华夏理财 30 天债券型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华夏理财 30 天债券型证券投资基金	
基金简称	华夏理财 30 天债券	
基金主代码	001057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 10 月 24 日	
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	
报告期末基金份额总额	17,510,533,433.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
下属分级基金的交易代码	001057	001058
报告期末下属分级基金的份额总额	893,916,220.15 份	16,616,617,213.70 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	本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A区	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	田国立

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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日）	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
本期已实现收益	17,121,947.20	317,883,712.16
本期利润	17,121,947.20	317,883,712.16
本期净值收益率	1.4444%	1.5652%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
期末基金资产净值	893,916,220.15	16,616,617,213.70
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
累计净值收益率	30.1696%	28.2586%

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本基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

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

华夏理财 30 天债券 A：

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.2056%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.0946%	0.0017%
过去三个月	0.6274%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2908%	0.0010%
过去六个月	1.4444%	0.0020%	0.6695%	0.0000%	0.7749%	0.0020%
过去一年	3.2553%	0.0039%	1.3500%	0.0000%	1.9053%	0.0039%
过去三年	11.5270%	0.0038%	4.0481%	0.0000%	7.4789%	0.0038%

自基金合同生效起至今	30.1696%	0.0057%	9.0240%	0.0000%	21.1456%	0.0057%

华夏理财 30 天债券 B：

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.2253%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.1143%	0.0017%
过去三个月	0.6877%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.3511%	0.0010%
过去六个月	1.5652%	0.0020%	0.6695%	0.0000%	0.8957%	0.0020%
过去一年	3.5036%	0.0039%	1.3500%	0.0000%	2.1536%	0.0039%
过去三年	10.7687%	0.0053%	4.0481%	0.0000%	6.7206%	0.0053%
自基金合同生效起至今	28.2586%	0.0066%	9.0240%	0.0000%	19.2346%	0.0066%

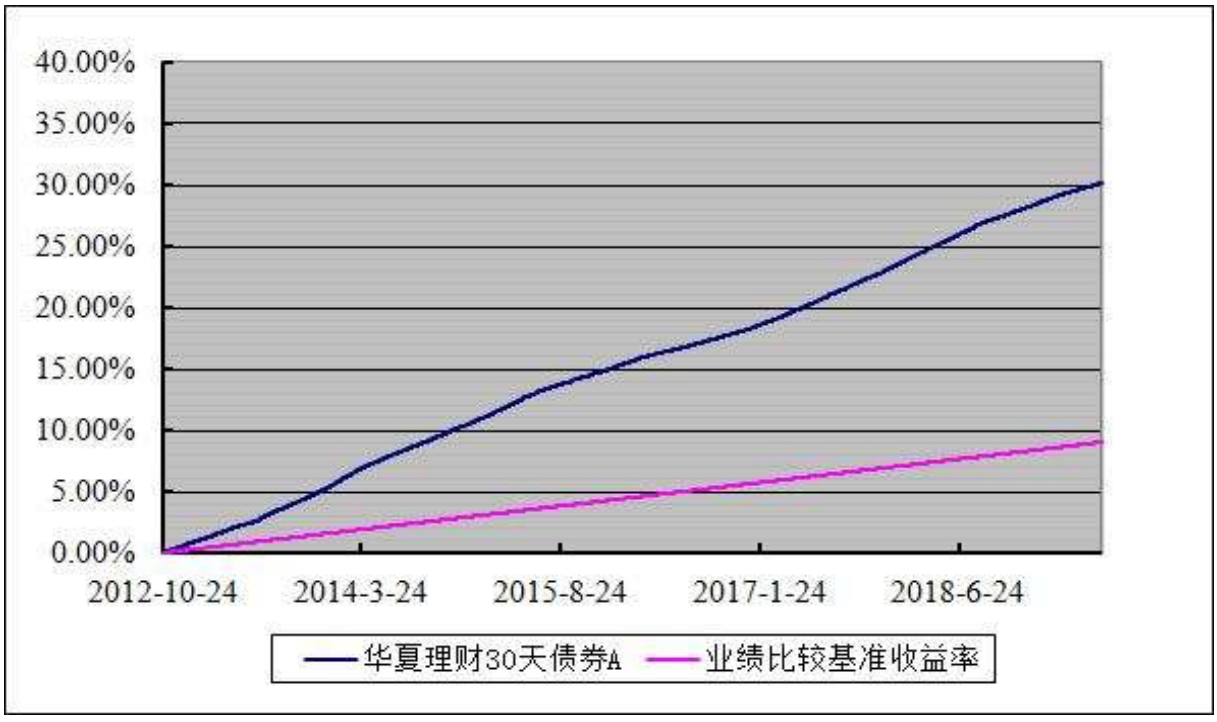
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财 30 天债券型证券投资基金

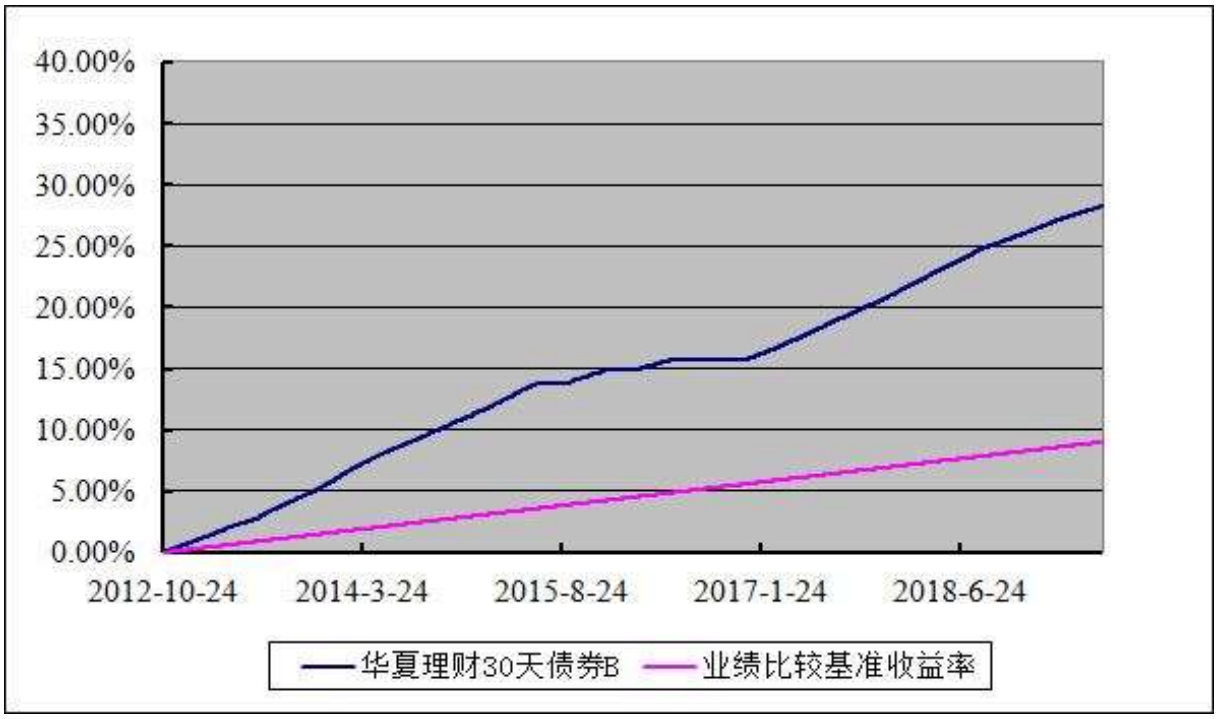
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 10 月 24 日至 2019 年 6 月 30 日)

华夏理财 30 天债券 A



华夏理财 30 天债券 B



§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、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 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 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、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、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、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 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），华夏移动互联混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中排序 9/34；华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金（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；华夏理财 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；华夏恒融定开债券在“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（非 A 类）”中排序 9/34。

上半年，公司及旗下基金荣膺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业明星基金奖颁奖典礼上，华夏安康债券、华夏收益债券（QDII）和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏鼎茂债券（004042）荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖，华夏中小板 ETF（159902）荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”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）直销电子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
		任职日期	离任日期		
周飞	本基金的基金经理、现金管理部高级副总裁	2016-10-20	-	9 年	中央财经大学理学学士、经济学学士。2010 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、现金管理部基金经理助理等。

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》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 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

上半年，国际方面，金融市场持续波动。中美贸易战一波三折，1 季度有所缓 2 季度又重新升

温，A 股指数也在国内外局势的影响下，冲高至 3288 点后大幅回落。

国内货币市场，央行上半年进行了 2 次降准操作，分别于 1 月 15 日和 1 月 25 日各降了 0.5%，并于 1 月 23 日进行了 TMLF 首次操作 2575 亿，释放流动性约 2 万亿，足以对冲春节的取现以及到期的 MLF 资金。开年一直到 2 月末，资金面一直处于宽松状态，隔夜利率一度下到 1.6%附近。2 月 20 日，李克强在国务院常务会议上指出：稳健的货币政策未变，坚决不搞“大水漫灌”。中国人民银行货币政策委员会季度例会表示，稳健的货币政策要松紧适度，把好货币供给总闸门，不搞“大水漫灌”，同时保持流动性合理充裕，广义货币 M2 和社会融资规模增速要与国内生产总值（GDP）名义增速相匹配。

从资金面的稳定性来看，2019 年 2 月开始，资金面波动性显著放大，临时性的资金紧张开始出现，表明了央行货币政策态度的边际变化。5 月末包商银行事件导致市场出现了大幅波动，同业市场的信用利差开始走阔，银行间市场中小机构负债压力激增，流动性风险有所增加。6 月中旬监管通过一系列的手段控制了事态的扩大，资金市场在包商事件经历了大幅的震荡后重新走向宽松平稳态势，半年末市场宽松，利率下行明显。期间央行通过逆回购、常备借贷便利（SLF）和中期借贷便利（MLF）等定向工具维持市场的合理充裕，央行继续维持稳健货币政策，报告期内资金面虽因包商事件影响出现结构性分化，但总体处于平稳态势。

报告期内，本基金主要投资于同业存单、同业存款，并于季末择机进行了存单和存款的投资，信用债比例维持低位。期限搭配以及杠杆水平合适，组合整体的流动性较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，华夏理财 30 天债券 A 本报告期份额净值收益率为 1.4444%；华夏理财 30 天债券 B 本报告期份额净值收益率为 1.5652%。同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。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

展望下半年，宏观经济方面，近期经济数据弱于预期，3 季度经济有再次下探风险，同时李克强总理再次强调解决中小企业融资贵、融资难问题，这些都有助于 3 季度政策加码，而 4 季度经济可能全面企稳，政策上可能会边际收紧，再叠加关键时点的冲击，届时收益可能会有所上行。

货币政策方面，预计央行仍会维持稳健的货币政策，利用和创设各种公开市场工具，以维持货币市场稳定和继续疏通流动性向实体经济传导的通道。上半年资金价格的波动加剧并未带来存单收益的大起大落，截止上半年末，仅因包商事件冲击下存单收益有明显跳升，但在央行大力投放操作后，收益回至前期位置，预计全年存单收益相对平稳。

本基金未来将维持较高仓位的高流动性短期存款和高资质的同业存单的投资，做好期限匹配，

在流动性风险可控前提下争取获得较好的投资收益。

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申购、赎回价格。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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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）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，并在每运作期期末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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，华夏理财 30 天债券 A 实施利润分配的金额为 17,121,947.20 元。

报告期内，华夏理财 30 天债券 B 实施利润分配的金额为 317,883,712.16 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：华夏理财 30 天债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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		1,301,077,286.44	2,091,527,798.30
结算备付金		25,913,000.00	2,182,272.73
存出保证金		-	-
交易性金融资产		21,313,672,322.25	27,125,212,092.81
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		21,313,672,322.25	27,125,212,092.81
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	399,800,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		58,818,318.72	90,396,221.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,380,893.39
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,699,480,927.41	29,712,499,278.95
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
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		4,941,367,037.81	6,991,065,473.36
应付证券清算款		215,968,314.24	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		4,324,444.29	5,535,270.19
应付托管费		1,281,316.82	1,640,080.08
应付销售服务费		342,301.28	528,134.55
应付交易费用		152,203.21	202,293.68
应交税费		223,798.03	206,433.37
应付利息		2,147,930.06	11,731,792.78
应付利润		23,024,816.10	34,283,773.77
递延所得税负债		-	-
其他负债		115,331.72	109,000.00
负债合计		5,188,947,493.56	7,045,302,251.78
所有者权益：		-	-
实收基金		17,510,533,433.85	22,667,197,027.17
未分配利润		-	-
所有者权益合计		17,510,533,433.85	22,667,197,027.17
负债和所有者权益总计		22,699,480,927.41	29,712,499,278.95

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 17,510,533,433.85 份（其中 A 类 893,916,220.15 份，B 类 16,616,617,213.70 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

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		422,173,961.20	676,832,942.60
1.利息收入		415,144,900.52	682,455,272.34
其中：存款利息收入		25,648,619.40	226,635,891.54
债券利息收入		367,851,347.24	453,365,781.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,644,933.88	2,453,599.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,029,060.68	-5,623,192.24
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		7,029,060.68	-5,623,192.24
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）		-	862.50
减：二、费用		87,168,301.84	123,775,887.51
1.管理人报酬		28,876,697.05	31,571,738.08
2.托管费		8,556,058.33	9,354,589.00
3.销售服务费		2,459,897.91	3,428,330.84
4.交易费用		-	-
5.利息支出		46,998,747.23	79,134,707.06
其中：卖出回购金融资产支出		46,998,747.23	79,134,707.06
6.税金及附加		118,783.81	157,568.50
7.其他费用		158,117.51	128,954.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		335,005,659.36	553,057,055.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		335,005,659.36	553,057,055.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	22,667,197,027.17	-	22,667,197,027.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	335,005,659.36	335,005,659.36
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）	-5,156,663,593.32	-	-5,156,663,593.32
其中：1.基金申购款	339,290,184.44	-	339,290,184.44
2.基金赎回款	-5,495,953,777.76	-	-5,495,953,777.76
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）	-	-335,005,659.36	-335,005,659.36
五、期末所有者权益（基金净值）	17,510,533,433.85	-	17,510,533,433.85
项目	**上年度可比期间** 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	13,045,340,513.77	-	13,045,340,513.77

净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	553,057,055.09	553,057,055.09
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）	16,096,845,462.03	-	16,096,845,462.03
其中：1.基金申购款	29,196,883,097.66	-	29,196,883,097.66
2.基金赎回款	-13,100,037,635.63	-	-13,100,037,635.63
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）	-	-553,057,055.09	-553,057,055.09
五、期末所有者权益（基金净值）	29,142,185,975.80	-	29,142,185,975.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

无。

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 债券交易

无。

6.4.4.1.4 债券回购交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	28,876,697.05	31,571,738.08
其中：支付销售机构的客户维护费	537,406.10	1,107,955.62

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	8,556,058.33	9,354,589.00

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 0.08%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×0.08%/当年天数。

6.4.4.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B	合计
华夏基金管理有限公司	254,498.63	1,004,663.06	1,259,161.69
中国建设银行	94,958.51	-	94,958.51
中信证券	2,100.74	-	2,100.74
中信证券（山东）	52.21	-	52.21
华夏财富	35,908.14	299.00	36,207.14
合计	387,518.23	1,004,962.06	1,392,480.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B	合计
华夏基金管理有限公司	398,421.09	1,046,019.66	1,444,440.75
中国建设银行	246,543.06	3,425.27	249,968.33
中信证券	5,615.66	-	5,615.66
中信证券（山东）	1,551.03	-	1,551.03
华夏财富	70,152.06	11,261.99	81,414.05
合计	722,282.90	1,060,706.92	1,782,989.82

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费分别按 A、B 类基金份额前一日基金资产净值 0.25%、0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：A 类日基金销售服务费＝前一日 A 类基金资产净值×0.25%/当年天数；B 类日基金销售服务费＝前一日 B 类基金资产净值×0.01%/当年天数。

6.4.4.3 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

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易的	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	交易金额	利息支出

各关联方名称				入		
中国建设银行	-	-	-	-	2,556,876,746.63	757,696.56
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国建设银行	-	-	-	-	4,929,810,000.00	3,460,991.71

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	1,077,286.44	90,922.53	1,653,054.40	34,371.94

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券质押式正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 4,941,367,037.81 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
180410	18 农发 10	2019-07-01	100.05	9,100,000.00	910,430,947.71
111918204	19 华夏银行 CD204	2019-07-01	99.40	6,250,000.00	621,220,830.16
111916158	19 上海银行 CD158	2019-07-01	99.83	2,895,000.00	289,012,628.49
111980506	19 长沙银行 CD112	2019-07-01	96.76	1,311,000.00	126,846,631.65
160315	16 进出 15	2019-07-01	100.26	1,200,000.00	120,313,340.18
190201	19 国开 01	2019-07-01	99.97	258,000.00	25,791,254.81
111999924	19 徽商银行 CD044	2019-07-02	98.55	4,301,000.00	423,866,292.75
111885736	18 厦门国际银行 CD228	2019-07-02	99.27	1,075,000.00	106,714,572.28
111997066	19 北京农商银行 CD077	2019-07-03	99.68	6,061,000.00	604,140,689.44
111997324	19 成都银行 CD103	2019-07-03	98.87	5,000,000.00	494,359,143.15
111888434	18 杭州银行 CD082	2019-07-03	98.83	4,000,000.00	395,307,938.39
111980055	19 宁波银行 CD107	2019-07-03	99.37	2,186,000.00	217,211,976.83
111918200	19 华夏银行 CD200	2019-07-04	98.66	7,500,000.00	739,978,466.30
111906173	19 交通银行 CD173	2019-07-04	98.66	26,000.00	2,565,260.03
111906173	19 交通银行 CD173	2019-07-05	98.66	1,178,000.00	116,226,012.12
合计				52,341,000.00	5,193,985,984.29

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2019 年 6 月 30 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 元，第二层次的余额为 21,313,672,322.25 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 0 元，第二层次的余额为 27,125,212,092.81 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	21,313,672,322.25	93.89
	其中：债券	21,313,672,322.25	93.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	1,326,990,286.44	5.85

4	其他各项资产	58,818,318.72	0.26
5	合计	22,699,480,927.41	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	16.22	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	4,941,367,037.81	28.22
	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情况的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.3.2 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	3.06	29.45
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	49.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
4	90 天（含）—120 天	4.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	50.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		129.30	29.45

7.4 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,100,720,560.64	6.29
	其中：政策性金融债	1,100,720,560.64	6.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,040,827,385.52	28.79
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,172,124,376.09	86.65
8	其他	-	-
9	合计	21,313,672,322.25	121.72
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111909078	19 浦发银行 CD078	20,000,000	1,986,179,988.82	11.34
2	111909188	19 浦发银行 CD188	10,000,000	993,811,905.65	5.68
3	180410	18 农发 10	9,100,000	910,430,947.71	5.20
4	111997066	19 北京农商银行 CD077	8,500,000	847,252,245.55	4.84
5	111918200	19 华夏银行 CD200	7,500,000	739,978,466.30	4.23
6	111918204	19 华夏银行 CD204	7,100,000	705,706,863.06	4.03
7	111993952	19 天津银行 CD024	7,000,000	695,296,311.76	3.97
8	111918211	19 华夏银行 CD211	7,100,000	694,402,305.54	3.97

9	111980240	19 东莞农村商业银行 CD058	6,000,000	596,039,429.79	3.40
10	111906173	19 交通银行 CD173	5,500,000	542,651,160.13	3.10

7.7“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	7 次
报告期内偏离度的最高值	0.27%
报告期内偏离度的最低值	0.02%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

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商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。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华夏银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	58,818,318.72
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	58,818,318.72

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.9.4.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

7.9.4.2 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏理财 30 天债券 A	49,514	18,053.81	5,297,669.93	0.59%	888,618,550.22	99.41%
华夏理财 30 天债券 B	25	664,664,688.55	16,556,801,100.98	99.64%	59,816,112.72	0.36%
合计	49,539	353,469.66	16,562,098,770.91	94.58%	948,434,662.94	5.42%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏理财 30 天债券 A	2,723,413.81	0.30%
	华夏理财 30 天债券 B	-	-
	合计	2,723,413.81	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基	华夏理财 30 天债券 A	10~50

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏理财 30 天债券 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏理财 30 天债券 A	0
	华夏理财 30 天债券 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
基金合同生效日（2012 年 10 月 24 日）基金份额总额	1,848,995,297.12	720,883,017.88
本报告期期初基金份额总额	1,518,382,279.51	21,148,814,747.66
本报告期基金总申购份额	22,578,037.85	316,712,146.59
减：本报告期基金总赎回份额	647,044,097.21	4,848,909,680.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	893,916,220.15	16,616,617,213.70

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 级基金份额间升降级的基金份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

ⅰ经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

ⅴ建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金还选择了东方证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、申万宏源证券、中信建投证券、平安证券、中国银河证券、招商证券、广州证券、中信证券、中金公司、西部证券、方正证券、高华证券、万联证券、东莞证券、国海证券、长江证券、长城证券、信达证券、华创证券、国盛证券、万和证券、东兴证券、天风证券、光大证券、安信证券、民生证券、东吴证券、川财证券、

汇丰前海证券、财通证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中信证券、东方证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元。民族证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	25,551,700,000.00	100.00%

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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
机构	1	2019-01-01至2019-06-30	5,159,875,991.82	82,535,923.75	-	5,242,411,915.57	29.94%
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量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。							

华夏基金管理有限公司

二〇一九年八月二十九日