华夏海外收益债券型证券投资基金

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

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。

其全托管人中国建设银行股份有限公司根据太其全合同规定 于 2018年8日23日复核了太报告中的财务指标 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。

基金的讨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	华夏海外收益债券型证券投资基金			
基金简称	华夏收益债券(QDII)			
基金主代码	001061	001061		
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2012年12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	862,175,339.27()			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	华夏收益债券(QDII)A	华夏收益债券(ODII)C		
下属分级基金的交易代码	001061	001063		
报告期末下属分级基金的价额总额	661,634,676.41(f) 200,540,662.86(f)			

投资目标	在控制风险的前提下,追求长期稳定的回报。
投资策略	本基金主要投资于全球证券市场的固定收益类金融工具,通过采取国家/地区配置 領額、债券类属配置策略,行用债投资策略,包转使投资策略,久期管理策略,汇率 超位策略,行生品投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	问期人民币三年期定期存款税后利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高 于货市市场基金。属于较低风险、按纸收益的品种。同时,本基金为境外证券投资的 基金。能了需要项目与境内证券投资基金类似的市场级为现金之外,本基金还面能 汇率风险、国别风险等高外市场投资所而能的特别投资风险。

1	页目	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 財系电话 电子邮箱		李彬	田青	
		400-818-6666	010-67595096	
		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		北京市順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	北京市西城区闸市口大街1号院1号楼	
邮政编码		100033	100033	
法定代表人	表人 杨明辉		田国立	

2.4 境外资产托管人

	项目	境外资产托管人
名称	英文	JPMorgan Chase Bank, National Association
-0.160	中文	摩根大通银行
注册地址		1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		270 Park Avenue, New York, New York 10017-2070
邮政编码		10017

§ 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

o a distribute instruction for	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)			
3.1.1期间数据和指标	华夏收益债券(QDII)A	华夏收益债券(QDII) C		
本期已实现收益	-20,005,471.50	-5,820,739.89		
本期利润	-47,908,962.10	-13,616,760.49		
加权平均基金份额本期利润	-0.0564	-0.0571		
本期加权平均净值利润率	-4.74%	-4.90%		
本期基金份額净值增长率	-4.05%	-4.15%		
3.1.2期末数据和指标	报告期末(201	报告期末(2018年6月30日)		
	华夏收益债券(QDII)A	华夏收益债券(ODII)C		
期末可供分配利润	88,983,315.98	21,070,733.44		
期末可供分配基金份额利润	0.1345	0.1051		
期末基金资产净值	783,622,796.32	231,792,781.58		
期末基金份额净值	1.184	1.156		
3.1.3累计期末指标	报告期末(201	8年6月30日)		
3.1.3旅订则水归怀	华夏收益债券(QDII)A	华夏收益债券(ODII)C		
基金份额累计净值增长率	36.09%	33.13%		

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 华夏收益债券(QDII)A

阶段	率①	砂部学信唱长 率标准差②	业绩比较易准 收益率(3)	收益率标准差 ④	(I) - (3)	2-4
过去一个月	1.37%	0.24%	0.23%	0.00%	1.14%	0.24%
过去三个月	0.34%	0.25%	0.69%	0.00%	-0.35%	0.25%
过去六个月	-4.05%	0.24%	1.36%	0.00%	-5.41%	0.24%
过去一年	-3.35%	0.22%	2.75%	0.00%	-6.10%	0.22%
过去三年	19.61%	0.27%	8.37%	0.00%	11.24%	0.27%
过去五年	41.17%	0.27%	16.60%	0.00%	24.57%	0.27%
自基金合同生效 起至今	36.09%	0.28%	18.99%	0.00%	17.10%	0.28%

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	1.31%	0.25%	0.23%	0.00%	1.08%	0.25%
过去三个月	0.35%	0.24%	0.69%	0.00%	-0.34%	0.24%
过去六个月	-4.15%	0.25%	1.36%	0.00%	-5.51%	0.25%
过去一年	-3.75%	0.22%	275%	0.00%	-6.50%	0.22%
过去三年	18.17%	0.27%	8.37%	0.00%	9.80%	0.27%
过去五年	38.39%	0.26%	16.60%	0.00%	21.79%	0.26%
自基金合同生效 起至今	33.13%	0.27%	18.99%	0.00%	14.14%	0.27%

期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏收益债券(QDII)A

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2018年1月1日至2018年6月30日)



§ 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

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, 华夏安康倩券荣获"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 条字时通知功能,方便客户及时了解交易变动的情况, 化夏基金网上交 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	说明
XE-CI	10(2)	任职日期	离任日期	限	9093
रुस्मा	本基金的基金 经理,机构债券 投资率总监	2017-09-08	-	17年	芝加爾在 東京 東京 東京 東京 東京 東京 東京 東京 東京 東京

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管理人对报告期内木其全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

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

回顾上半年,全球经济增长出现分化,美国经济增长依然保持稳健 态势,反之,欧元区经济则明显放缓。货币政策方面,美联储依旧维持渐 进的加息策略,分别在3月和6月进行了两次加息,而欧洲央行依然没有 对收紧货币政策提出预期。欧元区和美国在经济和货币政策的分化,以 及意大利、西班牙等核心欧元区国家政治风险上升,导致欧元在2季度大 幅贬值,人民币跟随欧元对美元贬值。之后由于国内经济出现放缓,货币 政策转向适度宽松后,人民币贬值进一步加快。新兴经济体在美元流动 性收紧和贸易战威胁增加的压力下,货币出现显著贬值,资本出现外流。 另外,巴西、墨西哥、土耳其、马来西亚等国的政治局势也出现不同程度 的波动,极大地影响了海外投资者的情绪。中国经济运行总体平稳,但资 本市场跟随外部市场波动较大。

上半年亚洲美元债券市场跌幅较大,避险情绪和中国信用紧缩带来 的负面影响在市场中持续发酵。此外,境内融资困难导致融资需求外溢 与投资者悲观情绪叠加,进一步引发市场对于债券的重新估值。从板块 看,中资离岸美元中城投平台、低信用等级民营企业、部分城商行优先股 下跌较为剧烈,部分债券2季度跌幅超过10%,市场流动性备受考验。

报告期内,基金管理人高度重视该基金持仓的信用风险和流动性风 险管理,坚决回避信用资质较弱的债券,适当控制中资美元债的比重。新 兴市场和欧洲高收益债券虽然也经历明显下跌,但是信用风险显著低于 同收益水平的中资美元债,也具备较好的流动性,部分品种已经出现了

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,华夏收益债券(QDII)A基金份额净值为 1.184元,本报告期份额净值增长率为-4.05%;华夏收益债券(QDII)C 基金份额净值为1.156元,本报告期份额净值增长率为-4.15%,同期业绩 比较其准增长率为1 36%

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,美国经济将较2季度有所下滑,主要由于基数效应和财 政政策刺激减弱等原因,但不会对货币政策构成太大影响,9月和12月 加息已成为市场基本预期。贸易战的走向仍将是未来1-2年内全球经济 重大的不确定性因素,目前其风险正在上升。美联储、欧洲央行和日本央 行已经注意到相关风险,一旦各种贸易限制措施显著拖累全球经济,不 排除主要央行的货币政策在未来发生改变的可能。此外,美联储缩表和 加息产生的流动性收紧影响,会进一步对风险资产估值构成压力,目前 美股、美国高收益债券等资产仍处于历史高位,应警惕回调风险。新兴市 场方面,中国经济放缓和美元流动性收紧不可避免地对其宏观经济稳定 构成影响,低债务、低赤字、内需稳健的新兴经济体将有较多的政策空间 来应对外部风险。

投资策略方面,组合投资将利用市场反弹进一步调整仓位,保持组 合流动性和高票息特性。中资美元债市场在上半年超跌后,部分板块品 种出现结构性机会,值得长线布局。但年内中资美元债市场上的系统性 风险仍未解除,贸易战、资本流出、债券发行人高杠杆等问题仍需要较长 的时间和更大幅度的调整来消化,信用风险的控制仍是重中之重,同时 组合也会增加高等级信用债的配置。对于其他新兴市场,下半年国内政 治和美元流动性收紧的排战仍然较大,基金管理人将予以密切关注。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将奉行华 夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理会, 规范运作, 审慎招 资,勒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

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 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

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。

会计主体, 化夏海外收益债券型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

		20104-0/13013	20174-12/73111
资产:		-	-
银行存款		148,031,199.09	209,220,839.19
古算备付金		-	-
存出保证金		4,004,501.11	-
交易性金融资产		863,522,434.17	1,237,543,200.75
其中:股票投资		-	
基金投资		11,733,878.44	5,446,107.55
责券投资		851,788,555.73	1,232,097,093.20
资产支持证券投资		-	
行生金融资产		-	
2.人返售金融资产		-	
立收证券清算款		15,560,958.90	1,627,081.85
 		13,181,217.81	13,580,141.80
垃收股利		134,823.61	15,648.38
立收申购款		2,122,501.52	7,362,801.72
並延所得税资产		-	-
其他资产		-	
8产总计		1,046,557,636.21	1,469,349,713.69
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
0债:		-	
2期借款		-	
を易性金融负债		-	
j生金融负债		-	
出回购金融资产款		-	-
2付证券清算款		18,922,262.98	-
拉付赎回款		11,060,242.39	10,216,890.32
拉付管理人报酬		652,089.37	939,718.69
拉付托管费		191,279.56	275,650.79
立付销售服务费		77,205.35	126,398.66
拉付交易费用		-	
立交税费		159,124.93	
位付利息		-	-
拉付利润		-	-
並延所得税负债		-	-
は他负债		79,853.73	102,530.67
负债合计		31,142,058.31	11,661,189.03
有者权益:		-	_
如收基金		862,175,339.27	1,188,095,561.52
		, , ,	
未分配利润		153,240,238.63	269,592,963.14
		153,240,238.63 1,015,415,577.90	269,592,963.14 1,457,688,524.66

1.184元,华夏收益债券(QDII)C基金份额净值1.156元;华夏收益债券 (QDII)基金份额总额862.175.339.27份(其中A类661.634.676.41份。 C类200,540,662.86份)。

6.2利润表

会计主体:华夏海外收益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

单位:人民币元

上年度末 2017年12月31日

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、收人		-54,544,189.80	51,917,362.17
1利息收入		33,341,186.55	40,924,866.64
其中:存款利息收入		193,486.82	106,601.99
债券利息收入		33,147,699.73	40,818,147.92
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		-	116.73
其他利息收入		-	-
2投资收益(损失以"-"填列)		-51,841,499.52	58,156,582.53
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		0.00	1,520,513.39
债券投资收益		-50,676,366.72	53,467,646.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-2,210,000.00	-
股利收益		1,044,867.20	3,168,42254
3公允价值变动收益(损失以"-"号填 列)		-35,699,511.20	-45,259,717.40
1.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-362,250.31	-2,287,702.13
s其他收入(损失以"-"号填列)		17,884.68	383,332.53
城:二、费用		6,981,532.79	8,604,474.21
1.管理人报酬		4,800,977.58	6,042,888.96
2.托管费		1,408,286.75	1,772,580.78
3.销售服务费		550,541.19	662,371.39
1.交易费用		2,788.84	19,358.78
5.利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
B税金及附加		99,443.19	-
7.其他费用		119,495.24	107,274.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填		-61,525,722.59	43,312,887.96
喊:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-61,525,722.59	43,312,887.96

6.3所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:华夏海外收益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

1001111	本的 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)	1,188,095,561.52	269,592,963.14	1,457,688,524.66		
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	-61,525,722.59	-61,525,722.59		
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)	-325,920,222.25	-54,827,001.92	-380,747,224.17		
其中:1基金申购款	372,287,588.32	71,067,357.27	443,354,945.59		
2基金赎回款	-698,207,810.57	-125,894,359.19	-824,102,169.76		
四、本期向基金份額持有人分配 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)	862, 175, 339.27	153,240,238.63	1,015,415,577.90		
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日				
项目	2017		0日		
项目	2017 实收基金		0日 所有者权益合计		
一、期初所有者权益 (基金净		年1月1日至2017年6月3			
一、期初所有者权益 (基金净	实收基金	年1月1日至2017年6月3 未分配利润	所有者权益合计		
一、期初所有者权益(基金净值) 二、本期经营活动产生的基金净	实收基金	年1月1日至2017年6月3 未分配利润 380,027,908.19	所有者权益合计 1,794,492,165.22		
一、期初所有者权益 (基金净 值) 二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润) 三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数(净值减少以 "一"号填列)	实收基金 1,414,464,257.03	年1月1日至2017年6月3 未分配利润 380,027,908.19 43,312,887.96	所有者权益合计 1,794,492,165.22 43,312,887.96		
一、則初所有者权益(基金净 值) 二、本期经营活动产生的基金净 值之,本期基金净值等的数(条期制制) 金净值要动数(净值减少以 "一号填列) 其中:1基金申购款	实收基金 1,414,464,267.03 - - -224,341,164.73	年1月1日至2017年6月3 来分配利润 380,027,908.19 43,312,887.96 -50,000,843.66	所有者权益合计 1,794,492,165.22 43,312,887.96 -274,342,008.39		
一、期初所有者权益(基金净 值) 二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润) 三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数(净值减少以 "一"号填列)	实收基金 1,414,464,257.03 - -224,341,164.73 169,120,764.34	年1月1日至2017年4月3 未分配利润 380,027,908.19 43,312,887.96 -60,000,843.66 37,022,335.70	所有者权益合计 1,794,492,165.22 43,312,887.96 -274,342,008.39 206,143,100.04		

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:汪贵华,会计机

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

6.4.3.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

与本基金的关系
基金管理人
基金托管人
基金境外资产托管人
基金管理人的股东
基金管理人股东控股的公司
基金管理人的子公司
基金管理人股东控股的公司
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

6.4.4.1.2权证交易

6.4.4.1.4债券回购交易

6.4.4.1.5基金交易

成交金額	占当期基金 交易成交总 額的比例	成交金额	占当期基金交 易成交总额的 比例			
9,296,278.70	100.00%	-	-			
6.4.4.1.6应支付关联方的佣金						
金额甲位:人民币元						
本期 2018年1月1日至2018年6月30日						
	^{成交金額} 9,296,278.70 付关联方的佣金	成交金额 占当期基金 交易成交总 额约虫员 9,296,278.70 100.00% 付关联方的佣金	成交金額	成文金爾		

6.4.4.2 关联方报酬6.4.4.2.1 基金管理费

	6.4.4.2大联万拉酬6.4.4.2.1基金官建筑						
			单位:人民币元				
	項目	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	4,800,977.58	6,042,888.96				
	其中:支付销售机构的客户维护费	1,248,592.89	1,144,531.14				
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							
70	50/的午弗索计坦 逐口罗计至后日日底 按日去付						

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

2018年半年度报告摘要

上年度可比期间 年1月1日至2017年6

单位:人民币元

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

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0.22% 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> 0.22%/当年天数/ 6.4.4.2.3销售服务费

	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				
庆得销售服务费的各 关联方名称					
300031117	华夏收益债券 (ODII)A	华夏收益债券(QDII) C	合计		
·夏基金管理有限公]	-	60,432.90	60,432.90		
中国建设银行	-	11,729.55	11,729.66		
官证券	-	1,595.52	1,595.52		
P信证券(山东)	-	1,258.27	1,258.27		
夏财富	-	6,451.99	6,451.99		
rit	-	81,468.23	81,468.23		
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日				
庆得销售服务费的各 关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费				
300031117	华夏收益债券 (ODII)A	华夏收益债券(QDII) C	合计		
·夏基金管理有限公	-	206,024.93	206,024.93		
中国建设银行	-	21,198.17	21,198.17		
官证券	-	4,880.43	4,880.43		
「信证券(山东)	-	1,794.49	1,794.49		
:夏财富	-	10,513.00	10,513.00		
rit	-	244,411.02	244,411.02		

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日 基金资产净值0.40%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

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 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

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

注:本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国建设银行和基金 境外资产托管人摩根大通银行保管,按适用利率或约定利率计息。

期末余额 当期利息收入

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

期末余額 当期利息收入

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

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 6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

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11,733,878.44元,第二层次的余额为851,788,

555.73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5.446.107.55元,第二层次的余额为1,232,097,093.20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

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具

的公允价值所属层次未发生重大变动。 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

序号	項目	金額	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	
	存托凭证	-	-
2	基金投资	11,733,878.44	1.13
3	固定收益投资	851,788,555.73	81.3
	其中:债券	851,788,555.73	81.39
	资产支持证券	-	_
4	金融衍生品投资	-	_
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	_
	权证	-	_
5	买人返售金融资产	-	_
	其中: 买断式回购的买人返售金融资产	-	_
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	148,031,199.09	14.14
	A A A A A A A CONTRACTOR		

7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资

7.3期末按行业分类的权益投资组合 本基金本报告期末未持有权益投资

本基金本报告期末未持有权益投资。 7.5报告期内股票投资组合的重大变动 7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投

本基金本报告期未持有权益投资

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投 资明细 本基金本报告期未持有权益投资。

7.5.3权益投资的买人成本总额及卖出收入总额 本基金本报告期未持有权益投资 7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

注:本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信 用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级 7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投

金额单位:人民币元

34,718,2

占基金资产 值比例(%

注:①债券代码为ISIN码 ②数量列示债券面值,外币按照期末估值汇率折为人民币,四舍五 人保留整数

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支 持证券投资明细

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金

金额单位:人民币元

单位:份

金额单位,人民币元

7.11投资组合报告附注 7.11.1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

7.11.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

封闭式基金

.11.	3期末具他各坝贸产构成	
		单位:人民币
字号	名称	金額
1	存出保证金	4,004,501.11
2	应收证券清算款	15,560,958.90
3	应收股利	134,823.61
4	应收利息	13,181,217.81
5	应收申购款	2,122,501.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
	114	

7.11.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.11.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末未持有股票。

份额单位,份 占总份 比例

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

8 9开放式基金份额变动

§ 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

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

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

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 本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7基金和用证券公司交易单元的有关情况

标准,即:

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

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

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

③除本表列示外、本基金还洗择了安信证券、光大证券、长城证券 东方证券、东莞证券、方正证券、高华证券、国泰君安证券、国信证券、广 7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投 州证券、海通证券、华泰证券、华创证券、民族证券、民生证券、平安证券 申万宏源证券、申万宏源西部证券、天风证券、万联证券、信达证券、西部 证券、中国银河证券、招商证券、中金公司、中信证券、中信建投证券、国 海证券、长江证券、川财证券、东吴证券、国盛证券、万和证券和东兴证券 的交易单元作为本基金交易单元,本基金本报告期无股票交易及应付佣

> ④在上述租用的券商交易单元中,本基金本期无新增的交易单元。 本期没有剔除的券商交易单元。

⑤此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易,佣金指基金通 过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。 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

§ 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

二〇一八年八月二十五日

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超

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

§ 6半年度财务会计报告(未经审计) 6.1资产负债表

6.4.4.1.3债券交易

金额单位:人民币元

券有限公司	9,296,278	100.0	%0		-	
1.6应支	付关联方的佣	金				
				金額	i单	位:人民
5名称 xx #0 1-xx #0.000.0	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
	期末应付佣金余额	b	期末应付佣金 总额的比例			
券有限公司	2,788.84	100.00%		_		

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× 0.75%/当年天数

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

过20%的情况。

况

金额单位:人民币元

占当期基金 成交总额的

华夏基金管理有限公司