

# 亚债中国债券指数基金

## 2017年第3季度报告

2017年9月30日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十五日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 23 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
| 基金简称            | 华夏亚债中国指数  |                |
| 基金主代码           | 001021  |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式  |                |
| 基金合同生效日         | 2011 年 5 月 25 日   |                |
| 报告期末基金份额总额      | 4,187,747,806.81 份  |                |
| 投资目标            | 本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。  |                |
| 投资策略            | 本基金为被动管理基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。 |                |
| 业绩比较基准          | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为 Markit 指数公司（Markit Indices Limited）编制并发布的 iBoxx®亚债中国指数。  |                |
| 风险收益特征          | 本基金属于债券基金，风险与收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于政府债券，风险和收益低于投资范围包括股票、可转换公司债及普通企业债的债券基金。   |                |
| 基金管理人           | 华夏基金管理有限公司  |                |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 华夏亚债中国指数 A  | 华夏亚债中国指数 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 001021  | 001023         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,178,671,426.97 份  | 9,076,379.84 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<br>(2017 年 7 月 1 日-2017 年 9 月 30 日) |              |
|-----------------|---|--------------|
|                 | 华夏亚债中国指数 A                              | 华夏亚债中国指数 C   |
| 1. 本期已实现收益      | 38,856,602.74                           | 73,576.39    |
| 2. 本期利润         | 7,577,871.44                            | 1,614.54     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0018                                  | 0.0002       |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,710,218,195.74                        | 9,990,937.83 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.127                                   | 1.101        |

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

华夏亚债中国指数A:

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.18%      | 0.09%         | 0.03%          | 0.09%                 | 0.15% | 0.00% |

华夏亚债中国指数C:

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.09%      | 0.07%         | 0.03%          | 0.09%                 | 0.06% | -0.02% |

##### 3.2.2 自基金合同生效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

亚债中国债券指数基金

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

(2011 年 5 月 25 日至 2017 年 9 月 30 日)

华夏亚债中国指数A:



华夏亚债中国指数C:



## §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 |      |   |
|-----|------------------|------------|------|------|---|
| 柳万军 | 本基金的基金经理、固定收益部总监 | 2015-07-16 | -    | 10 年 | 中国人民银行研究生部金融学硕士。曾任中国人民银行上海总部副主任科员、泰康资产固定收益部投资经理、交银施罗德基金固定收益部基金经理助理等。2013 年 6 月加入华夏基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员等。 |

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》、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 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

2017 年 3 季度，国际方面，美元指数继续下探，美债收益率有所下行。欧元区 PMI 维持在相对高位，经济走势好于预期，欧元继续上涨。大宗商品方面，原油价格震荡上行，黑色系商品涨幅较大。国内方面，经济走势仍处于平稳区间，通胀压力依然不大，长端债券收益率维持区间窄幅震荡，银行间和交易所回购利率中枢继续上行，中短端债券收益率上行明显，收益率曲线平

坦化。

报告期内，本基金保持了与指数接近的久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 9 月 30 日，华夏亚债中国指数 A 基金份额净值为 1.127 元，本报告期份额净值增长率为 0.18%；华夏亚债中国指数 C 基金份额净值为 1.101 元，本报告期份额净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准增长率为 0.03%。

#### 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            | 4,642,681,326.20 | 98.34        |
|    | 其中：债券             | 4,642,681,326.20 | 98.34        |
|    | 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          | 8,000,000.00     | 0.17         |
|    | 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      | 5,698,308.33     | 0.12         |
| 7  | 其他各项资产            | 64,683,629.08    | 1.37         |
| 8  | 合计                | 4,721,063,263.61 | 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 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      | 3,232,819,326.20 | 68.49        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,409,862,000.00 | 29.87        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,409,862,000.00 | 29.87        |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,642,681,326.20 | 98.36        |

### 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  | 160007 | 16 付息国债 07 | 2,900,000 | 280,459,000.00 | 5.94         |
| 2  | 160006 | 16 付息国债 06 | 1,600,000 | 153,056,000.00 | 3.24         |
| 3  | 160210 | 16 国开 10   | 1,600,000 | 146,688,000.00 | 3.11         |
| 4  | 120004 | 12 付息国债 04 | 1,400,000 | 139,482,000.00 | 2.95         |
| 5  | 160405 | 16 农发 05   | 1,400,000 | 130,382,000.00 | 2.76         |

### 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 | 9,863.01      |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 64,661,852.24 |
| 5  | 应收申购款   | 11,913.83     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 64,683,629.08 |

## 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           | 华夏亚债中国指数A        | 华夏亚债中国指数C    |
|--------------|------------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,180,729,953.97 | 8,348,058.52 |
| 报告期基金总申购份额   | 1,624,389.19     | 2,514,610.41 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 3,682,916.19     | 1,786,289.09 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -                | -            |
| 本报告期末基金份额总额  | 4,178,671,426.97 | 9,076,379.84 |

## §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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                            |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|-------|----------------|----------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间     | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机     | 1              | 2017-07-01 至<br>2017-09-30 | 3,973,992,791.56 | -    | -    | 3,973,992,791.56 | 94.90% |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 构  |  |  |  |  |  |  |  |
| 产品特有风险   |  |  |  |  |  |  |  |
| <p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于 5000 万元，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |  |  |  |  |  |  |  |

## 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

2017 年 7 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于修订亚债中国债券指数基金基金合同的公告。

2017 年 7 月 20 日发布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。

2017 年 8 月 1 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在华泰证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2017 年 8 月 1 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017 年 9 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017 年 9 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增世纪证券有限责任公司为代销机构的公告。

2017 年 9 月 29 日发布华夏基金管理有限公司公告。

### 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，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 9 月 29 日数据），华夏消费升级混合 A 在 255 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 8；华夏回报混合 A 和华夏回报二号混合分别在 171 只绝对收益目标基金

（A 类）中排名第 3 和第 5；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 5；华夏理财 30 天债券 A 在 39 只短期理财债券型基金（A 类）中排名第 8；华夏全球股票（QDII）在 56 只 QDII 股票型基金（A 类）中排名第 3；华夏收益债券（QDII）A 及华夏大中华信用债券（QDII）A 分别在 15 只 QDII 债券型基金（A 类）中排名第 1 和第 4。

在客户服务方面，3 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）升级华夏基金官网、与支付宝合作上线华夏基金财富号，为客户提供更便捷的基金投资和理财交流平台；（2）升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个渠道的在线客服系统，有效提升客户的服务满意度；（3）与星展银行、民生证券等代销机构合作，提供更多理财渠道，进一步提升客户体验；（4）开展“一门两世界，温差 20 度”、“华夏回报累计分红 78 次”、“火热报北马，一触‘基’发”等多项活动，为客户提供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

9.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2 《亚债中国债券指数基金基金合同》；

9.1.3 《亚债中国债券指数基金托管协议》；

9.1.4 法律意见书；

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6 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

二〇一七年十月二十五日