

华夏鼎沛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	706,246,976.35 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	451,358,173.00 份	254,888,803.35 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)

	华夏鼎沛债券 A	华夏鼎沛债券 C
1.本期已实现收益	6,353,297.95	3,286,641.64
2.本期利润	21,118,879.79	12,162,135.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0449	0.0439
4.期末基金资产净值	618,625,594.43	345,202,495.58
5.期末基金份额净值	1.3706	1.3543

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	3.36%	0.40%	0.75%	0.16%	2.61%	0.24%
过去六个月	-1.30%	0.47%	1.16%	0.23%	-2.46%	0.24%
过去一年	3.53%	0.69%	3.20%	0.21%	0.33%	0.48%
过去三年	41.26%	0.65%	8.80%	0.23%	32.46%	0.42%
自基金合同 生效起至今	41.34%	0.65%	9.15%	0.23%	32.19%	0.42%

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	3.26%	0.40%	0.75%	0.16%	2.51%	0.24%
过去六个月	-1.50%	0.47%	1.16%	0.23%	-2.66%	0.24%
过去一年	3.11%	0.69%	3.20%	0.21%	-0.09%	0.48%
过去三年	39.57%	0.65%	8.80%	0.23%	30.77%	0.42%
自基金合同 生效起至今	39.64%	0.65%	9.15%	0.23%	30.49%	0.42%

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 6 月 30 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		
赵航	本基金的基金经理	2020-05-18	-	24 年	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 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。
柳万军	本基金的基金经理、投委会成员	2018-06-26	-	14 年	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

					<p>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)、华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2019年4月25日至2021年1月27日期间)等。</p>
--	--	--	--	--	--

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

二季度，随着欧美疫苗接种覆盖率提升，发达经济体基本面继续复苏。但新兴市场国家疫情形势仍然严峻。全球复苏格局的错位导致大宗商品价格迅速上涨，美国二季度通胀触及历史高位，同时就业改善情况弱于预期。6 月美联储最新会议点阵图暗示 2023 年或有 2 次加息，但仍维持高通胀是暂时性的观点，且保持短期购债规模不变，短期对资产价格走势影响有限。

国内经济整体动能有所弱化。需求端看，投资较为疲弱，上半年财政支出较少使得基建投资下滑较为明显，地产小幅下滑，在较好的盈利景气度支撑下制造业投资继续上升，出口仍然保持较强韧性，消费平稳略有下滑，呈现了内需弱外需稳的格局。金融数据方面，社融受基数效应，非标、政府债超季节性下滑的拖累，总量下降，但结构尚可，有利于经济总体保持韧性。目前市场的隐忧在于通胀，5 月份 CPI 同比回升至 1.3%，从主要分项来看，除食品大幅走弱外，其余非食品价格整体偏强，下半年核心 CPI 超预期的风险需要关注。PPI 方面，5 月同比飙升至 9%，创下 2008 年 10 月以来新高，且暂时未见高点。

市场方面，二季度债券收益率震荡小幅下行，曲线结构陡峭化。由于经济环比小幅走弱，短期的通胀并未对货币政策带来紧缩压力，资金低位平稳、供给整体低于预期是驱动市场走势的核心动力，整体波动区间较小。

权益市场整体震荡上行，在美联储缓和紧缩预期、国内资金面维持偏松、1 季报业绩超预期等多方面因素作用下，海内外权益市场均明显反弹，结构性机会较为突出。2 季度新能源产业链、半导体产业链和上游资源品涨幅最为明显，而跌幅居前的主要是农牧、家电、地产。可转债跟随权益市场波动，目前转债市场整体估值处于历史中位水平。

报告期内，本基金保持了相对中性的纯债久期和仓位以持有收益。股票仓位持续较高，可转债仓位有所提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，华夏鼎沛债券 A 基金份额净值为 1.3706 元，本报告期份额净值增长率为 3.36%；华夏鼎沛债券 C 基金份额净值为 1.3543 元，本报告期份额净值增长率为 3.26%，同期业绩比较基准增长率为 0.75%。

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	188,075,162.76	15.54
	其中：股票	188,075,162.76	15.54
2	固定收益投资	963,667,017.91	79.62
	其中：债券	963,667,017.91	79.62
	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	28,044,452.19	2.32
7	其他各项资产	30,502,935.13	2.52
8	合计	1,210,289,567.99	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 64,148,375.52 元，占基金资产净值比例为 6.66%。

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	5,255,856.00	0.55
C	制造业	74,195,123.24	7.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,666,324.00	0.48
E	建筑业	-	-

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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	39,809,484.00	4.13
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	123,926,787.24	12.86

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	64,148,375.52	6.66
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	64,148,375.52	6.66

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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

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	25,698,000	64,148,375.52	6.66

2	300058	蓝色光标	6,580,080	39,809,484.00	4.13
3	002213	大为股份	2,663,999	36,976,306.12	3.84
4	002532	天山铝业	2,290,076	19,213,737.64	1.99
5	002436	兴森科技	1,202,500	13,227,500.00	1.37
6	601899	紫金矿业	542,400	5,255,856.00	0.55
7	600163	中闽能源	944,600	4,666,324.00	0.48
8	600362	江西铜业	121,300	2,714,694.00	0.28
9	000063	中兴通讯	66,203	2,062,885.48	0.21

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	46,175,298.00	4.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	289,199,100.00	30.01
	其中：政策性金融债	119,120,100.00	12.36
4	企业债券	49,276,970.00	5.11
5	企业短期融资券	50,180,000.00	5.21
6	中期票据	20,246,000.00	2.10
7	可转债（可交换债）	508,589,649.91	52.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	963,667,017.91	99.98

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	116,112,000.00	12.05
2	163861	21 国君 S1	900,000	89,991,000.00	9.34
3	163785	20 平证 04	800,000	80,088,000.00	8.31
4	113011	光大转债	675,130	78,031,525.40	8.10
5	123025	精测转债	354,943	50,185,390.77	5.21

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	396,568.42
2	应收证券清算款	21,929,017.97
3	应收股利	-
4	应收利息	7,983,105.54
5	应收申购款	194,243.20

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,502,935.13

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	78,031,525.40	8.10
2	123025	精测转债	50,185,390.77	5.21
3	123070	鹏辉转债	31,223,434.44	3.24
4	110053	苏银转债	29,647,034.40	3.08
5	110074	精达转债	17,672,262.80	1.83
6	123050	聚飞转债	16,618,259.90	1.72
7	128078	太极转债	16,066,247.90	1.67
8	110073	国投转债	11,855,639.70	1.23
9	113044	大秦转债	11,715,274.40	1.22
10	113528	长城转债	11,048,999.80	1.15
11	113034	滨化转债	8,997,009.20	0.93
12	123061	航新转债	7,452,160.00	0.77
13	128051	光华转债	7,201,147.20	0.75
14	132018	G 三峡 EB1	7,019,812.80	0.73
15	113550	常汽转债	6,629,230.80	0.69
16	128018	时达转债	6,550,377.22	0.68
17	113582	火炬转债	6,485,176.00	0.67
18	110067	华安转债	6,222,840.60	0.65
19	110051	中天转债	6,075,655.30	0.63
20	128107	交科转债	5,982,090.24	0.62
21	128130	景兴转债	5,312,742.02	0.55
22	128140	润建转债	5,311,737.16	0.55
23	113615	金诚转债	5,279,264.00	0.55
24	132007	16 凤凰 EB	5,217,000.00	0.54
25	113043	财通转债	4,808,518.30	0.50
26	127011	中鼎转 2	4,739,662.50	0.49
27	127005	长证转债	4,685,600.00	0.49
28	123058	欣旺转债	4,554,725.00	0.47
29	113040	星宇转债	4,451,271.40	0.46
30	110033	国贸转债	4,387,480.00	0.46
31	123048	应急转债	4,280,282.59	0.44
32	128017	金禾转债	4,121,944.40	0.43

33	123086	海兰转债	3,763,100.40	0.39
34	127023	华菱转 2	3,511,514.40	0.36
35	113606	荣泰转债	3,132,504.00	0.33
36	128074	游族转债	3,059,027.40	0.32
37	113611	福 20 转债	2,989,203.30	0.31
38	110063	鹰 19 转债	2,804,622.30	0.29
39	110071	湖盐转债	2,791,547.20	0.29
40	123068	弘信转债	2,406,041.62	0.25
41	113607	伟 20 转债	2,315,200.00	0.24
42	110038	济川转债	2,229,562.80	0.23
43	123022	长信转债	2,056,966.96	0.21
44	128022	众信转债	1,988,675.00	0.21
45	128082	华锋转债	1,976,124.80	0.21
46	123053	宝通转债	1,667,136.60	0.17
47	128127	文科转债	1,570,240.00	0.16
48	123077	汉得转债	1,310,566.32	0.14
49	113505	杭电转债	1,166,669.40	0.12
50	123051	今天转债	1,159,700.00	0.12
51	128128	齐翔转 2	1,158,384.16	0.12
52	128046	利尔转债	1,142,588.00	0.12
53	110068	龙净转债	1,055,713.60	0.11
54	123078	飞凯转债	1,037,935.00	0.11
55	113012	骆驼转债	1,010,885.20	0.10
56	123083	朗新转债	942,658.64	0.10
57	123004	铁汉转债	704,571.40	0.07
58	110057	现代转债	576,939.60	0.06
59	123073	同和转债	170,318.40	0.02
60	127026	超声转债	144,681.60	0.02
61	127012	招路转债	66,358.60	0.01
62	123067	斯莱转债	492.75	0.00
63	128057	博彦转债	492.64	0.00
64	128093	百川转债	403.38	0.00
65	128081	海亮转债	113.71	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	000063	中兴通讯	2,062,885.48	0.21	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	486,048,491.48	321,616,581.46
报告期期间基金总申购份额	3,504,278.57	10,364,568.53
减：报告期期间基金总赎回份额	38,194,597.05	77,092,346.64
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	451,358,173.00	254,888,803.35

§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 2 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 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 4 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 4 月 21 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 28 日发布华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修订旗下部分公募基金基金合同的公告。

2021 年 5 月 8 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 5 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。

2021 年 5 月 13 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 5 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。

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 5 月 28 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 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 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 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、华夏移动互联网混合 (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

二〇二一年七月二十日