

华夏鼎融债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

§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 2023 年 8 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。

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 2023 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.....	12
§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.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
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.....	48
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.....	48
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.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§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	663,630,575.27 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	648,234,550.18 份	15,396,025.09 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	王小飞
	联系电话	021-6063 7103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637228
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
-------	-----	-----

2.5 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/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,539,350.45	14,227.87
本期利润	11,483,247.78	96,096.18
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0509
本期加权平均净值利润率	2.38%	4.55%
本期基金份额净值增长率	2.36%	2.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	20,885,550.27	1,759,795.71
期末可供分配基金份额利润	0.0322	0.1143
期末基金资产净值	673,519,534.95	17,284,880.25
期末基金份额净值	1.0390	1.1227
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	27.62%	24.28%

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	0.46%	0.12%	0.18%	0.05%	0.28%	0.07%
过去三个月	0.57%	0.13%	0.94%	0.04%	-0.37%	0.09%
过去六个月	2.36%	0.14%	1.22%	0.04%	1.14%	0.10%
过去一年	-0.46%	0.14%	1.35%	0.05%	-1.81%	0.09%
过去三年	12.18%	0.25%	2.99%	0.05%	9.19%	0.20%
自基金合同生效起至今	27.62%	0.21%	3.88%	0.07%	23.74%	0.14%

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	0.44%	0.13%	0.18%	0.05%	0.26%	0.08%
过去三个月	0.47%	0.13%	0.94%	0.04%	-0.47%	0.09%
过去六个月	2.18%	0.14%	1.22%	0.04%	0.96%	0.10%
过去一年	-0.84%	0.15%	1.35%	0.05%	-2.19%	0.10%
过去三年	10.85%	0.25%	2.99%	0.05%	7.86%	0.20%
自基金合同生效起至今	24.28%	0.21%	3.88%	0.07%	20.40%	0.14%

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 2023 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、青岛、武汉、沈阳设有分公司,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、首批个人养老金基金管理人、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、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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、公募 REITs 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、SmartBeta 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 2023 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:在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中,华夏保守养老一年持有混合(FOF)(A 类)排名第 1/59;在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中,华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中,华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11;在低碳环保行业股票型基金(A 类)中,华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10;在消费行业偏股型基金(A 类)中,华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66;在 QDII 混合基金(A 类)中,华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 3/43;在偏债型基金(A 类)中,华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619);在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中,华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440);在标准股票型基金(A 类)中,华夏智胜先锋股票(LOF)(A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317);在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中,华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214);在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中,华夏核心制造混合(A 类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

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)排名第 1/24、华夏收益债券（QDII）(A 类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A 类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A 类)排名前 7%(87/1228)；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名前 9%(32/376)；在普通债券型基金(二级)(A 类)中，华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品：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)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 2/132；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 1/110；在信用债指数债券型基金(A 类)中，华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/16；在 QDII 跨境股票 ETF 基金中，华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33；在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏恒生 ETF 联接(A 类)排名第 3/10；在主题指数股票 ETF 基金中，华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313)；在规模指数股票 ETF 基金中，华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 4/102；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中，华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中，华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报，将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面，2023 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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与华润银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦！”、“亲子财商 36 计”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		
宋洋	本基金的 基金经理	2022-03-07	-	13 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。
文世伦	本基金的 基金经理 助理	2023-03-28	-	6 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员，中融基金管理有限公司投资经理。2022 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。
席与焜	本基金的 基金经理 助理	2023-03-28	-	5 年	硕士。2018 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。
刘薇	本基金的 基金经理 助理	2022-11-21	2023-06-30	10 年	硕士。2013 年 1 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、基金经理助理。

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 90 次，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，债券市场走出牛市行情，久期策略优于票息策略。从持有期收益率的排序上看，30Y 国债和 20Y 国开持有期收益率最高，其次是 3-5Y 段的二永、普通信用债。5Y 国债明显跑输 5Y 国开，10Y 国开上半年表现也不及 10Y 国债。得益于第三产业的快速恢复，一季度经济表现偏好，逆周期政策继续发力的必要性下降。二季度逆周期政策开始逐步退出，经济修复的节奏趋缓，信贷需求趋弱，银行对基础货币的需求减少，在此背景下资金利率中枢大幅下行。长短端收益率下行，10Y 国债从 2.88 下行至 2.65 左右。信用债方面，随着理财产品发行恢复正常，存量理财规模企稳，去年底因赎回踩踏而走高的信用利差和等级利差快速修复。

权益市场上半年呈现先上后下的走势。一季度，伴随着去年年底疫情管控政策的边际放松，社会经济秩序逐步回归常态，叠加市场预期美联储紧缩货币政策接近尾声等海外金融因素的加持，市场迎来开门红。但在二季度，伴随着经济数据的逐步披露，权益市场经历了从“强预期+弱现实”到“弱现实+弱预期”预期交易的转换，而二季度又正逢领导班子换届以及大兴调研之风的时间窗口期，因此具体政策预期并不明朗，导致二季度回吐了部分一季度的涨幅。整体而言，权益市场上半年呈先上后下之势，继续处于市场存量博弈的环境中。行业与主题的轮动速度仍在历史高位，结构化分化严重。TMT 和国企改革投资主线轮番表现，消费、地产、新能源等行业遭遇一定幅度的回调。

报告期内，本基金股票端投资采取与反脆弱相结合的系统化主观投资策略作为核心策略，采取自下而上组合投资结合中观配置，自上而下的宏观框架指导的组合构建方式，采用多策略的管理方式，在全市场范畴内寻找兼顾安全边际和景气度、具备较高投资性价比的行业和个股，力争穿越市场不同风格与投资主线周期，积极管理产品的波动和回撤水平。二季度相对于一季度，边际增加了权益仓位敞口的暴露水平，在权益细分资产内部配置方面，考虑到全球主要经济体的利率水平、通胀水平、逆全球化进程都处于较高水平，因此增加了避险资产的配置比例，以期增强组合的反脆弱性。报告期内，以产品投资目标为指导，积极调整仓位管理策略为更为积极的偏左侧的仓位管理方式，以期更好地应对股票市场的波动。在债券上涨的过程中，动态微调二永等高波动资产的占比，以达到控制组合整体回撤和波动的目的。债券端报告期内维持了合理的仓位和久期，根据市场情况进行了一定的波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值为 1.0390 元，本报告期份额净值增长率为 2.36%；华夏鼎融债券 C 基金份额净值为 1.1227 元，本报告期份额净值增长率为 2.18%，同期业绩比较基准增长率为 1.22%。

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，债券市场方面，10Y 国债已经在 2.62% 附近的位置，低于 MLF 约 3bp。7 月在远洋展期、地产销售疲弱的状态下，资金没有进一步宽松，DR007 仍在 1.8%-1.9% 的水平。我们认为，若要突破前低 2.59%，需要基本面再度转弱或者新增宽货币政策的支持。前者需要密切跟踪高频数据，及时修正投资观点，后者本质上也是从基本面出发，但从经验上看，可以结合相关部门、领导的讲话综合判断，我们认为目前央行的表态偏向友好，全年实现 5% 左右仍需要货币政策配合，因此我们预计在经济数据出现明显拐点之前，宽货币政策仍可期待，利率仍有一定的下行空间。但是具体节奏不好把握，容易受到各类会议、理财申赎的影响。下半年组合会以票息策略为主，择机参与利率债波段增厚收益。

权益市场方面，目前股债商汇四类资产对未来经济增长已经较为充分定价了中国增长因子下修的悲观预期，而当前影响增长因子变化最关键的驱动是政策。后续伴随着以提振信心、达成全年经济增速目标为导向的稳增长组合拳的陆续出台，预计权益市场将处于底部水位不断抬升的存量博弈环境。当前依旧维持前期对权益市场的基准假设：“弱经济（经济弱复苏）+弱产业（产业景气度均不高）+较好的宏观流动性环境+产业政策频出”的判断，在这个基准假设下，以追逐具备确定性溢价的资产结构为主，体现在两个方面，一是产业趋势的确定性，如 AI+（长期技术革新和工业革命），二是永续经营、高现金流、高股息的资产。同时从复盘角度来看，在经济增长因子下修背景下，首

先由于增长因子偏弱导致市场缺乏动量效应，导致行业轮动的速度仍将处于高位水平，其次，经济增长因子偏弱叠加当前市场筹码结构，导致自 2021 年春节后以来小盘成长持续跑赢市场，公募基金暴露程度最高的大盘成长方向持续跑输市场。因此在基准假设下，待稳增长政策调控窗口期结束且出现市场风险偏好转向迹象时，小盘成长将是值得关注的投资机会。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,061,189.95	38,374,320.82
结算备付金		3,248,475.73	1,456,378.58
存出保证金		58,247.49	44,488.64
交易性金融资产	6.4.7.2	680,808,342.99	536,835,852.81
其中：股票投资		103,022,010.45	85,187,077.53
基金投资		-	-
债券投资		577,786,332.54	451,648,775.28
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	-3,561.64	-
应收清算款		3,331,947.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		691,504,641.71	576,711,040.85
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	55,007,843.84
应付清算款		-	10,006,713.69
应付赎回款		-	3,193,470.00
应付管理人报酬		291,911.42	348,415.47
应付托管费		97,303.82	116,138.50
应付销售服务费		3,041.13	739.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,396.63	16,804.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	291,573.51	298,195.43
负债合计		700,226.51	68,988,321.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	663,630,575.27	500,069,230.03
未分配利润	6.4.7.8	27,173,839.93	7,653,489.59
净资产合计		690,804,415.20	507,722,719.62
负债和净资产总计		691,504,641.71	576,711,040.85

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值 1.0390 元，华夏鼎融债券 C 基金份额净值 1.1227 元；华夏鼎融债券基金份额总额 663,630,575.27 份（其中 A 类 648,234,550.18 份，C 类 15,396,025.09 份）。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,056,090.38	-2,474,869.10
1.利息收入		80,561.37	23,252.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	56,494.38	23,252.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,066.99	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,949,721.50	-1,411,240.24
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,203,076.05	-4,003,955.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,893,618.87	2,522,023.10
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	1,259,178.68	70,692.47
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	10,025,765.64	-1,087,133.25
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	41.87	251.51
减：二、营业总支出		2,476,746.42	804,047.78
1.管理人报酬		1,445,562.37	382,217.72
2.托管费		481,854.19	127,405.94
3.销售服务费		3,961.10	896.95
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		429,822.93	185,062.59
其中：卖出回购金融资产支出		429,822.93	185,062.59
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		8,817.01	3,315.24
8.其他费用	6.4.7.18	106,728.82	105,149.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,579,343.96	-3,278,916.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,579,343.96	-3,278,916.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,579,343.96	-3,278,916.88

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	500,069,230.03	-	7,653,489.59	507,722,719.62
二、本期期初净资产（基金净值）	500,069,230.03	-	7,653,489.59	507,722,719.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	163,561,345.24	-	19,520,350.34	183,081,695.58

(一)、综合收益总额	-	-	11,579,343.96	11,579,343.96
(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)	163,561,345.24	-	7,941,006.38	171,502,351.62
其中: 1.基金申购款	283,636,181.32	-	11,447,579.34	295,083,760.66
2.基金赎回款	-120,074,836.08	-	-3,506,572.96	-123,581,409.04
(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)	663,630,575.27	-	27,173,839.93	690,804,415.20
项目	上年度可比期间 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.基金申购款	943,415.94	-	261,761.37	1,205,177.31
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

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、《资产管理产品相关会计处理规定》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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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

本基金本报告期无会计政策变更。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,061,189.95
等于：本金	4,056,661.72

加：应计利息	4,528.23
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	4,061,189.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	103,649,962.49	-	103,022,010.45	-627,952.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	166,867,477.47	2,536,353.21	169,679,347.81	275,517.13
	银行间市场	402,909,006.73	4,901,384.73	408,106,984.73	296,593.27
	合计	569,776,484.20	7,437,737.94	577,786,332.54	572,110.40
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	673,426,446.69	7,437,737.94	680,808,342.99	-55,841.64	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-3,561.64	-
银行间市场	-	-

合计	-3,561.64	-
----	-----------	---

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 2023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	157,270.95
其中：交易所市场	152,166.06
银行间市场	5,104.89
应付利息	-
预提费用	134,302.56
合计	291,573.51

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	498,093,037.40	498,093,037.40
本期申购	268,328,063.25	268,328,063.25
本期赎回（以“-”号填列）	-118,186,550.47	-118,186,550.47
本期末	648,234,550.18	648,234,550.18

华夏鼎融债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,976,192.63	1,976,192.63
本期申购	15,308,118.07	15,308,118.07
本期赎回（以“-”号填列）	-1,888,285.61	-1,888,285.61
本期末	15,396,025.09	15,396,025.09

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
上年度末	14,495,154.03	-7,036,972.91	7,458,181.12
本期利润	1,539,350.45	9,943,897.33	11,483,247.78
本期基金份额交易产生的变动数	4,851,045.79	1,492,510.08	6,343,555.87
其中：基金申购款	8,240,858.31	1,400,628.10	9,641,486.41
基金赎回款	-3,389,812.52	91,881.98	-3,297,930.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,885,550.27	4,399,434.50	25,284,984.77

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
上年度末	223,470.27	-28,161.80	195,308.47
本期利润	14,227.87	81,868.31	96,096.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,522,097.57	75,352.94	1,597,450.51
其中：基金申购款	1,732,485.51	73,607.42	1,806,092.93
基金赎回款	-210,387.94	1,745.52	-208,642.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,759,795.71	129,059.45	1,888,855.16

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	25,472.39
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	30,474.77
其他	547.22
合计	56,494.38

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	300,762,645.43
减：卖出股票成本总额	302,348,091.65
减：交易费用	617,629.83

买卖股票差价收入	-2,203,076.05
----------	---------------

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,431,423.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,537,804.23
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	4,893,618.87

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	378,482,978.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	375,316,006.43
减：应计利息总额	4,696,546.57
减：交易费用	8,229.68
买卖债券差价收入	-1,537,804.23

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
	2023年1月1日至2023年6月30日

股票投资产生的股利收益	1,259,178.68
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	1,259,178.68

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	10,025,765.64
——股票投资	2,471,123.90
——债券投资	7,554,641.74
——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	10,025,765.64

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	41.87
合计	41.87

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 2023年1月1日至2023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	3,824.16
银行间账户维护费	18,000.00
存托服务费	2.10

其他	600.00
合计	106,728.82

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

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

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

无。

6.4.10.1.2 债券回购交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-
------	---	---	---	---

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,445,562.37	382,217.72
其中：支付销售机构的客户维护费	184,943.21	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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	481,854.19	127,405.94

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	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	合计

费的各关联方名称			
华夏基金管理有限公司	-	985.27	985.27
合计	-	985.27	985.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	4,061,189.95	25,472.39	1,015,280.10	7,950.58

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 2023年1月1日至2023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	601916	浙商银行	配股发行	26,700	53,934.00
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	1,000	9,600.00
上年度可比期间 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	-	-	-	-	-

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（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023-06-12	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	242	24,200.00	24,202.02	期末估值单价为含息价格

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

无。

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	4,061,189.95	-	-	4,061,189.95
结算备付金	3,248,475.73	-	-	3,248,475.73
结算保证金	58,247.49	-	-	58,247.49
债券投资	93,319,925.89	464,324,767.31	20,141,639.34	577,786,332.54
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-3,561.64	-	-	-3,561.64
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	38,374,320.82	-	-	38,374,320.82
结算备付金	1,456,378.58	-	-	1,456,378.58
结算保证金	44,488.64	-	-	44,488.64
债券投资	134,192,885.97	313,932,868.49	3,523,020.82	451,648,775.28
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	55,007,843.84	-	-	55,007,843.84

款				
---	--	--	--	--

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	3,265,464.06	2,199,796.06
	利率上升 25 个基点	-3,230,905.46	-2,180,300.90

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	103,022,010.45	14.91	85,187,077.53	16.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	156,723.56	0.02	73,892.55	0.01
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	103,178,734.01	14.94	85,260,970.08	16.79

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-6,732,170.86	-7,303,378.14
	+5%	6,732,170.86	7,303,378.14

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	103,154,531.99
第二层次	577,653,811.00
第三层次	-
合计	680,808,342.99

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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日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 2023 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	103,022,010.45	14.90
	其中：股票	103,022,010.45	14.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	577,786,332.54	83.55
	其中：债券	577,786,332.54	83.55
	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	-3,561.64	0.00
	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	7,309,665.68	1.06
8	其他各项资产	3,390,194.68	0.49
9	合计	691,504,641.71	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	1,894,937.00	0.27
B	采矿业	7,416,543.00	1.07
C	制造业	58,695,393.89	8.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,865,124.40	0.70
E	建筑业	2,729,572.00	0.40
F	批发和零售业	2,139,828.56	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	2,326,365.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,071,543.60	0.88
J	金融业	8,134,675.00	1.18
K	房地产业	4,330,109.00	0.63
L	租赁和商务服务业	960,867.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	2,061,812.00	0.30

N	水利、环境和公共设施管理业	597,169.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	93,394.00	0.01
Q	卫生和社会工作	143,450.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	561,227.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	103,022,010.45	14.91

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	600547	山东黄金	60,200	1,413,496.00	0.20
2	000975	银泰黄金	99,200	1,160,640.00	0.17
3	600489	中金黄金	110,700	1,143,531.00	0.17
4	600060	海信视像	38,900	962,775.00	0.14
5	600674	川投能源	63,400	954,170.00	0.14
6	600066	宇通客车	57,200	843,128.00	0.12
7	300908	仲景食品	17,100	775,485.00	0.11
8	002422	科伦药业	25,900	768,712.00	0.11
9	600050	中国联通	144,300	692,640.00	0.10
10	605077	华康股份	26,100	691,128.00	0.10
11	601336	新华保险	18,500	680,245.00	0.10
12	601318	中国平安	14,300	663,520.00	0.10
13	603156	养元饮品	25,300	624,910.00	0.09
14	603129	春风动力	3,700	599,030.00	0.09
15	002367	康力电梯	65,000	593,450.00	0.09
16	002772	众兴菌业	50,800	574,040.00	0.08
17	600941	中国移动	6,100	569,130.00	0.08
18	601163	三角轮胎	35,400	561,798.00	0.08
19	300979	华利集团	11,400	555,636.00	0.08
20	600377	宁沪高速	55,700	547,531.00	0.08
21	603878	武进不锈	64,680	546,546.00	0.08
22	002233	塔牌集团	70,600	545,032.00	0.08
23	601619	嘉泽新能	119,600	544,180.00	0.08
24	002489	浙江永强	134,100	543,105.00	0.08
25	600251	冠农股份	59,800	539,994.00	0.08
26	603518	锦泓集团	47,300	536,855.00	0.08
27	002832	比音勒芬	15,100	534,691.00	0.08
28	000517	荣安地产	174,900	533,445.00	0.08
29	600035	楚天高速	129,700	529,176.00	0.08
30	000048	京基智农	27,100	528,992.00	0.08
31	000906	浙商中拓	58,700	523,604.00	0.08

32	600639	浦东金桥	42,000	521,220.00	0.08
33	600612	老凤祥	7,300	510,124.00	0.07
34	300888	稳健医疗	12,180	507,540.60	0.07
35	001914	招商积余	32,600	490,630.00	0.07
36	001979	招商蛇口	37,600	489,928.00	0.07
37	600729	重庆百货	15,300	481,032.00	0.07
38	601155	新城控股	33,300	479,853.00	0.07
39	600028	中国石化	75,200	478,272.00	0.07
40	600325	华发股份	48,500	477,725.00	0.07
41	300146	汤臣倍健	19,900	477,202.00	0.07
42	600642	申能股份	68,000	475,320.00	0.07
43	601857	中国石油	63,500	474,345.00	0.07
44	000937	冀中能源	74,200	473,396.00	0.07
45	600048	保利发展	36,300	472,989.00	0.07
46	002714	牧原股份	11,200	472,080.00	0.07
47	002448	中原内配	67,400	471,800.00	0.07
48	002404	嘉欣丝绸	69,900	471,126.00	0.07
49	600863	内蒙华电	113,200	469,780.00	0.07
50	601766	中国中车	71,300	463,450.00	0.07
51	600531	豫光金铅	72,500	456,750.00	0.07
52	600803	新奥股份	23,900	453,622.00	0.07
53	300433	蓝思科技	38,500	452,760.00	0.07
54	600598	北大荒	33,900	451,887.00	0.07
55	002275	桂林三金	24,900	448,449.00	0.06
56	600089	特变电工	20,100	448,029.00	0.06
57	000728	国元证券	68,100	444,012.00	0.06
58	000623	吉林敖东	27,600	442,704.00	0.06
59	601319	中国人保	75,500	440,920.00	0.06
60	000538	云南白药	8,400	440,832.00	0.06
61	000783	长江证券	75,900	440,220.00	0.06
62	600909	华安证券	94,000	438,980.00	0.06
63	002154	报喜鸟	79,500	438,840.00	0.06
64	600938	中国海油	24,200	438,504.00	0.06
65	000739	普洛药业	24,700	438,178.00	0.06
66	601555	东吴证券	62,800	435,832.00	0.06
67	600761	安徽合力	21,700	432,481.00	0.06
68	603105	芯能科技	25,600	432,384.00	0.06
69	601728	中国电信	76,100	428,443.00	0.06
70	600266	城建发展	83,900	426,212.00	0.06
71	600248	陕建股份	88,500	422,145.00	0.06
72	002129	TCL 中环	12,675	420,810.00	0.06
73	603693	江苏新能	29,900	418,600.00	0.06
74	301039	中集车辆	31,200	412,776.00	0.06

75	003006	百亚股份	23,800	411,264.00	0.06
76	600971	恒源煤电	52,400	408,196.00	0.06
77	603565	中谷物流	37,500	405,000.00	0.06
78	600483	福能股份	34,300	396,165.00	0.06
79	000921	海信家电	14,600	393,470.00	0.06
80	300855	图南股份	11,020	389,226.40	0.06
81	600919	江苏银行	51,800	380,730.00	0.06
82	601186	中国铁建	38,300	377,255.00	0.05
83	000333	美的集团	6,400	377,088.00	0.05
84	301046	能辉科技	11,400	372,780.00	0.05
85	300203	聚光科技	18,300	370,941.00	0.05
86	002959	小熊电器	4,400	367,400.00	0.05
87	605499	东鹏饮料	2,100	363,090.00	0.05
88	300396	迪瑞医疗	11,100	360,639.00	0.05
89	601668	中国建筑	62,100	356,454.00	0.05
90	003011	海象新材	10,600	341,850.00	0.05
91	600784	鲁银投资	47,200	341,728.00	0.05
92	002092	中泰化学	52,800	340,560.00	0.05
93	000404	长虹华意	48,000	332,160.00	0.05
94	600211	西藏药业	5,400	320,760.00	0.05
95	603328	依顿电子	38,100	315,468.00	0.05
96	601138	工业富联	12,500	315,000.00	0.05
97	000651	格力电器	8,500	310,335.00	0.04
98	600583	海油工程	52,700	308,295.00	0.04
99	601800	中国交建	27,700	302,207.00	0.04
100	002847	盐津铺子	3,500	297,675.00	0.04
101	601916	浙商银行	111,900	295,416.00	0.04
102	601390	中国中铁	37,000	280,460.00	0.04
103	600580	卧龙电驱	18,800	274,668.00	0.04
104	605009	豪悦护理	5,700	273,600.00	0.04
105	002345	潮宏基	34,500	271,170.00	0.04
106	002402	和而泰	15,900	269,982.00	0.04
107	300002	神州泰岳	19,100	267,400.00	0.04
108	002429	兆驰股份	47,700	262,350.00	0.04
109	002611	东方精工	45,400	260,596.00	0.04
110	300012	华测检测	13,300	259,350.00	0.04
111	603757	大元泵业	8,600	256,624.00	0.04
112	601601	中国太保	9,700	252,006.00	0.04
113	601288	农业银行	71,200	251,336.00	0.04
114	603345	安井食品	1,700	249,560.00	0.04
115	000811	冰轮环境	15,700	247,432.00	0.04
116	601328	交通银行	42,500	246,500.00	0.04
117	300009	安科生物	24,500	245,000.00	0.04

118	000543	皖能电力	36,900	243,540.00	0.04
119	600926	杭州银行	20,600	242,050.00	0.04
120	300316	晶盛机电	3,400	241,060.00	0.03
121	000338	潍柴动力	19,300	240,478.00	0.03
122	300515	三德科技	14,900	240,188.00	0.03
123	601169	北京银行	51,700	239,371.00	0.03
124	002027	分众传媒	35,100	239,031.00	0.03
125	603529	爱玛科技	7,350	236,817.00	0.03
126	001322	箭牌家居	14,100	236,034.00	0.03
127	002419	天虹股份	40,200	235,170.00	0.03
128	002966	苏州银行	35,900	235,145.00	0.03
129	600016	民生银行	62,700	235,125.00	0.03
130	600438	通威股份	6,800	233,308.00	0.03
131	603136	天目湖	9,000	232,200.00	0.03
132	002415	海康威视	7,000	231,770.00	0.03
133	000001	平安银行	20,600	231,338.00	0.03
134	601658	邮储银行	47,300	231,297.00	0.03
135	002536	飞龙股份	15,400	231,000.00	0.03
136	603300	华铁应急	42,300	230,535.00	0.03
137	002335	科华数据	6,400	230,080.00	0.03
138	688676	金盘科技	7,500	227,175.00	0.03
139	600461	洪城环境	27,700	226,309.00	0.03
140	002050	三花智控	7,400	223,924.00	0.03
141	688357	建龙微纳	3,460	223,827.40	0.03
142	002683	广东宏大	7,600	223,744.00	0.03
143	603050	科林电气	13,820	222,640.20	0.03
144	601117	中国化学	26,800	221,904.00	0.03
145	002028	思源电气	4,700	219,584.00	0.03
146	300833	浩洋股份	2,000	218,860.00	0.03
147	601137	博威合金	14,000	217,840.00	0.03
148	300014	亿纬锂能	3,600	217,800.00	0.03
149	300881	盛德鑫泰	6,600	217,470.00	0.03
150	002518	科士达	5,400	216,054.00	0.03
151	300723	一品红	7,350	215,355.00	0.03
152	603901	永创智能	14,700	214,032.00	0.03
153	300990	同飞股份	4,220	212,266.00	0.03
154	600256	广汇能源	30,900	211,974.00	0.03
155	605336	帅丰电器	12,100	208,120.00	0.03
156	600600	青岛啤酒	2,000	207,260.00	0.03
157	688315	诺禾致源	7,800	207,090.00	0.03
158	600690	海尔智家	8,800	206,624.00	0.03
159	300582	英飞特	14,900	202,193.00	0.03
160	300443	金雷股份	5,700	202,065.00	0.03

161	300258	精锻科技	13,900	201,411.00	0.03
162	300911	亿田智能	5,200	197,444.00	0.03
163	603298	杭叉集团	8,200	193,110.00	0.03
164	002371	北方华创	600	190,590.00	0.03
165	688569	铁科轨道	4,400	185,108.00	0.03
166	002945	华林证券	13,500	184,680.00	0.03
167	300795	米奥会展	4,400	183,524.00	0.03
168	601688	华泰证券	13,300	183,141.00	0.03
169	300532	今天国际	8,900	182,984.00	0.03
170	300842	帝科股份	2,000	182,880.00	0.03
171	601066	中信建投	7,500	181,500.00	0.03
172	601377	兴业证券	29,600	181,152.00	0.03
173	601881	中国银河	15,600	181,116.00	0.03
174	000625	长安汽车	14,000	181,020.00	0.03
175	000776	广发证券	12,300	180,933.00	0.03
176	601788	光大证券	11,300	179,557.00	0.03
177	600958	东方证券	18,500	179,450.00	0.03
178	300059	东方财富	12,600	178,920.00	0.03
179	000065	北方国际	11,800	177,236.00	0.03
180	002033	丽江股份	16,000	174,080.00	0.03
181	600312	平高电气	14,000	173,460.00	0.03
182	002920	德赛西威	1,100	171,391.00	0.02
183	300349	金卡智能	12,300	170,724.00	0.02
184	605167	利柏特	17,500	169,400.00	0.02
185	002056	横店东磁	9,300	169,353.00	0.02
186	600570	恒生电子	3,800	168,302.00	0.02
187	600415	小商品城	19,600	167,188.00	0.02
188	002444	巨星科技	7,500	164,100.00	0.02
189	601689	拓普集团	2,000	161,400.00	0.02
190	688338	赛科希德	2,900	160,805.00	0.02
191	603279	景津装备	5,100	159,936.00	0.02
192	603786	科博达	2,400	157,680.00	0.02
193	603165	荣晟环保	9,800	157,192.00	0.02
194	300314	戴维医疗	7,400	156,436.00	0.02
195	002594	比亚迪	600	154,962.00	0.02
196	001223	欧克科技	1,700	154,683.00	0.02
197	002737	葵花药业	6,300	153,342.00	0.02
198	688186	广大特材	4,700	152,891.00	0.02
199	600188	兖矿能源	5,100	152,592.00	0.02
200	002865	钧达股份	1,000	152,530.00	0.02
201	603556	海兴电力	6,000	151,440.00	0.02
202	002459	晶澳科技	3,620	150,954.00	0.02
203	000425	徐工机械	22,100	149,617.00	0.02

204	000913	钱江摩托	8,200	149,486.00	0.02
205	605289	罗曼股份	3,900	149,409.00	0.02
206	600129	太极集团	2,500	148,725.00	0.02
207	601799	星宇股份	1,200	148,320.00	0.02
208	002283	天润工业	23,100	148,302.00	0.02
209	603368	柳药集团	6,000	148,260.00	0.02
210	600757	长江传媒	17,200	147,920.00	0.02
211	002929	润建股份	3,400	147,594.00	0.02
212	000858	五粮液	900	147,213.00	0.02
213	600967	内蒙一机	14,400	145,440.00	0.02
214	002970	锐明技术	4,600	144,854.00	0.02
215	002965	祥鑫科技	2,600	144,768.00	0.02
216	300863	卡倍亿	2,300	144,693.00	0.02
217	600933	爱柯迪	6,200	144,398.00	0.02
218	002597	金禾实业	6,100	143,960.00	0.02
219	605368	蓝天燃气	15,020	143,741.40	0.02
220	603882	金城医学	1,900	143,450.00	0.02
221	603596	伯特利	1,800	142,668.00	0.02
222	688009	中国通号	24,400	141,520.00	0.02
223	600285	羚锐制药	8,800	141,328.00	0.02
224	601877	正泰电器	5,100	141,015.00	0.02
225	601633	长城汽车	5,600	140,952.00	0.02
226	600879	航天电子	16,600	140,934.00	0.02
227	000785	居然之家	36,900	140,589.00	0.02
228	600584	长电科技	4,500	140,265.00	0.02
229	000862	银星能源	18,200	139,412.00	0.02
230	600566	济川药业	4,800	139,392.00	0.02
231	688223	晶科能源	9,900	139,194.00	0.02
232	000923	河钢资源	10,300	139,050.00	0.02
233	600548	深高速	15,400	138,292.00	0.02
234	002997	瑞鹄模具	4,600	136,758.00	0.02
235	601006	大秦铁路	18,400	136,712.00	0.02
236	000778	新兴铸管	33,500	136,680.00	0.02
237	601000	唐山港	38,700	136,611.00	0.02
238	603688	石英股份	1,200	136,608.00	0.02
239	601899	紫金矿业	12,000	136,440.00	0.02
240	600419	天润乳业	8,400	136,248.00	0.02
241	600888	新疆众和	17,200	136,224.00	0.02
242	300511	雪榕生物	17,900	136,040.00	0.02
243	301079	邵阳液压	6,380	136,021.60	0.02
244	688533	上声电子	2,900	135,517.00	0.02
245	300772	运达股份	10,500	135,240.00	0.02
246	600487	亨通光电	9,200	134,872.00	0.02

247	300885	海昌新材	12,900	134,289.00	0.02
248	000630	铜陵有色	46,400	134,096.00	0.02
249	300119	瑞普生物	7,500	133,500.00	0.02
250	301096	百诚医药	2,200	133,342.00	0.02
251	600219	南山铝业	44,100	133,182.00	0.02
252	603516	淳中科技	6,000	132,300.00	0.02
253	603063	禾望电气	4,300	132,225.00	0.02
254	600998	九州通	12,712	131,950.56	0.02
255	000636	风华高科	8,600	131,924.00	0.02
256	600332	白云山	4,100	130,708.00	0.02
257	600073	上海梅林	17,900	130,670.00	0.02
258	603990	麦迪科技	5,900	130,095.00	0.02
259	002209	达意隆	12,600	129,150.00	0.02
260	603289	泰瑞机器	11,500	129,030.00	0.02
261	002747	埃斯顿	4,600	128,800.00	0.02
262	600860	京城股份	9,900	128,502.00	0.02
263	002697	红旗连锁	22,000	128,480.00	0.02
264	605399	晨光新材	7,200	128,160.00	0.02
265	001266	宏英智能	4,400	127,820.00	0.02
266	600741	华域汽车	6,900	127,374.00	0.02
267	301070	开勒股份	3,400	127,160.00	0.02
268	300490	华自科技	7,400	126,984.00	0.02
269	000725	京东方 A	30,700	125,563.00	0.02
270	300835	龙磁科技	4,000	125,520.00	0.02
271	301168	通灵股份	2,000	124,600.00	0.02
272	603689	皖天然气	14,200	124,534.00	0.02
273	000400	许继电气	5,400	124,470.00	0.02
274	301051	信濠光电	2,050	124,004.50	0.02
275	600929	雪天盐业	15,600	123,864.00	0.02
276	000852	石化机械	17,200	123,668.00	0.02
277	300750	宁德时代	540	123,546.60	0.02
278	301330	熵基科技	3,450	123,441.00	0.02
279	300112	万讯自控	11,200	123,424.00	0.02
280	300609	汇纳科技	4,400	123,200.00	0.02
281	601919	中远海控	13,100	123,140.00	0.02
282	002471	中超控股	46,100	123,087.00	0.02
283	600353	旭光电子	15,000	123,000.00	0.02
284	603027	千禾味业	5,800	122,496.00	0.02
285	002185	华天科技	13,300	122,360.00	0.02
286	002581	未名医药	6,400	122,176.00	0.02
287	603511	爱慕股份	7,100	122,120.00	0.02
288	603633	徕木股份	9,300	121,551.00	0.02
289	603115	海星股份	7,900	121,423.00	0.02

290	000807	云铝股份	9,500	120,935.00	0.02
291	300405	科隆股份	22,100	120,887.00	0.02
292	300554	三超新材	5,800	120,814.00	0.02
293	002980	华盛昌	3,600	120,456.00	0.02
294	605155	西大门	8,300	120,433.00	0.02
295	002105	信隆健康	20,200	120,190.00	0.02
296	600901	江苏金租	29,100	120,183.00	0.02
297	300894	火星人	4,700	120,038.00	0.02
298	300876	蒙泰高新	4,600	119,830.00	0.02
299	300206	理邦仪器	7,900	119,132.00	0.02
300	000534	万泽股份	7,100	119,067.00	0.02
301	002439	启明星辰	4,000	119,040.00	0.02
302	603969	银龙股份	25,700	118,734.00	0.02
303	301327	华宝新能	1,500	118,665.00	0.02
304	600373	中文传媒	8,900	118,548.00	0.02
305	688777	中控技术	1,885	118,340.30	0.02
306	000555	神州信息	9,600	118,080.00	0.02
307	301077	星华新材	5,500	117,865.00	0.02
308	300614	百川畅银	4,300	117,777.00	0.02
309	002688	金河生物	24,900	117,528.00	0.02
310	301221	光庭信息	2,100	117,243.00	0.02
311	000719	中原传媒	10,000	117,000.00	0.02
312	600512	腾达建设	43,600	116,848.00	0.02
313	300787	海能实业	5,900	116,230.00	0.02
314	002727	一心堂	4,400	116,160.00	0.02
315	301013	利和兴	8,100	115,830.00	0.02
316	002840	华统股份	7,400	115,736.00	0.02
317	301196	唯科科技	3,400	115,430.00	0.02
318	600180	瑞茂通	19,300	115,414.00	0.02
319	301228	实朴检测	7,400	115,292.00	0.02
320	688248	南网科技	3,000	115,170.00	0.02
321	300642	透景生命	5,700	114,969.00	0.02
322	300674	宇信科技	6,500	114,920.00	0.02
323	300440	运达科技	16,200	114,534.00	0.02
324	001308	康冠科技	4,170	114,508.20	0.02
325	300757	罗博特科	1,300	114,413.00	0.02
326	300467	迅游科技	5,600	114,408.00	0.02
327	603357	设计总院	10,880	114,240.00	0.02
328	300051	三五互联	9,100	114,205.00	0.02
329	688131	皓元医药	2,000	113,960.00	0.02
330	002624	完美世界	6,700	113,163.00	0.02
331	603803	瑞斯康达	12,000	113,040.00	0.02
332	300872	天阳科技	7,200	111,888.00	0.02

332	002403	爱仕达	11,100	111,888.00	0.02
334	300773	拉卡拉	6,400	111,616.00	0.02
335	002384	东山精密	4,300	111,370.00	0.02
336	601058	赛轮轮胎	9,700	110,483.00	0.02
337	002786	银宝山新	17,100	110,295.00	0.02
338	301236	软通动力	4,050	110,200.50	0.02
339	001313	粤海饲料	13,800	109,020.00	0.02
340	603507	振江股份	3,000	108,780.00	0.02
341	600469	风神股份	16,800	108,192.00	0.02
342	603171	税友股份	2,700	107,946.00	0.02
343	600665	天地源	26,600	107,730.00	0.02
344	301026	浩通科技	3,000	107,160.00	0.02
345	301195	北路智控	2,300	107,088.00	0.02
346	600892	大晟文化	16,200	107,082.00	0.02
347	603222	济民医疗	10,200	106,386.00	0.02
348	300766	每日互动	6,300	105,588.00	0.02
349	002893	京能热力	9,800	105,546.00	0.02
350	300996	普联软件	3,400	104,380.00	0.02
351	601801	皖新传媒	11,100	104,229.00	0.02
352	300579	数字认证	3,600	104,040.00	0.02
353	603499	翔港科技	10,800	103,032.00	0.01
354	603161	科华控股	7,000	101,990.00	0.01
355	002334	英威腾	8,000	101,920.00	0.01
356	301121	紫建电子	2,000	101,280.00	0.01
357	000599	青岛双星	23,700	101,199.00	0.01
358	688408	中信博	1,200	101,196.00	0.01
359	300462	华铭智能	8,600	100,964.00	0.01
360	600686	金龙汽车	12,400	100,936.00	0.01
361	000521	长虹美菱	13,200	100,848.00	0.01
362	002718	友邦吊顶	6,600	100,056.00	0.01
363	600525	长园集团	17,000	99,960.00	0.01
364	002162	悦心健康	22,200	99,678.00	0.01
365	002652	扬子新材	37,700	99,528.00	0.01
366	600198	大唐电信	14,500	99,325.00	0.01
367	600887	伊利股份	3,500	99,120.00	0.01
368	300464	星徽股份	14,800	98,716.00	0.01
369	300132	青松股份	17,400	98,658.00	0.01
370	603667	五洲新春	6,600	98,208.00	0.01
371	002583	海能达	16,900	98,189.00	0.01
372	600498	烽火通信	4,800	97,776.00	0.01
373	600119	长江投资	16,600	97,774.00	0.01
374	002775	文科园林	26,000	97,500.00	0.01
375	300530	领湃科技	4,300	97,352.00	0.01

376	002158	汉钟精机	3,900	97,344.00	0.01
377	601567	三星医疗	7,700	97,251.00	0.01
378	603536	惠发食品	15,100	97,244.00	0.01
379	688121	卓然股份	2,600	97,240.00	0.01
380	600097	开创国际	10,200	97,206.00	0.01
381	002512	达华智能	24,100	96,641.00	0.01
382	600031	三一重工	5,800	96,454.00	0.01
383	300161	华中数控	1,800	96,336.00	0.01
384	600375	汉马科技	12,700	96,266.00	0.01
385	300157	恒泰艾普	29,800	95,956.00	0.01
386	300419	浩丰科技	15,300	95,778.00	0.01
387	603198	迎驾贡酒	1,500	95,700.00	0.01
388	600513	联环药业	9,900	95,634.00	0.01
389	600150	中国船舶	2,900	95,439.00	0.01
390	603369	今世缘	1,800	95,040.00	0.01
391	600797	浙大网新	13,300	94,962.00	0.01
392	300407	凯发电气	10,400	94,952.00	0.01
393	688111	金山办公	200	94,444.00	0.01
394	688516	奥特维	500	94,200.00	0.01
395	002332	仙琚制药	7,100	94,075.00	0.01
396	688033	天宜上佳	4,900	93,688.00	0.01
397	600661	昂立教育	9,800	93,394.00	0.01
398	002269	美邦服饰	59,400	93,258.00	0.01
399	688266	泽璟制药	2,000	93,100.00	0.01
400	603378	亚士创能	10,200	92,922.00	0.01
401	300449	汉邦高科	13,900	92,713.00	0.01
402	002237	恒邦股份	8,500	92,565.00	0.01
403	300242	佳云科技	26,500	91,425.00	0.01
404	601126	四方股份	6,000	91,140.00	0.01
405	601369	陕鼓动力	10,000	91,100.00	0.01
406	601113	华鼎股份	28,100	91,044.00	0.01
407	300887	谱尼测试	2,300	91,034.00	0.01
408	600481	双良节能	6,500	90,870.00	0.01
409	002244	滨江集团	10,300	90,846.00	0.01
410	000498	山东路桥	14,100	90,522.00	0.01
411	600502	安徽建工	17,100	90,288.00	0.01
412	603856	东宏股份	6,800	89,692.00	0.01
413	688175	高凌信息	2,700	89,424.00	0.01
414	688378	奥来德	1,800	88,920.00	0.01
415	605599	菜百股份	6,700	88,507.00	0.01
416	300416	苏试试验	4,100	88,396.00	0.01
417	600012	皖通高速	8,400	88,032.00	0.01
418	003816	中国广核	28,300	88,013.00	0.01

419	603187	海容冷链	4,400	87,956.00	0.01
420	603551	奥普家居	6,800	87,924.00	0.01
421	000908	景峰医药	34,600	87,538.00	0.01
422	002947	恒铭达	4,200	87,528.00	0.01
423	002938	鹏鼎控股	3,600	87,444.00	0.01
424	603966	法兰泰克	6,900	87,147.00	0.01
425	300092	科新机电	5,300	86,920.00	0.01
426	002837	英维克	2,900	86,826.00	0.01
427	002940	昂利康	4,500	86,445.00	0.01
428	002529	海源复材	5,600	85,960.00	0.01
429	300390	天华新能	2,400	85,920.00	0.01
430	601717	郑煤机	6,900	85,905.00	0.01
431	000014	沙河股份	7,500	85,800.00	0.01
432	688296	和达科技	4,800	85,680.00	0.01
433	605507	国邦医药	4,000	85,080.00	0.01
434	002600	领益智造	12,300	84,993.00	0.01
435	002478	常宝股份	11,400	84,930.00	0.01
436	603283	赛腾股份	1,900	84,550.00	0.01
437	000933	神火股份	6,500	84,500.00	0.01
438	603858	步长制药	4,100	84,419.00	0.01
439	002299	圣农发展	4,400	84,260.00	0.01
440	832419	路斯股份	12,200	84,180.00	0.01
441	300360	炬华科技	4,700	84,036.00	0.01
442	300729	乐歌股份	4,710	84,026.40	0.01
443	603920	世运电路	4,300	83,979.00	0.01
444	688318	财富趋势	840	83,974.80	0.01
445	002638	勤上股份	25,100	83,583.00	0.01
446	002821	凯莱英	700	82,502.00	0.01
447	688078	龙软科技	1,600	82,480.00	0.01
448	603639	海利尔	4,600	82,432.00	0.01
449	300259	新天科技	20,500	82,205.00	0.01
450	600681	百川能源	17,600	82,192.00	0.01
451	300951	博硕科技	1,500	81,945.00	0.01
452	603086	先达股份	11,900	81,515.00	0.01
453	001218	丽臣实业	3,600	81,396.00	0.01
454	605158	华达新材	10,600	80,560.00	0.01
455	300777	中简科技	1,700	80,342.00	0.01
456	002381	双箭股份	10,400	80,288.00	0.01
457	601958	金铂股份	7,200	80,280.00	0.01
458	002532	天山铝业	13,300	79,667.00	0.01
459	832000	安徽凤凰	15,100	79,577.00	0.01
460	838171	邦德股份	8,800	79,464.00	0.01
461	300970	华绿生物	3,400	79,424.00	0.01

462	688365	光云科技	5,500	79,310.00	0.01
463	836260	中寰股份	15,400	78,232.00	0.01
464	833427	华维设计	14,500	78,155.00	0.01
465	002952	亚世光电	4,400	78,012.00	0.01
466	002133	广宇集团	23,000	77,970.00	0.01
467	838924	广脉科技	12,600	77,868.00	0.01
468	603619	中曼石油	4,600	77,832.00	0.01
469	000885	城发环境	5,800	77,198.00	0.01
470	603519	立霸股份	5,200	77,064.00	0.01
471	002131	利欧股份	33,000	75,900.00	0.01
472	835174	五新隧装	9,213	75,822.99	0.01
473	600658	电子城	13,700	75,761.00	0.01
474	832735	德源药业	3,200	75,456.00	0.01
475	831039	国义招标	14,800	75,332.00	0.01
476	834415	恒拓开源	19,100	75,254.00	0.01
477	832225	利通科技	7,980	75,091.80	0.01
478	872925	锦好医疗	7,900	74,892.00	0.01
479	600728	佳都科技	10,800	74,844.00	0.01
480	603367	辰欣药业	4,900	74,382.00	0.01
481	000596	古井贡酒	300	74,214.00	0.01
482	603230	内蒙新华	5,700	73,530.00	0.01
483	836263	中航泰达	15,200	73,112.00	0.01
484	601086	国芳集团	16,300	72,535.00	0.01
485	002746	仙坛股份	9,000	70,920.00	0.01
486	834475	三友科技	9,700	69,840.00	0.01
487	002728	特一药业	4,480	68,320.00	0.01
488	688658	悦康药业	3,200	66,592.00	0.01
489	301080	百普赛斯	1,050	65,961.00	0.01
490	688661	和林微纳	900	63,270.00	0.01
491	603259	药明康德	1,000	62,310.00	0.01
492	688100	威胜信息	2,000	59,620.00	0.01
493	830839	万通液压	7,600	53,276.00	0.01
494	002304	洋河股份	400	52,540.00	0.01
495	600170	上海建工	17,600	47,344.00	0.01
496	601872	招商轮船	8,100	46,899.00	0.01
497	002085	万丰奥威	6,500	45,045.00	0.01
498	603237	五芳斋	1,040	31,543.20	0.00
499	600702	舍得酒业	200	24,790.00	0.00
500	301360	荣旗科技	200	20,856.00	0.00
501	603322	超讯通信	700	20,496.00	0.00
502	603338	浙江鼎力	300	16,803.00	0.00
503	603589	口子窖	300	14,805.00	0.00
504	600038	中直股份	300	11,946.00	0.00

505	601222	林洋能源	1,100	9,009.00	0.00
506	002895	川恒股份	100	1,970.00	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	600547	山东黄金	2,536,939.00	0.50
2	600489	中金黄金	2,329,080.00	0.46
3	000975	银泰黄金	2,205,714.00	0.43
4	300750	宁德时代	2,136,314.00	0.42
5	601155	新城控股	1,633,702.00	0.32
6	600519	贵州茅台	1,615,778.00	0.32
7	601318	中国平安	1,578,218.00	0.31
8	600050	中国联通	1,360,689.00	0.27
9	600060	海信视像	1,329,305.49	0.26
10	600803	新奥股份	1,300,772.00	0.26
11	300059	东方财富	1,243,587.82	0.24
12	601800	中国交建	1,212,388.00	0.24
13	600941	中国移动	1,146,830.00	0.23
14	300316	晶盛机电	1,140,054.00	0.22
15	300124	汇川技术	1,116,105.00	0.22
16	600674	川投能源	1,111,716.00	0.22
17	600938	中国海油	1,090,821.00	0.21
18	600988	赤峰黄金	1,089,241.00	0.21
19	002050	三花智控	1,047,114.00	0.21
20	600066	宇通客车	1,042,873.00	0.21

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	300750	宁德时代	5,713,772.00	1.13
2	600519	贵州茅台	4,410,441.00	0.87
3	601166	兴业银行	3,145,512.00	0.62
4	600036	招商银行	2,464,046.00	0.49
5	300760	迈瑞医疗	2,150,058.00	0.42
6	601318	中国平安	2,103,026.00	0.41
7	300009	安科生物	1,814,534.64	0.36
8	000001	平安银行	1,703,326.00	0.34

9	601012	隆基绿能	1,614,394.00	0.32
10	002142	宁波银行	1,487,347.00	0.29
11	601857	中国石油	1,438,680.00	0.28
12	600048	保利发展	1,416,409.00	0.28
13	000568	泸州老窖	1,329,332.00	0.26
14	300059	东方财富	1,277,656.00	0.25
15	603259	药明康德	1,271,176.00	0.25
16	600809	山西汾酒	1,267,598.00	0.25
17	001914	招商积余	1,254,045.00	0.25
18	000651	格力电器	1,233,090.00	0.24
19	002594	比亚迪	1,185,027.00	0.23
20	000002	万科 A	1,143,722.00	0.23

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	317,711,900.67
卖出股票收入（成交）总额	300,762,645.43

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	80,792,365.67	11.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	250,897,186.71	36.32
	其中：政策性金融债	52,157,557.15	7.55
4	企业债券	78,477,918.85	11.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	167,462,137.75	24.24
7	可转债（可交换债）	156,723.56	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	577,786,332.54	83.64

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	019688	22 国债 23	599,000	60,570,436.90	8.77
2	180214	18 国开 14	300,000	32,015,917.81	4.63
3	2228003	22 兴业银行 二级 01	300,000	30,753,106.85	4.45
4	2128028	21 邮储银行 二级 01	270,000	28,156,246.52	4.08
5	2120105	21 厦门银行 二级 02	200,000	20,766,785.75	3.01

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，兴业银行股份有限公司、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。

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	58,247.49
2	应收清算款	3,331,947.19
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	3,390,194.68

7.12.4 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。

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	207	3,131,567.88	647,758,839.14	99.93%	475,711.04	0.07%
华夏鼎融债券 C	52	296,077.41	15,206,173.73	98.77%	189,851.36	1.23%
合计	259	2,562,280.21	662,965,012.87	99.90%	665,562.40	0.10%

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	1,918.88	0.00%
	华夏鼎融债券 C	345.70	0.00%
	合计	2,264.58	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	华夏鼎融债券 A	0
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0

本开放式基金		
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏鼎融债券 A	0
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0

§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	498,093,037.40	1,976,192.63
本报告期基金总申购份额	268,328,063.25	15,308,118.07
减：本报告期基金总赎回份额	118,186,550.47	1,888,285.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	648,234,550.18	15,396,025.09

§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，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
长江证券	3	198,118,420.01	32.04%	85,449.20	31.97%	-
广发证券	1	176,892,425.14	28.61%	76,294.09	28.54%	-
国盛证券	2	135,333,695.26	21.88%	58,370.90	21.84%	-
国泰君安证券	2	103,191,603.09	16.69%	44,507.47	16.65%	-
中金公司	2	4,859,248.60	0.79%	2,672.95	1.00%	-
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、北京高华证券、财通证券、长城证券、川财证券、德邦证券、东方证券、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、国信证券、海通证券、华创证券、华西证券、汇丰前海证券、江海证券、开源证券、民生证券、平安证券、申万宏源证券、天风证券、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、中航证券、中信建投证券、中信证券、中邮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，中邮证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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
长江证券	20,846,646.83	6.36%	60,000,000.00	1.85%	-	-	-	-
广发证券	75,039,023.00	22.89%	1,209,900,000.00	37.39%	-	-	-	-
国盛证券	101,864,306.00	31.07%	1,843,000,000.00	56.95%	-	-	-	-
国泰君安证券	40,031,640.00	12.21%	123,000,000.00	3.80%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	90,049,900.00	27.47%	-	-	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及	2023-01-06

		网站	
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	2023-04-06

§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	2023-06-21 至 2023-06-30	39,022,867.40	96,478,533.53	-	135,501,400.93	20.42%
	2	2023-01-05 至 2023-05-11	93,259,792.99	-	-	93,259,792.99	14.05%

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。

§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

二〇二三年八月三十日