

华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年四月二十一日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏睿磐泰荣混合	
基金主代码	005140	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日	
报告期末基金份额总额	626,806,427.21 份	
投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。	
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。	
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
下属分级基金的交易代码	005140	005141
报告期末下属分级基金的份额总额	575,858,143.00 份	50,948,284.21 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 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)	
	华夏睿磐泰荣混合 A	华夏睿磐泰荣混合 C
1.本期已实现收益	13,116,839.52	1,079,253.40
2.本期利润	4,544,210.36	517,714.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0112
4.期末基金资产净值	714,707,872.14	62,580,576.06
5.期末基金份额净值	1.2411	1.2283

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

华夏睿磐泰荣混合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	0.81%	0.36%	0.17%	0.30%	0.64%	0.06%
过去六个月	5.38%	0.31%	2.66%	0.26%	2.72%	0.05%
过去一年	10.34%	0.34%	8.18%	0.26%	2.16%	0.08%
过去三年	29.94%	0.32%	16.68%	0.27%	13.26%	0.05%
自基金合同 生效起至今	29.94%	0.31%	17.13%	0.27%	12.81%	0.04%

华夏睿磐泰荣混合C：

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	0.74%	0.36%	0.17%	0.30%	0.57%	0.06%
过去六个月	5.21%	0.31%	2.66%	0.26%	2.55%	0.05%
过去一年	10.01%	0.34%	8.18%	0.26%	1.83%	0.08%
过去三年	28.78%	0.32%	16.68%	0.27%	12.10%	0.05%
自基金合同	28.65%	0.31%	17.13%	0.27%	11.52%	0.04%

生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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

华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金

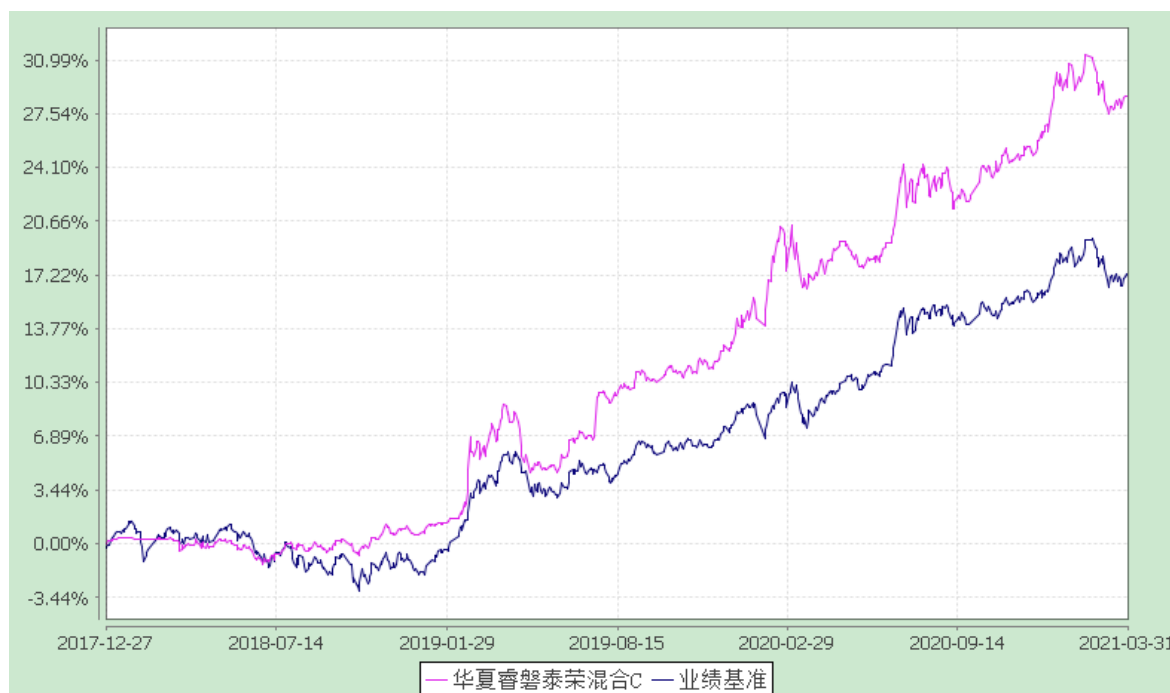
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 12 月 27 日至 2021 年 3 月 31 日)

华夏睿磐泰荣混合A:



华夏睿磐泰荣混合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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2017-12-27	-	21 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间）等。
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总	2018-01-08	-	19 年	北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员等。2003 年 8 月加入原中信基金，曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员，华夏新锦略灵活配置混合型证券投资基金基金经理

	裁				<p>(2017 年 9 月 8 日至 2018 年 5 月 22 日期间)、华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理 (2017 年 1 月 18 日至 2018 年 7 月 16 日期间)、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 8 日至 2018 年 9 月 10 日期间)、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 10 月 13 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏圆和灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 10 月 17 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (2017 年 10 月 18 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2016 年 8 月 24 日至 2018 年 12 月 17 日期间)、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理 (2013 年 5 月 13 日至 2019 年 1 月 14 日期间)、华夏磐泰混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理 (2018 年 7 月 17 日至 2019 年 1 月 14 日期间)、华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 8 日至 2019 年 5 月 7 日期间) 等。</p>
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2018-04-10	-	11 年	<p>中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员，华夏新锦图灵活配置混合型证券</p>

					投资基金基金经理(2017年3月24日至2018年9月10日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2018年4月10日至2019年2月26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

1 季度世界加快新冠疫苗接种，全球新增病例见顶回落，美国总统更替完成，各国政府继续推进财政刺激政策，欧美经济数据均表现良好。国内政策应对逆周期，在外需持续强劲下，投资和财政政策均有所弱化。基建持续回落，与财政支出节奏、降低政府杠杆率的目标等匹配。由于疫情复发，就地过年，消费出现了阶段性的走弱，后续还需继续观察趋势。央行在春节前采用公开市场操作进行跨节资金投放，提高了资金市场利率的波动性，但 3 月份回归正常节奏。通胀方面，CPI 主要是受春节错位以及节前国内疫情防控再次收紧的临时性影响，同比为负。PPI 同比

快速上升至+1.7%，结构上，各行业呈普涨状态，工业品通胀风险值得密切关注。

市场方面，疫苗加快接种后，经济数据向好叠加市场预期大幅改善，在短暂的股市暴涨之后，金融条件有所收紧。影响市场的三大因素，经济活动、金融条件和估值水平，呈现此消彼长的现象，并对高估值交易拥挤的基金重仓股形成了打击。1 季度债券市场从前期的下跌趋势转变为震荡格局，1 月资金主导债市波动，上旬受去年永煤事件影响，资金延续宽松，曲线陡峭化下探；下旬随着公开市场回笼，资金波动率骤升，收益率曲线大幅平坦化上行。2 月春节期间海外商品快速大幅走高，带动通胀预期提升，长端上行。3 月市场受低融资成本、供给担忧缓解等因素影响，窄幅下行。目前看，市场整体仍处于震荡格局。中美启动高级别会谈后，市场有部分人士担心从前期的中美对抗转变为“八国联军”。但考虑到历史上除了 2018 年 Trump 咄咄逼人的对抗导致下跌幅度超预期，今年疫情尚未完全走出，对抗可能达到的强度应该弱于 2018 年，但投资经理会密切关注这一边际变化。只要不重现 2018 年的对抗强度，一般认为，政治、军事、自然灾害、短期的供给冲击对市场的影响都比较短暂和轻微。可转债跟随权益市场波动，今年以来股票市场风格轮动迅速，转债同样风格转换剧烈，转债市场整体估值在经历这波调整后处于历史中位略偏低水平。权益市场 1 季度以来呈现先涨后跌的态势，1 月份市场整体表现为上涨行情，2 月份以来，受到美债利率上行产生流动性收缩的担忧，市场整体表现出下跌态势。分板块来看，去年表现较为优异的创业板今年表现较为一般，而去年表现一般的中证 500、上证 50 等板块今年以来表现相对强势。

报告期内，本基金在股票端投资以板块配置和策略动能策略为主进行投资管理，以期更好地捕获市场收益机会，权益端更好地获取收益，在仓位管理方面基于宏观中观与微观因子的耦合信号，进行组合的仓位管理，力争为客户实现稳健型的收益回报，同时积极使用股指期货进行降低组合波动率，并控制组合的回撤水平；债券端增持了债券，并清仓可转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 3 月 31 日，华夏睿磐泰荣混合 A 基金份额净值为 1.2411 元，本报告期份额净值增长率为 0.81%；华夏睿磐泰荣混合 C 基金份额净值为 1.2283 元，本报告期份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准增长率为 0.17%。

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	130,949,494.81	16.81
	其中：股票	130,949,494.81	16.81
2	固定收益投资	539,157,470.50	69.22
	其中：债券	539,157,470.50	69.22
	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	71,200,000.00	9.14
	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	28,073,632.07	3.60
7	其他各项资产	9,560,540.74	1.23
8	合计	778,941,138.12	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,044,513.26	0.13
B	采矿业	1,341,474.00	0.17
C	制造业	94,434,355.42	12.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,892.12	0.01
E	建筑业	1,286,346.00	0.17
F	批发和零售业	93,162.78	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	630,417.88	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,223,089.87	0.80
J	金融业	19,623,845.90	2.52
K	房地产业	1,319,987.30	0.17
L	租赁和商务服务业	2,263,632.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	1,132,124.60	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	82,331.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	166,203.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,035,759.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	174,360.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	130,949,494.81	16.85

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	50,600	3,982,220.00	0.51
2	600519	贵州茅台	1,900	3,817,100.00	0.49
3	002271	东方雨虹	66,400	3,397,024.00	0.44
4	300415	伊之密	151,900	3,039,519.00	0.39
5	002987	京北方	60,100	2,952,112.00	0.38
6	002484	江海股份	202,200	2,942,010.00	0.38
7	603811	诚意药业	114,100	2,907,268.00	0.37
8	002799	环球印务	136,000	2,815,200.00	0.36
9	300499	高澜股份	304,300	2,790,431.00	0.36
10	300582	英飞特	145,100	2,768,508.00	0.36

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	108,323,170.50	13.94
	其中：政策性金融债	98,312,170.50	12.65
4	企业债券	167,598,300.00	21.56

5	企业短期融资券	25,085,000.00	3.23
6	中期票据	120,662,000.00	15.52
7	可转债（可交换债）	612,000.00	0.08
8	同业存单	116,877,000.00	15.04
9	其他	-	-
10	合计	539,157,470.50	69.36

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	112104015	21 中国银行 CD015	600,000	58,212,000.00	7.49
2	200215	20 国开 15	500,000	50,320,000.00	6.47
3	101901391	19 日照港 MTN002	300,000	30,291,000.00	3.90
4	163679	20 诚通 15	300,000	29,883,000.00	3.84
5	092018001	20 农发清发 01	300,000	29,862,000.00	3.84

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IH2106	上证 50 股指期货 IH2106 合约	-4	-4,150,080.00	438,900.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IH2104	上证 50 股指期货 IH2104 合约	-9	-9,487,800.00	665,400.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性

					管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					1,104,300.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,767,933.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,183,040.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现投资目标。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	1,688,373.40
2	应收证券清算款	1,852,440.46
3	应收股利	-
4	应收利息	6,015,756.51
5	应收申购款	3,970.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	9,560,540.74
---	----	--------------

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	华夏睿磐泰荣混合A	华夏睿磐泰荣混合C
本报告期期初基金份额总额	536,635,680.99	46,364,229.09
报告期期间基金总申购份额	129,435,119.50	12,711,037.71
减：报告期期间基金总赎回份额	90,212,657.49	8,126,982.59
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	575,858,143.00	50,948,284.21

§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
机构	1	2021-01-01 至 2021-01-03	124,811,948.74	-	65,000,000.00	59,811,948.74	9.54%

产品特有风险

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正常运作水平，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。

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 1 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 1 月 9 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 1 月 15 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 1 月 20 日发布华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告。

2021 年 1 月 27 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 2 月 1 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 2 月 24 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 3 月 12 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）、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)、大湾区 (159983)、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)、创蓝筹 (159966)、创成长 (159967)、恒生 ETF (513660)、恒生 ETF (159920)、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 3 月 31 日，华夏基金旗下多只产品同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：华夏全球聚享(QDII)(A 类)在 QDII 混合基金 (A 类) 中排序第 3/37；华夏新兴消费混合(A 类)在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）(A 类) 中排序第 6/28；华夏磐利一年定开混合(A 类)在定期开放式偏股型基金 (A 类) 中排序第 14/66；华夏经典混合在偏股型基金（股票上限 80%）(A 类) 中排序第 19/135；华夏大盘精选混合在偏股型基金（股票上限 95%）(A 类) 中排序第 24/178；华夏线上经济主题精选混合在偏股型基金（股票上限 95%）(A 类) 中排序第 42/178。

固收与固收+产品：华夏聚利债券在普通债券型基金（可投转债）(A 类) 中排序第 3/217；华夏可转债增强债券(A 类)在可转换债券型基金 (A 类) 中排序第 5/37；华夏恒融定开债券在定期开放式普通债券型基金（二级）(A 类) 中排序第 7/25；华夏永康添福混合在偏债型基金 (A 类) 中排序第 14/236；华夏短债债券(A 类)在短期纯债债券型基金 (A 类) 中排序第 14/56；华夏中短债债券(A 类)在中短期纯债债券型基金 (A 类) 中排序第 16/84；华夏亚债中国指数(A 类)在指数债券型基金 (A 类) 中排序第 19/144；华夏鼎航债券(A 类)在长期纯债债券型基金 (A 类) 中排序第 19/641。

指数与量化产品：华夏中证 500 指数增强(A 类)在增强规模指数股票型基金 (A 类) 中排序第 1/103；华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合在定期开放式绝对收益目标基金 (A 类) 中排序第 1/24；华夏智胜价值成长股票(A 类)在标准股票型基金 (A 类) 中排序第 15/265。

在客户服务方面，1 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）华夏基金管家客户端上线人脸识别及盖章账单自动生成功能，提升了投资者业务

办理及盖章账单申请的办理效率；（2）同时管家客户端还上线了非货基收益提醒功能，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况；（3）与民商基金销售等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“从你们的老朋友说起”、“都 2021 年了，你还要自己记么？”、“震荡市需要口服镇心丸”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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰荣混合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

二〇二一年四月二十一日