

**华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式  
证券投资基金  
2021 年年度报告  
2021 年 12 月 31 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，本基金不向个人投资者销售。

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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示及目录.....                            | 1  |
| §2 基金简介.....                               | 3  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....               | 4  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                       | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                            | 5  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                     | 8  |
| §4 管理人报告.....                              | 8  |
| §5 托管人报告.....                              | 15 |
| §6 审计报告.....                               | 15 |
| §7 年度财务报表.....                             | 17 |
| 7.1 资产负债表.....                             | 17 |
| 7.2 利润表.....                               | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 19 |
| §8 投资组合报告.....                             | 39 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                        | 39 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 39 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 40 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 40 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 40 |
| 8.6 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.....    | 40 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 8.8 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贵金属投资明细..... | 41 |
| 8.9 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.....    | 41 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 41 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 41 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 41 |
| §9 基金份额持有人信息.....                          | 42 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 42 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 42 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....      | 42 |
| §10 开放式基金份额变动.....                         | 43 |
| §11 重大事件揭示.....                            | 43 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                    | 47 |
| §13 备查文件目录.....                            | 48 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                         |                 |
|-----------------|-------------------------|-----------------|
| 基金名称            | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 华夏鼎诺三个月定期开放债券           |                 |
| 基金主代码           | 004979                  |                 |
| 基金运作方式          | 契约型、定期开放式               |                 |
| 基金合同生效日         | 2017年10月13日             |                 |
| 基金管理人           | 华夏基金管理有限公司              |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司            |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 808,711,960.57 份        |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                     |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A         | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 004979                  | 004980          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 808,684,278.24 份        | 27,682.33 份     |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在有效控制风险的前提下，追求持续、稳定的收益。  |
| 投资策略   | <p>封闭期投资策略：主要投资策略包括债券类属配置策略、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、国债期货投资策略等。</p> <p>开放期投资策略：开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率。   |
| 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基金、混合基金，高于货币市场基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

|             |                       |                      |
|-------------|-----------------------|----------------------|
| 项目          | 基金管理人                 | 基金托管人                |
| 名称          | 华夏基金管理有限公司            | 中国工商银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                    | 李彬                   |
|             | 联系电话                  | 400-818-6666         |
|             | 电子邮箱                  | service@ChinaAMC.com |
| 客户服务电话      | 400-818-6666          | 95588                |
| 传真          | 010-63136700          | 010-66105798         |
| 注册地址        | 北京市顺义区安庆大街甲3号院        | 北京市西城区复兴门内大街55号      |
| 办公地址        | 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 | 北京市西城区复兴门内大街55号      |
| 邮政编码        | 100033                | 100140               |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 杨明辉 | 陈四清 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》          |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                        |
|--------|----------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼   |
| 注册登记机构 | 华夏基金管理有限公司           | 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年          |                 | 2020 年          |                 | 2019 年          |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|               | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C |
| 本期已实现收益       | 23,681,060.61   | 1,009.11        | 6,082,614.59    | 56.53           | -32,607,635.24  | -               |
| 本期利润          | 28,081,562.42   | 1,112.00        | 6,285,836.60    | 231.83          | -1,738,666.86   | -               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0415          | 0.0381          | 0.0070          | 0.0096          | -0.0017         | -               |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.12%           | 3.75%           | 0.69%           | 0.96%           | -0.17%          | -               |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.87%           | 3.85%           | 1.61%           | 0.74%           | -0.39%          | -               |
| 3.1.2 期       | 2021 年末         |                 | 2020 年末         |                 | 2019 年末         |                 |

|              |                 |                 |                 |                 |                  |                 |
|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------|-----------------|
| 末数据和指标       | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C |
| 期末可供分配利润     | 1,645,886.40    | 333.78          | 1,359,103.17    | 194.73          | -759,175.00      | -               |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0020          | 0.0121          | 0.0064          | 0.0064          | -0.0005          | -               |
| 期末基金资产净值     | 812,665,019.07  | 28,097.59       | 212,790,537.72  | 30,755.83       | 1,510,361,544.39 | -               |
| 期末基金份额净值     | 1.0049          | 1.0150          | 1.0064          | 1.0064          | 1.0004           | -               |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末         |                 | 2020 年末         |                 | 2019 年末          |                 |
|              | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C |
| 基金份额累计净值增长率  | 10.18%          | 4.61%           | 6.08%           | 0.74%           | 4.40%            | -               |

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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

华夏鼎诺三个月定期开放债券 A:

| 阶段     | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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  | 1.07%    | 0.04%       | 0.60%      | 0.05%         | 0.47% | -0.01% |
| 过去六个月  | 2.27%    | 0.04%       | 1.44%      | 0.05%         | 0.83% | -0.01% |
| 过去一年   | 3.87%    | 0.03%       | 2.10%      | 0.05%         | 1.77% | -0.02% |
| 过去三年   | 5.13%    | 0.10%       | 3.37%      | 0.07%         | 1.76% | 0.03%  |
| 自基金合同生 | 10.18%   | 0.10%       | 7.07%      | 0.07%         | 3.11% | 0.03%  |

|      |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|

华夏鼎诺三个月定期开放债券 C:

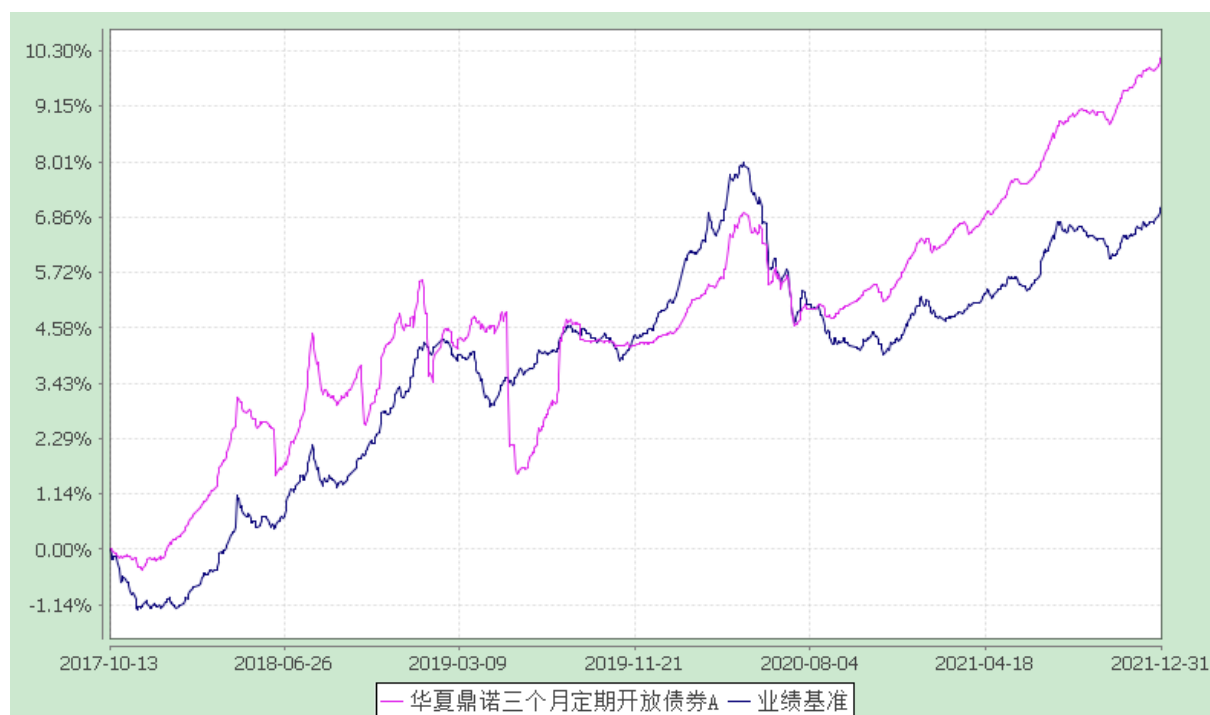
| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 1.05%    | 0.04%       | 0.60%      | 0.05%         | 0.45% | -0.01% |
| 过去六个月          | 2.23%    | 0.04%       | 1.44%      | 0.05%         | 0.79% | -0.01% |
| 过去一年           | 3.85%    | 0.03%       | 2.10%      | 0.05%         | 1.75% | -0.02% |
| 2020年11月17日起至今 | 4.61%    | 0.03%       | 2.71%      | 0.05%         | 1.90% | -0.02% |

注：2017年10月13日至2020年11月16日期间，华夏鼎诺三个月定期开放债券 C 类基金份额为零。

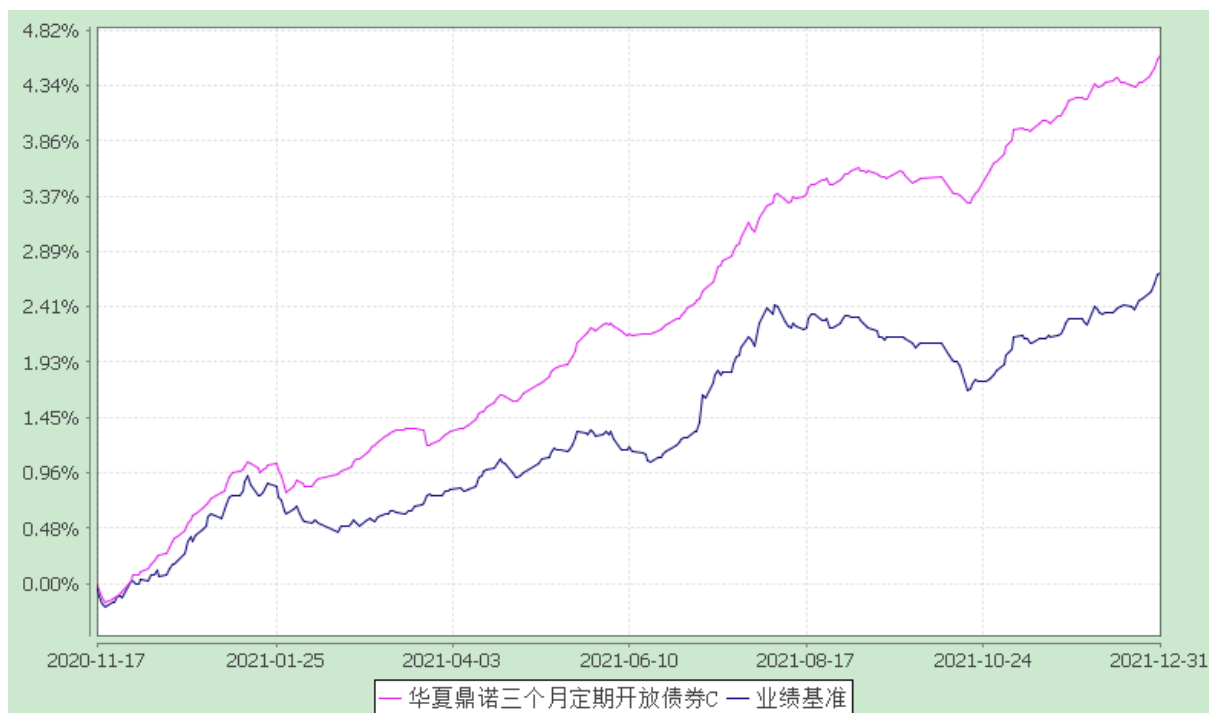
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
 基金份额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10月13日至2021年12月31日)

华夏鼎诺三个月定期开放债券 A



华夏鼎诺三个月定期开放债券 C

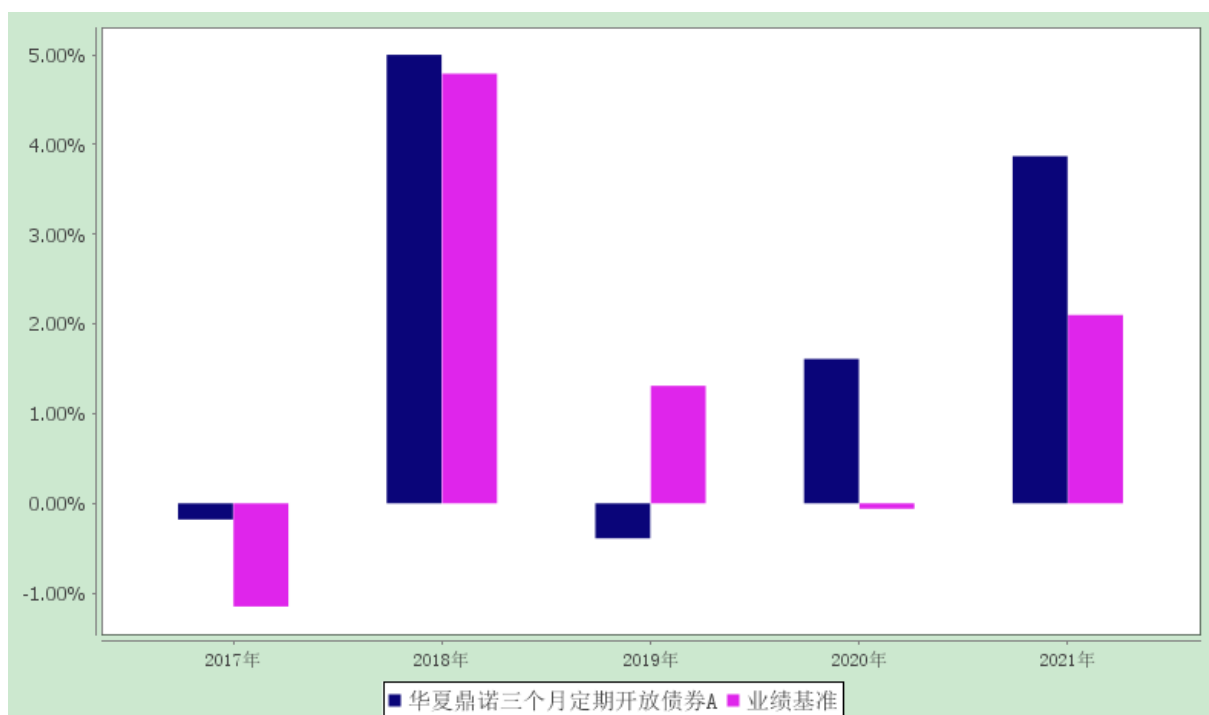


注：2017年10月13日至2020年11月16日期间，华夏鼎诺三个月定期开放债券C类基金份额为零。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

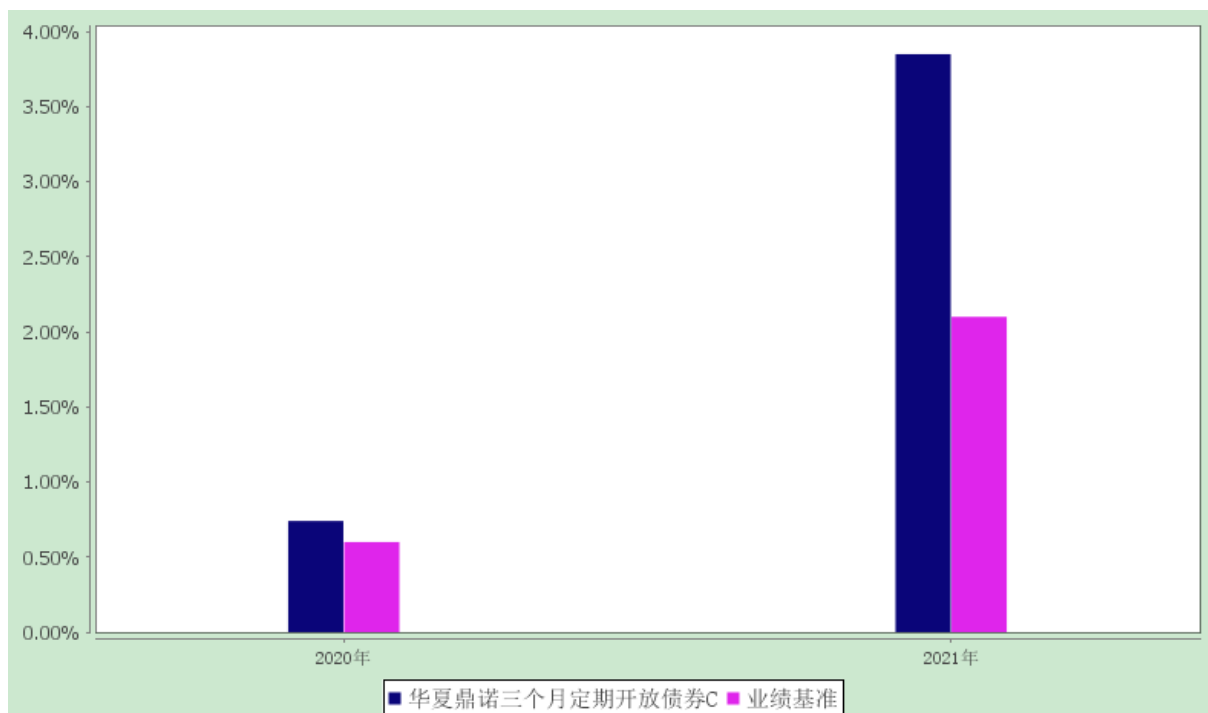
华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏鼎诺三个月定期开放债券A



华夏鼎诺三个月定期开放债券C





注：2017年10月13日至2020年11月16日期间，华夏鼎诺三个月定期开放债券C类基金份额为零。

本基金合同于2017年10月13日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

华夏鼎诺三个月定期开放债券A：

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|-------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2021年 | 0.398       | 26,213,834.88 | 0.32      | 26,213,835.20 | -  |
| 2020年 | 0.100       | 15,097,002.82 | -         | 15,097,002.82 | -  |
| 合计    | 0.498       | 41,310,837.70 | 0.32      | 41,310,838.02 | -  |

华夏鼎诺三个月定期开放债券C：

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------|-----------|----------|----|
| 2021年 | 0.298       | 507.35   | 319.00    | 826.35   | -  |
| 合计    | 0.298       | 507.35   | 319.00    | 826.35   | -  |

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，首批公募 MOM 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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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，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 12 月 31 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）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；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 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；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 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；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 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）

排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A 类)排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42.；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接(A 类)排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）华夏大中华信用债券（QDII）(A 类)排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）(A 类)排序第 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合(A 类)排序第 26/231、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎航债券(A 类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A 类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A 类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A 类)排序第 32/203；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏鼎泓债券(A 类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A 类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：在混合型 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏聚丰混合（FOF）(A 类)排序第 1/16、华夏聚惠 FOF(A 类)排序第 3/16；在养老目标日期 FOF（2040）（A 类）中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/11。

在客户服务方面，2021 年，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、交通银行卡快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线人脸识别，盖章账单自动生成，非货基收益提醒及预约赎回等功能，提升了投资者业务办理的方便快捷性，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况，增加客户操作便利性；（3）与民商基金销售、众惠基金、泰信财富、排排网基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“震荡市需要口服镇心丸”、“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“牙掉了之后”、“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“华夏亲子财商营”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务     | 任本基金的基金经理（助理）期限 |            | 证券从业年限 | 说明          |
|-----|--------|-----------------|------------|--------|-------------|
|     |        | 任职日期            | 离任日期       |        |             |
| 刘明宇 | 本基金的基金 | 2017-12-11      | 2021-01-27 | 12 年   | 硕士。2009 年 6 |

|    |                     |            |            |    |   |
|----|---------------------|------------|------------|----|---|
|    | 经理、公募固定收益投资总监、投委会成员 |            |            |    | 月加入华夏基金管理有限公司。曾任机构债券投资部研究员、投资经理助理、投资经理、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理（2017年12月19日至2018年3月14日期间）、华夏鼎盛债券型证券投资基金基金经理（2017年12月19日至2019年1月7日期间）、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理（2018年12月17日至2020年3月24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12月11日至2020年6月23日期间）等。 |
| 刘薇 | 本基金的基金经理            | 2021-01-27 | -          | 8年 | 硕士。2013年1月加入华夏基金管理有限公司。曾任固定收益部研究员。  |
| 孙蕾 | 本基金的基金经理助理          | 2019-12-23 | 2021-04-02 | 6年 | 硕士。2015年5月加入华夏基金管理有限公司。曾任固定收益部研究员。  |

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其

在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

##### 4.3.3 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 73 次，其中 52 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同

而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，全年经济呈现明显的前高后低的特征，结构层面，外需强于内需、通胀强于增长。具体来看，年初受疫情影响，国内管制措施明显收紧，对一季度消费产生了一定负面拖累，此外，由于稳增长压力较小，开年政策整体处于观望状态，财政支出节奏明显偏慢，两者相叠加，最终导致一季度 GDP 两年平均同比回落至 5.0%。此后，二、三季度经济在供给约束、严控地产、预期转弱、PPI 高企的夹击下，滞胀特征明显。进入四季度，政策纠偏力度加码，煤炭保供成效显著，并带动以动力煤为首的国内黑色系商品价格快速下行，工业品通胀压力明显减轻，需求端，在房贷利率下行、地产保交房等措施的影响下，地产失速下行的势头得到初步缓解，同时财政支出加快，在各项纠偏政策的合力之下，四季度经济整体呈现了底部企稳的特征。

市场方面，纯债大类表现来看，利率债指数表现好于信用债指数，呈现典型的牛市特征。全年行情大致分为两个部分，7 月以前，由于社融增速的快速下滑，带来了衰退式宽松，收益率平行下行 15bp 左右，7 月以后，下半年经济在供给制约、疫情和需求减弱三重夹击下，下行压力加大，政策全面转向稳增长，降准、LPR 降息相继落地，收益率曲线平坦化下行。

报告期内，本基金积极关注市场主导因素的切换，根据市场情况调整久期和仓位，并严格控制信用风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，华夏鼎诺三个月定期开放债券 A 基金份额净值为 1.0049 元，本报告期份额净值增长率为 3.87%；华夏鼎诺三个月定期开放债券 C 基金份额净值为 1.0150 元，本报告期份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准增长率为 2.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，宏观数据的基数扰动仍然明显，在剔除掉基数效应后，出口回落确定性较强、投资大概率底部温和修复、消费“耐克型”修复。节奏上，当前经济整体处于“底部已现、静待反弹”的阶段，预计上半年经济阶段性复苏的概率较大。考虑到在现有的政策导向下，财政和地产总量层面加码空间有限，更多是纠偏及节奏前置，这意味着全年来看经济增长动能有限，预计下半年基本面又会重新转弱。主要的不确定性在于，稳增长诉求下，下半年地产调控政策是否会进一步松动。通胀层面，CPI 持续回升、PPI 快速下行，整体来看，暂时不会构成货币政策的掣肘。综上，预计债券整体呈区间震荡走势。本基金将保持中性久期，积极参与波段交易机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为

信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司着力加强合规制度建设，在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时，继续强化业务部门专兼合规管理职责，规范任免流程，提高工作质量，完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训，提升员工的合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 3 次，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24695 号

华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### （一）我们审计的内容

我们审计了华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“华夏鼎诺三个月定期开放债券”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### （二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏鼎诺三个月定期开放债券 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础



我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏鼎诺三个月定期开放债券，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏鼎诺三个月定期开放债券的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏鼎诺三个月定期开放债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏鼎诺三个月定期开放债券、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏鼎诺三个月定期开放债券的财务报告过程。

### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华夏鼎诺三个月定期开放债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大

不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏鼎诺三个月定期开放债券不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 朱宏宇

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         |                         |                          |
| 银行存款     | 7.4.7.1 | 6,790,466.05            | 1,536,444.20             |
| 结算备付金    |         | 7,127,243.13            | 28,588.22                |
| 存出保证金    |         | 4,912.08                | 7,138.71                 |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 1,227,808,000.00        | 259,207,000.00           |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 1,205,906,000.00        | 259,207,000.00           |
| 资产支持证券投资 |         | 21,902,000.00           | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | -                       | -                        |
| 应收证券清算款  |         | 15,670,936.28           | -                        |

|            |          |                         |                          |
|------------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息       | 7.4.7.5  | 20,820,223.57           | 3,279,859.40             |
| 应收股利       |          | -                       | -                        |
| 应收申购款      |          | -                       | -                        |
| 递延所得税资产    |          | -                       | -                        |
| 其他资产       | 7.4.7.6  | -                       | -                        |
| 资产总计       |          | 1,278,221,781.11        | 264,059,030.53           |
| 负债和所有者权益   | 附注号      | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
| 负债：        |          |                         |                          |
| 短期借款       |          | -                       | -                        |
| 交易性金融负债    |          | -                       | -                        |
| 衍生金融负债     | 7.4.7.3  | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款  |          | 464,907,007.64          | 50,938,523.59            |
| 应付证券清算款    |          | -                       | -                        |
| 应付赎回款      |          | -                       | -                        |
| 应付管理人报酬    |          | 208,523.98              | 53,862.23                |
| 应付托管费      |          | 69,507.97               | 17,954.10                |
| 应付销售服务费    |          | 2.48                    | 2.45                     |
| 应付交易费用     | 7.4.7.7  | 13,489.30               | 14,395.16                |
| 应交税费       |          | 85,664.30               | 14,255.41                |
| 应付利息       |          | 74,468.78               | 28,744.04                |
| 应付利润       |          | -                       | -                        |
| 递延所得税负债    |          | -                       | -                        |
| 其他负债       | 7.4.7.8  | 170,000.00              | 170,000.00               |
| 负债合计       |          | 465,528,664.45          | 51,237,736.98            |
| 所有者权益：     |          |                         |                          |
| 实收基金       | 7.4.7.9  | 808,711,960.57          | 211,461,995.65           |
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | 3,981,156.09            | 1,359,297.90             |
| 所有者权益合计    |          | 812,693,116.66          | 212,821,293.55           |
| 负债和所有者权益总计 |          | 1,278,221,781.11        | 264,059,030.53           |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，华夏鼎诺三个月定期开放债券 A 基金份额净值 1.0049 元，华夏鼎诺三个月定期开放债券 C 基金份额净值 1.0150 元；华夏鼎诺三个月定期开放债券基金份额总额 808,711,960.57 份（其中 A 类 808,684,278.24 份，C 类 27,682.33 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 |
|----|-----|---|--|
|    |     |   |  |

|                       |          |               |                |
|-----------------------|----------|---------------|----------------|
| 一、收入                  |          | 37,705,989.05 | 13,199,088.92  |
| 1.利息收入                |          | 35,511,430.85 | 29,447,952.02  |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 166,699.99    | 381,642.14     |
| 债券利息收入                |          | 34,151,096.89 | 28,629,145.33  |
| 资产支持证券利息收入            |          | 1,193,633.97  | 437,164.55     |
| 买入返售金融资产收入            |          | -             | -              |
| 证券出借利息收入              |          | -             | -              |
| 其他利息收入                |          | -             | -              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | -2,206,046.50 | -16,452,260.51 |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | -             | -              |
| 基金投资收益                |          | -             | -              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | -1,944,592.30 | -16,405,770.65 |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.14 | -261,454.20   | -46,489.86     |
| 贵金属投资收益               |          | -             | -              |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.15 | -             | -              |
| 股利收益                  | 7.4.7.16 | -             | -              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 4,400,604.70  | 203,397.31     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -             | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18 | -             | 0.10           |
| 减：二、费用                |          | 9,623,314.63  | 6,913,020.49   |
| 1.管理人报酬               |          | 2,031,154.91  | 2,759,282.80   |
| 2.托管费                 |          | 677,051.60    | 919,760.99     |
| 3.销售服务费               |          | 29.86         | 2.89           |
| 4.交易费用                | 7.4.7.19 | 23,912.64     | 39,368.00      |
| 5.利息支出                |          | 6,574,418.57  | 2,905,598.65   |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |          | 6,574,418.57  | 2,905,598.65   |
| 6.税金及附加               |          | 90,470.49     | 54,508.57      |
| 7.其他费用                | 7.4.7.20 | 226,276.56    | 234,498.59     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |          | 28,082,674.42 | 6,286,068.43   |
| 减：所得税费用               |          | -             | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |          | 28,082,674.42 | 6,286,068.43   |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |              |                |
|-----------------|--|--------------|----------------|
|                 | 实收基金                                   | 未分配利润        | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 211,461,995.65                         | 1,359,297.90 | 212,821,293.55 |

|  |                                  |                |                   |
|--|----------------------------------|----------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 28,082,674.42  | 28,082,674.42     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 597,249,964.92                   | 753,845.32     | 598,003,810.24    |
| 其中：1.基金申购款                             | 798,732,171.86                   | 1,318,327.29   | 800,050,499.15    |
| 2.基金赎回款                                | -201,482,206.94                  | -564,481.97    | -202,046,688.91   |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                | -26,214,661.55 | -26,214,661.55    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 808,711,960.57                   | 3,981,156.09   | 812,693,116.66    |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                |                   |
|  | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                |                   |
|  | 实收基金                             | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,509,700,282.53                 | 661,261.86     | 1,510,361,544.39  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 6,286,068.43   | 6,286,068.43      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,298,238,286.88                | 9,508,970.43   | -1,288,729,316.45 |
| 其中：1.基金申购款                             | 100,462,096.02                   | -421,801.74    | 100,040,294.28    |
| 2.基金赎回款                                | -1,398,700,382.90                | 9,930,772.17   | -1,388,769,610.73 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                | -15,097,002.82 | -15,097,002.82    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 211,461,995.65                   | 1,359,297.90   | 212,821,293.55    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 基金基本情况

华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督

管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1178 号《关于准予华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式，存续期限为不定期。本基金自 2017 年 9 月 26 日至 2017 年 10 月 10 日共募集 1,509,999,000.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2017）验字第 60739337\_A27 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2017 年 10 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,510,183,555.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 184,555.67 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债和公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易可转债）的纯债部分、可交换债券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值

为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息



收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

3、基金买卖债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

4、存款利息收入不征收增值税。

5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

6、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 6,790,466.05            | 1,536,444.20             |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |

|      |              |              |
|------|--------------|--------------|
| 其他存款 | -            | -            |
| 合计   | 6,790,466.05 | 1,536,444.20 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |                  |              |
|---------------|-------|--------------------------|------------------|--------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                        | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 342,001,321.51           | 341,729,000.00   | -272,321.51  |
|               | 银行间市场 | 859,069,579.03           | 864,177,000.00   | 5,107,420.97 |
|               | 合计    | 1,201,070,900.54         | 1,205,906,000.00 | 4,835,099.46 |
| 资产支持证券        |       | 21,939,322.66            | 21,902,000.00    | -37,322.66   |
| 基金            |       | -                        | -                | -            |
| 其他            |       | -                        | -                | -            |
| 合计            |       | 1,223,010,223.20         | 1,227,808,000.00 | 4,797,776.80 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                  |              |
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                        | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 9,989,885.48             | 9,999,000.00     | 9,114.52     |
|               | 银行间市场 | 248,819,942.42           | 249,208,000.00   | 388,057.58   |
|               | 合计    | 258,809,827.90           | 259,207,000.00   | 397,172.10   |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                | -            |
| 基金            |       | -                        | -                | -            |
| 其他            |       | -                        | -                | -            |
| 合计            |       | 258,809,827.90           | 259,207,000.00   | 397,172.10   |

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,446.72                | 160.72                   |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 3,528.03                | 14.19                    |
| 应收债券利息     | 20,512,675.01           | 3,279,680.97             |
| 应收资产支持证券利息 | 301,571.39              | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 2.42                    | 3.52                     |
| 合计         | 20,820,223.57           | 3,279,859.40             |

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 13,489.30               | 14,395.16                |
| 合计          | 13,489.30               | 14,395.16                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 170,000.00              | 170,000.00               |
| 合计          | 170,000.00              | 170,000.00               |

#### 7.4.7.9 实收基金

华夏鼎诺三个月定期开放债券 A

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                |
|------|-----------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末 | 211,431,434.55              | 211,431,434.55 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购          | 798,731,856.97  | 798,731,856.97  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -201,479,013.28 | -201,479,013.28 |
| 本期末           | 808,684,278.24  | 808,684,278.24  |

## 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |           |
|---------------|-----------------------------|-----------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额      |
| 上年度末          | 30,561.10                   | 30,561.10 |
| 本期申购          | 314.89                      | 314.89    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,193.66                   | -3,193.66 |
| 本期末           | 27,682.33                   | 27,682.33 |

## 7.4.7.10 未分配利润

## 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 1,571,274.23   | -212,171.06   | 1,359,103.17   |
| 本期利润           | 23,681,060.61  | 4,400,501.81  | 28,081,562.42  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,607,386.76   | -1,853,476.32 | 753,910.44     |
| 其中：基金申购款       | 3,752,386.34   | -2,434,063.16 | 1,318,323.18   |
| 基金赎回款          | -1,144,999.58  | 580,586.84    | -564,412.74    |
| 本期已分配利润        | -26,213,835.20 | -             | -26,213,835.20 |
| 本期末            | 1,645,886.40   | 2,334,854.43  | 3,980,740.83   |

## 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分    | 未实现部分  | 未分配利润合计  |
|----------------|----------|--------|----------|
| 上年度末           | 225.42   | -30.69 | 194.73   |
| 本期利润           | 1,009.11 | 102.89 | 1,112.00 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -74.40   | 9.28   | -65.12   |
| 其中：基金申购款       | 3.48     | 0.63   | 4.11     |
| 基金赎回款          | -77.88   | 8.65   | -69.23   |
| 本期已分配利润        | -826.35  | -      | -826.35  |
| 本期末            | 333.78   | 81.48  | 415.26   |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                 | 上年度可比期间            |
|----|--------------------|--------------------|
|    | 2021年1月1日至2021年12月 | 2020年1月1日至2020年12月 |
|    |                    |                    |

|           | 31 日       | 月 31 日     |
|-----------|------------|------------|
| 活期存款利息收入  | 60,758.42  | 364,539.95 |
| 定期存款利息收入  | -          | -          |
| 其他存款利息收入  | -          | -          |
| 结算备付金利息收入 | 105,803.25 | 16,945.79  |
| 其他        | 138.32     | 156.40     |
| 合计        | 166,699.99 | 381,642.14 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,202,265,765.37      | 3,357,871,698.37      |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,178,439,216.41      | 3,332,350,415.70      |
| 减：应收利息总额               | 25,771,141.26         | 41,927,053.32         |
| 买卖债券差价收入               | -1,944,592.30         | -16,405,770.65        |

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 卖出资产支持证券成交总额   | 61,176,357.91         | 80,061,030.14         |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 59,947,454.20         | 80,003,156.16         |
| 减：应收利息总额       | 1,490,357.91          | 104,363.84            |
| 资产支持证券投资收益     | -261,454.20           | -46,489.86            |

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

无。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 4,400,604.70                | 203,397.31                       |
| ——股票投资                 | -                           | -                                |
| ——债券投资                 | 4,437,927.36                | 203,397.31                       |
| ——资产支持证券投资             | -37,322.66                  | -                                |
| ——基金投资                 | -                           | -                                |
| ——贵金属投资                | -                           | -                                |
| ——其他                   | -                           | -                                |
| 2.衍生工具                 | -                           | -                                |
| ——权证投资                 | -                           | -                                |
| 3.其他                   | -                           | -                                |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                           | -                                |
| 合计                     | 4,400,604.70                | 203,397.31                       |

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                           | 0.10                             |
| 合计      | -                           | 0.10                             |

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,422.64                    | 343.00                           |
| 银行间市场交易费用 | 21,490.00                   | 39,025.00                        |
| 合计        | 23,912.64                   | 39,368.00                        |

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用     | 50,000.00                   | 50,000.00                        |
| 信息披露费    | 120,000.00                  | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金  | -                           | -                                |
| 银行费用     | 20,526.56                   | 27,298.59                        |
| 银行间账户维护费 | 34,350.00                   | 36,000.00                        |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 其他 | 1,400.00   | 1,200.00   |
| 合计 | 226,276.56 | 234,498.59 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                           | 与本基金的关系  |
|---------------------------------|----------|
| 华夏基金管理有限公司                      | 基金管理人    |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）          | 基金托管人    |
| 中信证券股份有限公司（“中信证券”）              | 基金管理人的股东 |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 基金管理人的股东 |
| POWER CORPORATION OF CANADA     | 基金管理人的股东 |
| 天津海鹏科技咨询有限公司                    | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的比例 |
| 中信证券  | 271,015,600.00              | 44.20%       | -                                | -            |

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬



7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|-----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,031,154.91                | 2,759,282.80                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5.45                        | 0.87                             |

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 677,051.60                  | 919,760.99                       |

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日      |                 |       |
|----------------|----------------------------------|-----------------|-------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                 |       |
|                | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A                  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 合计    |
| 华夏基金管理有限公司     | -                                | 24.15           | 24.15 |
| 合计             | -                                | 24.15           | 24.15 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                 |       |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                 |       |
|                | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A                  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 合计    |

|                |   |      |      |
|----------------|---|------|------|
| 华夏基金管理有限<br>公司 | - | 2.02 | 2.02 |
| 合计             | - | 2.02 | 2.02 |

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                        | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                    | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                    |
|---------------------------|-----------------------------|--------------------|----------------------------------|--------------------|
|                           | 华夏鼎诺三个月定期<br>开放债券A          | 华夏鼎诺三个月定<br>期开放债券C | 华夏鼎诺三个月定<br>期开放债券A               | 华夏鼎诺三个月<br>定期开放债券C |
| 期初持有的基金<br>份额             | 10,001,222.34               | -                  | 10,001,222.34                    | -                  |
| 期间申购/买入总<br>份额            | -                           | -                  | -                                | -                  |
| 期间因拆分变动<br>份额             | -                           | -                  | -                                | -                  |
| 减：期间赎回/卖出<br>总份额          | -                           | -                  | -                                | -                  |
| 期末持有的基金<br>份额             | 10,001,222.34               | -                  | 10,001,222.34                    | -                  |
| 期末持有的基金<br>份额占基金总份<br>额比例 | 1.24%                       | -                  | 4.73%                            | -                  |

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |            |
|------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|            | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 中国工商银行活期存款 | 6,790,466.05                | 60,758.42 | 1,536,444.20                     | 364,539.95 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

华夏鼎诺三个月定期开放债券 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份基金<br>份额分<br>红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资<br>形式发<br>放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------------|---------------|-------------------|---------------|----|
| 1  | 2021-03-18 | 2021-03-18 | 0.100                 | 2,114,213.84  | -                 | 2,114,213.84  | -  |
| 2  | 2021-07-26 | 2021-07-26 | 0.168                 | 13,586,725.84 | 0.20              | 13,586,726.04 | -  |
| 3  | 2021-12-23 | 2021-12-23 | 0.130                 | 10,512,895.20 | 0.12              | 10,512,895.32 | -  |
| 合计 |            |            | 0.398                 | 26,213,834.88 | 0.32              | 26,213,835.20 | -  |

华夏鼎诺三个月定期开放债券 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份基金<br>份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2021-07-26 | 2021-07-26 | 0.168                 | 289.79       | 178.55        | 468.34       | -  |
| 2  | 2021-12-23 | 2021-12-23 | 0.130                 | 217.56       | 140.45        | 358.01       | -  |
| 合计 |            |            | 0.298                 | 507.35       | 319.00        | 826.35       | -  |

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券质押式正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 234,907,007.64 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|-----------|-------------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 210002    | 21 付息国债<br>02     | 2022-01-06 | 101.82     | 579,000.00   | 58,953,780.00  |
| 2028047   | 20 交通银行<br>02     | 2022-01-07 | 101.44     | 550,000.00   | 55,792,000.00  |
| 102100558 | 21 新长宁<br>MTN001  | 2022-01-07 | 102.11     | 400,000.00   | 40,844,000.00  |
| 101900333 | 19 国开投<br>MTN001A | 2022-01-07 | 100.79     | 400,000.00   | 40,316,000.00  |
| 088018    | 08 大唐债            | 2022-01-07 | 105.17     | 200,000.00   | 21,034,000.00  |
| 2128012   | 21 浦发银行<br>01     | 2022-01-07 | 102.01     | 134,000.00   | 13,669,340.00  |
| 200002    | 20 付息国债<br>02     | 2022-01-10 | 100.01     | 212,000.00   | 21,202,120.00  |
| 合计        |                   |            |            | 2,475,000.00 | 251,811,240.00 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 230,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管

理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年12月31日  | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 合计               |
|---------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 银行存款                | 6,790,466.05   | -              | -             | 6,790,466.05     |
| 结算备付金               | 7,127,243.13   | -              | -             | 7,127,243.13     |
| 结算保证金               | 4,912.08       | -              | -             | 4,912.08         |
| 债券投资                | 312,148,000.00 | 811,882,000.00 | 81,876,000.00 | 1,205,906,000.00 |
| 资产支持证券              | 21,902,000.00  | -              | -             | 21,902,000.00    |
| 买入返售金融资产            | -              | -              | -             | -                |
| 应收直销申购款             | -              | -              | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款           | 464,907,007.64 | -              | -             | 464,907,007.64   |
| 上年度末<br>2020年12月31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 合计               |
| 银行存款                | 1,536,444.20   | -              | -             | 1,536,444.20     |
| 结算备付金               | 28,588.22      | -              | -             | 28,588.22        |
| 结算保证金               | 7,138.71       | -              | -             | 7,138.71         |
| 债券投资                | 158,986,000.00 | 100,221,000.00 | -             | 259,207,000.00   |
| 资产支持证券              | -              | -              | -             | -                |
| 买入返售金融资产            | -              | -              | -             | -                |
| 应收直销申购款             | -              | -              | -             | -                |
| 卖出回购金融资产款           | 50,938,523.59  | -              | -             | 50,938,523.59    |

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|--------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 利率下降 25 个基点        | 7,671,679.83                    | 880,917.90               |
|    | 利率上升 25 个基点        | -7,560,403.71                   | -873,559.37              |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

截至本期末，本基金主要持有利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### （1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### （2）各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 0 元，第二层次的余额为 1,227,808,000.00 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 0 元，第二层次的余额为 259,207,000.00 元，第三层次的余额为 0 元。）

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(5) 新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中:股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,227,808,000.00 | 96.06        |
|    | 其中:债券             | 1,205,906,000.00 | 94.34        |
|    | 资产支持证券            | 21,902,000.00    | 1.71         |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 13,917,709.18    | 1.09         |
| 8  | 其他各项资产            | 36,496,071.93    | 2.86         |
| 9  | 合计                | 1,278,221,781.11 | 100.00       |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。



8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 242,820,000.00   | 29.88        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 107,482,000.00   | 13.23        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,404,000.00    | 1.28         |
| 4  | 企业债券      | 373,224,000.00   | 45.92        |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,016,000.00    | 2.46         |
| 6  | 中期票据      | 462,364,000.00   | 56.89        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,205,906,000.00 | 148.38       |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称       | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 210002    | 21 付息国债 02 | 600,000 | 61,092,000.00 | 7.52         |
| 2  | 200002    | 20 付息国债 02 | 600,000 | 60,006,000.00 | 7.38         |
| 3  | 2028047   | 20 交通银行 02 | 550,000 | 55,792,000.00 | 6.87         |
| 4  | 210009    | 21 付息国债 09 | 500,000 | 50,830,000.00 | 6.25         |
| 5  | 101901011 | 19 中铝集     | 500,000 | 50,625,000.00 | 6.23         |

|  |  |        |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|
|  |  | MTN004 |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量(份)      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 159972 | 19 资本 1A | 200,000.00 | 20,092,000.00 | 2.47         |
| 2  | 137140 | 狮桥 25A1  | 200,000.00 | 1,810,000.00  | 0.22         |

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额       |
|----|-------|----------|
| 1  | 存出保证金 | 4,912.08 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 15,670,936.28 |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 20,820,223.57 |
| 5 | 应收申购款   | -             |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 36,496,071.93 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别            | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额    | 持有人结构          |         |       |        |
|-----------------|----------|--------------|----------------|---------|-------|--------|
|                 |          |              | 机构投资者          |         | 个人投资者 |        |
|                 |          |              | 持有份额           | 占总份额比例  | 持有份额  | 占总份额比例 |
| 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | 183      | 4,419,039.77 | 808,684,278.24 | 100.00% | -     | -      |
| 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | 44       | 629.14       | 27,682.33      | 100.00% | -     | -      |
| 合计              | 227      | 3,562,607.76 | 808,711,960.57 | 100.00% | -     | -      |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别            | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 A | -         | -        |
|                  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券 C | -         | -        |
|                  | 合计              | -         | -        |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 份额级别                | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|---------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 华夏鼎诺三个月定期开<br>放债券 A | 0                 |
|                                    | 华夏鼎诺三个月定期开<br>放债券 C | 0                 |
|                                    | 合计                  | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开<br>放式基金                | 华夏鼎诺三个月定期开<br>放债券 A | 0                 |
|                                    | 华夏鼎诺三个月定期开<br>放债券 C | 0                 |
|                                    | 合计                  | 0                 |

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2020 年 10 月 13 日，华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 华夏鼎诺三个月定期开放债券<br>A | 华夏鼎诺三个月定期开放债<br>券 C |
|---------------------------------|--------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 10 月 13 日）基金份额总额 | 1,510,183,555.67   | -                   |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 211,431,434.55     | 30,561.10           |
| 本报告期基金总申购份额                     | 798,731,856.97     | 314.89              |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 201,479,013.28     | 3,193.66            |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                  | -                   |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 808,684,278.24     | 27,682.33           |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再担任华夏基金管理有限公司高级

管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 5 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|        |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券   | 6      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中国银河证券 | 4      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了长江证券、东北证券、东方证券、方正证券、国盛证券、国泰君安证券、华安证券、上海证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、粤开证券、招商证券、中金财富、中金公司、中泰证券、中投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，国泰君安证券、中信证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，国金证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易           |              | 回购交易              |              |
|--------|----------------|--------------|-------------------|--------------|
|        | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的比例 |
| 中信证券   | 271,015,600.00 | 44.20%       | -                 | -            |
| 中国银河证券 | 189,286,300.00 | 30.87%       | 18,903,300,000.00 | 99.60%       |
| 国金证券   | 142,807,964.23 | 23.29%       | 76,600,000.00     | 0.40%        |
| 中信建投证券 | 9,987,700.00   | 1.63%        | -                 | -            |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式       | 法定披露日期     |
|----|--|--------------|------------|
| 1  | 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                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-09 |
| 2  | 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                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-15 |
| 3  | 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         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-20 |
| 4  | 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                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-27 |
| 5  | 华夏基金管理有限公司关于调整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的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-01-29 |
| 6  | 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                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-02-01 |

|    |   |              |            |
|----|---|--------------|------------|
| 7  | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-02-24 |
| 8  | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-04 |
| 9  | 华夏基金管理有限公司关于限制华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金申购业务的公告          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-04 |
| 10 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-12 |
| 11 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第三次分红公告                        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-17 |
| 12 | 华夏基金管理有限公司关于华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束开放期并进入下一封闭期的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-03-26 |
| 13 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-02 |
| 14 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-07 |
| 15 | 华夏基金管理有限公司公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-09 |
| 16 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-09 |
| 17 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-21 |
| 18 | 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 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-04-28 |
| 19 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-08 |
| 20 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-12 |
| 21 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-13 |
| 22 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-19 |
| 23 | 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                            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-25 |
| 24 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-05-28 |
| 25 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-04 |
| 26 | 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                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-09 |

|    |  |              |            |
|----|--|--------------|------------|
| 27 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-23 |
| 28 | 华夏基金管理有限公司关于限制华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金申购业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-23 |
| 29 | 华夏基金管理有限公司关于华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金延长开放期的公告  | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-02 |
| 30 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第四次分红公告               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-24 |
| 31 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-09-29 |
| 32 | 华夏基金管理有限公司关于限制华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金申购业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-09-29 |
| 33 | 华夏基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-11-02 |
| 34 | 华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第五次分红公告               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-22 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2021-03-22 至 2021-03-23  | 10,001,222.34  | -              | -              | 10,001,222.34  | 1.24%  |
|  | 2              | 2021-03-24 至 2021-12-31  | -              | 798,682,279.92 | -              | 798,682,279.92 | 98.76% |
|  | 3              | 2021-01-01 至 2021-03-21  | 201,419,545.41 | -              | 201,419,545.41 | -              | -      |
| 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二二年三月三十日