05	34,400,000	3,437,111,053.07	4.76
4	111781331	17盛京银行CD159	25,000,000	2,466,587,177.21	3.42
5	111780627	17哈尔滨银行CD136	20,000,000	1,953,129,908.59	2.70
6	111785465	17天津银行CD197	19,000,000	1,859,174,993.19	2.57
7	170204	17国开04	16,100,000	1,605,510,526.05	2.22
8	111718261	17华夏银行CD261	15,000,000	1,496,009,479.06	2.07
9	111720167	17广发银行CD167	15,000,000	1,493,228,128.38	2.07
10	111716187	17上海银行CD187	15,000,000	1,490,531,369.91	2.06

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	0.14%
报告期内偏离度的最低值	0.03%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

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前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 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	296,048,150.66
4	应收申购款	236,327,366.65
5	其他应收款	6,917.87
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	532,382,424.18

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

	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
本报告期期初基金份额总额	26,993,292,457.74	30,874,964,202.47
报告期基金总申购份额	22,237,428,931.22	31,662,445,501.85
报告期基金总赎回份额	18,638,852,496.90	20,902,874,897.79
报告期期末基金份额总额	30,591,868,892.06	41,634,534,806.53

注:上述"本报告期基金总申购份额"、"本报告期基金总赎回份额"包含A级基金份额、B级基金份额间转换的基金份额。

§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

项目	华夏现金增利货币A/E	华夏现金增利货币B
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	929,954,971.16
报告期期间买入/申购总份额	-	6,227,134.69
报告期期间卖出/赎回总份额	-	530,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	406,182,105.85
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	0.98

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	赎回	2017-07-13	-70,000,000.00	-70,000,000.00	0.00%
2	基金转换转出	2017-08-02	-400,000,000.00	-400,000,000.00	0.00%
3	赎回	2017-08-07	-10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
4	赎回	2017-08-08	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
5	赎回	2017-08-17	-20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
6	红利再投资	-	6,227,134.69	6,227,134.69	0.00%
合计			-523,772,865.31	-523,772,865.31	

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	2017-07-01至2017-08-07;2017-08-10	12,106,049,766.11	128,547,595.16	-	12,234,597,381.27	16.94%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大额赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于5000万元,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

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

2017年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017年9月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华财