

华夏理财 30 天债券型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§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 2021 年 1 月 19 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。

华夏基金管理有限公司 2020 年 10 月 9 日发布《华夏基金管理有限公司关于修订华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同的公告》，根据监管机构关于规范理财债券基金业务的要求及相关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，对华夏理财 30 天债券型证券投资基金的基金合同按照开放式债券基金规则等进行了修订，修订内容自 2020 年 12 月 28 日起正式生效，本基金的投资范围、投资比例限制、风险收益特征、基金资产估值方法、收益分配、基金份额申购赎回价格、信息披露、自动升降级业务等相应调整。

本基金根据估值方法、投资范围等不同将报告期区分为 2020 年 12 月 28 日起至 2020 年 12 月 31 日止和 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 27 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	380,302,025.57 份	
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。主要投资策略包括资产配置策略、期限配置策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、其他衍生工具投资策略等。	
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，高于货币市场基金。	
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	368,970,834.23 份	11,331,191.34 份

注：根据监管机构关于规范理财债券基金业务的要求及相关规定，本基金管理人已对本基金基金合同按照开放式债券基金规则等进行了修订，修订内容自 2020 年 12 月 28 日起生效，本基金的投资范围、投资比例限制、风险收益特征、基金资产估值方法等相应调整。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 报告期：2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日

3.1.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 12 月 28 日-2020 年 12 月 31 日)	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
1.本期已实现收益	1,117,979.14	34,486.53
2.本期利润	1,812,769.36	55,774.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0049	0.0012
4.期末基金资产净值	370,778,630.52	11,386,966.22
5.期末基金份额净值	1.0049	1.0049

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。

3.1.2 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

华夏理财 30 天债券 A:

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
2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日	0.49%	0.20%	0.01%	0.00%	0.48%	0.20%

华夏理财 30 天债券 B:

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

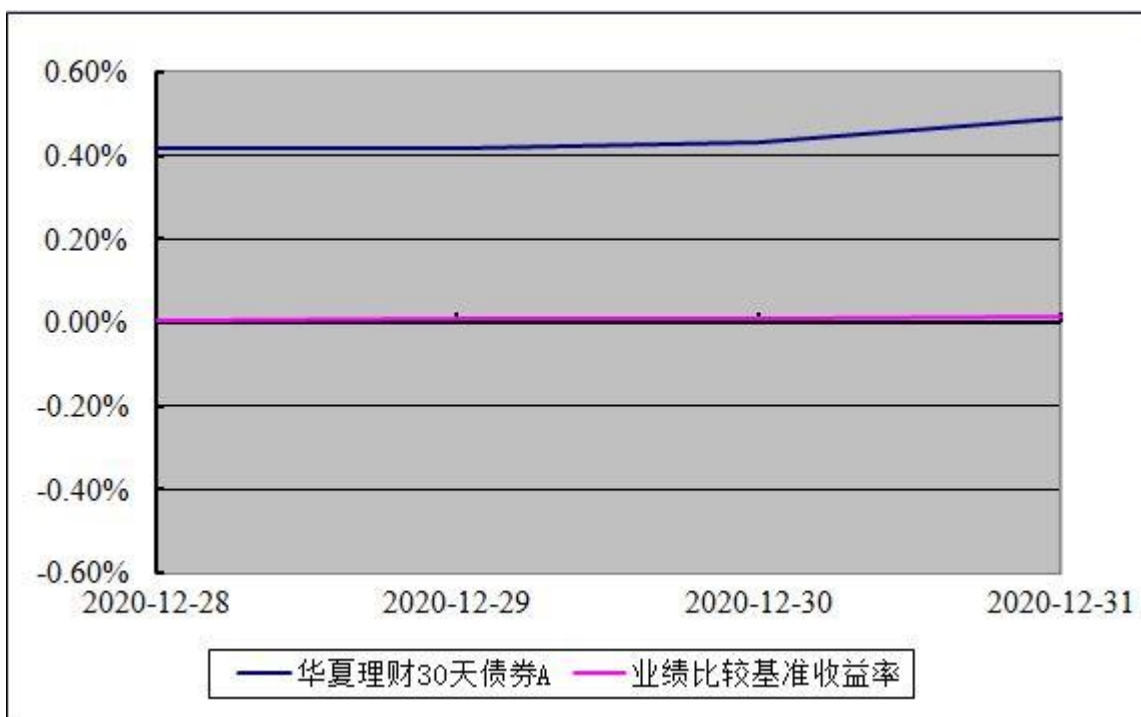
2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日	0.49%	0.20%	0.01%	0.00%	0.48%	0.20%
------------------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

3.1.3 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

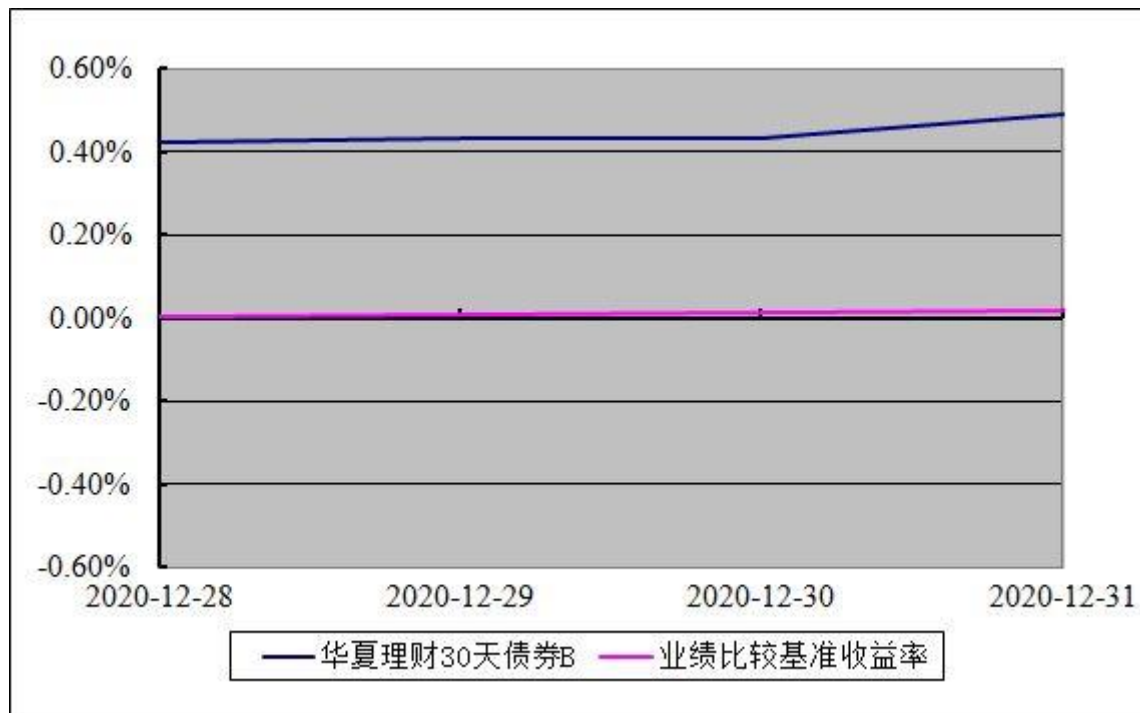
华夏理财 30 天债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日)

华夏理财 30 天债券 A



华夏理财 30 天债券 B



3.2 报告期：2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 27 日

3.2.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 27 日)	
	华夏理财 30 天债券 A	华夏理财 30 天债券 B
1.本期已实现收益	2,117,406.16	16,175,866.22
2.本期利润	2,117,406.16	16,175,866.22
3.期末基金资产净值	370,305,878.10	159,890,837.07

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。

3.2.2 基金净值表现

华夏理财 30 天债券 A:

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	0.5521%	0.0015%	0.3357%	0.0000%	0.2164%	0.0015%
过去六个月	1.0182%	0.0017%	0.6750%	0.0000%	0.3432%	0.0017%
过去一年	2.2516%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	0.9016%	0.0028%
过去三年	9.3402%	0.0037%	4.0500%	0.0000%	5.2902%	0.0037%
过去五年	17.1975%	0.0045%	6.7500%	0.0000%	10.4475%	0.0045%
自基金合同生效起至 2020 年 12 月 27 日	34.7326%	0.0055%	11.0398%	0.0000%	23.6928%	0.0055%

华夏理财 30 天债券 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	0.6120%	0.0015%	0.3357%	0.0000%	0.2763%	0.0015%
过去六个月	1.1393%	0.0017%	0.6750%	0.0000%	0.4643%	0.0017%
过去一年	2.4970%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.1470%	0.0028%
过去三年	10.1297%	0.0037%	4.0500%	0.0000%	6.0797%	0.0037%
过去五年	15.9920%	0.0050%	6.7500%	0.0000%	9.2420%	0.0050%
自基金合同生效起至 2020 年 12 月 27 日	33.2308%	0.0062%	11.0398%	0.0000%	22.1910%	0.0062%

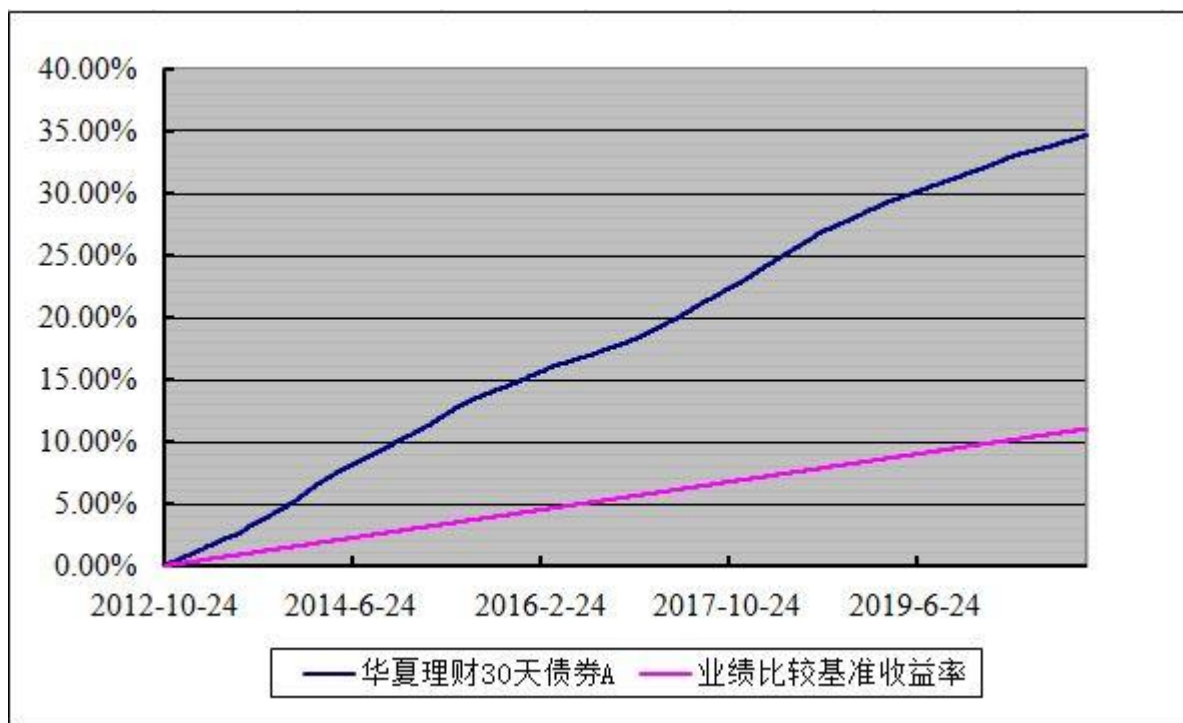
3.2.3 基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财 30 天债券型证券投资基金

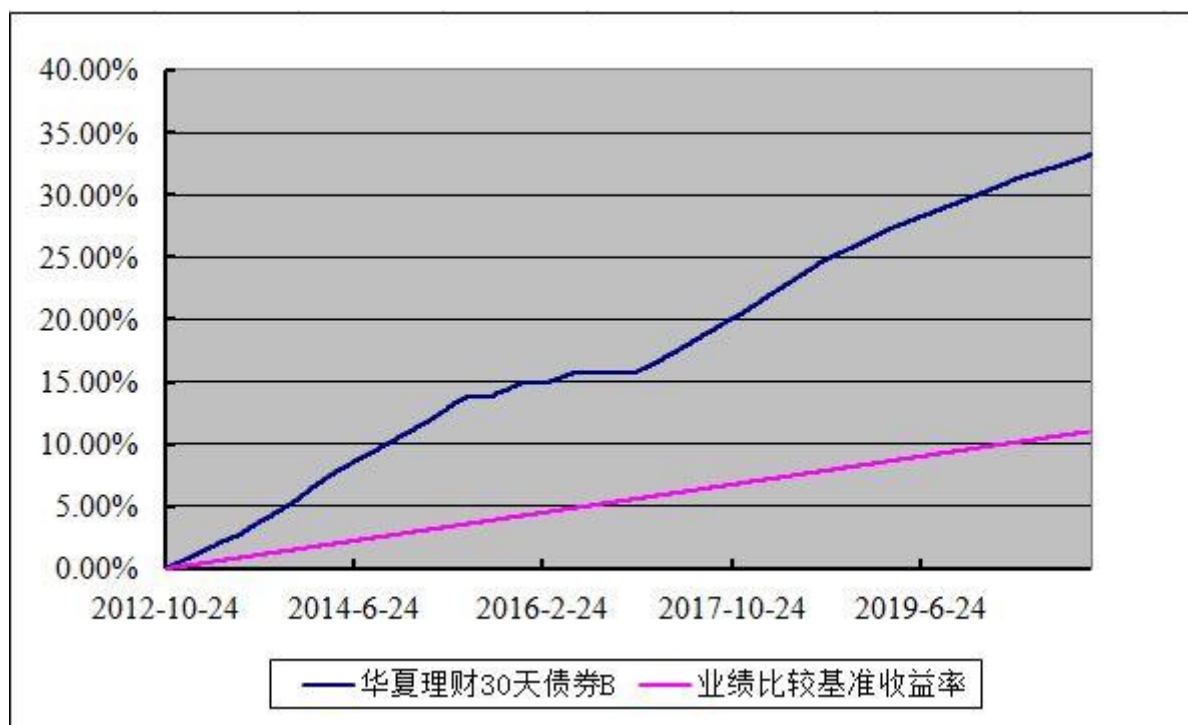
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 10 月 24 日至 2020 年 12 月 27 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		
周飞	本基金的基金经理、现金管理部高级副总裁	2016-10-20	-	10 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合规守信情况的说明

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

4 季度，新冠病毒在全球各地的肆虐并未有明显的缓解，继续影响各国的经济数据和金融市场。在资金推动及美国大选的影响下，美股继续震荡反弹，A 股市场在 3200 到 3400 点区间震荡。

国内方面，货币政策保持稳健，流动性处于均衡状态，但 12 月债券市场爆发黑天鹅事件，地方国企永煤的违约引爆信用市场，信任危机加剧，流动性分层严重，资金面出现大幅波动。央行为维持市场的平稳，提前投放公开市场稳定信心，资金面重回宽松态势，但信用市场的信心还需要相当长的时间来重塑。报告期内，央行运用逆回购和中期借贷便利（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，资金面总体处于平稳态势，但是波动率较大。

市场方面，资金利率整体看先上后下，受永煤事件影响 11 月底-12 月初波动较大，过剩产能信用债收益率整体上行 100BPs 左右且流动性较差。存款存单利率受资金面影响及永煤事件的波及，也经历了过山车行情，存款存单利率 10-11 月收益率持续上行，央行投放 MLF 后，收益触顶下行。资金利率方面，10-11 月隔夜利率围绕 2% 上下波动，7 天回购利率在 2.5% 左右位置，均值都有所上行，12 月隔夜资金下行至 1.0%-1.5% 水平，7 天下行至 2.0%-2.3% 附近；存款存单方面，先上后下收益走平，3 个月 AAA 存单从 2.7% 上行至 3.2% 后又下行至 2.7% 附近，6 个月 AAA 存单从 2.85% 上行至 3.3% 后又下行至 2.8% 附近，1 年 AAA 存单从 3.05% 上行至 3.35% 后下行至 3% 左右。

报告期内，本基金主要投资于质押式逆回购，6 个月以内的同业存款、高等级同业存单，择机提高了利率债比例和组合久期。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

2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 27 日，华夏理财 30 天债券 A 本报告期份额净值收益率为 0.5521%；华夏理财 30 天债券 B 本报告期份额净值收益率为 0.6120%。同期业绩比较基准收益率为 0.3357%。本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日，华夏理财 30 天债券 A 本报告期份额净值增长率为 0.49%；华夏理财 30 天债券 B 本报告期份额净值增长率为 0.49%。同期业绩比较基准收益率为 0.01%。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：2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日

5.1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	468,745,000.00	91.40
	其中：债券	468,745,000.00	91.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,651,087.36	7.15
8	其他各项资产	7,427,869.37	1.45
9	合计	512,823,956.73	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	118,536,000.00	31.02

2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,054,000.00	15.71
	其中：政策性金融债	60,054,000.00	15.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,929,000.00	39.23
6	中期票据	101,082,000.00	26.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	39,144,000.00	10.24
9	其他	-	-
10	合计	468,745,000.00	122.65

5.1.5 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	209954	20 贴现国债 54	1,200,000.00	118,536,000.00	31.02
2	160206	16 国开 06	600,000.00	60,054,000.00	15.71
3	101800526	18 中金集 MTN001BC	300,000.00	30,381,000.00	7.95
4	101652021	16 中油股 MTN001	300,000.00	30,213,000.00	7.91
5	012003646	20 中国航油 SCP003	300,000.00	30,045,000.00	7.86

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 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。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,943.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,806,728.17
5	应收申购款	1,618,197.88
6	其他应收款	
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,427,869.37

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.11.6 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。

5.2 报告期：2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 27 日

5.2.1 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	518,006,572.63	78.90
	其中：债券	518,006,572.63	78.90
	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	37,603,010.22	5.73
4	其他资产	100,962,093.73	15.38
5	合计	656,571,676.58	100.00

5.2.2 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	12.45	
	其中：买断式回购融资	-	
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	124,928,617.54	23.56
	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。

5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

5.2.3.1 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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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。

5.2.3.2 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	25.02	23.56
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	26.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	3.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	13.19	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	54.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		122.72	23.56

5.2.4 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。

5.2.5 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	118,658,094.02	22.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,950,832.64	20.74
	其中：政策性金融债	109,950,832.64	20.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,320,427.40	28.16
6	中期票据	100,490,970.87	18.95
7	同业存单	39,586,247.70	7.47
8	其他	-	-
9	合计	518,006,572.63	97.70
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.2.6 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	209954	20 贴现国债 54	1,200,000.00	118,658,094.02	22.38
2	160206	16 国开 06	1,100,000.00	109,950,832.64	20.74
3	101800526	18 中金集 MTN001	300,000.00	30,205,724.45	5.70
4	101652021	16 中油股 MTN001	300,000.00	30,041,597.35	5.67
5	012003255	20 中电投 SCP023	300,000.00	29,964,536.49	5.65
6	012003646	20 中国航油 SCP003	300,000.00	29,913,223.83	5.64
7	042000262	20 电网 CP005	300,000.00	29,750,125.42	5.61
8	101800522	18 苏交通 MTN001	200,000.00	20,126,395.31	3.80
9	101800422	18 汇金 MTN004	200,000.00	20,117,253.76	3.79
10	012003007	20 深圳地铁 SCP007	200,000.00	19,963,552.31	3.77

5.2.7“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	5 次
报告期内偏离度的最高值	0.30%
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	0.08%

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。

5.2.8 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。

5.2.9 投资组合报告附注

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,943.32
2	应收证券清算款	95,040,083.98
3	应收利息	5,919,066.43
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	100,962,093.73

5.2.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

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

项目	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	427,618,249.00	6,519,413,556.82
报告期期间基金总申购份额	4,747,619.26	9,721,291.13
减：报告期期间基金总赎回份额	63,395,034.03	6,517,803,656.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末（12月31日）基金份额总额	368,970,834.23	11,331,191.34

§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 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

2020 年 10 月 9 日发布华夏基金管理有限公司关于修订华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同的公告。

2020 年 10 月 9 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏理财 30 天债券型证券投资基金暂停申购业务的公告。

2020 年 11 月 26 日发布华夏理财 30 天债券型证券投资基金在直销柜台开放转换转出业务的公告。

2020 年 12 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于修订华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同的第一次提示性公告。

2020 年 12 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于修订华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同的第二次提示性公告。

2020 年 12 月 25 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏理财 30 天债券型证券投资基金恢复申购业务的公告。

2020 年 12 月 29 日发布华夏基金管理有限公司关于限制华夏理财 30 天债券型证券投资基金申购业务的公告。

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、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，首批商品期货 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、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏上证科创板 50 成份 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏中证浙江国资创新发展 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏恒生互联网科技业 ETF (QDII)、华夏野村日经 225ETF、华夏纳斯达克 100ETF (QDII)、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指

数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品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《中国基金业绩评价报告》，2020 年，华夏基金旗下主要产品在基金分类排名中（数据截至 2020 年 12 月 31 日），华夏创新前沿股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 21/201；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 3/10；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/34 和 2/34；华夏新兴消费混合在“混合基金-行业偏股型基金-消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）”中排序 1/18；华夏稳盛混合、华夏高端制造混合和华夏军工安全混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中分别排序 23/481、26/481 和 33/481；华夏消费升级混合 C 在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（非 A 类）”中排序 12/215；华夏聚利债券（A）、华夏双债债券（A 类）及华夏债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中分别排序 1/184、3/184 和 5/184；华夏鼎利债券（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 5/238；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 5/334；华夏可转债增强债券（A 类）在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 3/34；华夏鼎通债券在“债券基金-纯债债券型基金-长期纯债债券型基金（A 类）”中排序 31/499；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数（C 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（非 A 类）”中排序 8/21；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 1/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/33 和 4/33；华夏能源革新股票在“股票基金-行业股票型基金-其他行业股票型基金”中排序 2/36；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/52；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/16 和 3/16；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 14/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 2/18。

在客户服务方面，4 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）华夏基金直销上线美元支付方式，为投资者使用美元交易提供便利；（2）根据客户需求，华夏基金管家客户端陆续上线双周定投、日定投功能，丰富了投资者定期定额交易的投资形式；（3）与华融融达等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“少年的你”、“牙掉了之后”、“2020 新鲜事”等活动，为客户提供了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

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏理财 30 天债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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

二〇二一年一月二十一日