华夏鼎融债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十五日

§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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§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	
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	200,254,690.86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	200,196,913.01份	57,777.85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	基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断,并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征,在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时进行动态调整。
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	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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(2018年1月1日至2018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	1,246,763.54	396.39
本期利润	921,966.58	138.13
加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0017
本期加权平均净值利润率	0.45%	0.16%
本期基金份额净值增长率	0.45%	0.25%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018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	3,145,037.00	516.82
期末可供分配基金份额利润	0.0157	0.0089
期末基金资产净值	203,341,950.01	58,294.67
期末基金份额净值	1.0157	1.0089
3.1.3累计期末指标	报告期末(2018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	1.57%	0.89%

注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏鼎融债券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	-0.22%	0.15%	0.34%	0.06%	-0.56%	0.09%
过去三个月	-0.16%	0.13%	1.01%	0.10%	-1.17%	0.03%
过去六个月	0.45%	0.13%	2.16%	0.08%	-1.71%	0.05%
过去一年	0.95%	0.10%	0.83%	0.06%	0.12%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.57%	0.09%	-3.71%	0.09%	5.28%	0.00%

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	-0.26%	0.15%	0.34%	0.06%	-0.60%	0.09%
过去三个月	-0.26%	0.13%	1.01%	0.10%	-1.27%	0.03%
过去六个月	0.25%	0.13%	2.16%	0.08%	-1.91%	0.05%
过去一年	0.54%	0.10%	0.83%	0.06%	-0.29%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.89%	0.09%	-3.71%	0.09%	4.60%	0.00%

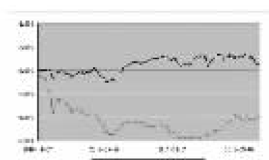
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎融债券型证券投资基金

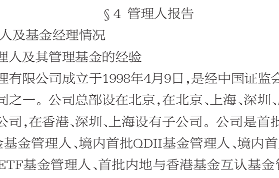
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月7日至2018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,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基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至2018年6月30日数据),华夏经济转型股票在"股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A类)"中排序3/154;华夏医疗健康混合(A类)在"混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(A类)"中排序2/152;华夏医药ETF、华夏消费ETF、华夏沪港通恒生ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序2/115、8/115、9/115。

上半年,公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中,公司荣获"中国基金业20周年卓越贡献公司"和"被动投资金牛基金公司"两大奖项,旗下华夏回报混合荣获"2017年度开放式混合型金牛基金"称号,华夏安康债券荣获"2017年度开放式债券型金牛基金"称号。在《证券时报》评奖活动中,旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报绝对收益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报积极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017年度平衡混合型明星基金"称号。在《上海证券报》举行的2018中国基金业峰会暨第十五届"金基金"颁奖评选中,华夏基金荣获公募基金20周年"金基金"TOP基金公司大奖、华夏沪深300ETF获得第十五届"金基金"指数基金奖(一年期)、华夏上证50ETF获得第十五届"金基金"指数基金奖(三年期)。在《证券时报》的评奖活动中,华夏永福混合和华夏回报混合荣获"三年持续回报绝对收益明星基金"称号,华夏安康债券荣获"三年持续回报积极债券型明星基金"称号,华夏消费升级混合荣获"2017年度平衡混合型明星基金"称号。

在客户服务方面,2018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)华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动,为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式;(2)微信服务号上线随存随取业务实时通知功能,为客户及时了解交易变动的情况;华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能,为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式;(3)与中原银行、长城华西银行、西安银行等代销机构合作,拓宽了客户交易的渠道,提高了交易便利性;(4)开展"四大明星基金有奖寻人"、"华夏基金20周年司庆感恩二十年"、"华夏基金20周年献礼,华夏基金户口本"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、董事总经理	2016-12-29	-	18年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾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)、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)、恒生交易型开放式指数证券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)、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)、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)等。
魏镇江	本基金的基金经理、固定收益部总监	2017-09-08	-	15年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员,华夏理财30天债券型证券投资基金基金经理(2013年4月26日至2015年4月2日期间)、华夏理财21天债券型证券投资基金基金经理(2013年4月26日至2015年4月2日期间)、华夏鼎诚债券型证券投资基金基金经理(2016年12月13日至2017年8月30日期间)、华夏鼎新债券型证券投资基金基金经理(2016年3月22日至2017年11月15日期间)、华夏债券投资基金基金经理(2010年2月4日至2017年12月19日期间)等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规,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,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4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,全球经济增长整体保持了平稳势头,但结构分化和隐忧也逐步体现。美国经济增长势头维持强劲,欧洲、日本经济数据边际趋弱,贸易战的升温给未来全球经济走势带来较大的不确定性,美联储加息步伐维持高位,符合市场预期。美元指数先下后上,维持相对强劲走势。在美联储加息预期强化的背景下,美债收益率曲线进一步平坦化抬升,对全球货币和资产价格产生一定影响。国内方面,上半年经济走势整体维持平稳,但在去杠杆压力下,相对2017年边际出现走弱趋势,通胀维持平稳,压力较小;货币政策维持稳健中性、边际微调,金融市场流动性整体维持在合理水平;金融监管政策稳步落地,短期对股、债表现带来一定压力。在经济边际趋弱、政策平稳、宏观信用收缩的背景下,债券市场出现了利率、信用分化格局,利率债表现较好,收益率曲线平坦化下行,信用债二季度以来持续走弱,信用利差走阔。受经济走势偏弱和风险情绪受挫影响,可转债面临双杀格局,走势较为疲弱。

报告期内,本基金维持了适度的杠杆水平,一季度久期偏短,二季度适度拉长了久期;组合信用持仓维持高等级,利率债以长端波段操作为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,华夏鼎融债券A基金份额净值为1.0157元,本报告期份额净值增长率为0.45%;华夏鼎融债券C基金份额净值为1.0089元,本报告期份额净值增长率为0.25%;同期业绩比较基准增长率为2.16%。

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,贸易战对经济的不确定性难以消除,国内紧信用滞后带来的经济下行压力仍将持续;货币政策延续合理充裕取向概率较高,去杠杆进入稳杠杆阶段后,有利于信用环境的改善,我们对下半年债券市场维持相对乐观判断,中段高等级信用债或将会有一定表现。

下半年,本基金将在维持偏高等级信用债的前提下,适度提升组合的信用债久期水平。

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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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半年度财务会计报告(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:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		-	-
银行存款		13,580,386.45	1,639,094.45
结算备付金		4,111,686.13	613,739.37
存出保证金		12,024.00	9,626.71
交易性金融资产		239,361,323.30	193,548,201.99
其中:股票投资		18,916,076.40	16,261,241.68
基金投资		-	-
债券投资		200,463,246.90	154,672,788.31
资产支持证券投资		19,982,000.00	22,614,172.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	4,300,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		4,696,931.24	2,783,435.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	9.94
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		261,762,351.12	202,894,108.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		57,000,000.00	-
应付证券清算款		1,058,478.40	92,743.78
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		100,311.40	103,138.76
应付托管费		33,437.19	34,379.62
应付销售服务费		19.33	22.01
应付交易费用		82,166.05	16,310.49
应交税费		15,602.00	-
应付利息		7,625.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		64,466.77	50,000.00
负债合计		58,362,106.44	296,594.66
所有者权益:		-	-
实收基金		200,254,690.86	200,372,302.86
未分配利润		3,145,553.82	2,225,210.74
所有者权益合计		203,400,244.68	202,597,513.60
负债和所有者权益总计		261,762,351.12	202,894,108.26

注:报告截止日2018年6月30日,华夏鼎融债券A基金份额净值1.0157元,华夏鼎融债券C基金份额净值1.0089元;华夏鼎融债券基金份额总额200,254,690.86份(其中A类200,196,913.01份,C类57,777.85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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		2,717,957.52	5,669,023.41
1.利息收入		4,229,468.30	7,847,682.90
其中:存款利息收入		40,263.25	58,017.30
债券利息收入		3,721,731.91	5,913,386.21
资产支持证券利息收入		453,828.33	1,824,592.12
买入返售金融资产收入		13,644.81	51,687.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,186,456.56	-1,570,382.05
其中:股票投资收益		-1,276,781.21	-525,672.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-166,537.34	-1,330,319.45
资产支持证券投资收益		-172.00	6,882.87
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		257,033.99	278,726.90
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-325,055.22	-608,282.46
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1.00	5.02
减:二、费用		1,795,852.81	2,420,922.70
1.管理人报酬		605,890.48	1,489,120.88
2.托管费		201,963.50	496,373.57
3.销售服务费		169.81	437.06
4.交易费用		164,518.89	301,698.98
5.利息支出		719,076.10	35,166.75
其中:卖出回购金融资产支出		719,076.10	35,166.75
6.税金及附加		11,234.57	-
7.其他费用		92,999.46	98,125.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		922,104.71	3,248,100.71
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		922,104.71	3,248,100.71

6.3所有者权益(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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,372,302.86	2,225,210.74	202,597,513.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	922,104.71	922,104.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-117,612.00	-1,761.63	-119,373.63
其中:1.基金申购款	60,848.02	780.23	61,628.25
2.基金赎回款	-178,460.02	-2,541.86	-181,001.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	200,254,690.86	3,145,553.82	203,400,244.68
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	501,853,084.95	-190,984.48	501,662,100.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,248,100.71	3,248,100.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,125,312.67	3,352.18	-1,121,960.49
其中:1.基金申购款	23,008.50	2.56	23,011.06
2.基金赎回款	-1,148,321.17	3,349.62	-1,144,971.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	500,727,772.28	3,060,468.41	503,788,240.69

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人:杨明辉,主管会计工作负责人:汪贵华,会计机构负责人:汪贵华

6.4报表附注

6.4.1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。

6.4.2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。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1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。

6.4.3.2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
上海华夏财富投资管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	112,320,413.98	99.99%	134,236,080.99	63.14%

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	120,503,479.49	65.75%	39,254,963.90	100.00%

6.4.4.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	3,522,300,000.00	100.00%	144,120,000.00	29.33%

6.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	95,987.87	100.00%	78,541.05	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	101,514.56	58.18%	54,471.04	42.74%

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。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	605,890.48	1,489,120.88
其中:支付销售机构的客户维护费	-	176.44

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0.6%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×0.6%/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。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	201,963.50	496,373.57

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0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.4.2.3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 2018年1月1日至2018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	-	169.81	169.81
华夏财富	-	-	-
合计	-	169.81	169.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	-	318.72	318.72
华夏财富	-	118.34	118.34
合计	-	437.06	437.06

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。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2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。

6.4.4.5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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	13,580,386.45	19,174.91	4,378,649.95	43,628.40

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,按银行同业利率计息。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000415	渤海金控	2018-01-16	重大事项	5.84	2018-07-17	5.26	52,300	316,293.60	305,432.00	-
600485	信威集团	2016-12-23	重大事项	14.59	-	-	11,400	187,378.00	166,326.00	-
000603	盛达矿业	2018-06-08	重大事项	10.83	2018-08-21	9.75	12,200	136,735.06	132,126.00	-
601390	中国中铁	2018-05-04	重大事项	7.47	2018-08-20	7.25	17,400	129,997.00	129,978.00	-
000796	凯撒旅游	2018-01-18	重大事项	12.90	2018-07-19	11.61	1,800	25,559.00	23,220.00	-
600221	海航控股	2018-01-09	重大事项	2.61	2018-07-20	2.91	4,600	14,996.00	12,006.00	-
002005	德豪润达	2018-01-02	重大事项	4.36	2018-07-02	3.92	2,100	9,735.83	9,156.00	-
000022	深赤湾A	2017-11-17	重大事项	22.82	2018-07-10	20.55	200	5,373.75	4,564.00	-
002098	浔兴股份	2017-11-10	重大事项	16.33	-	-	200	2,853.00	3,266.00	-
000566	海南海药	2017-11-21	重大事项	12.89	2018-07-09	11.60	200	2,613.20	2,578.00	-

注:上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

6.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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57,000,000.00元,于2018年7月2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。

6.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

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

6.4.6.2各层次金融工具公允价值

截至2018年6月30日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为18,919,266.90元,第二层次的余额为220,442,056.40元,第三层次的余额为0元。(截至2017年12月31日止:第一层次的余额为19,128,234.19元,第二层次的余额为174,419,967.80元,第三层次的余额为0元。)

6.4.6.3公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票,本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

6.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	18,916,076.40	7.23
	其中:股票	18,916,076.40	7.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	220,445,246.90	84.22
	其中:债券	200,463,246.90	76.58
	资产支持证券	19,982,000.00	7.63
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	17,692,072.58	6.76
8	其他各项资产	4,708,955.24	1.80
9	合计	261,762,351.12	100.00

7.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,843.00	0.01
B	采矿业	1,020,523.00	0.50
C	制造业	9,495,620.20	4.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	627,014.00	0.31
E	建筑业	614,073.00	0.30
F	批发和零售业	1,003,197.40	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	513,371.00	0.25
H	住宿和餐饮业	71,949.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	456,405.00	0.22
J	金融业	3,299,797.00	1.62
K	房地产业	804,620.00	0.40
L	租赁和商务服务业	586,242.80	0.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,960.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	342,131.00	0.17
S	综合	42,330.00	0.02
	合计	18,916,076.40	9.30

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000651	格力电器	11,960	563,914.00	0.28
2	601318	中国平安	8,800	515,504.00	0.25
3	000999	华润三九	16,300	453,629.00	0.22
4	600694	大商股份	11,900	386,869.00	0.19
5	601166	兴业银行	25,200	362,880.00	0.18
6	600016	民生银行	49,800	348,600.00	0.17
7	601288	农业银行	99,700	342,968.00	0.17
8	000858	五粮液	4,300	326,800.00	0.16
9	000581	威孚高科	14,000	309,540.00	0.15
10	000415	渤海金控	52,300	305,432.00	0.15

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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	000651	格力电器	572,705.00	0.28
2	601988	中国银行	530,646.00	0.26
3	000581	威孚高科	511,053.00	0.25
4	601186	中国铁建	509,035.00	0.25
5	000999	华润三九	490,656.00	0.24
6	000830	鲁西化工	480,760.72	0.24
7	600703	三安光电	467,977.00	0.23
8	002152	广电运通	433,032.04	0.21
9	000050	深天马A	432,307.28	0.21
10	002517	恺英网络	424,344.00	0.21
11	603328	依顿电子	423,947.00	0.21
12	600406	国电南瑞	421,207.00	0.21
13	002415	海康威视	405,407.00	0.20
14	600694	大商股份	402,803.00	0.20
15	600511	国药股份	400,298.00	0.20
16	000528	柳工	395,899.00	0.20
17	600572	康恩贝	393,046.00	0.19
18	600837	海通证券	381,855.00	0.19
19	601288	农业银行	381,443.00	0.19
20	600383	金地集团	381,157.00	0.19

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	601988	中国银行	533,974.00	0.26
2	002008	大族激光	497,657.00	0.25
3	000050	深天马A	450,026.00	0.22
4	002195	二三四五	418,903.00	0.21
5	601328	交通银行	403,743.00	0.20
6	000002	万科A	401,285.00	0.20
7	600690	青岛海尔	368,321.40	0.18
8	002517	恺英网络	362,270.43	0.18
9	600094	大名城	358,538.95	0.18
10	000830	鲁西化工	349,926.00	0.17
11	600037	歌华有线	348,913.00	0.17
12	600036	招商银行	346,834.00	0.17
13	600519	贵州茅台	344,809.00	0.17
14	000039	中集集团	338,346.56	0.17
15	600801	华新水泥	333,565.00	0.16
16	600516	方大炭素	332,058.00	0.16
17	600572	康恩贝	317,084.00	0.16
18	002573	清新环境	309,093.00	0.15
19	600153	建发股份	303,527.00	0.15
20	600048	保利地产	299,165.00	0.15

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

买入股票的成本(成交)总额	59,132,633.19
卖出股票的收入(成交)总额	53,253,380.89

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,988,800.00	41.29
	其中:政策性金融债	83,988,800.00	41.29
4	企业债券	96,324,250.40	47.36
5	企业短期融资券	10,024,000.00	4.93
6	中期票据	10,111,000.00	4.97
7	可转债(可交换债)	15,196.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,463,246.90	98.56

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	180205	18国开05	500,000	52,435,000.00	25.78
2	180406	18农发06	200,000	20,512,000.00	10.08
3	143165	17世茂G1	120,000	11,880,000.00	5.84
4	018005	国开1701	110,000	11,041,800.00	5.43
5	122395	15富力债	102,000	10,200,000.00	5.01

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1589279	15开元8优先	200,000.00	19,982,000.00	9.82
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12投资组合报告附注

7.12.1报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	12,024.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,696,931.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,708,955.24

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	113013	国君转债	15,196.50	0.01

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000415	渤海金控	305,432.00	0.15	重大事项

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	175	1,143,982.36	200,000,000.00	99.90%	196,913.01	0.10%
华夏鼎融债券C	46	1,256.04	-	-	57,777.85	100.00%
合计	221	906,129.82	200,000,000.00	99.87%	254,690.86	0.13%

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	14,201.13	0.01%
	华夏鼎融债券C	2,470.42	4.28%
	合计	16,671.55	0.01%

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开放式基金	华夏鼎融债券A	0~10
	华夏鼎融债券C	0
	合计	0~10

§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	200,308,213.57	64,089.29
本报告期基金总申购份额	9,423.04	51,424.98
减:本报告期基金总赎回份额	120,723.60	57,736.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	200,196,913.01	57,777.85

§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,本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于2018年4月28日发布公告,杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理,汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于2018年5月19日发布公告,李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

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	
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	112,320,413.98	99.99%	95,987.87	100.00%	-
华泰证券	1	9,920.10	0.01%	-	-	-

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

ⅰ经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度,在业内有良好的声誉。

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

ⅴ建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序:

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

③除本表列示外,本基金还选择东方证券、国信证券、海通证券、中信建投证券、平安证券、申万宏源证券、中国银河证券、招商证券、中金公司、西部证券、方正证券、高华证券、万联证券、东莞证券、国海证券、广州证券、长江证券、长城证券、信达证券、华创证券、民族证券、国盛证券、万和证券、东兴证券、天风证券、民生证券、东吴证券、光大证券、安信证券和川财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,本基金本期没有新增的交易单元。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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国泰君安证券	24,079,924.49	13.14%	-	-
中信证券	120,503,479.49	65.75%	3,522,300,000.00	100.00%
华泰证券	38,690,810.00	21.11%	-	-

§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	2018-01-01至2018-06-30	200,000,000.00	-	-	200,000,000.00	99.87%

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。

华夏基金管理有限公司

二〇一八年八月二十五日