华夏现金宝货币市场基金

（原华夏理财 21 天债券型证券投资基金转型）

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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。

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。

根据本基金管理人相关公告，华夏理财 21 天债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议基金转型有关事项，该基金份额持有人大会决议自 2016 年 9 月 20 日起生效。 华夏理财 21 天债券型证券投资基金于 2016 年 10 月 28 日正式转型为华夏现金宝货币市场基金。

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。

华夏现金宝货币市场基金报告期自 2016 年 10 月 28 日起至 2016 年 12 月 31 日止，原华夏理财 21 天债券型证券投资基金报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 10 月 27 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

2.1.1华夏现金宝货币市场基金

基金名称	华夏现金宝货币市场基金	
基金简称	华夏现金宝货币	
基金主代码	001077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月28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	184,778,178.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏现金宝货币A	华夏现金宝货币B
下属分级基金的交易代码	001077	001078
报告期末下属分级基金的份额总额	85,916,080.21份	98,862,097.80份

2.1.2 原华夏理财21天债券型证券投资基金

基金名称	华夏理财21天债券型证券投资基金	
基金简称	华夏理财21天债券	
基金主代码	001077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月22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	50,763,654.83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21天债券A	华夏理财21天债券B
下属分级基金的交易代码	001077	001078
报告期末下属分级基金的份额总额	23,223,092.92份	27,540,561.91份

注：原华夏理财 21 天债券型证券投资基金于 2016 年 10 月 28 日转型为华夏现金宝货币市场基金。

2.2 基金产品说明

2.2.1华夏现金宝货币市场基金

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	基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置

	比例，并适时进行动态调整。
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。

2.2.2 原华夏理财21天债券型证券投资基金

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，在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	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	
	转型后 报告期（2016 年 10 月 28 日-2016 年 12 月 31 日）		转型前 报告期（2016 年 1 月 1 日-2016 年 10 月 27 日）					
	华夏现金宝货币 A	华夏现金宝货币 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
本期已实现收益	206,420.83	142,798.66	418,669.42	483,285.66	1,721,573.40	105,227.83	6,958,399.87	740,999.37
本期利润	206,420.83	142,798.66	418,669.42	483,285.66	1,721,573.40	105,227.83	6,958,399.87	740,999.37

本期净值收益率	0.3827%	0.4248%	1.4944%	1.7368%	3.0581%	0.8214%	4.6455%	2.6196%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 12 月 31 日）		报告期末（2016 年 10 月 27 日）		2015 年末		2014 年末	
	华夏现金宝货币 A	华夏现金宝货币 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
期末基金资产净值	85,916,080.21	98,862,097.80	23,223,092.92	27,540,561.91	33,782,475.41	17,084,778.56	74,490,243.20	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 12 月 31 日）		报告期末（2016 年 10 月 27 日）		2015 年末		2014 年末	
	华夏现金宝货币 A	华夏现金宝货币 A	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B
累计净值收益率	0.3827%	0.4248%	13.9327%	9.8642%	12.2552%	7.9887%	8.9243%	7.1089%

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华夏理财 21 天债券型证券投资基金每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

④华夏现金宝货币市场基金按日结转份额。

⑤自 2016 年 10 月 28 日起，由《华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 华夏现金宝货币市场基金

3.2.1.1 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

华夏现金宝货币 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
自基金转型起至今	0.3827%	0.0025%	0.2398%	0.0000%	0.1429%	0.0025%

华夏现金宝货币 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
自基金转型起至今	0.4248%	0.0025%	0.2398%	0.0000%	0.1850%	0.0025%

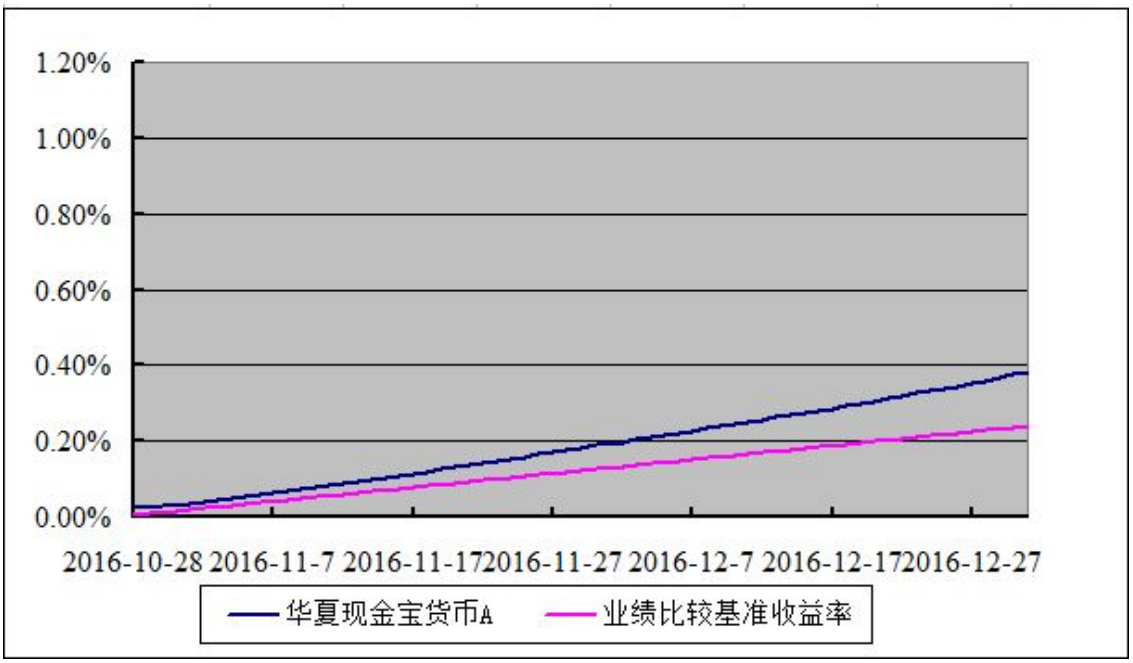
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏现金宝货币市场基金

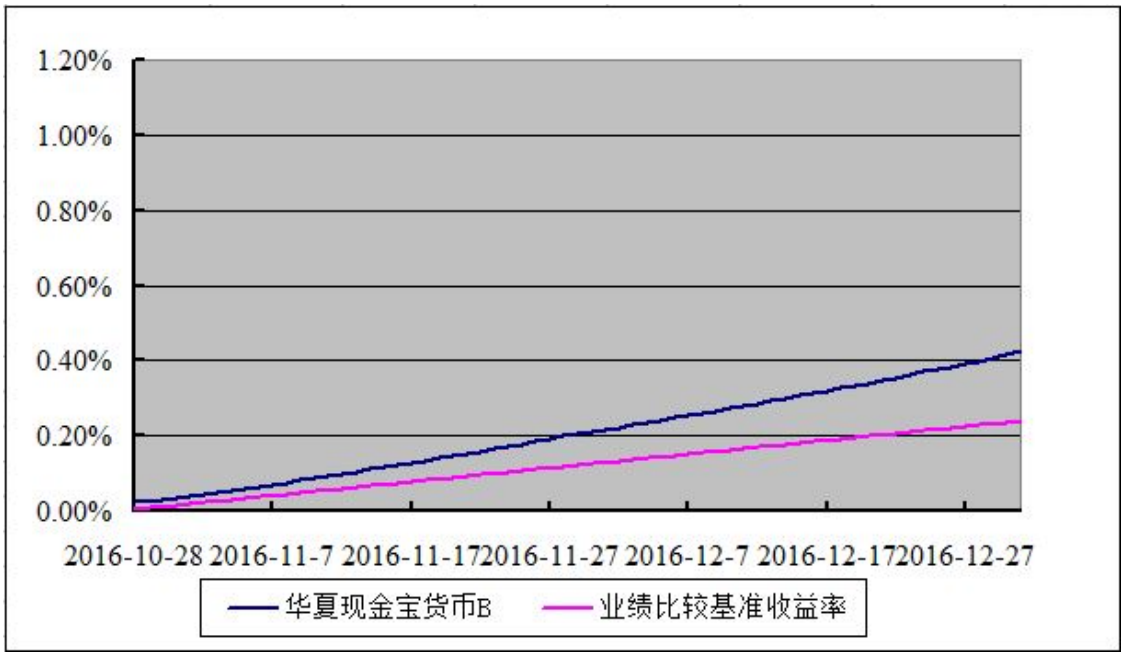
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016 年 10 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日）

华夏现金宝货币 A



华夏现金宝货币 B

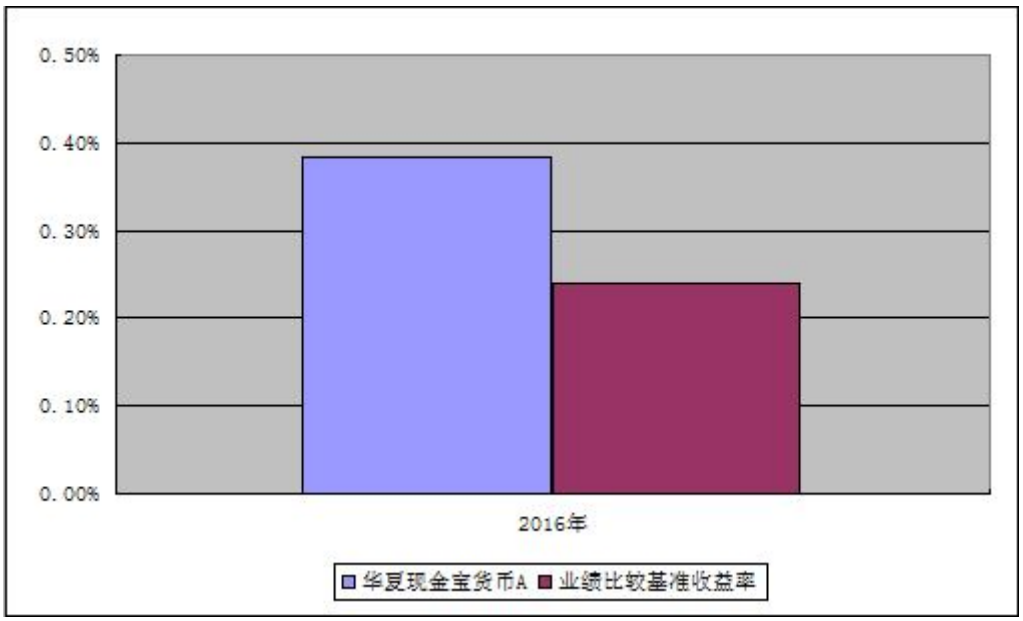


注：①自 2016 年 10 月 28 日起，由《华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效。

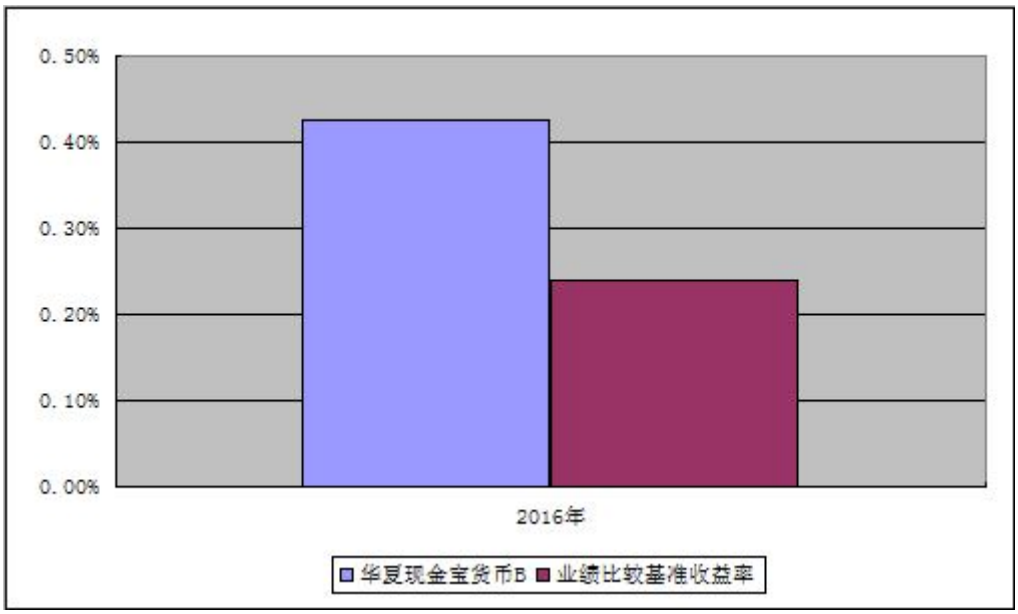
②根据华夏现金宝货币市场基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

3.2.1.3 自基金转型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

华夏现金宝货币 A



华夏现金宝货币 B



注：自 2016 年 10 月 28 日起，由《华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》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。

3.2.2 原华夏理财 21 天债券型证券投资基金

3.2.2.1 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 21 天债券 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
过去三个月	0.4100%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.0707%	0.0007%
过去六个月	0.8507%	0.0005%	0.6750%	0.0000%	0.1757%	0.0005%
过去一年	1.8868%	0.0009%	1.3507%	0.0000%	0.5361%	0.0009%
过去三年	10.4353%	0.0065%	4.0507%	0.0000%	6.3846%	0.0065%
自基金合同生效起至转型前	13.9327%	0.0060%	5.0826%	0.0000%	8.8501%	0.0060%

华夏理财 21 天债券 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	② －③	②－④
过去三个月	0.4832%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.1439%	0.0007%
过去六个月	0.9971%	0.0005%	0.6750%	0.0000%	0.3221%	0.0005%
过去一年	2.1830%	0.0009%	1.3507%	0.0000%	0.8323%	0.0009%
过去三年	6.2551%	0.0059%	4.0507%	0.0000%	2.2044%	0.0059%
自基金合同	9.8642%	0.0060%	5.0826%	0.0000%	4.7816%	0.0060%

生效起至转型前						

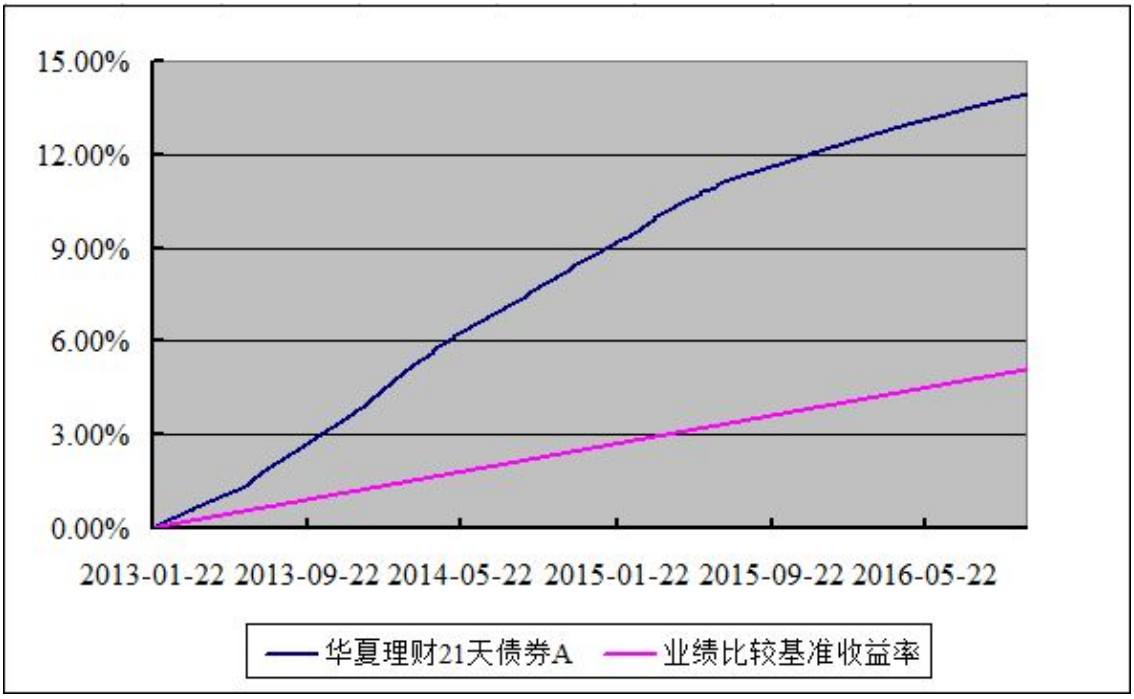
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

原华夏理财 21 天债券型证券投资基金

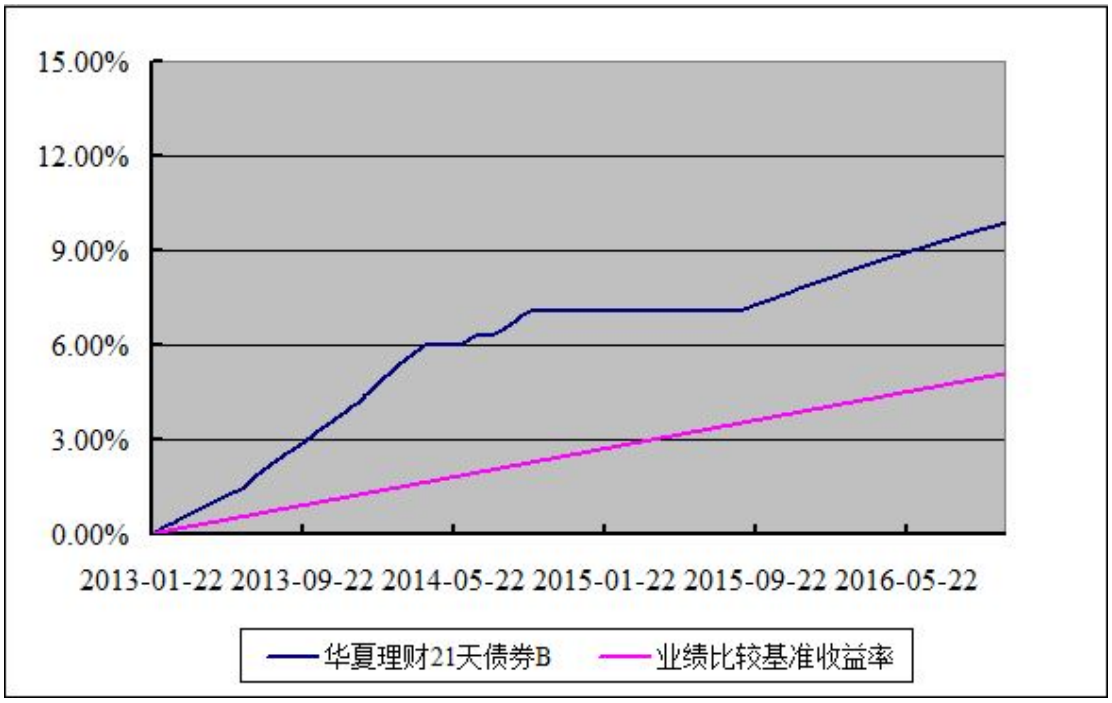
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013 年 1 月 22 日至 2016 年 10 月 27 日）

华夏理财 21 天债券 A



华夏理财 21 天债券 B

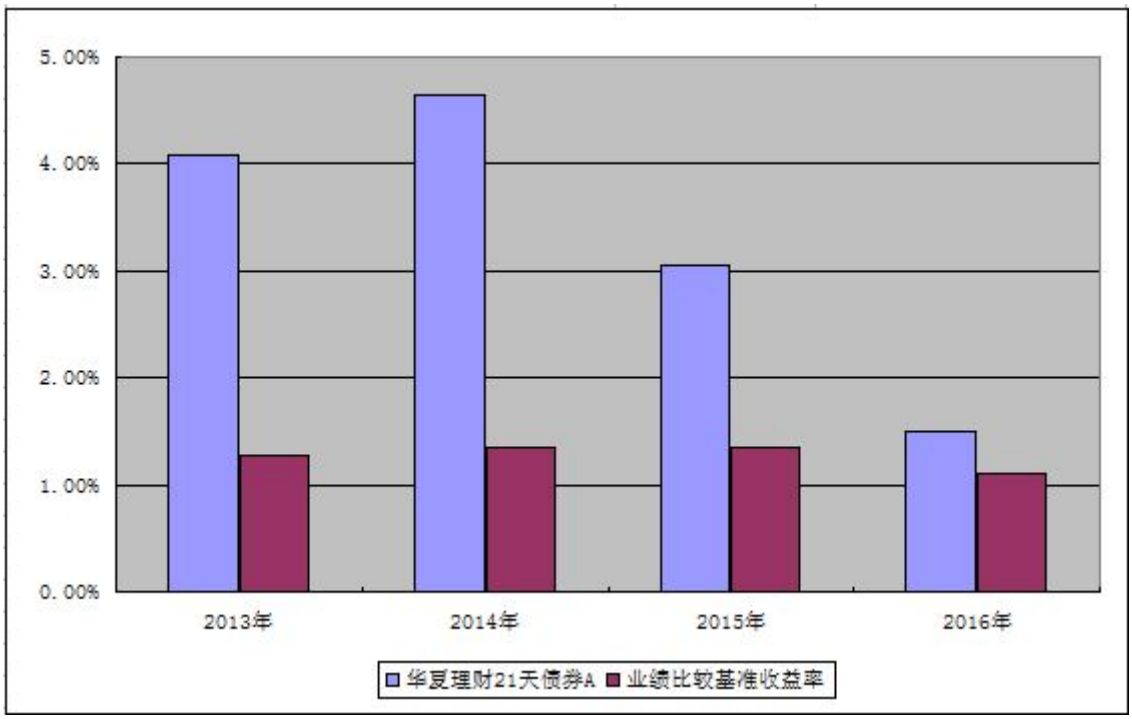


3.2.2.3　自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

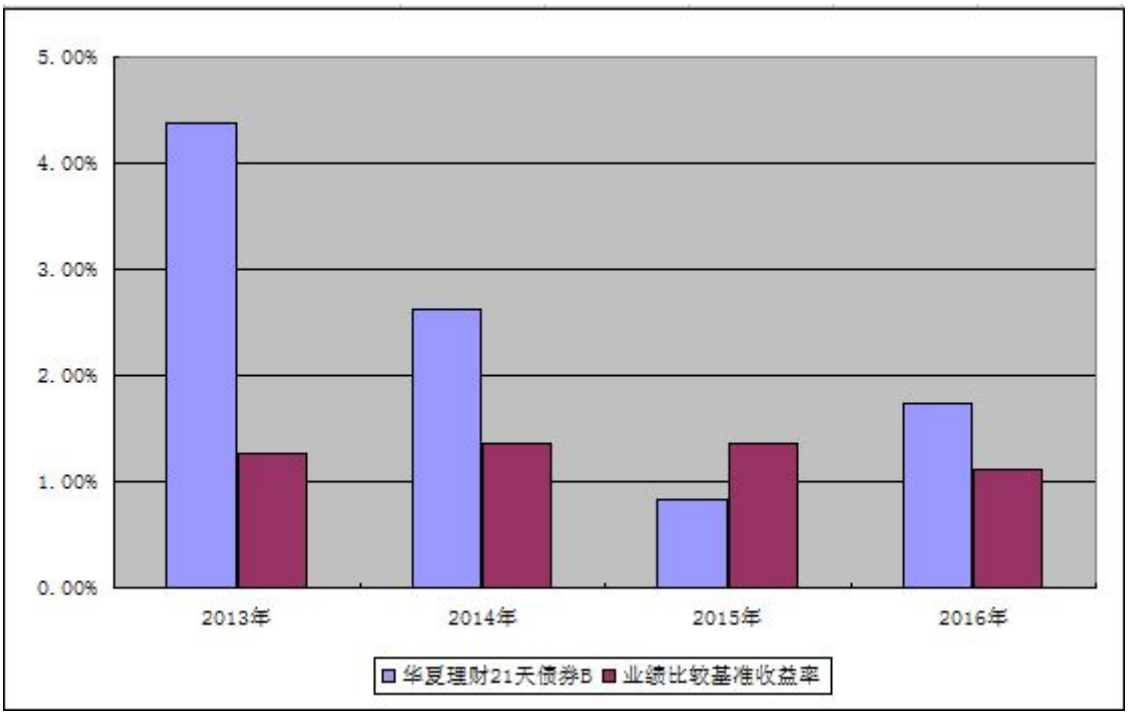
原华夏理财 21 天债券型证券投资基金

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

华夏理财 21 天债券 A



华夏理财 21 天债券 B



注：本基金合同于 2013 年 1 月 22 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。

3.3 基金的利润分配情况

3.3.1 华夏现金宝货币市场基金转型以来基金的利润分配情况

华夏现金宝货币 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
转型后（2016 年 10 月 28 日-2016 年 12 月 31 日）	204,684.14	-	1,736.69	206,420.83	-
合计	204,684.14	-	1,736.69	206,420.83	-

华夏现金宝货币 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
转型后（2016 年 10 月 28 日-2016 年 12 月 31 日）	141,099.74	-	1,698.92	142,798.66	-
合计	141,099.74	-	1,698.92	142,798.66	-

3.3.2 华夏理财 21 天债券型证券投资基金自基金合同生效以来至基金转型前基金利润分配情况

华夏理财 21 天债券 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
转型前（2016 年 1 月 1 日-2016 年 10 月 27 日）	388,804.81	35,157.02	-5,292.41	418,669.42	-
2015 年	1,472,461.78	330,161.47	-81,049.85	1,721,573.40	-
2014 年	6,116,049.20	1,194,423.25	-352,072.58	6,958,399.87	-
合计	7,977,315.79	1,559,741.74	-438,414.84	9,098,642.69	-

华夏理财 21 天债券 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
转型前（2016 年 1 月 1 日-2016 年 10 月 27 日）	455,783.35	33,952.34	-6,450.03	483,285.66	-
2015 年	84,778.56	-	20,449.27	105,227.83	-
2014 年	514,721.74	264,559.59	-38,281.96	740,999.37	-
合计	1,055,283.65	298,511.93	-24,282.72	1,329,512.86	-

§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		
周飞	本基金的基金经理、现金管理部副总裁	2016-10-28	-	6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。
罗远航	本基金的基金经理、现金管理部副总裁	2014-8-20	2016-10-28	5年	清华大学应用经济学硕士。2011年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、交易管理部交易员、现金管理部研究员等。

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，国际方面，金融市场波动较大，英国脱欧，欧洲和日本央行加大宽松力度，美国大选尘埃落定，美联储货币政策更加鹰派，年内加息终于落定。国内方面，经济增长整体呈现企稳并温和复苏迹象，全年通胀较低但PPI（生产物价指数）在全球大宗商品以及供给侧改革影响下明显回升，年末“再通胀”预期又有所提升。资金面前松后紧，因受制于汇率、资产价格等因素，下半年监管对于去杠杆、防风险等表态明确，央行对货币政策态度也有所转变。

市场方面，央行上半年货币政策整体偏宽松，资金面也呈现平稳宽松态势，央行通过各类工具加强了对资金面的调控，2016年春节后降准一次，在调降中期借贷便利（MLF）利率的同时维持了7天逆回购利率不变,上半年存款利率和存单利率整体小幅下行，短期债券的收益率在1季度下行后，2季度有所上行；下半年央行态度有所转变，货币政策转为中性，陆续重启14天逆回购、28天逆回购以及1年MLF等锁短放长操作，债券收益率走势呈现较为剧烈的波动，尤其是在年末黑天鹅事件以及资金面阶段性大幅收紧的冲击下迅速上扬。

报告期内，本基金主要投资于同业存款和存单，波段操作短期债券，并于4季度降低了债券、存单比例及剩余期限，组合整体流动性良好，期限搭配和杠杆水平相对合理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金转型前，截至2016年10月27日，华夏理财21天债券A2016年1月1日至10月27日期间份额净值收益率为1.4944 %；华夏理财21天债券B2016年1月1日至10月27日期间份额净值收益率1.7368 %。同期业绩比较基准收益率为1.1102 %；本基金转型后，截止2016年12月31日，华夏现金宝货币A2016年10月28日至12月31日期间份额净值收益率为0.3827 %；华夏现金宝货币B2016年10月28日至12月31日期间份额净值收益率0.4248 %，同期业绩比较基准收益率为0.2398 %，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，国际方面，美国经济复苏大势依然不变，美联储延续加息通道和鹰派倾向，美元相对于其他货币强势的地位不变，资金回流美国的趋势大

概率会继续维持。国内方面，预期经济整体维持平稳态势，中央经济工作会议定调2017年的货币政策保持稳健中性。央行将继续使用定向工具维护市场的流动性，但受汇率压力、债市持续“去杠杆”的约束，以及公开市场到期及银行MPA时点考核压力等影响，资金面的不确定性会加大，预期资金面仍会出现阶段性的波动。

本基金未来将维持较高仓位的高流动性短期存款和一定比例的短期存单投资，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

4.8.1华夏现金宝货币市场基金

根据本基金合同及招募说明书/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，并定期支付且结转为相应的基金份额。

4.8.2原华夏理财21天债券型证券投资基金

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。

4.9 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现金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，华夏现金宝货币市场基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏现金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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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现金宝货币市场基金2016年年度报告中财务指标、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

6.1 华夏现金宝货币市场基金

安永华明（2017）审字第60739337_B18号

华夏现金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现金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10月28日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间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。

6.1.1 基金管理人对财务报表的责任

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。

6.1.2 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。

6.1.3 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，公允反映了华夏现金宝货币市场基金2016 年 12 月 31 日的财务状况以及2016 年 10 月 28日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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）　　中国注册会计师　汤骏 马剑英

2017 年 3 月 10 日

6.2 原华夏理财 21 天债券基金

安永华明（2017）审字第60739337_B38号

华夏理财21天债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏理财 21 天债券型证券投资基金财务报表，包括2016 年 10 月 27 日的资产负债表和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 10 月 27 日止期间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。

6.2.1 基金管理人对财务报表的责任

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。

6.2.2 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。

6.2.3 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，公允反映了华夏理财 21 天债券型证券投资基金2016 年 10 月 27 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 10 月 27 日止期间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）　　中国注册会计师　汤骏　马剑英

2017 年 3 月 10 日

§7 年度财务报表

7.1 华夏现金宝货币市场基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：华夏现金宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		87,795,624.91
结算备付金		528,225.30
存出保证金		-
交易性金融资产		7,984,405.79
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		7,984,405.79
资产支持证券投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		43,976,425.96

应收证券清算款		8,004,059.61
应收利息		206,933.76
应收股利		-
应收申购款		36,404,712.60
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		184,900,387.93
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		21,580.53
应付托管费		6,394.23
应付销售服务费		12,691.43
应付交易费用		4,254.80
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		28,288.93
递延所得税负债		-
其他负债		49,000.00
负债合计		122,209.92
所有者权益：		
实收基金		184,778,178.01
未分配利润		-
所有者权益合计		184,778,178.01
负债和所有者权益总计		184,900,387.93

注：①自2016年10月28日起，由《华夏理财21天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效，本报告期自2016年10月28日至2016年12月31日。

②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184,778,178.01份(其中A类 85,916,080.21份,B类98,862,097.80份)。

7.1.2 利润表

会计主体：华夏现金宝货币市场基金

本报告期：2016年10月28日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年10月28日至 2016年12月31日
一、收入		479,671.40
1.利息收入		479,671.40
其中：存款利息收入		242,747.34
债券利息收入		93,079.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		143,844.52
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		130,451.91
1.管理人报酬		40,589.81
2.托管费		12,026.61
3.销售服务费		24,143.55
4.交易费用		-
5.利息支出		20,628.06
其中：卖出回购金融资产支出		20,628.06
6.其他费用		33,063.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		349,219.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		349,219.49

注：自2016年10月28日起，由《华夏理财21天债券型证券投资基金基金合同》修

订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效，本报告期自2016年10月28日至2016年12月31日。

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏现金宝货币市场基金

本报告期：2016年10月28日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月28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）	50,763,654.83	-	50,763,654.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	349,219.49	349,219.49
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）	134,014,523.18	-	134,014,523.18
其中：1.基金申购款	262,262,942.06	-	262,262,942.06
2.基金赎回款	-128,248,418.88	-	-128,248,418.88
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）	-	-349,219.49	-349,219.49
五、期末所有者权益（基金净值）	184,778,178.01	-	184,778,178.01

注：自2016年10月28日起，由《华夏理财21天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效，本报告期自2016年10月28日至2016年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1.1至7.1.4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

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 重要会计政策和会计估计

7.1.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计报表的实际编制期间为2016年10月28日（基金合同生效日）至2016年12月31日。

7.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.1.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计

算影子价格(附注7.1.4.4.5)，以避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.1.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致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，基金管理人于每一计价日采用债券投资和资产支持证券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.1.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.1.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.1.4.1.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。在计算实际利率时，扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税因素。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.1.4.1.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.1.4.1.10 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付利润科目，定期支付且结转为相应的基金份额。

由于本基金各基金份额类别的销售服务费率不同，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

7.1.4.2 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。

7.1.4.3 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
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
中信期货有限公司(“中信期货”)	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。

7.1.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.4.1.1 股票交易

无。

7.1.4.4.1.2 权证交易

无。

7.1.4.4.1.3 债券交易

无。

7.1.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.1.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.1.4.4.2 关联方报酬

7.1.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年10月28日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	40,589.81
其中：支付销售机构的客户维护费	7,660.65

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。

7.1.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,026.61

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。

7.1.4.4.2.3 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 10 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏现金宝货币 A	华夏现金宝货币 B	合计
华夏基金管理有限公司	8,228.13	490.30	8,718.43
中国工商银行	9,804.92	47.78	9,852.70
中信证券	20.50	21.85	42.35
中信证券（山东）	25.75	-	25.75
中信期货	20.82	-	20.82
华夏财富	1.36	-	1.36
合计	18,101.48	559.93	18,661.41

注： ①支付基金销售机构的基金销售服务费分别按 A 类、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。

7.1.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.1.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.1.4.4.4.2 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。

7.1.4.4.5 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 2016年10月28日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	1,795,624.91	4,855.78

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.1.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.1.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.1.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.1.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.1.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.1.4.6.1 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。

7.1.4.6.2 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元，第二层次的余额为7,984,405.79 元，第三层次的余额为0元。

7.1.4.6.3 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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。

7.1.4.6.4 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。

7.2 原华夏理财21天债券型证券投资基金

7.2.1 资产负债表

会计主体：原华夏理财21天债券型证券投资基金

报告截止日：2016年10月27日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年10月27日	上年度末 2015年12月 31日
资产：			
银行存款		21,781,305.20	40,449,377.17

结算备付金		37,500.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		-	10,008,517.25
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	10,008,517.25
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		31,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		82,706.73	450,045.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,000.00	150,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		52,902,511.93	51,057,940.40
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016年10月27日**	**上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		1,994,413.33	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,030.60	11,624.31
应付托管费		2,972.03	3,444.19
应付销售服务费		5,257.81	9,146.73
应付交易费用		-	875.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		24,853.32	36,595.76
递延所得税负债		-	-
其他负债		101,330.01	129,000.00
负债合计		2,138,857.10	190,686.43
所有者权益：		-	-

实收基金		50,763,654.83	50,867,253.97
未分配利润		-	-
所有者权益合计		50,763,654.83	50,867,253.97
负债和所有者权益总计		52,902,511.93	51,057,940.40

注：①自2016年10月28日起，由《华夏理财21天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效。

②报告截止日2016年10月27日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额50,763,654.83份(其中A类23,223,092.92份,B类27,540,561.91份)。

7.2.2 利润表

会计主体：原华夏理财21天债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年10月27日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年10月27日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		1,273,626.09	2,392,353.56
1.利息收入		1,273,626.09	2,273,431.81
其中：存款利息收入		1,094,487.53	1,570,748.70
债券利息收入		125,222.66	665,890.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		53,915.90	36,792.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	118,921.75
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	118,921.75
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		371,671.01	565,552.33

1.管理人报酬		124,697.09	159,951.36
2.托管费		36,947.41	47,392.81
3.销售服务费		71,115.03	165,258.27
4.交易费用		-	-
5.利息支出		1,969.19	20,586.47
其中：卖出回购金融资产支出		1,969.19	20,586.47
6.其他费用		136,942.29	172,363.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		901,955.08	1,826,801.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		901,955.08	1,826,801.23

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：原华夏理财21天债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年10月27日

单位：人民币元

项目	**本期 2016年1月1日至2016年10月27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）	50,867,253.97	-	50,867,253.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	901,955.08	901,955.08
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）	-103,599.14	-	-103,599.14
其中：1.基金申购款	74,113,972.91	-	74,113,972.91
2.基金赎回款	-74,217,572.05	-	-74,217,572.05
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）	-	-901,955.08	-901,955.08
五、期末所有者权益（基金净值）	50,763,654.83	-	50,763,654.83
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）	74,490,243.20	-	74,490,243.20

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,826,801.23	1,826,801.23
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）	-23,622,989.23	-	-23,622,989.23
其中：1.基金申购款	167,655,393.48	-	167,655,393.48
2.基金赎回款	-191,278,382.71	-	-191,278,382.71
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）	-	-1,826,801.23	-1,826,801.23
五、期末所有者权益（基金净值）	50,867,253.97	-	50,867,253.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.2.1至7.2.4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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 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。

7.2.4.2 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。

7.2.4.3 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

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。

7.2.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.4.1.1 股票交易

无。

7.2.4.4.1.2 权证交易

无。

7.2.4.4.1.3 债券交易

无。

7.2.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.2.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.2.4.4.2 关联方报酬

7.2.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年10月27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	124,697.09	159,951.36
其中：支付销售机构的客户维护费	18,228.90	41,596.96

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。

7.2.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 10 月 27 日	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	36,947.41	47,392.81

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。

7.2.4.4.2.3 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 10 月 27 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	合计
华夏基金管理有限公司	20,994.05	2,332.85	23,326.90
中国工商银行	30,949.99	-	30,949.99
中信证券	99.94	-	99.94
合计	52,043.98	2,332.85	54,376.83
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		
	华夏理财 21 天债券 A	华夏理财 21 天债券 B	合计
华夏基金管理有限公司	57,302.29	429.96	57,732.25
中国工商银行	72,754.71	-	72,754.71
中信证券	239.38	-	239.38
合计	130,296.38	429.96	130,726.34

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费分别按 A 类、B 类基金份额前一日基金资产净值 0.30%、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×0.30%/ 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。

7.2.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.2.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.2.4.4.4.2 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。

7.2.4.4.5 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 2016年1月1日至 2016年10月27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	6,781,305.20	21,759.83	1,449,377.17	13,764.92

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.2.4.5 期末（2016年10月27日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.2.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.2.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.2.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.2.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.4.6.1 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。

7.2.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至2016年10月27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0 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10,008,517.25元，第三层次的余额为0元。）

7.2.4.6.3 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。

7.2.4.6.4 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。

§8 投资组合报告

8.1 华夏现金宝货币市场基金

（报告期末为2016年12月31日，报告期间为2016年10月28日至2016年12月31日）

8.1.1 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	7,984,405.79	4.32
	其中：债券	7,984,405.79	4.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	43,976,425.96	23.78
	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	88,323,850.21	47.77
4	其他各项资产	44,615,705.97	24.13
5	合计	184,900,387.93	100.00

8.1.2 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	4.81	
	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	-	-
	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%。

8.1.3 基金投资组合平均剩余期限

8.1.3.1 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	31
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况的说明

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。

8.1.3.2 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	46.71	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	60天(含)—90天	17.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	80.25	-

8.1.4 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。

8.1.5 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	7,984,405.79	4.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	7,984,405.79	4.32
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.1.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	169948	16贴现国债48	80,000	7,984,405.79	4.32
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-

7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

8.1.7 “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	0.00%
报告期内偏离度的最低值	-0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

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。

8.1.8 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。

8.1.9 投资组合报告附注

8.1.9.1 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。

8.1.9.2 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。

8.1.9.3 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	8,004,059.61
3	应收利息	206,933.76
4	应收申购款	36,404,712.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,615,705.97

8.1.9.5 其他需说明的重要事项

8.1.9.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

8.1.9.5.2 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。

8.2 原华夏理财21天债券型证券投资基金

（报告期末为2016年10月27日，报告期间为2016年1月1日至2016年10月27日）

8.2.1 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	31,000,000.00	58.60
	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	21,818,805.20	41.24
4	其他各项资产	83,706.73	0.16
5	合计	52,902,511.93	100.00

8.2.2 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	0.14	
	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	-	-
	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。

8.2.3 基金投资组合平均剩余期限

8.2.3.1 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	9
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

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141天"，本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.2.3.2 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	98.14	3.93
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.91	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.05	3.93

8.2.4 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。

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.2.7 “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	0.01%
报告期内偏离度的最低值	-0.00%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.00%

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。

8.2.8 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。

8.2.9 投资组合报告附注

8.2.9.1 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。

8.2.9.2 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。

8.2.9.3 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	82,706.73
4	应收申购款	1,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	83,706.73

8.2.9.5 其他需说明的重要事项

8.2.9.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

8.2.9.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 华夏现金宝货币市场基金

9.1.1 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	户均持有的基金	持有人结构

	数（户）	份额	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
华夏现金宝货币 A	1,789	48,024.64	11,521,346.36	13.41%	74,394,733.85	86.59%
华夏现金宝货币 B	9	10,984,677.53	57,854,099.63	58.52%	41,007,998.17	41.48%
合计	1,798	102,768.73	69,375,445.99	37.55%	115,402,732.02	62.45%

9.1.2 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	华夏现金宝货币 A	615.38	0.00%
	华夏现金宝货币 B	-	-
	合计	615.38	0.00%

9.1.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏现金宝货币 A	0
	华夏现金宝货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏现金宝货币 A	0
	华夏现金宝货币 B	0
	合计	0

9.2 原华夏理财 21 天债券型证券投资基金

9.2.1 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 21 天债券 A	1,409	16,481.97	1,015.87	0.00%	23,222,077.05	100.00%
华夏理财 21 天债券 B	1	27,540,561.91	27,540,561.91	100.00%	-	-
合计	1,410	36,002.59	27,541,577.78	54.25%	23,222,077.05	45.75%

9.2.2 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 21 天债券 A	513.03	0.00%
	华夏理财 21 天债券 B	-	-
	合计	513.03	0.00%

9.2.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏理财 21 天债券 A	0
	华夏理财 21 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏理财 21 天债券 A	0
	华夏理财 21 天债券 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

10.1 华夏现金宝货币市场基金

单位：份

项目	华夏现金宝货币A	华夏现金宝货币B
基金合同生效日（2016年10月28日）基金份额总额	23,223,092.92	27,540,561.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	153,481,187.32	108,781,754.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	90,788,200.03	37,460,218.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	85,916,080.21	98,862,097.80

注：①自 2016 年 10 月 28 日起，由《华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效。

②上述“基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额”、“基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额”包含 A 级基金份额、B 级基金份额间升降级的基金份额。

10.2 华夏理财 21 天债券型证券投资基金

单位：份

项目	华夏理财21天债券A	华夏理财21天债券B
基金合同生效日（2013年1月22日）基金份额总额	2,566,365,216.47	1,182,544,384.04
本报告期期初基金份额总额	33,782,475.41	17,084,778.56

本报告期基金总申购份额	32,558,053.56	41,555,919.35
减：本报告期基金总赎回份额	43,117,436.05	31,100,136.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,223,092.92	27,540,561.91

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

华夏理财 21 天债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于华夏理财 21 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，该基金份额持有人大会决议自 2016 年 9 月 20 日起生效。自 2016 年 10 月 28 日起，“华夏理财 21 天债券型证券投资基金”正式转型为“华夏现金宝货币市场基金”。

11.2 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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于华夏理财 21 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，将“华夏理财 21 天债券型证券投资基金”转型为“华夏现金宝货币市场基金”，基金投资策略相应调整，调整后的内容可查阅《华夏现金宝货币市场基金基金合同》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金及原华夏理财 21 天债券型证券投资基金提供 4 年的审计服务。

11.6 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未受到任何处分。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

11.7.1.1 华夏现金宝货币市场基金

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	
-	-	-	-	-	-	-

11.7.1.2 华夏理财21天债券型证券投资基金

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	
-	-	-	-	-	-	-

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自2016年10月28日起，由《华夏理财21天债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏现金宝货币市场基金基金合同》生效。除本表列示外，本基金还选择了中泰证券、新时代证券、国金证券、信达证券、上海证券、中信建投证券、长江证券、东北证券、兴业证券、中国银河证券、国泰君安证券、中投证券和中银国际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，新时代证券、东北证券、长江证券、兴业证券和中泰证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

11.7.2.1 华夏现金宝货币市场基金

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
中国银河证券	-	-	231,200,000.00	100%

1.7.2.2 华夏理财 21 天债券型证券投资基金

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
中国银河证券	-	-	167,300,000.00	100%

11.8 偏离度绝对值超过 0.5％的情况

11.8.1 华夏现金宝货币市场基金

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

11.8.2 原华夏理财 21 天债券型证券投资基金

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日