

# 华夏鼎沛债券型证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	华夏鼎沛债券	
基金主代码	005886	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
报告期末基金份额总额	807,665,072.94 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。	
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略等。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80% + 沪深 300 指数收益率×10% + 经汇率调整的恒生指数收益率×10%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎沛债券 A	华夏鼎沛债券 C
下属分级基金的交易代码	005886	005887
报告期末下属分级基金的份额总额	486,048,491.48 份	321,616,581.46 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)

	华夏鼎沛债券 A	华夏鼎沛债券 C
1.本期已实现收益	-52,987,755.98	-15,963,887.85
2.本期利润	-72,157,985.61	-22,551,250.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0670	-0.0656
4.期末基金资产净值	644,503,164.15	421,827,821.35
5.期末基金份额净值	1.3260	1.3116

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

华夏鼎沛债券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	-4.52%	0.52%	0.41%	0.28%	-4.93%	0.24%
过去六个月	-2.84%	0.51%	3.36%	0.23%	-6.20%	0.28%
过去一年	6.56%	0.72%	3.26%	0.23%	3.30%	0.49%
自基金合同 生效起至今	36.74%	0.67%	8.34%	0.24%	28.40%	0.43%

华夏鼎沛债券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	-4.60%	0.52%	0.41%	0.28%	-5.01%	0.24%
过去六个月	-3.03%	0.51%	3.36%	0.23%	-6.39%	0.28%
过去一年	6.13%	0.72%	3.26%	0.23%	2.87%	0.49%
自基金合同 生效起至今	35.24%	0.67%	8.34%	0.24%	26.90%	0.43%

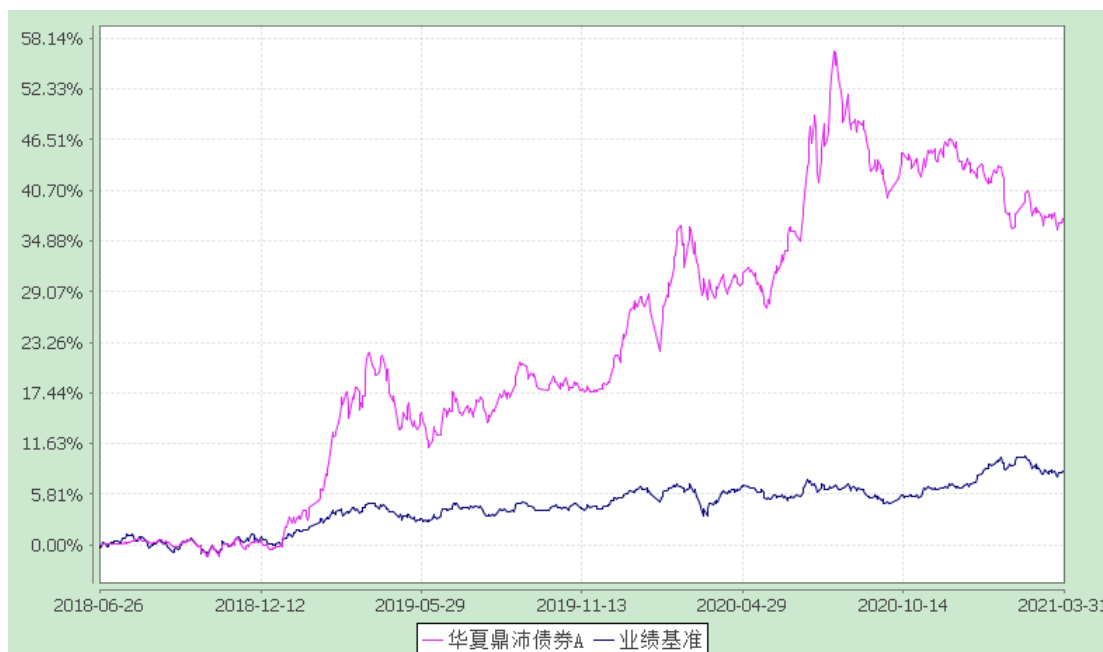
#### 3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎沛债券型证券投资基金

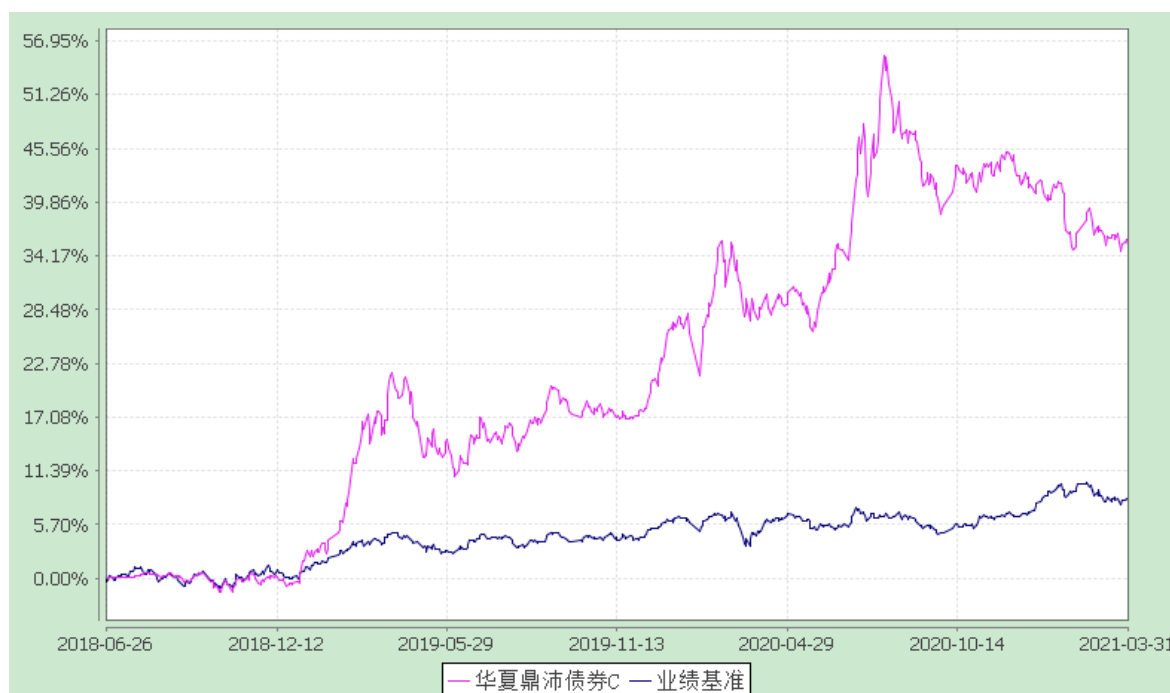
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年6月26日至2021年3月31日)

华夏鼎沛债券A:



华夏鼎沛债券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	2018-06-26	-	14 年	中国人民银行研究生部金融学

	的基金经理、固定收益部执行总经理				<p>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，华夏薪金宝货币市场基金基金经理(2014年5月26日至2017年8月7日期间)、华夏货币市场基金基金经理(2013年12月31日至2017年8月7日期间)、华夏恒利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2016年3月29日至2018年6月28日期间)、华夏新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年2月23日至2018年12月17日期间)、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2018年4月24日至2019年7月29日期间)、华夏新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年3月30日至2019年11月29日期间)、华夏恒利3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2018年6月29日至2019年11月29日期间)、亚债中国债券指数基金基金经理(2015年7月16日至2020年1月6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(2018年12月17日至2020年1月6日期间)、华夏鼎康债券型证券投资基金基金经理(2019年8月12日至2020年8月25日期间)、华夏鼎淳债券型证券投资基金基金经理(2019年8月21日至2020年8月25日期间)等。</p>
赵航	本基金的基金经理、股票投资部执	2020-05-18	-	24年	<p>中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券资产管理中心投资经理、长城证券投资银行部项目经理、鹏华基金原普华证券投资基金基金经理(2003年4月</p>

	行总经理				10 日至 2005 年 5 月 21 日期间) 等。2005 年 10 月加入原中信基金, 曾任中信红利精选股票型证券投资基金基金经理(2008 年 5 月 19 日至 2009 年 4 月 18 日期间), 华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理(2009 年 8 月 7 日至 2011 年 11 月 7 日期间)、华夏复兴混合型证券投资基金基金经理(2015 年 1 月 7 日至 2019 年 3 月 21 日期间)、华夏红利混合型证券投资基金基金经理(2011 年 1 月 18 日至 2020 年 5 月 18 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

今年 1 季度, 各国陆续推进新冠疫苗接种, 全球日新增确诊病例见顶回落, 尽管疫情影响尚

未消退，但在大量的财政刺激政策和疫情好转等影响下，欧美经济数据均表现良好。国内经济环比有所弱化，外需持续强劲，内需主要是消费和投资数据则有所走弱。对于投资数据的走弱，需要细化分析：制造业投资大幅滑落缺乏高频和行业数据支撑，不排除数据扰动；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，更多体现了政府稳增长期权在节奏上的摆布；房地产新开工以及投资双双下行，与地产销售数据存在偏差，预计不影响全年地产投资数据的平稳。通胀方面，1-2 月 CPI 同比转负，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。PPI 同比快速上升至+1.7%，结构上，各行业呈普涨状态，考虑到后续基数较低，本轮 PPI 高点可能会达到 5% 以上，工业品通胀风险值得中期关注。

市场方面，一季度债券收益率中枢有所抬升，呈现震荡走势。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，DR007 最高偏离政策利率 95BP，收益率曲线大幅平坦化上行。2 月央行重申公开市场“价格比数量投放更重要”，稳定了资金预期，短端有所回落；但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。

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，年初抱团行情火热，创成长涨幅最高达+21%，之后在流动性收紧预期下，高估值股票出现大幅调整，截止目前各类宽基指数年初以来的累计收益均转为负值。转债同样风格转换剧烈，年初在信用风险事件的作用下低价偏债类个券大幅下跌，之后在权益市场转为下跌时，偏债类个券又出现明显反弹。目前转债市场整体估值处于历史中位略偏低水平。

报告期内，本基金维持了基本的债券持仓，适当削减了可转债仓位，并保持了较高的股票仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 3 月 31 日，华夏鼎沛债券 A 基金份额净值为 1.3260 元，本报告期份额净值增长率为-4.52%；华夏鼎沛债券 C 基金份额净值为 1.3116 元，本报告期份额净值增长率为-4.60%，同期业绩比较基准增长率为 0.41%。

#### 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	207,579,224.67	17.10
	其中：股票	207,579,224.67	17.10
2	固定收益投资	867,611,389.69	71.45
	其中：债券	867,611,389.69	71.45
	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	60,000,000.00	4.94
	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	64,948,541.13	5.35
7	其他各项资产	14,112,355.93	1.16
8	合计	1,214,251,511.42	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 75,825,551.90 元，占基金资产净值比例为 7.11%。

## 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	-	-
B	采矿业	6,635,876.00	0.62
C	制造业	66,090,607.50	6.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,470,248.67	0.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,312,827.00	0.59
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	42,244,113.60	3.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	131,753,672.77	12.36

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	75,825,551.90	7.11
保健	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
非必需消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
通信服务	-	-
信息技术	-	-
合计	75,825,551.90	7.11

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 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	06166	中国宏泰发展	29,609,000	75,825,551.90	7.11
2	300058	蓝色光标	6,580,080	42,244,113.60	3.96
3	002213	大为股份	2,868,899	32,533,314.66	3.05
4	002532	天山铝业	2,290,076	18,847,325.48	1.77
5	300712	永福股份	397,957	10,470,248.67	0.98
6	600111	北方稀土	352,806	6,745,650.72	0.63
7	601899	紫金矿业	689,800	6,635,876.00	0.62

8	000001	平安银行	146,700	3,228,867.00	0.30
9	600362	江西铜业	140,300	3,103,436.00	0.29
10	601601	中国太保	81,500	3,083,960.00	0.29

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 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	13,251,562.20	1.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	360,004,000.00	33.76
	其中：政策性金融债	164,958,000.00	15.47
4	企业债券	49,249,410.00	4.62
5	企业短期融资券	110,143,000.00	10.33
6	中期票据	19,864,000.00	1.86
7	可转债（可交换债）	315,099,417.49	29.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	867,611,389.69	81.36

#### 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	200210	20 国开 10	1,200,000	115,008,000.00	10.79
2	163861	21 国君 S1	1,000,000	100,000,000.00	9.38
3	113011	光大转债	676,030	82,408,057.00	7.73
4	163785	20 平证 04	800,000	80,040,000.00	7.51
5	200211	20 国开 11	500,000	49,950,000.00	4.68

#### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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	504,753.81
2	应收证券清算款	4,248,713.11
3	应收股利	-
4	应收利息	9,052,062.37
5	应收申购款	306,826.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	14,112,355.93
---	----	---------------

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	82,408,057.00	7.73
2	123025	精测转债	44,364,325.57	4.16
3	123050	聚飞转债	16,027,719.70	1.50
4	128078	太极转债	15,716,496.97	1.47
5	128017	金禾转债	15,483,793.20	1.45
6	110073	国投转债	11,558,450.70	1.08
7	128126	赣锋转 2	9,249,563.40	0.87
8	132018	G 三峡 EB1	7,134,355.20	0.67
9	128046	利尔转债	6,970,528.80	0.65
10	113582	火炬转债	6,442,832.40	0.60
11	110067	华安转债	6,315,528.60	0.59
12	128130	景兴转债	5,513,338.08	0.52
13	132007	16 凤凰 EB	5,180,000.00	0.49
14	128107	交科转债	3,986,892.00	0.37
15	110053	苏银转债	2,815,117.80	0.26
16	110063	鹰 19 转债	2,799,392.90	0.26
17	110038	济川转债	2,197,702.80	0.21
18	128111	中矿转债	2,003,922.60	0.19
19	128022	众信转债	1,919,495.50	0.18
20	123022	长信转债	1,788,987.71	0.17
21	123053	宝通转债	1,468,251.40	0.14
22	110051	中天转债	1,384,003.40	0.13
23	110068	龙净转债	1,068,301.60	0.10
24	110069	瀚蓝转债	842,850.90	0.08
25	123004	铁汉转债	692,582.80	0.06
26	128018	时达转债	647,319.00	0.06
27	113542	好客转债	644,782.60	0.06
28	110066	盛屯转债	522,624.50	0.05
29	132006	16 皖新 EB	374,884.00	0.04
30	127012	招路转债	66,333.80	0.01
31	128051	光华转债	12,128.60	0.00
32	128057	博彦转债	477.36	0.00
33	128093	百川转债	303.30	0.00
34	128128	齐翔转 2	109.41	0.00
35	128081	海亮转债	101.75	0.00

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况 说明
1	002532	天山铝业	18,847,325.48	1.77	非公开发行流 通受限

#### 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	华夏鼎沛债券A	华夏鼎沛债券C
本报告期期初基金份额总额	1,693,067,520.42	426,727,013.03
报告期期间基金总申购份额	93,508,866.53	64,094,570.78
减：报告期期间基金总赎回份额	1,300,527,895.47	169,205,002.35
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	486,048,491.48	321,616,581.46

## §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	2021-01-22 至 2021-01-24,2021-01-28 至 2021-02-25	355,750,894.06	-	355,750,894.06	-	-
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、《华夏鼎沛债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏鼎沛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

二〇二一年四月二十一日