华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月11日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	华夏鼎禄三个月定开债券
基金主代码	006862
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年10月11日
报告期末基金份额总额	210,011,833.39份
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求持续、稳定的收益。
投资策略	本基金主要通过采取债券类属配置策略、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、资产支持证券投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华夏鼎禄三个月定开债券A / 华夏鼎禄三个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	006862 / 006863
报告期末下属分级基金的份额总额	210,011,833.39份 / -份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月11日(基金合同生效日)-2018年12月31日)	
	华夏鼎禄三个月定开债券A	华夏鼎禄三个月定开债券C
1.本期已实现收益	1,319,456.25	-
2.本期利润	3,286,280.33	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0156	-
4.期末基金资产净值	213,298,113.72	-
5.期末基金份额净值	1.0156	-

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本基金合同于2018年10月11日生效。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏鼎禄三个月定期开放债券A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.56%	0.06%	1.84%	0.06%	-0.28%	0.01%

华夏鼎禄三个月定期开放债券C:

2018年10月11日至2018年12月31日期间, 华夏鼎禄三个月定开债券C类基金份额为零。

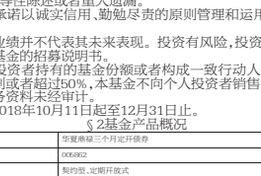
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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10月11日至2018年12月31日)

华夏鼎禄三个月定期开放债券A:



注:①本基金合同于2018年10月11日生效。

②根据华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金合同规定, 本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

③2018年10月11日至2018年12月31日期间, 华夏鼎禄三个月定开债券C类基金份额为零。

§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明宇	本基金的基金经理、固定收益部执行总经理	2018-10-11	-	9年	经济学硕士,2009年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构债券投资部研究员、投资经理助理、投资经理,华夏鼎安债券型证券投资基金基金经理(2017年12月19日至2018年3月14日期间)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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年4季度,国际经济方面,在对美国经济增长放缓、中美贸易战持续和美联储加息的担忧下,美股从高位大幅回撤。美联储12月如期加息,但释放了一定的鸽派信号,市场对明年美联储加息次数预期有所降低。油价从高位大幅回落,美元指数维持高位,美债收益率下行。国内经济方面,数据显示国内经济有较大的下行压力,3季度GDP创15年来单季最大下滑环比,信贷和旧口径社融数据下滑且结构较差,工业增加值、消费和企业利润数据持续回落,抢出口效应消退后,11月进出口数据也大幅下滑。中美摩擦继续升级,但在G20会议中美元首会面后有所缓和,人民币汇率徘徊在6.9附近高位,外汇占款持续下降。国内政策方面,央行12月创设定向中期借贷便利(TMLF)定向货币宽松,政府针对股权质押、民企信用风险和实体融资困难等问题推出一系列政策,环保限产和金融监管也边际放松,宽货币加宽信用的政策方向延续。债市方面,4季度利率债和地方债供给较少,利率债一级招标情绪较好,10月较差的金融数据公布后,收益率出现较大幅度下行,之后12月中,在年末资金面季节性收紧、地产放松预期增强和19年地方债可能提前发行的传言等多重因素叠加下,收益率小幅回调。总体来看,长端政金债和地方债表现最好,各类属债券收益率曲线变平,信用利差变动不大,受政策利好带动,民企债、城投债和低等级债券利差有所收窄。股市方面,季初美股高位回落带动全球股市下跌,A股大幅下跌至年内新低,由于政策催化和风险偏好修复,股权质押风险有所化解,股市小幅反弹,4季度转债表现略好于股票。

报告期内,本基金优化了组合结构,适度提升了持仓久期,维持了合适的杠杆水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日, 华夏鼎禄三个月定期开放债券A基金份额净值为1.0156元,本报告期份额净值增长率为1.56%,同期业绩比较基准增长率为1.84%。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	388,694,092.60	97.33
	其中:债券	388,694,092.60	97.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,852,680.76	0.71
7	其他各项资产	7,794,838.32	1.95
8	合计	399,341,611.68	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	350,024,092.60	164.10
	其中:政策性金融债	350,024,092.60	164.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	38,670,000.00	18.13
9	其他	-	-
10	合计	388,694,092.60	182.23

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160306	16进出06	1,000,000	99,690,000.00	46.72
2	108602	国开1704	985,080	99,463,527.60	46.63
3	108604	国开1805	707,950	71,290,548.00	33.42
4	160411	16农发11	600,000	59,814,000.00	28.04
5	160421	16农发21	200,000	19,806,000.00	9.29

5.6报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海浦发银行股份有限公司、兴业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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,965.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,774,872.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,794,838.32

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏鼎禄三个月定开债券A	华夏鼎禄三个月定开债券C
基金合同生效日基金份额总额	210,011,833.39	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	210,011,833.39	-

注:本基金合同于2018年10月11日生效。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	华夏鼎禄三个月定开债券A	华夏鼎禄三个月定开债券C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,000,611.17	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,611.17	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.76	-

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,611.17	4.76%	10,000,000.00	4.76%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,611.17	4.76%	10,000,000.00	4.76%	-

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1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

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过20%的情况。

9.2影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2018年10月12日发布华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告。

2018年12月7日发布华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告。

2018年12月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构及华夏财富申购、赎回等业务最低数额限制的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人,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12月31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2/152;华夏圆和混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金 (股票上下限0-95%+基准股票比例60%-100%)”中排序9/346;华夏沪港通恒生ETF、华夏金融ETF在“股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金”中分别排序1/109和9/109;华夏沪港通恒生ETF联接(A类)、华夏上证50ETF联接(A类)在“股票基金-指数股票型基金-股票ETF联接基金(A类)”中分别排序2/73和10/73。

在客户服务方面,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)华夏基金直销交易系统上线养老基金“申购+定投”功能,为客户提供了更便捷的投资方式;(2)对旗下部分开放式基金申购、赎回、转换和定期定额申购业务的最低数额限制进行调整, 降低了客户交易及持有基金的门槛;(3)与长沙银行、网商银行、百度百盈基金等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展“华夏邀您重阳登高祈福”、“大胆预测退休金”、“猜‘折扣5因素’”等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§10备查文件目录

10.1备查文件目录

10.1.1中国证监会准予基金注册的文件;

10.1.2《华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;

10.1.3《华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;

10.1.4法律意见书;

10.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

10.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2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。

10.3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

二〇一九年一月二十一日

华夏鼎茂债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	华夏鼎茂债券
基金主代码	004042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月15日
报告期末基金份额总额	1,956,666,445.66份
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求持续、稳定的收益。
投资策略	本基金主要通过采取债券类属配置策略、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等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华夏鼎茂债券A / 华夏鼎茂债券C
下属分级基金的交易代码	004042 / 004043
报告期末下属分级基金的份额总额	512,246,383.82份 / 1,444,420,061.84份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)	
	华夏鼎茂债券A	华夏鼎茂债券C
1.本期已实现收益	5,974,681.01	10,729,643.70
2.本期利润	9,861,400.62	17,058,518.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0290	0.0266
4.期末基金资产净值	568,627,030.66	1,582,997,805.18
5.期末基金份额净值	1.0906	1.0959

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏鼎茂债券A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.74%	0.06%	1.99%	0.06%	0.75%	0.01%

华夏鼎茂债券C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.71%	0.06%	1.99%	0.06%	0.72%	0.01%

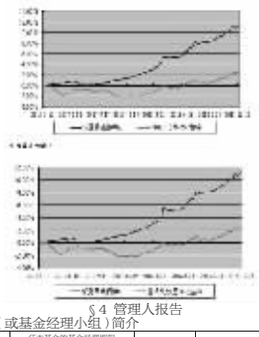
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎茂债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月15日至2018年12月31日)

华夏鼎茂债券A:



§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明宇	本基金的基金经理、固定收益部执行总经理	2017-12-11	-	9年	经济学硕士,2009年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构债券投资部研究员、投资经理助理、投资经理,华夏鼎安债券型证券投资基金基金经理(2017年12月19日至2018年3月14日期间)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公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年4季度,国际经济方面,在对美国经济增长放缓、中美贸易战持续和美联储加息的担忧下,美股从高位大幅回撤。美联储12月如期加息,但释放了一定的鸽派信号,市场对明年美联储加息次数预期有所降低。油价从高位大幅回落,美元指数维持高位,美债收益率下行。国内经济方面,数据显示国内经济有较大的下行压力,3季度GDP创15年来单季最大下滑环比,信贷和旧口径社融数据下滑且结构较差,工业增加值、消费和企业利润数据持续回落,抢出口效应消退后,11月进出口数据也大幅下滑。中美摩擦继续升级,但在G20会议中美元首会面后有所缓和,人民币汇率徘徊在6.9附近高位,外汇占款持续下降。国内政策方面,央行12月创设定向中期借贷便利(TMLF)定向货币宽松,政府针对股权质押、民企信用风险和实体融资困难等问题推出一系列政策,环保限产和金融监管也边际放松,宽货币加宽信用的政策方向延续。债市方面,4季度利率债和地方债供给较少,利率债一级招标情绪较好,10月较差的金融数据公布后,收益率出现较大幅度下行,之后12月中,在年末资金面季节性收紧、地产放松预期增强和19年地方债可能提前发行的传言等多重因素叠加下,收益率小幅回调。总体来看,长端政金债和地方债表现最好,各类属债券收益率曲线变平,信用利差变动不大,受政策利好带动,民企债、城投债和低等级债券利差有所收窄。股市方面,季初美股高位回落带动全球股市下跌,A股大幅下跌至年内新低,由于政策催化和风险偏好修复,股权质押风险有所化解,股市小幅反弹,4季度转债表现略好于股票。

报告期内,本基金优化了组合结构,适度提升了持仓久期,维持了合适的杠杆水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日, 华夏鼎茂债券A基金份额净值为1.0905元,本报告期份额净值增长率为2.74%;华夏鼎茂债券C基金份额净值为1.0959元,本报告期份额净值增长率为2.71%,同期业绩比较基准增长率为1.99%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,326,847,283.70	94.08
	其中:债券	2,323,706,883.70	93.95
	资产支持证券	3,140,500.00	0.13
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	50,709,486.56	2.05
7	其他各项资产	95,790,684.03	3.87
8	合计	2,473,347,486.28	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	646,172,325.10	42.61
	其中:政策性金融债	475,330,325.10	31.34
4	企业债券	857,186,566.52	56.52
5	企业短期融资券	20,144,000.00	1.33
6	中期票据	888,764,700.00	58.60
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,412,267,591.62	159.06

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180205	18国开05	3,200,000	348,672,000.00	16.28
2	180210	18国开10	2,700,000	278,451,000.00	13.00
3	101759011	17荷开MTN002	900,000	91,494,000.00	4.27
4	108901	农发1801	827,560	82,763,275.50	3.86
5	101800668	18金隅MTN002	800,000	82,696,000.00	3.86

5.6报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116983	狮桥11A	50,000.00	3,140,500.00	0.15
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,644.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,441,328.45
5	应收申购款	43,334,711.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,790,684.03

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏鼎茂债券A	华夏鼎茂债券C
基金合同生效日基金份额总额	512,246,383.82	1,444,420,061.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	512,246,383.82	1,444,420,061.84

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	华夏鼎茂债券A	华夏鼎茂债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	25,120,578.78	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	25,120,578.78	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.90	-

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,222.34	0.68%	10,000,000.00	0.68%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,222.34	0.68%	10,000,000.00	0.68%	-

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1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

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过20%的情况。

9.2影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2018年10月10日发布华夏基金管理有限公司关于华夏鼎茂债券型证券投资基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告。

2018年10月31日发布华夏基金管理有限公司关于限制华夏鼎茂债券型证券投资基金申购业务的公告。

2018年11月8日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的公告。

2018年11月19日发布华夏基金管理有限公司关于华夏鼎茂债券型证券投资基金新增北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告。

2018年12月3日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构的公告。

2018年12月4日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增腾安基金销售(深圳)有限公司为代销机构的公告。

2018年12月4日发布华夏鼎茂债券型证券投资基金第二次分红公告。

2018年12月7日发布华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告。

2018年12月14日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告。

2018年12月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构及华夏财富申购、赎回等业务最低数额限制的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人,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12月31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2/152;华夏圆和混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金 (股票上下限0-95%+基准股票比例60%-100%)”中排序9/346;华夏沪港通恒生ETF、华夏金融ETF在“股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金”中分别排序1/109和9/109;华夏沪港通恒生ETF联接(A类)、华夏上证50ETF联接(A类)在“股票基金-指数股票型基金-股票