

华夏鼎融债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	13
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 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.....	49
7.7 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.....	49
7.8 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.....	49
7.9 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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏鼎融债券型证券投资基金	
基金简称	华夏鼎融债券	
基金主代码	003301	
交易代码	003301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 7 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	99,798,227.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
下属分级基金的交易代码	003301	003302
报告期末下属分级基金的份额总额	99,469,401.91 份	328,825.17 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	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、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中债综合指数。
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	李申
	联系电话	400-818-6666	021-60637102
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637111
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
本期已实现收益	-2,183,820.91	-7,962.72
本期利润	-3,265,520.73	-13,396.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0327	-0.0373
本期加权平均净值利润率	-2.55%	-2.97%
本期基金份额净值增长率	-2.48%	-2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
期末可供分配利润	27,503,115.72	81,518.35
期末可供分配基金份额利润	0.2765	0.2479
期末基金资产净值	127,525,571.73	412,118.49
期末基金份额净值	1.2821	1.2533
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
基金份额累计净值增长率	28.21%	25.33%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

华夏鼎融债券 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
过去一个月	0.68%	0.09%	-0.24%	0.03%	0.92%	0.06%
过去三个月	0.31%	0.14%	0.29%	0.04%	0.02%	0.10%
过去六个月	-2.48%	0.23%	0.38%	0.05%	-2.86%	0.18%
过去一年	2.51%	0.24%	1.83%	0.05%	0.68%	0.19%
过去三年	20.58%	0.28%	3.53%	0.06%	17.05%	0.22%
自基金合同生效起至今	28.21%	0.22%	2.50%	0.07%	25.71%	0.15%

华夏鼎融债券 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
过去一个月	0.64%	0.09%	-0.24%	0.03%	0.88%	0.06%
过去三个月	0.20%	0.14%	0.29%	0.04%	-0.09%	0.10%
过去六个月	-2.68%	0.23%	0.38%	0.05%	-3.06%	0.18%
过去一年	2.10%	0.24%	1.83%	0.05%	0.27%	0.19%
过去三年	19.13%	0.28%	3.53%	0.06%	15.60%	0.22%
自基金合同生效起至今	25.33%	0.22%	2.50%	0.07%	22.83%	0.15%

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

华夏鼎融债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 11 月 7 日至 2022 年 6 月 30 日)

华夏鼎融债券 A



华夏鼎融债券 C



§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,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,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 2022 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:在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188;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 2/14;在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77;在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52;在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53;在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134;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 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905;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 59/286;在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品:在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25;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 3/13;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 7/98;在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642;在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；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 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排序第 15/60；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 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；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 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，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）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，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优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”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）及基金经理助理的简介

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		
张弘弢	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2016-12-29	2022-03-07	22 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券

				<p>投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间）、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理（2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理（2019 年 2 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理（2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013</p>
--	--	--	--	--

					年 3 月 28 日至 2021 年 5 月 27 日期间)等。
宋洋	本基金的基金经理	2022-03-07	-	12 年	博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2018 年 4 月 10 日至 2019 年 2 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 8 月 29 日至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理 (2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 3 月 24 日至 2021 年 8 月 3 日期间)等。
孙蒙	本基金的基金经理助理	2018-02-09	2022-06-15	8 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
陆晓天	本基金的基金经理助理	2021-08-13	-	4 年	硕士。2018 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任投资研究部研究员。

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。

4.2 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 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 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，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；其余均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。

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

上半年，国内外宏观环境经历了大幅波动，股市走出 V 型，债市则始终横盘震荡。一季度初期主要是海外事件性冲击，在高通胀压力下，美联储鹰派超预期转向，带动美债利率从 1.5% 一路向上突破 2%，使得其他资产面临资金流出压力，全球股市下跌。随后俄乌冲突爆发，战争、制裁等导致原油、金属、农产品等周期品因供给约束而大幅上涨，在避险、紧缩担忧、成本担忧等多重压力下，全球股市再度下挫。进入 3 月，国内地产信用风险蔓延至销售和社融，股指在 3 月 15 日探至新的低点，直到金稳委盘中发声，一一回应市场担忧，才得以触底反弹。一季度股市风格也更偏向于低估值、防御性和底部反转的板块，如大金融、生猪养殖、服务消费等。转债由于整体估值偏高，也跟随出现较大幅度回撤。

然而上海疫情影响持续时间大幅超过预期，导致华东地区供应链和正常生产受到较大冲击，4 月末北京也开始受到疫情扩散影响，这导致 4-5 月国内各项经济数据遭遇了类似 2020 年武汉疫情的冲击明显下滑。加之 3、4 月降息预期落空，市场对稳增长意愿和全年经济目标也产生怀疑，股市进一步下挫，探至历史低点估值。同期海外则受困于高通胀，加息步伐加快，股市出现普跌，压制了风险偏好。但 4 月末政治局会议再度定调稳增长后，迎来了新一轮的宽松政策，包括降 lpr、各地因城施策降低购房利率和购房限制、乘用车购置税减免等，5 月末总理召开稳经济大盘万人大会，使得市场信心继续恢复。5 月的社融总量在政策推动下呈现超预期的修复。6 月，上海和北京快速展开疫后复工复产，主要经济指标底部回升。6 月末，国内疫情防控政策迎来优化调整，缩短隔离时间、

细化风险地区定义和防控标准。总体上，股市从 4 月末开始底部持续修复，主要领涨的还是前期景气度高的和有政策加码的行业如光伏、锂电、汽车等。债市上半年整体都维持区间震荡走势，在“弱现实、强预期”中反复，波动性远不及股票。

报告期内，本基金股票端在对宏观周期的把握和中观的指导下，自下而上采用与反脆弱相结合的系统化主观投资策略进行组合的投资管理，仓位方面，大部分时间组合保持了较为稳定的水平，并结合组合的风险预算较一季度进行了小幅加仓操作，日常运作过程中更多的精力放在胜率和赔率框架下以组合投资为抓手，做好股票细分资产的策略配置以期增厚组合收益，同时做好组合的波动和回撤管理；债券端组合在中性仓位、中性久期下运作。转债部分在中性仓位运作，配置低估值大盘转债，风格上总体偏向金融、稳定、低估值的板块，根据对大势判断，调整成长行业暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值为 1.2821 元，本报告期份额净值增长率为-2.48%；华夏鼎融债券 C 基金份额净值为 1.2533 元，本报告期份额净值增长率为-2.68%，同期业绩比较基准增长率为 0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，6 月超预期的社融总量和结构特征，表明经济内生动能并未失速，经济周期虽仍在筑底，也仍待增量政策发力，但本轮经济底部已基本探明，有望于年末前后迎来经济周期拐点，景气度向上的行业也将逐步增加。从股票市场的投资风格上来看，预计在美债利率三季度筑顶缓解成长压力，四季度可能回落的大背景下带动成长优于价值；叠加经济预期环比改善、信用利差收敛带动小盘跑赢大盘，风格上成长占优于价值，小盘占优于大盘，整体上相对看好小盘成长风格。转债资产方面，当前可转债估值重回到年内高位，这制约了转债的盈亏比，我们将积极寻找结构性机会，并对潜在的引致估值波动的因素（信用风险和高溢价的转债），做好择券上的策略应对。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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。会计师事务所对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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	1,015,280.10	1,014,379.57
结算备付金		622,039.49	1,012,197.24
存出保证金		9,867.16	2,929.52
交易性金融资产	6.4.7.2	136,271,549.81	151,465,355.93
其中：股票投资		9,372,193.26	13,359,530.73
基金投资		-	-
债券投资		126,899,356.55	138,105,825.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,960,527.90
资产总计		137,918,736.56	155,455,390.16
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,700,000.00	23,300,000.00
应付清算款		1,460.31	14,005.53
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,859.30	66,730.08
应付托管费		20,953.11	22,243.36
应付销售服务费		136.05	181.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,381.73	14,713.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	192,255.84	196,044.64
负债合计		9,981,046.34	23,613,918.67
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	99,798,227.08	100,289,880.88
未分配利润	6.4.7.8	28,139,463.14	31,551,590.61
净资产合计		127,937,690.22	131,841,471.49
负债和净资产总计		137,918,736.56	155,455,390.16

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值 1.2821 元，华夏鼎融债券

C 基金份额净值 1.2533 元；华夏鼎融债券基金份额总额 99,798,227.08 份（其中 A 类 99,469,401.91 份，C 类 328,825.17 份）。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,474,869.10	5,135,478.73
1.利息收入		23,252.88	2,328,175.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,252.88	21,595.54
债券利息收入		-	2,306,165.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	414.71
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,411,240.24	278,486.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,003,955.81	-16,716.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,522,023.10	205,912.78
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	70,692.47	89,290.02
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,087,133.25	2,528,775.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	251.51	40.47
减：二、营业总支出		804,047.78	960,194.11
1.管理人报酬		382,217.72	359,677.94
2.托管费		127,405.94	119,892.67

3.销售服务费		896.95	516.83
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		185,062.59	219,769.04
其中：卖出回购金融资产支出		185,062.59	219,769.04
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		3,315.24	6,263.90
8.其他费用	6.4.7.18	105,149.34	254,073.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,278,916.88	4,175,284.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,278,916.88	4,175,284.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,278,916.88	4,175,284.62

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	100,289,880.88	-	31,551,590.61	131,841,471.49
二、本期期初净资产（基金净值）	100,289,880.88	-	31,551,590.61	131,841,471.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-491,653.80	-	-3,412,127.47	-3,903,781.27
（一）、综合收益总额	-	-	-3,278,916.88	-3,278,916.88
（二）、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）	-491,653.80	-	-133,210.59	-624,864.39
其中：1.基金申购	943,415.94	-	261,761.37	1,205,177.31

款				
2.基金赎回款	-1,435,069.74	-	-394,971.96	-1,830,041.70
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	99,798,227.08	-	28,139,463.14	127,937,690.22
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	99,250,624.57	-	20,704,568.46	119,955,193.03
二、本期期初净资产(基金净值)	99,250,624.57	-	20,704,568.46	119,955,193.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	328,654.93	-	4,251,749.92	4,580,404.85
(一)、综合收益总额	-	-	4,175,284.62	4,175,284.62
(二)、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)	328,654.93	-	76,465.30	405,120.23
其中：1.基金申购款	638,111.61	-	141,089.01	779,200.62
2.基金赎回款	-309,456.68	-	-64,623.71	-374,080.39
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	99,579,279.50	-	24,956,318.38	124,535,597.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏鼎融债券型证券投资基金(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[2016]1963 号《关于准予华夏鼎融债券型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》、《华夏鼎融债券型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。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期。本基金自 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 11 月 2 日共募集 501,730,574.69 元(不含认购资金利息),业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(16)第 1052 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 501,853,084.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 122,510.26 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏鼎融债券型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股票(含存托凭证)、债券、货币市场工具、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)。本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债和公司债(含中小企业私募债券)、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)、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 1,014,379.57 元、1,012,197.24 元、2,929.52 元和 1,960,527.90 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 1,014,497.12 元、1,012,698.29 元、2,930.95 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 151,465,355.93 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 153,425,263.80 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 23,300,000.00 元、14,005.53 元、66,730.08 元、22,243.36 元、181.46 元、36,548.79 元、-10,504.15 元和 170,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 23,289,495.85 元、14,005.53 元、66,730.08 元、22,243.36 元、181.46 元、36,548.79 元、0.00 元和 170,000.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，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) 基金买卖股票、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) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,015,280.10
等于：本金	1,015,176.07

加：应计利息	104.03
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,015,280.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,743,084.09	-	9,372,193.26	629,109.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	569,784.68	43,019,528.18	421,701.48
	银行间市场	82,669,626.36	83,879,828.37	248,573.64
	合计	124,697,668.38	1,531,413.05	670,275.12
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	133,440,752.47	1,531,413.05	136,271,549.81	1,299,384.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	-
应付交易费用	57,953.28
其中：交易所市场	57,428.28
银行间市场	525.00
应付利息	-
预提费用	134,302.56
合计	192,255.84

6.4.7.7 实收基金

华夏鼎融债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	99,872,474.00	99,872,474.00
本期申购	899,137.33	899,137.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,302,209.42	-1,302,209.42
本期末	99,469,401.91	99,469,401.91

华夏鼎融债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	417,406.88	417,406.88
本期申购	44,278.61	44,278.61
本期赎回（以“-”号填列）	-132,860.32	-132,860.32
本期末	328,825.17	328,825.17

6.4.7.8 未分配利润

华夏鼎融债券 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
本期期初	29,799,757.88	1,631,714.37	31,431,472.25
本期利润	-2,183,820.91	-1,081,699.82	-3,265,520.73

本期基金份额交易产生的变动数	-112,821.25	3,039.55	-109,781.70
其中：基金申购款	259,606.80	-9,566.82	250,039.98
基金赎回款	-372,428.05	12,606.37	-359,821.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,503,115.72	553,054.10	28,056,169.82

华夏鼎融债券 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
本期期初	113,449.94	6,668.42	120,118.36
本期利润	-7,962.72	-5,433.43	-13,396.15
本期基金份额交易产生的变动数	-23,968.87	539.98	-23,428.89
其中：基金申购款	11,604.43	116.96	11,721.39
基金赎回款	-35,573.30	423.02	-35,150.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,518.35	1,774.97	83,293.32

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,950.58
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	15,244.40
其他	57.90
合计	23,252.88

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	53,953,063.21
减：卖出股票成本总额	57,813,945.83
减：交易费用	143,073.19
买卖股票差价收入	-4,003,955.81

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,037,816.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	484,206.44
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,522,023.10

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	188,086,206.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	185,213,717.66
减：应计利息总额	2,382,262.18
减：交易费用	6,020.03
买卖债券差价收入	484,206.44

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	70,692.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	70,692.47

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-1,087,133.25
——股票投资	683,215.35
——债券投资	-1,770,348.60
——资产支持证券投资	-
——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	-1,087,133.25

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	251.51
基金申购费收入	-
合计	251.51

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,246.78
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	105,149.34

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	72,733,815.03	68.48%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	-	-	27,602,894.54	33.34%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期债券回购成交总

		交总额的 比例		额的比例
中信证券	-	-	1,078,300,000.00	60.92%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	53,189.81	66.82%	53,189.81	82.34%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	382,217.72	359,677.94
其中：支付销售机构的客户维护费	174.19	-

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 0.60%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×0.60%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30
----	-------------------------	--------------------------------

	30日	日
当期发生的基金应支付的托管费	127,405.94	119,892.67

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
关联方名称	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	合计
华夏基金管理 有限公司	-	896.95	896.95
合计	-	896.95	896.95
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
关联方名称	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	合计
华夏基金管理 有限公司	-	516.83	516.83
合计	-	516.83	516.83

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 0.40%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×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	1,015,280.10	7,950.58	1,111,831.18	4,358.31

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688425	铁建重工	网上申购	500	1,435.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 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 9,700,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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之内。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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“6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,015,280.10	-	-	1,015,280.10
结算备付金	622,039.49	-	-	622,039.49
结算保证金	9,867.16	-	-	9,867.16
债券投资	47,344,491.57	59,179,720.23	20,375,144.75	126,899,356.55
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	9,700,000.00	-	-	9,700,000.00
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,014,379.57	-	-	1,014,379.57
结算备付金	1,012,197.24	-	-	1,012,197.24
结算保证金	2,929.52	-	-	2,929.52
债券投资	30,174,826.20	91,290,000.00	16,640,999.00	138,105,825.20
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	23,300,000.00	-	-	23,300,000.00

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。

6.4.13.4.1.2 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 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	770,135.93	1,104,999.07
	利率上升 25 个基点	-758,492.88	-1,076,634.49

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,372,193.26	7.33	13,359,530.73	10.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,652,131.77	5.98	12,571,826.20	9.54
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,024,325.03	13.31	25,931,356.93	19.67

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证转债指数×80%+沪深 300 指数×20%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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-1,077,883.51	-2,097,069.87
	+5%	1,077,883.51	2,097,069.87

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	15,521,368.72
第二层次	120,750,181.09
第三层次	-
合计	136,271,549.81

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	9,372,193.26	6.80
	其中：股票	9,372,193.26	6.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,899,356.55	92.01
	其中：债券	126,899,356.55	92.01
	资产支持证券	-	-
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	1,637,319.59	1.19
8	其他各项资产	9,867.16	0.01
9	合计	137,918,736.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	16,666.00	0.01
B	采矿业	405,387.00	0.32
C	制造业	7,072,871.92	5.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	319,923.32	0.25
E	建筑业	24,685.60	0.02
F	批发和零售业	158,191.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	290,080.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	317,322.53	0.25
J	金融业	241,466.39	0.19
K	房地产业	149,520.20	0.12
L	租赁和商务服务业	15,085.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	124,353.30	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	129,089.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	79,304.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	18,359.00	0.01
S	综合	9,889.00	0.01
	合计	9,372,193.26	7.33

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300390	天华超净	1,900	166,060.00	0.13
2	300432	富临精工	5,000	110,000.00	0.09
3	688123	聚辰股份	900	95,868.00	0.07
4	300037	新宙邦	1,740	91,454.40	0.07
5	002466	天齐锂业	700	87,360.00	0.07
6	300363	博腾股份	1,100	85,789.00	0.07
7	002996	顺博合金	5,600	85,120.00	0.07
8	600348	华阳股份	5,400	83,484.00	0.07
9	002801	微光股份	2,700	80,595.00	0.06
10	605368	蓝天燃气	6,300	79,380.00	0.06
11	300938	信测标准	2,670	73,932.30	0.06
12	300327	中颖电子	1,470	73,220.70	0.06
13	600096	云天化	2,300	72,404.00	0.06
14	300373	扬杰科技	1,000	71,250.00	0.06

15	688303	大全能源	1,000	68,320.00	0.05
16	688707	振华新材	900	68,103.00	0.05
17	002182	云海金属	2,700	67,716.00	0.05
18	601156	东航物流	3,400	67,320.00	0.05
19	000893	亚钾国际	1,900	65,379.00	0.05
20	688396	华润微	1,100	64,977.00	0.05
21	601677	明泰铝业	2,720	64,736.00	0.05
22	600273	嘉化能源	5,900	64,074.00	0.05
23	000729	燕京啤酒	6,600	63,756.00	0.05
24	300130	新国都	5,000	61,300.00	0.05
25	000553	安道麦 A	5,000	60,550.00	0.05
26	300196	长海股份	3,100	58,559.00	0.05
27	000629	攀钢钒钛	15,100	57,380.00	0.04
28	688033	天宜上佳	2,700	57,348.00	0.04
29	000708	中信特钢	2,800	56,420.00	0.04
30	688668	鼎通科技	800	56,272.00	0.04
31	003038	鑫铂股份	1,100	55,440.00	0.04
32	600160	巨化股份	4,200	55,230.00	0.04
33	600888	新疆众和	6,000	55,200.00	0.04
34	605198	德利股份	3,000	54,720.00	0.04
35	300160	秀强股份	6,600	53,658.00	0.04
36	600863	内蒙华电	14,700	53,655.00	0.04
37	300750	宁德时代	100	53,400.00	0.04
38	000559	万向钱潮	8,900	52,866.00	0.04
39	002539	云图控股	3,300	52,767.00	0.04
40	688385	复旦微电	800	52,152.00	0.04
41	600809	山西汾酒	160	51,968.00	0.04
42	600867	通化东宝	5,000	51,700.00	0.04
43	605169	洪通燃气	4,532	51,030.32	0.04
44	000552	靖远煤电	11,700	50,427.00	0.04
45	002908	德生科技	4,360	50,314.40	0.04
46	603128	华贸物流	5,000	50,150.00	0.04
47	300855	图南股份	1,200	50,148.00	0.04
48	300604	长川科技	1,100	49,665.00	0.04
49	000519	中兵红箭	1,700	49,555.00	0.04
50	300068	南都电源	3,200	49,088.00	0.04
51	600438	通威股份	800	47,888.00	0.04
52	601899	紫金矿业	5,100	47,583.00	0.04
53	600884	杉杉股份	1,600	47,552.00	0.04
54	600018	上港集团	8,100	47,223.00	0.04
55	002916	深南电路	500	46,855.00	0.04
56	300926	博俊科技	2,000	46,700.00	0.04
57	603392	万泰生物	300	46,590.00	0.04

58	002312	川发龙蟒	2,600	44,876.00	0.04
59	601728	中国电信	11,700	43,641.00	0.03
60	300803	指南针	700	41,146.00	0.03
61	000625	长安汽车	2,340	40,528.80	0.03
62	600905	三峡能源	6,400	40,256.00	0.03
63	688191	智洋创新	2,300	39,100.00	0.03
64	688556	高测股份	480	38,736.00	0.03
65	002332	仙琚制药	3,800	37,316.00	0.03
66	002709	天赐材料	600	37,236.00	0.03
67	000651	格力电器	1,100	37,092.00	0.03
68	002304	洋河股份	200	36,630.00	0.03
69	600389	江山股份	600	36,438.00	0.03
70	601717	郑煤机	2,500	36,025.00	0.03
71	003019	宸展光电	1,380	34,831.20	0.03
72	300122	智飞生物	300	33,303.00	0.03
73	603882	金域医学	400	33,020.00	0.03
74	603198	迎驾贡酒	500	32,570.00	0.03
75	300398	飞凯材料	1,400	32,004.00	0.03
76	688360	德马科技	1,200	31,944.00	0.02
77	000933	神火股份	2,400	31,392.00	0.02
78	002986	宇新股份	1,320	30,993.60	0.02
79	300911	亿田智能	400	30,740.00	0.02
80	002932	明德生物	447	30,646.32	0.02
81	300481	濮阳惠成	1,300	30,550.00	0.02
82	871396	常辅股份	3,740	30,368.80	0.02
83	002841	视源股份	400	30,128.00	0.02
84	600163	中闽能源	3,500	29,575.00	0.02
85	603277	银都股份	1,400	29,554.00	0.02
86	002129	TCL 中环	500	29,445.00	0.02
87	688559	海目星	400	29,080.00	0.02
88	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.02
89	605123	派克新材	200	28,144.00	0.02
90	688378	奥来德	720	28,087.20	0.02
91	300059	东方财富	1,100	27,940.00	0.02
92	833523	德瑞锂电	1,800	27,882.00	0.02
93	002371	北方华创	100	27,712.00	0.02
94	603713	密尔克卫	200	27,340.00	0.02
95	601615	明阳智能	800	27,040.00	0.02
96	688050	爱博医疗	120	26,904.00	0.02
97	002241	歌尔股份	800	26,880.00	0.02
98	603688	石英股份	200	26,522.00	0.02
99	301018	申菱环境	1,000	25,810.00	0.02
100	002555	三七互娱	1,200	25,476.00	0.02

101	002549	凯美特气	1,400	25,340.00	0.02
102	600481	双良节能	1,500	25,275.00	0.02
103	688800	瑞可达	200	25,262.00	0.02
104	605008	长鸿高科	1,800	25,236.00	0.02
105	002993	奥海科技	600	24,936.00	0.02
106	605369	拱东医疗	200	24,840.00	0.02
107	301035	润丰股份	300	24,735.00	0.02
108	688767	博拓生物	400	24,664.00	0.02
109	000568	泸州老窖	100	24,654.00	0.02
110	600916	中国黄金	2,100	24,570.00	0.02
111	301060	兰卫医学	700	24,514.00	0.02
112	300837	浙矿股份	600	24,330.00	0.02
113	000333	美的集团	400	24,156.00	0.02
114	605599	莱百股份	2,200	23,936.00	0.02
115	605208	永茂泰	1,510	23,903.30	0.02
116	301004	嘉益股份	1,000	23,660.00	0.02
117	000661	长春高新	100	23,342.00	0.02
118	603931	格林达	1,160	23,316.00	0.02
119	601088	中国神华	700	23,310.00	0.02
120	600195	中牧股份	1,900	23,294.00	0.02
121	688575	亚辉龙	1,100	23,012.00	0.02
122	601568	北元集团	3,600	22,824.00	0.02
123	688981	中芯国际	500	22,585.00	0.02
124	600233	圆通速递	1,100	22,429.00	0.02
125	603155	新亚强	600	22,356.00	0.02
126	603565	中谷物流	1,400	22,218.00	0.02
127	600256	广汇能源	2,100	22,134.00	0.02
128	002459	晶澳科技	280	22,092.00	0.02
129	688569	铁科轨道	1,200	22,020.00	0.02
130	603529	爱玛科技	420	21,999.60	0.02
131	603185	上机数控	140	21,838.60	0.02
132	300244	迪安诊断	700	21,770.00	0.02
133	002597	金禾实业	500	21,665.00	0.02
134	002216	三全食品	1,100	21,549.00	0.02
135	600269	赣粤高速	6,200	21,514.00	0.02
136	001203	大中矿业	1,900	21,470.00	0.02
137	600063	皖维高新	2,800	21,224.00	0.02
138	601225	陕西煤业	1,000	21,180.00	0.02
139	601077	渝农商行	5,700	21,090.00	0.02
140	000001	平安银行	1,400	20,972.00	0.02
141	300268	佳沃食品	700	20,825.00	0.02
142	603867	新化股份	600	20,382.00	0.02
143	000858	五粮液	100	20,193.00	0.02

144	601898	中煤能源	1,900	19,722.00	0.02
145	002902	铭普光磁	1,400	19,432.00	0.02
146	603656	泰禾智能	1,300	19,214.00	0.02
147	600873	梅花生物	1,700	19,176.00	0.01
148	002001	新和成	840	19,160.40	0.01
149	600639	浦东金桥	1,400	19,026.00	0.01
150	002049	紫光国微	100	18,972.00	0.01
151	836077	吉林碳谷	300	18,690.00	0.01
152	300861	美畅股份	200	18,538.00	0.01
153	002738	中矿资源	200	18,522.00	0.01
154	603619	中曼石油	900	18,513.00	0.01
155	000968	蓝焰控股	1,700	17,765.00	0.01
156	000895	双汇发展	600	17,580.00	0.01
157	600546	山煤国际	900	17,514.00	0.01
158	600176	中国巨石	1,000	17,410.00	0.01
159	000983	山西焦煤	1,300	17,407.00	0.01
160	603236	移远通信	130	17,375.80	0.01
161	000877	天山股份	1,400	17,220.00	0.01
162	688330	宏力达	200	17,198.00	0.01
163	300606	金太阳	1,400	17,010.00	0.01
164	603790	雅运股份	1,600	17,008.00	0.01
165	000935	四川双马	700	16,954.00	0.01
166	603948	建业股份	600	16,890.00	0.01
167	000876	新希望	1,100	16,830.00	0.01
168	002331	皖通科技	2,300	16,721.00	0.01
169	003004	声迅股份	800	16,688.00	0.01
170	002787	华源控股	2,800	16,324.00	0.01
171	300482	万孚生物	400	16,284.00	0.01
172	301061	匠心家居	480	16,272.00	0.01
173	300195	长荣股份	2,900	16,269.00	0.01
174	300321	同大股份	1,000	16,220.00	0.01
175	688350	富淼科技	900	16,191.00	0.01
176	688690	纳微科技	200	16,162.00	0.01
177	001979	招商蛇口	1,200	16,116.00	0.01
178	603615	茶花股份	2,100	16,086.00	0.01
179	003033	征和工业	600	16,080.00	0.01
180	003036	泰坦股份	1,500	16,065.00	0.01
181	300445	康斯特	1,400	16,044.00	0.01
182	603709	中源家居	1,000	15,940.00	0.01
183	002899	英派斯	1,300	15,938.00	0.01
184	605298	必得科技	1,170	15,912.00	0.01
185	300836	佰奥智能	650	15,860.00	0.01
186	300583	赛托生物	700	15,820.00	0.01

187	300218	安利股份	1,100	15,697.00	0.01
188	000593	德龙汇能	2,800	15,680.00	0.01
188	603499	翔港科技	2,000	15,680.00	0.01
190	603321	梅轮电梯	2,400	15,624.00	0.01
191	002494	华斯股份	3,700	15,614.00	0.01
192	002574	明牌珠宝	3,200	15,584.00	0.01
193	300689	澄天伟业	900	15,579.00	0.01
194	300899	上海凯鑫	700	15,540.00	0.01
195	603586	金麒麟	1,200	15,504.00	0.01
195	300963	中洲特材	800	15,504.00	0.01
197	600302	标准股份	3,100	15,500.00	0.01
198	002193	如意集团	2,600	15,470.00	0.01
199	688090	瑞松科技	500	15,465.00	0.01
200	300615	欣天科技	1,400	15,428.00	0.01
201	605081	太和水	900	15,408.00	0.01
201	605001	威奥股份	2,400	15,408.00	0.01
201	300462	华铭智能	1,600	15,408.00	0.01
204	300555	路通视信	2,000	15,400.00	0.01
205	300573	兴齐眼药	100	15,332.00	0.01
206	603369	今世缘	300	15,300.00	0.01
206	300594	朗进科技	900	15,300.00	0.01
208	002295	精艺股份	2,300	15,295.00	0.01
209	002756	永兴材料	100	15,221.00	0.01
210	688215	瑞晟智能	500	15,215.00	0.01
211	688679	通源环境	1,400	15,204.00	0.01
212	600325	华发股份	2,000	15,140.00	0.01
213	830946	森萱医药	1,400	15,008.00	0.01
214	300639	凯普生物	700	14,966.00	0.01
215	300839	博汇股份	1,100	14,839.00	0.01
216	605088	冠盛股份	1,100	14,828.00	0.01
217	002920	德赛西威	100	14,800.00	0.01
218	688178	万德斯	800	14,704.00	0.01
219	603878	武进不锈	2,300	14,674.00	0.01
220	688379	华光新材	900	14,589.00	0.01
221	688571	杭华股份	2,000	14,560.00	0.01
222	002415	海康威视	400	14,480.00	0.01
223	300625	三雄极光	1,200	14,424.00	0.01
224	601857	中国石油	2,700	14,310.00	0.01
225	688466	金科环境	900	14,130.00	0.01
225	600328	中盐化工	600	14,130.00	0.01
227	600111	北方稀土	400	14,064.00	0.01
228	002229	鸿博股份	2,100	13,986.00	0.01
229	600901	江苏租赁	2,700	13,851.00	0.01

230	000733	振华科技	100	13,597.00	0.01
231	002895	川恒股份	400	13,524.00	0.01
232	300316	晶盛机电	200	13,518.00	0.01
233	000517	荣安地产	4,200	13,356.00	0.01
234	300360	炬华科技	1,000	13,340.00	0.01
235	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.01
236	600064	南京高科	1,200	13,200.00	0.01
237	002645	华宏科技	600	13,092.00	0.01
238	430489	佳先股份	1,860	12,945.60	0.01
239	002472	双环传动	400	12,736.00	0.01
240	002860	星帅尔	840	12,440.40	0.01
241	603180	金牌厨柜	400	12,384.00	0.01
242	600048	保利发展	700	12,222.00	0.01
243	688606	奥泰生物	100	12,162.00	0.01
244	002938	鹏鼎控股	400	12,084.00	0.01
245	002240	盛新锂能	200	12,072.00	0.01
246	000792	盐湖股份	400	11,984.00	0.01
247	600188	兖矿能源	300	11,844.00	0.01
248	002655	共达电声	800	11,824.00	0.01
249	603260	合盛硅业	100	11,796.00	0.01
250	605033	美邦股份	500	11,595.00	0.01
251	600559	老白干酒	400	11,476.00	0.01
252	002126	银轮股份	1,000	11,450.00	0.01
253	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.01
254	603078	江化微	400	11,428.00	0.01
255	600690	海尔智家	400	10,984.00	0.01
256	300828	锐新科技	650	10,920.00	0.01
257	002170	芭田股份	1,700	10,897.00	0.01
258	002410	广联达	200	10,888.00	0.01
259	002955	鸿合科技	500	10,885.00	0.01
260	603773	沃格光电	680	10,880.00	0.01
261	601666	平煤股份	800	10,872.00	0.01
262	300499	高澜股份	900	10,863.00	0.01
263	688699	明微电子	100	10,846.00	0.01
264	300346	南大光电	300	10,794.00	0.01
265	300824	北鼎股份	900	10,674.00	0.01
266	002869	金溢科技	700	10,556.00	0.01
267	300119	瑞普生物	600	10,494.00	0.01
268	300167	迪威迅	2,000	10,440.00	0.01
269	603259	药明康德	100	10,399.00	0.01
270	002968	新大正	420	10,357.20	0.01
271	600557	康缘药业	700	10,283.00	0.01
272	300491	通合科技	700	10,269.00	0.01

273	002420	毅昌科技	1,400	10,220.00	0.01
274	002567	唐人神	1,200	10,212.00	0.01
275	002979	雷赛智能	500	10,210.00	0.01
276	603085	天成自控	1,200	10,128.00	0.01
277	601668	中国建筑	1,900	10,108.00	0.01
278	003003	天元股份	1,100	10,065.00	0.01
279	300214	日科化学	1,300	10,062.00	0.01
280	603583	捷昌驱动	300	10,017.00	0.01
281	002809	红墙股份	1,000	10,000.00	0.01
282	603399	吉翔股份	400	9,964.00	0.01
283	300620	光库科技	300	9,957.00	0.01
284	600429	三元股份	1,900	9,956.00	0.01
285	002724	海洋王	800	9,944.00	0.01
286	600673	东阳光	1,100	9,889.00	0.01
287	002930	宏川智慧	500	9,885.00	0.01
288	300652	雷迪克	400	9,788.00	0.01
289	600713	南京医药	2,000	9,740.00	0.01
289	301057	汇隆新材	400	9,740.00	0.01
291	600309	万华化学	100	9,699.00	0.01
292	002029	七匹狼	1,800	9,684.00	0.01
293	000918	嘉凯城	4,200	9,660.00	0.01
294	300354	东华测试	300	9,645.00	0.01
295	002261	拓维信息	1,500	9,615.00	0.01
296	300739	明阳电路	600	9,612.00	0.01
297	601956	东贝集团	1,500	9,585.00	0.01
298	301077	星华反光	400	9,564.00	0.01
299	300797	钢研纳克	700	9,534.00	0.01
300	603818	曲美家居	1,000	9,500.00	0.01
301	002913	奥士康	300	9,495.00	0.01
302	600337	美克家居	3,100	9,486.00	0.01
303	600250	南纺股份	1,700	9,367.00	0.01
304	600326	西藏天路	1,600	9,360.00	0.01
305	300182	捷成股份	1,700	9,350.00	0.01
306	002984	森麒麟	300	9,333.00	0.01
307	002573	清新环境	1,600	9,296.00	0.01
308	300275	梅安森	700	9,289.00	0.01
309	600929	雪天盐业	1,000	9,280.00	0.01
310	605228	神通科技	1,200	9,276.00	0.01
311	301069	凯盛新材	200	9,222.00	0.01
312	001965	招商公路	1,200	9,156.00	0.01
313	300425	中建环能	1,900	9,082.00	0.01
314	002734	利民股份	900	9,054.00	0.01
315	601208	东材科技	700	9,044.00	0.01

316	002795	永和智控	1,100	9,042.00	0.01
317	300654	世纪天鸿	1,100	9,009.00	0.01
318	605366	宏柏新材	300	8,937.00	0.01
319	603379	三美股份	400	8,900.00	0.01
320	605151	西上海	500	8,880.00	0.01
320	000567	海德股份	600	8,880.00	0.01
322	688078	龙软科技	179	8,855.13	0.01
323	600057	厦门象屿	1,000	8,790.00	0.01
324	300568	星源材质	300	8,712.00	0.01
325	002948	青岛银行	2,400	8,688.00	0.01
326	603279	景津装备	280	8,682.80	0.01
327	300787	海能实业	300	8,682.00	0.01
328	600596	新安股份	400	8,660.00	0.01
329	601933	永辉超市	2,000	8,560.00	0.01
330	000630	铜陵有色	2,600	8,476.00	0.01
331	600036	招商银行	200	8,440.00	0.01
332	002041	登海种业	400	8,436.00	0.01
333	002517	恺英网络	1,500	8,370.00	0.01
334	301099	雅创电子	100	8,348.00	0.01
335	000915	华特达因	200	8,270.00	0.01
336	300571	平治信息	200	8,260.00	0.01
337	002050	三花智控	300	8,244.00	0.01
338	603968	醋化股份	400	8,240.00	0.01
339	300087	荃银高科	500	8,230.00	0.01
340	000598	兴蓉环境	1,600	8,176.00	0.01
341	002759	天际股份	300	8,154.00	0.01
342	600566	济川药业	300	8,148.00	0.01
343	003010	若羽臣	500	8,125.00	0.01
344	300818	耐普矿机	200	8,112.00	0.01
345	600584	长电科技	300	8,100.00	0.01
346	002286	保龄宝	700	8,015.00	0.01
347	002545	东方铁塔	700	7,966.00	0.01
348	300533	冰川网络	300	7,890.00	0.01
349	603599	广信股份	280	7,882.00	0.01
350	603706	东方环宇	500	7,820.00	0.01
351	300801	泰和科技	300	7,806.00	0.01
352	603585	苏利股份	400	7,772.00	0.01
353	300909	汇创达	300	7,713.00	0.01
354	002768	国恩股份	300	7,704.00	0.01
354	300532	今天国际	600	7,704.00	0.01
356	000617	中油资本	1,600	7,696.00	0.01
357	000063	中兴通讯	300	7,659.00	0.01
358	002061	浙江交科	1,100	7,656.00	0.01

358	002736	国信证券	800	7,656.00	0.01
360	601636	旗滨集团	600	7,650.00	0.01
361	603556	海兴电力	500	7,610.00	0.01
362	600295	鄂尔多斯	420	7,581.00	0.01
363	002832	比音勒芬	300	7,560.00	0.01
364	002091	江苏国泰	700	7,525.00	0.01
365	002191	劲嘉股份	700	7,504.00	0.01
366	600668	尖峰集团	500	7,390.00	0.01
367	002947	恒铭达	400	7,360.00	0.01
368	603165	荣晟环保	500	7,300.00	0.01
369	000680	山推股份	1,400	7,280.00	0.01
369	000731	四川美丰	800	7,280.00	0.01
371	002133	广宇集团	2,000	7,260.00	0.01
372	603359	东珠生态	600	7,248.00	0.01
373	002648	卫星化学	280	7,238.00	0.01
374	300170	汉得信息	800	7,208.00	0.01
375	601231	环旭电子	500	7,180.00	0.01
376	600073	上海梅林	900	7,173.00	0.01
377	002142	宁波银行	200	7,162.00	0.01
378	601001	晋控煤业	400	7,100.00	0.01
379	601601	中国太保	300	7,059.00	0.01
380	002658	雪迪龙	1,000	7,030.00	0.01
381	002315	焦点科技	500	7,010.00	0.01
382	002833	弘亚数控	420	7,005.60	0.01
383	002267	陕天然气	1,000	6,990.00	0.01
384	600173	卧龙地产	1,200	6,960.00	0.01
384	002043	兔宝宝	600	6,960.00	0.01
386	603889	新澳股份	1,100	6,952.00	0.01
387	002989	中天精装	480	6,921.60	0.01
388	600425	青松建化	1,700	6,919.00	0.01
389	603368	柳药集团	400	6,888.00	0.01
390	002727	一心堂	300	6,879.00	0.01
391	601128	常熟银行	900	6,876.00	0.01
392	002788	鹭燕医药	800	6,872.00	0.01
393	600649	城投控股	1,600	6,848.00	0.01
394	601216	君正集团	1,400	6,832.00	0.01
395	600787	中储股份	1,200	6,828.00	0.01
396	600648	外高桥	500	6,800.00	0.01
397	000848	承德露露	700	6,776.00	0.01
398	000011	深物业 A	500	6,755.00	0.01
399	600383	金地集团	500	6,720.00	0.01
400	000937	冀中能源	900	6,714.00	0.01
401	000960	锡业股份	400	6,708.00	0.01

402	603018	华设集团	700	6,685.00	0.01
403	601838	成都银行	400	6,632.00	0.01
404	600177	雅戈尔	1,000	6,630.00	0.01
405	300732	设研院	600	6,618.00	0.01
406	601229	上海银行	1,000	6,550.00	0.01
407	300813	泰林生物	160	6,510.40	0.01
408	600461	洪城环境	800	6,472.00	0.01
409	603393	新天然气	300	6,408.00	0.01
410	300418	昆仑万维	400	6,400.00	0.01
411	000650	仁和药业	1,000	6,380.00	0.00
412	002911	佛燃能源	700	6,356.00	0.00
413	601233	桐昆股份	400	6,352.00	0.00
414	000062	深圳华强	500	6,350.00	0.00
415	000401	冀东水泥	600	6,312.00	0.00
416	002818	富森美	500	6,295.00	0.00
417	601009	南京银行	600	6,252.00	0.00
418	600618	氯碱化工	500	6,250.00	0.00
419	002867	周大生	400	6,212.00	0.00
420	601398	工商银行	1,300	6,201.00	0.00
421	002233	塔牌集团	700	6,195.00	0.00
422	600908	无锡银行	1,100	6,193.00	0.00
423	002034	旺能环境	300	6,159.00	0.00
424	002078	太阳纸业	500	6,155.00	0.00
425	002884	凌霄泵业	300	6,147.00	0.00
426	000932	华菱钢铁	1,200	6,108.00	0.00
427	300677	英科医疗	240	6,086.40	0.00
428	600449	宁夏建材	500	6,085.00	0.00
429	300371	汇中股份	500	6,070.00	0.00
430	603177	德创环保	400	6,060.00	0.00
431	601298	青岛港	1,100	6,017.00	0.00
432	002601	龙佰集团	300	6,015.00	0.00
433	002432	九安医疗	100	6,006.00	0.00
434	603387	基蛋生物	420	5,989.20	0.00
435	600282	南钢股份	1,900	5,985.00	0.00
436	601166	兴业银行	300	5,970.00	0.00
437	600802	福建水泥	900	5,949.00	0.00
438	002064	华峰化学	700	5,908.00	0.00
439	600007	中国国贸	400	5,900.00	0.00
440	603699	纽威股份	700	5,887.00	0.00
441	600426	华鲁恒升	200	5,840.00	0.00
442	002687	乔治白	1,305	5,833.35	0.00
443	600985	淮北矿业	400	5,824.00	0.00
444	002757	南兴股份	500	5,815.00	0.00

445	601997	贵阳银行	1,000	5,810.00	0.00
446	600479	千金药业	600	5,784.00	0.00
447	600681	百川能源	1,300	5,759.00	0.00
448	603357	设计总院	500	5,740.00	0.00
449	601577	长沙银行	723	5,733.39	0.00
450	002128	电投能源	400	5,728.00	0.00
451	002145	中核钛白	800	5,704.00	0.00
452	600398	海澜之家	1,200	5,700.00	0.00
453	600727	鲁北化工	700	5,684.00	0.00
454	000717	韶钢松山	1,600	5,600.00	0.00
455	002110	三钢闽光	900	5,481.00	0.00
456	600511	国药股份	200	5,356.00	0.00
457	000301	东方盛虹	300	5,073.00	0.00
458	002180	纳思达	100	5,062.00	0.00
459	600507	方大特钢	700	4,893.00	0.00
460	002318	久立特材	300	4,797.00	0.00
461	601318	中国平安	100	4,669.00	0.00
462	688589	力合微	100	4,482.00	0.00
463	688577	浙海德曼	100	4,106.00	0.00
464	688329	艾隆科技	109	3,526.15	0.00
465	688558	国盛智科	100	3,439.00	0.00
466	688135	利扬芯片	100	3,148.00	0.00
467	688519	南亚新材	100	2,833.00	0.00
468	002088	鲁阳节能	112	2,357.60	0.00
469	300146	汤臣倍健	81	1,753.65	0.00
470	300991	创益通	120	1,725.60	0.00
471	003816	中国广核	600	1,680.00	0.00
472	301008	宏昌科技	60	1,621.80	0.00
473	300705	九典制药	60	1,309.20	0.00
474	601985	中国核电	100	686.00	0.00
475	688600	皖仪科技	27	349.11	0.00
476	688055	龙腾光电	6	32.34	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	467,614.00	0.35
2	603799	华友钴业	360,139.00	0.27
3	600519	贵州茅台	346,409.00	0.26
4	603026	石大胜华	343,663.00	0.26
5	603392	万泰生物	331,508.00	0.25

6	603948	建业股份	329,958.00	0.25
7	300390	天华超净	323,120.00	0.25
8	300363	博腾股份	291,120.00	0.22
9	002008	大族激光	288,413.00	0.22
10	300347	泰格医药	284,356.00	0.22
11	002539	云图控股	277,362.00	0.21
12	002601	龙佰集团	269,735.00	0.20
13	000630	铜陵有色	263,257.00	0.20
14	300124	汇川技术	263,028.00	0.20
15	000893	亚钾国际	259,973.00	0.20
16	000552	靖远煤电	256,866.00	0.19
17	600438	通威股份	253,066.00	0.19
18	002182	云海金属	241,046.00	0.18
19	603290	斯达半导	235,988.00	0.18
20	601899	紫金矿业	233,617.00	0.18

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	733,986.00	0.56
2	300750	宁德时代	544,509.00	0.41
3	601166	兴业银行	503,902.00	0.38
4	601318	中国平安	491,342.00	0.37
5	600887	伊利股份	429,862.00	0.33
6	600438	通威股份	429,352.00	0.33
7	600036	招商银行	376,290.00	0.29
8	603392	万泰生物	368,745.22	0.28
9	603290	斯达半导	312,843.00	0.24
10	300059	东方财富	310,787.00	0.24
11	603799	华友钴业	310,533.00	0.24
12	603948	建业股份	297,646.00	0.23
13	002539	云图控股	295,073.00	0.22
14	601899	紫金矿业	283,117.00	0.21
15	603026	石大胜华	277,186.00	0.21
16	002008	大族激光	275,101.00	0.21
17	300661	圣邦股份	272,951.00	0.21
18	300124	汇川技术	267,939.00	0.20
19	000733	振华科技	266,937.00	0.20
20	603260	合盛硅业	266,528.00	0.20

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	53,143,393.01
卖出股票收入（成交）总额	53,953,063.21

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	33,123,167.36	25.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,067,117.81	39.92
	其中：政策性金融债	51,067,117.81	39.92
4	企业债券	22,647,998.46	17.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	12,408,941.15	9.70
7	可转债（可交换债）	7,652,131.77	5.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	126,899,356.55	99.19

7.6 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	210011	21 付息国债 11	100,000	10,272,046.58	8.03
2	210210	21 国开 10	100,000	10,243,421.92	8.01
3	210313	21 进出 13	100,000	10,229,967.12	8.00
4	210218	21 国开 18	100,000	10,220,523.29	7.99
5	210303	21 进出 03	100,000	10,206,424.66	7.98

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	9,867.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,867.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132015	18 中油 EB	943,112.47	0.74
2	110079	杭银转债	638,940.30	0.50
3	132018	G 三峡 EB1	559,843.84	0.44
4	110053	苏银转债	554,309.71	0.43
5	113052	兴业转债	524,856.21	0.41
6	110061	川投转债	491,779.73	0.38
7	110075	南航转债	419,511.21	0.33

8	113622	杭叉转债	327,792.46	0.26
9	128134	鸿路转债	290,835.92	0.23
10	113585	寿仙转债	218,810.04	0.17
11	128107	交科转债	218,501.48	0.17
12	127020	中金转债	211,344.02	0.17
13	123059	银信转债	205,153.48	0.16
14	128144	利民转债	202,850.29	0.16
15	110072	广汇转债	198,615.84	0.16
16	113637	华翔转债	2,851.75	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
华夏鼎融债券 A	201	494,872.65	98,744,919.85	99.27%	724,482.06	0.73%
华夏鼎融债券 C	49	6,710.72	-	-	328,825.17	100.00%
合计	250	399,192.91	98,744,919.85	98.94%	1,053,307.23	1.06%

8.2 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	华夏鼎融债券 A	1,979.66	0.00%
	华夏鼎融债券 C	332.84	0.10%
	合计	2,312.50	0.00%

8.3 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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏鼎融债券 A	0
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本	华夏鼎融债券 A	0

开放式基金	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 7 日）基金份额总额	501,374,679.32	478,405.63
本报告期期初基金份额总额	99,872,474.00	417,406.88
本报告期基金总申购份额	899,137.33	44,278.61
减：本报告期基金总赎回份额	1,302,209.42	132,860.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	99,469,401.91	328,825.17

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中航证券	1	47,046,146.26	43.93%	34,404.55	43.24%	-
东方证券	2	43,746,781.66	40.85%	31,992.16	40.21%	-
平安证券	1	8,009,293.52	7.48%	7,458.74	9.37%	-
天风证券	2	7,363,284.80	6.88%	5,384.27	6.77%	-
中金公司	2	549,670.72	0.51%	164.95	0.21%	-
华创证券	1	369,068.52	0.34%	159.17	0.20%	-
国泰君安证券	1	4,085.24	0.00%	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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。

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有较强的全方位金融服务能力和水平：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；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、国海证券、国盛证券、国信证券、海通证券、华西证券、汇丰前海证券、江海证券、开源证券、民生证券、申万宏源证券、万联证券、西部证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中泰证券、中信建投证券、中信证券、中信证券（华南）、中信证券（华南）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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中航证券	13,465,411.60	19.31%	1,246,350,000.00	72.78%	-	-	-	-
东方证券	18,690,745.88	26.81%	45,900,000.00	2.68%	-	-	-	-
平安证券	2,813,642.30	4.04%	26,700,000.00	1.56%	-	-	-	-
天风证券	8,006,194.20	11.48%	302,800,000.00	17.68%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	1,569,078.00	2.25%	90,850,000.00	5.30%	-	-	-	-
国泰君安证券	3,047,490.00	4.37%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	22,124,400.00	31.73%	-	-	-	-	-	-

10.8 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调整华夏鼎融债券型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	2022-03-09
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
3	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25
4	华夏鼎融债券型证券投资基金开放日常转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-29
5	华夏鼎融债券型证券投资基金取消申购业务上限的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2022-01-01 至 2022-06-30	98,615,000.00	-	-	98,615,000.00	98.81%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>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。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏鼎融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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二二年八月三十日