

华夏天利货币市场基金

2017 年半年度报告

2017 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	25
7.1 期末基金资产组合情况.....	25
7.2 债券回购融资情况.....	26
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	26
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.....	27
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	27
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.....	27
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	28
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	28
7.9 投资组合报告附注.....	28
§8 基金份额持有人信息.....	29
§9 开放式基金份额变动.....	30
§10 重大事件揭示.....	30
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	33
§12 备查文件目录.....	33

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏天利货币市场基金	
基金简称	华夏天利货币	
基金主代码	002894	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 13 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,390,130,626.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B
下属分级基金的交易代码	002894	002895
报告期末下属分级基金的份额总额	511,499,165.66 份	878,631,460.67 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、资产支持证券投资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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	林葛
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		杨明辉	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§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（2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日）	
	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B
本期已实现收益	7,245,991.37	16,021,921.92
本期利润	7,245,991.37	16,021,921.92
本期净值收益率	1.7700%	1.8920%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B
期末基金资产净值	511,499,165.66	878,631,460.67
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(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B
累计净值收益率	2.2567%	2.4328%

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 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

华夏天利货币 A:

阶段	份额净值收	净值收益率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	益率①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.3433%	0.0054%	0.1110%	0.0000%	0.2323%	0.0054%
过去三个月	0.9354%	0.0033%	0.3366%	0.0000%	0.5988%	0.0033%
过去六个月	1.7700%	0.0028%	0.6695%	0.0000%	1.1005%	0.0028%
自基金合同生效起至今	2.2567%	0.0033%	0.9645%	0.0000%	1.2922%	0.0033%

华夏天利货币 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	0.3628%	0.0054%	0.1110%	0.0000%	0.2518%	0.0054%
过去三个月	0.9957%	0.0033%	0.3366%	0.0000%	0.6591%	0.0033%
过去六个月	1.8920%	0.0028%	0.6695%	0.0000%	1.2225%	0.0028%
自基金合同生效起至今	2.4328%	0.0033%	0.9645%	0.0000%	1.4683%	0.0033%

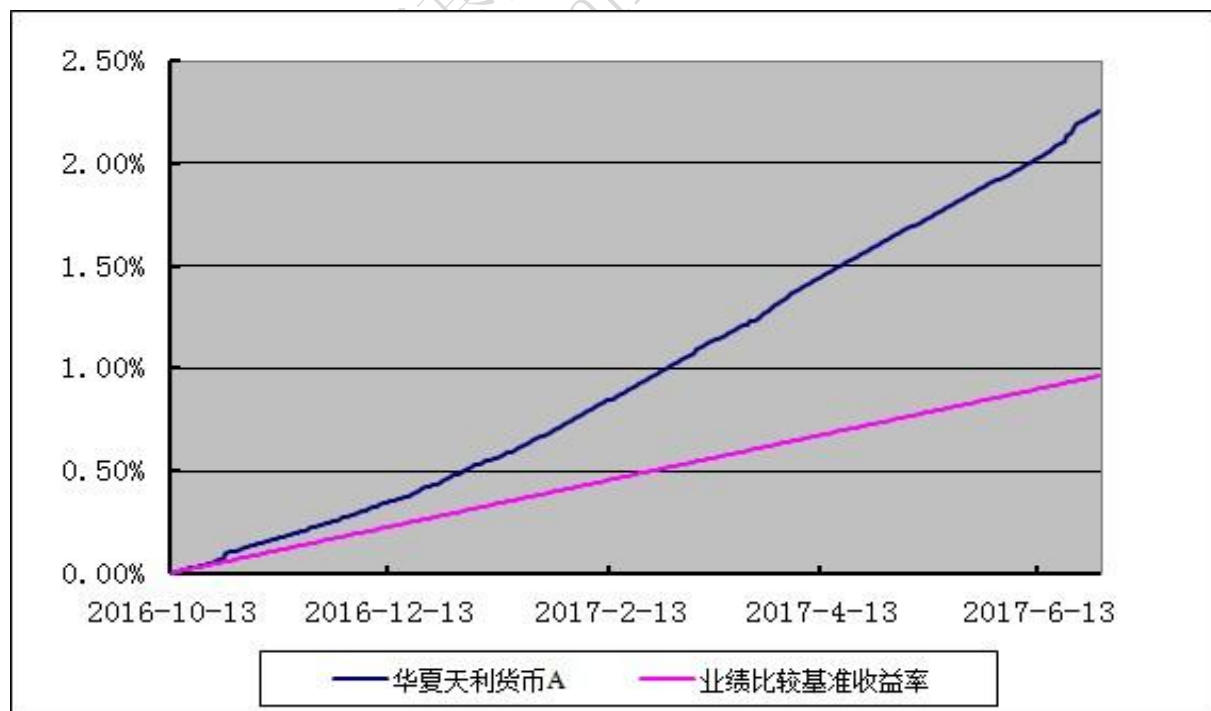
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏天利货币市场基金

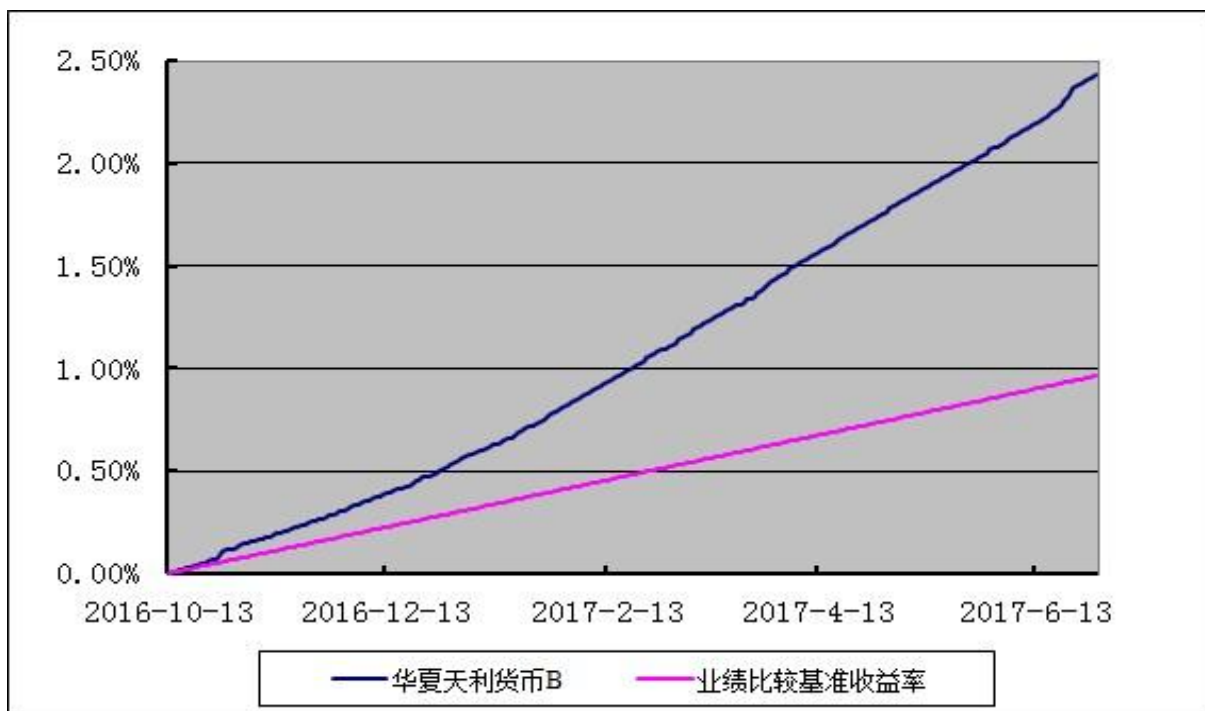
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 10 月 13 日至 2017 年 6 月 30 日)

华夏天利货币 A



华夏天利货币 B



注：①本基金合同于 2016 年 10 月 13 日生效。

②根据华夏天利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。

§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，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 6 月 30 日数据），华夏大盘精选混合在 137 只普通偏股型基金（A 类）中排名第 5；华夏消费升级混合 A 在 256 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 2；华夏回报混合 A 和华夏回

报二号混合分别在 172 只绝对收益目标基金（A 类）中排名第 2 和第 3；华夏全球股票(QDII)在 56 只 QDII 股票型基金（A 类）中排名第 3；华夏安康债券 C 在 126 只普通债券型基金（二级非 A 类）中排名第 9；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 3。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，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）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供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		
曲波	本基金的基金经理、董事总经理	2016-10-13	-	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合规守信情况的说明

报告期内，本基金 2 次出现投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计低于 5% 的情形，本基金管理人已就该情况与基金托管人沟通一致，并于发生日次日将上述比例调整至法律法规及基金合同规定的范围内，同时对相关工作制度、流程、技术支持手段等进行了改进优化。本基金管理人已将上述情况及处理方式向中国证券监督管理委员会北京监管局进行报告。

除此之外，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，美联储加息 2 次，美元上涨。国内方面，去杠杆进程加速推进，社会融资、M2 增速显著下行，CPI 走弱成为市场共识。为防范金融风险，监管态度有所收紧，银行负债扩张受限，SHIBOR 利率最高上行至 4.78%。央行在短端维持中性操作，资金面总体平稳。

市场方面，央行灵活操作，帮助市场平稳度过季末。受监管政策收紧的影响，3 个月 SHIBOR 利率由年初的 3.3% 左右升至 4.5% 以上；同业存单收益率抬升明显，3 个月 AAA 存单在 6 月底最高升至 5% 左右。

报告期内，本基金主要滚动投资于利率较高的同业存单和短期回购，维持了相对短的组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华夏天利货币 A 本报告期份额净值收益率为 1.7700%；华夏天利货币 B 本报告期份额净值收益率为 1.8920%。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，国际方面，美联储加息步伐放缓，美元走弱；欧洲、日本温和复苏；美元回流速度将放缓，人民币贬值压力减弱，外汇占款数据企稳。国内方面，社融数据走弱将影响经济增长，PPI 进入下行通道，经济基本面总体有利于债市。货币政策预计总体呈中性态势，但财政存款波动性加大，将成为资金面主要的扰动因素。

下半年，本基金将主要投资于安全度高和流动性好的同业存单，并匹配短期存款，在控制好流动性风险的前提下力争提高组合收益。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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。

4.7 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，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。

4.8 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,华夏天利货币市场基金 2 次出现投资现金、国债、中央银行票据、政策性金融债占基金资产净值的比例低于 5% 的情形,基金管理人均于发生日次日将上述比例调整至法律法规及基金合同规定的范围内。本托管人认为,除此以外,华夏基金管理有限公司在华夏天利货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：华夏天利货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	117,286,193.83	2,511,214,713.17
结算备付金		-	5,227,272.73
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	1,121,100,728.97	724,873,760.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,121,100,728.97	724,873,760.10
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	120,700,501.05	715,000,962.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,564,873.46	8,476,065.85
应收股利		-	-
应收申购款		30,039,976.11	742,720,300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,390,692,273.42	4,707,513,074.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	500,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		188,474.91	359,720.78
应付托管费		57,113.60	109,006.29
应付销售服务费		66,351.26	145,325.81
应付交易费用	6.4.7.7	26,854.93	16,076.51
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		147,785.53	722,784.01
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	75,066.86	59,210.00
负债合计		561,647.09	501,412,123.40
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,390,130,626.33	4,206,100,950.95
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,390,130,626.33	4,206,100,950.95
负债和所有者权益总计		1,390,692,273.42	4,707,513,074.35

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,390,130,626.33 份（其中 A 类 511,499,165.66 份，B 类 878,631,460.67 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏天利货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		27,257,173.26
1.利息收入		26,958,778.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,143,116.36
债券利息收入		9,141,437.31
资产支持证券利息收入		59,836.00
买入返售金融资产收入		2,614,388.44
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		298,395.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	298,395.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		3,989,259.97
1.管理人报酬		2,225,980.41
2.托管费		674,539.50
3.销售服务费		579,669.55
4.交易费用		-
5.利息支出		382,250.02
其中：卖出回购金融资产支出		382,250.02
6.其他费用	6.4.7.19	126,820.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,267,913.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,267,913.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏天利货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	4,206,100,950.95	-	4,206,100,950.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,267,913.29	23,267,913.29
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）	-2,815,970,324.62	-	-2,815,970,324.62
其中：1.基金申购款	5,633,659,729.19	-	5,633,659,729.19
2.基金赎回款	-8,449,630,053.81	-	-8,449,630,053.81
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）	-	-23,267,913.29	-23,267,913.29
五、期末所有者权益（基金净值）	1,390,130,626.33	-	1,390,130,626.33

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：汪贵华，会计机构负责人：汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏天利货币市场基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1195 号《关于准予华夏天利货币市场基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏天利货币市场基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 10 月 10 日至 2016 年 10 月 11 日共募集 4,806,819,820.14 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 0933 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏天利货币市场基金基金合同》于 2016 年 10 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,806,928,605.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 108,785.32 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏天利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括：1、现金。2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单。3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券。4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货

币市场工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	17,286,193.83
定期存款	100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
其他存款	-
合计	117,286,193.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	1,121,100,728.97	1,121,498,000.00	397,271.03	0.03
	合计	1,121,100,728.97	1,121,498,000.00	397,271.03	0.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售 金融资产	120,700,501.05	-
合计	120,700,501.05	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,106.85

应收定期存款利息	144,333.24
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,400,709.59
应收买入返售证券利息	18,723.78
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,564,873.46

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	26,854.93
合计	26,854.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	73,466.77
其他	1,600.09
合计	75,066.86

6.4.7.9 实收基金

华夏天利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,545,591,074.01	1,545,591,074.01
本期申购	1,233,333,444.73	1,233,333,444.73
本期赎回（以“-”号填列）	-2,267,425,353.08	-2,267,425,353.08
本期末	511,499,165.66	511,499,165.66

华夏天利货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,660,509,876.94	2,660,509,876.94
本期申购	4,400,326,284.46	4,400,326,284.46
本期赎回（以“-”号填列）	-6,182,204,700.73	-6,182,204,700.73
本期末	878,631,460.67	878,631,460.67

注：上述“本期申购”、“本期赎回”包含 A 级基金份额、B 级基金份额间升降级的基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

华夏天利货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	7,245,991.37	-	7,245,991.37
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-7,245,991.37	-	-7,245,991.37
本期末	-	-	-

华夏天利货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	16,021,921.92	-	16,021,921.92
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-16,021,921.92	-	-16,021,921.92
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	14,561,296.94
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	486,171.60

其他	-
合计	15,143,116.36

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,113,432,509.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,106,341,320.12
减：应收利息总额	6,792,793.93
买卖债券差价收入	298,395.15

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
银行费用	43,863.72

银行间账户维护费	18,000.00
其他费用	490.00
合计	126,820.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
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	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,225,980.41
其中：支付销售机构的客户维护费	356,951.29

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 0.33%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×0.33%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	674,539.50

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 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B	合计
华夏基金管理有限 公司	132,251.47	30,940.03	163,191.50
中国农业银行	315,443.60	10,392.38	325,835.98
中信证券	435.76	863.83	1,299.59
中信证券（山东）	71.35	-	71.35
中信期货	146.83	-	146.83
华夏财富	6,561.76	2,008.13	8,569.89

合计	454,910.77	44,204.37	499,115.14
----	------------	-----------	------------

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。

6.4.10.3 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 2017年1月1日至2017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
中国农业银行	29,779,240.55	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	17,286,193.83	95,647.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

华夏天利货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
7,447,219.68	-	-201,228.31	7,245,991.37	-

华夏天利货币 B

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
16,395,692.09	-	-373,770.17	16,021,921.92	-

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	合计
银行存款	117,286,193.83	-	-	117,286,193.83
结算备付金	-	-	-	-
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	1,121,100,728.97	-	-	1,121,100,728.97
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	120,700,501.05	-	-	120,700,501.05
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末	6个月以内	6个月-1年	1-5年	合计

2016 年 12 月 31 日				
银行存款	2,511,214,713.17	-	-	2,511,214,713.17
结算备付金	5,227,272.73	-	-	5,227,272.73
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	684,834,634.96	40,039,125.14	-	724,873,760.10
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融 资产	715,000,962.50	-	-	715,000,962.50
卖出回购金融 资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 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 1,121,100,728.97 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止，第一层次的余额为 0 元，第二层次的余额为 724,873,760.10 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.14.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	1,121,100,728.97	80.61
	其中：债券	1,121,100,728.97	80.61
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	120,700,501.05	8.68
	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	117,286,193.83	8.43
4	其他各项资产	31,604,849.57	2.27
5	合计	1,390,692,273.42	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	2.99	
	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%。

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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

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。

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	14.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	27.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	52.04	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.56	-
	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		97.77	-

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	49,918,917.30	3.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,007,263.18	2.16
	其中：政策性金融债	30,007,263.18	2.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,041,174,548.49	74.90
8	其他	-	-
9	合计	1,121,100,728.97	80.65
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	111707141	17 招商银行 CD141	1,200,000	118,777,100.29	8.54
2	111711209	17 平安银行 CD209	1,000,000	99,351,342.55	7.15
3	111710297	17 兴业银行 CD297	1,000,000	98,994,071.47	7.12
4	111720116	17 广发银行 CD116	800,000	79,209,531.72	5.70
5	111711240	17 平安银行 CD240	600,000	59,471,049.06	4.28
6	111608242	16 中信 CD242	500,000	49,797,295.25	3.58
7	111709196	17 浦发银行 CD196	500,000	49,690,268.10	3.57
8	111717126	17 光大银行 CD126	500,000	49,557,373.33	3.56

9	111715184	17 民生银行 CD184	500,000	49,498,138.55	3.56
10	111720125	17 广发银行 CD125	500,000	49,487,291.16	3.56

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	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.05%
报告期内偏离度的最低值	0.00%
报告期内每个交易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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

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。

7.9.2 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。

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	1,564,873.46
4	应收申购款	30,039,976.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,604,849.57

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
华夏天利货币 A	7,133	71,708.84	17,603,141.29	3.44%	493,896,024.37	96.56%
华夏天利货币 B	38	23,121,880.54	655,284,020.52	74.58%	223,347,440.15	25.42%
合计	7,171	193,854.50	672,887,161.81	48.40%	717,243,464.52	51.60%

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	华夏天利货币 A	1,123,721.24	0.22%
	华夏天利货币 B	5,450,712.04	0.62%
	合计	6,574,433.28	0.47%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	华夏天利货币 A	0~10
	华夏天利货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本	华夏天利货币 A	0~10

开放式基金	华夏天利货币 B	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏天利货币 A	华夏天利货币 B
基金合同生效日（2016 年 10 月 13 日）基金份额总额	2,366,079,922.05	2,440,848,683.41
本报告期期初基金份额总额	1,545,591,074.01	2,660,509,876.94
本报告期基金总申购份额	1,233,333,444.73	4,400,326,284.46
减：本报告期基金总赎回份额	2,267,425,353.08	6,182,204,700.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	511,499,165.66	878,631,460.67

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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

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未受到任何处

分。

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	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-

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除本表列示外，本基金还选择了安信证券、东吴证券、高华证券、光大证券、广发证券、国海证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、华西证券、西部证券、银河证券、长江证券、中投证券、中信建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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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
申万宏源证券	-	-	6,435,000,000.00	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%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于在直销机构及华夏财富调整旗下部分开放式基金申购、赎回等业务数量限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-16
2	华夏天利货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-23
3	华夏天利货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复后继续限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-23
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增天津国美基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-15
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-16
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京君德汇富投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-07
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-17
8	华夏天利货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复上述业务后继续限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-28
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中银国际证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-07
10	华夏天利货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复上述业务后继续限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-25
11	华夏天利货币市场基金暂停申购、转换转入业务及恢复上述业务后继续限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-23
12	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业	中国证监会指定报刊及	2017-06-03

	场所变更的公告	网站	
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富投资管理有限公司网上交易平台开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-16
14	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	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-27
15	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-29

§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

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《华夏天利货币市场基金基金合同》；

12.1.3 《华夏天利货币市场基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年八月二十六日