华夏理财 30 天债券型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：二〇二一年七月二十日

§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 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 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	336,032,454.41 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	324,701,263.07 份	11,331,191.34 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 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	2,685,722.90	95,809.27
2.本期利润	1,933,714.13	70,968.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0063
4.期末基金资产净值	329,797,570.14	11,522,635.18
5.期末基金份额净值	1.0157	1.0169

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

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.56%	0.01%	0.34%	0.00%	0.22%	0.01%
过去六个月	1.07%	0.02%	0.67%	0.00%	0.40%	0.02%
自 2020 年 12 月 28 日起至今	1.57%	0.04%	0.69%	0.00%	0.88%	0.04%

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
过去三个月	0.62%	0.01%	0.34%	0.00%	0.28%	0.01%
过去六个月	1.19%	0.02%	0.67%	0.00%	0.52%	0.02%
自 2020 年 12 月 28 日起至今	1.69%	0.04%	0.69%	0.00%	1.00%	0.04%

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。基于此，自 2020 年 12 月 28 日起本基金净值表现使用净值增长率计算与列示。自本基金基金合同生效日起至 2020

年 12 月 27 日止，本基金净值表现使用净值收益率计算与列示，该期间本基金 A 类基金份额净值收益率为 34.7326%，B 类基金份额净值收益率为 33.2308%，同期业绩比较基准收益率为 11.0398%。

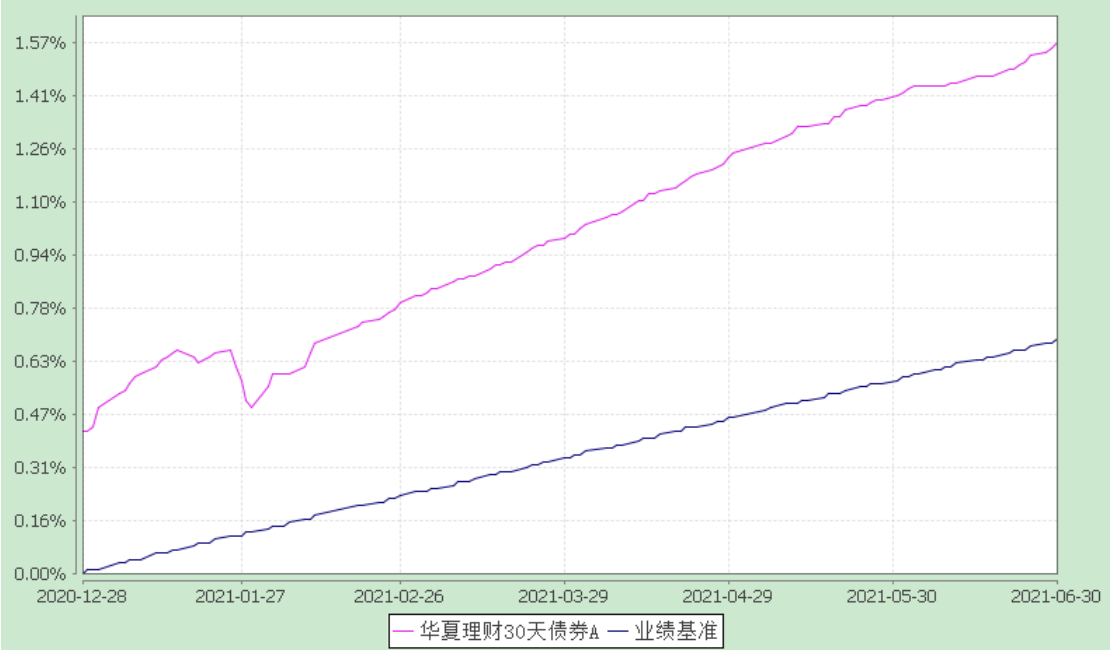
3.2.2自2020年12月28日以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财 30 天债券型证券投资基金

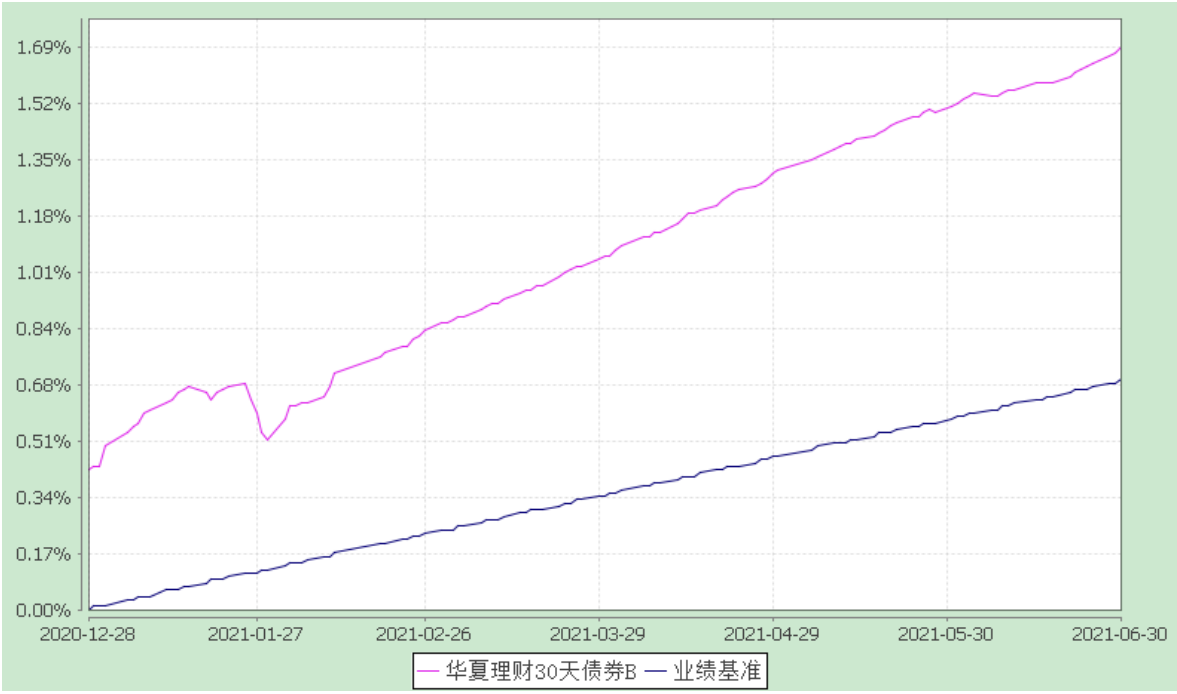
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 12 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日)

华夏理财30天债券A：



华夏理财30天债券B：



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。基于此，自 2020 年 12 月 28 日起本基金净值表现使用净值增长率计算与列示。自本基金基金合同生效日起至 2020 年 12 月 27 日止，本基金净值表现使用净值收益率计算与列示，该期间本基金 A 类基金份额净值收益率为 34.7326%，B 类基金份额净值收益率为 33.2308%，同期业绩比较基准收益率为 11.0398%。

§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	2016-10-20	-	11 年	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。

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

2 季度，新冠肺炎病毒在印度二次暴发并愈演愈烈，变异毒株逐渐向各国传导，国内广东疫情也有所起伏，美国也未有明显的好转，进而继续影响各国的经济数据和金融市场。拜登继续通过撒钱的方式来维护资本市场平稳和社会的安定，美股继续延续震荡反弹的格局，A 股市场震荡上行至 3600 点附近。

国内方面，货币政策维持稳健，流动性合理充裕，整个 2 季度资金面未有明显波澜，整体处于稳健偏宽松的态势。报告期间，央行通过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。

市场方面，资金利率、存单利率处于区间震荡走势，资金利率的波动有所增加，均值有所抬升，但存单存款的利率并未有明显的上行，利差有所收窄。资金利率方面，隔夜利率均值在 2%附近，7 天回购利率在 2.25%左右位置；存款存单利率，3 个月 AAA 存单一直在 2.4%-2.55%之间窄幅震荡，6 个月 AAA 存单在 2.55%-2.7%之间窄幅震荡，整体看利率水平变化不大。

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

截至 2021 年 6 月 30 日，华夏理财 30 天债券 A 基金份额净值为 1.0157 元，本报告期份额净值增长率为 0.56%；华夏理财 30 天债券 B 基金份额净值为 1.0169 元，本报告期份额净值增长率

为 0.62%，同期业绩比较基准增长率为 0.34%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	419,995,000.00	98.00
	其中：债券	419,995,000.00	98.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,639,326.00	0.85
7	其他各项资产	4,919,409.39	1.15
8	合计	428,553,735.39	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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。

5.4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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,060,000.00	14.67
	其中：政策性金融债	50,060,000.00	14.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	190,436,000.00	55.79
6	中期票据	120,993,000.00	35.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	58,506,000.00	17.14
9	其他	-	-
10	合计	419,995,000.00	123.05

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	210301	21 进出 01	500,000	50,060,000.00	14.67
2	112117076	21 光大银行 CD076	500,000	48,570,000.00	14.23
3	101801278	18 光明 MTN005	300,000	30,294,000.00	8.88
4	101800849	18 汇金 MTN010	300,000	30,249,000.00	8.86
5	012100667	21 中化工 SCP004	300,000	30,102,000.00	8.82

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,897,003.96
5	应收申购款	22,405.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,919,409.39

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

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	354,452,211.31	11,331,191.34
报告期期间基金总申购份额	12,633,767.14	-
减：报告期期间基金总赎回份额	42,384,715.38	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	324,701,263.07	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报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2021 年 4 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 4 月 9 日发布华夏基金管理有限公司公告。

2021 年 5 月 25 日发布华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告。

2021 年 6 月 4 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 6 月 17 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 6 月 18 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 6 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

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，目前旗下管理上证 50ETF（510050）、300ETF 基金（510330）、MSCIA 股 ETF（512990）、500ETF 基金（512500）、中小 100（159902）、双创基金(159783)、创业板 HX（159957）、科创 50ETF（588000）、中证 1000（159845）、央企改革 ETF（512950）、四川国改（159962）、浙江国资 ETF（515760）、战略新兴 ETF（512770）、5GETF（515050）、人工智能 AIETF（515070）、芯片 ETF（159995）、新能源车 ETF（515030）、智能车(159888)、高端装备 ETF(516320)、大湾区（159983）、沪港深 ETF(517170)、消费 ETF 基金（510630）、金融地产 ETF（510650）、医药卫生 ETF（510660）、食品饮料 ETF（515170）、券商 ETF 基金（515010）、银行 ETF 华夏（515020）、房地产 ETF 基金（515060）、大数据 50ETF（516000）、生物科技 ETF（516500）、新能源 80ETF（516850）、游戏 ETF（159869）、有色 50ETF(516650)、创蓝筹（159966）、创成长（159967）、恒生 ETF（513660）、恒生 ETF（159920）、恒生科技指数 ETF(513180)、恒生互联网 ETF（513330）、H 股 50（159850）、日经 ETF（513520）、纳斯达克 ETF（513300）、中期信用 ETF（511280）、豆粕 ETF（159985）、黄金 ETF9999（518850），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》，截至 2021 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏新时代混合（QDII）排序第 1/36、华夏移动互联混合（QDII）排序第 4/36；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票排序第 2/36；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合(A 类)排序第 2/21；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 37/226；在绝对收益目标基金（A 类）中华夏回报混合(A 类)排序第 25/139、华夏回报二号混合排序第 27/139；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%60%）（A 类）中华夏军工安全混合排序第 39/491；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 15/491、华夏稳盛混合排序第 54/491；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 9/566、华夏行业龙头混合排序第 36/566；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 11/128；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 11/168、华夏兴华混合(A 类)排序第 32/168、华夏大盘精选混合(A 类)排序第 40/168；在偏债型基金（A 类）中华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 44/149。FOF 类产品中，在养老目标风险 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏稳健养老一年持有混合（FOF）排序第 4/20；在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）(A 类)排序第 10/36；

固收与固收+产品：在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 1/196、华夏双债债券(A 类)排序第 3/196、华夏债券(A/B 类)排序第 12/196；在可转换债券型基金（A 类）中华夏可转债增强债券(A 类)排序第 3/34；在定期开放式纯债债券型基金（摊余成本法）（A 类）中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/73；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 12/53；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 18/149；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏安康债券(A 类)排序第 40/248、华夏鼎利债券(A 类)排序第 41/248。在 QDII 债券型基金（非 A 类）中华夏收益债券（QDII）(A 类)(美元)排序第 2/35、华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)（美元）排序第 4/35；

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/22、华夏创蓝筹 ETF 排序第 6/22；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/90、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 排序第 26/90；在行业指数股票 ETF 基金中华夏消费 ETF 排序第 4/39、华夏医药 ETF 排序第 5/39；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强(A 类)排序第 6/93；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/88、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/88、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 11/88。

在客户服务方面，2 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）华夏基金直销上线邮储银行卡直连支付方式，进一步拓展了支付渠道；（2）管家

客户端上线理财小管家和微信登录功能，方便客户及时了解市场观点、投资者教育等信息,也为客户提供了多样的登录方式；（3）与众惠基金等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“我是真的追不上”、“风往哪吹”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

二〇二一年七月二十日