

华夏鼎盛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。

根据基金管理人于2019年1月5日发布的《华夏鼎盛债券型证券投资基金基金业绩持续达标公告》，华夏鼎盛债券型证券投资基金自2019年1月8日正式转型为华夏短债债券型证券投资基金。

本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

基金名称	华夏鼎盛债券A
基金代码	004972
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2017年12月31日
报告期末基金份额总额	101,368,107.73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	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略。在宏观政策、信用债市场、利率债市场、可转债市场、权益市场等方面进行综合分析，动态调整资产配置比例。
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，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、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
下属分级基金的基本情况	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
报告期末基金份额总额	004972 004973
报告期末基金份额总额	101,368,107.73份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
1.本期已实现收益	751,209.84	138,132.80
2.本期公允价值变动收益	805,265.93	140,265.93
3.本期投资收益	805,265.93	140,265.93
4.本期基金资产净值	101,368,107.73	101,368,107.73
5.本期基金份额净值	1.013681	1.013681

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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

3.2.2本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

华夏鼎盛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

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年一月二一日

§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。

基金托管人兴业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合计不超过基金总份额的15%。本基金不向个人投资者销售。

本报告财务资料未经审计。

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

基金名称	华夏鼎盛债券A
基金代码	004972
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2018年12月31日
报告期末基金份额总额	101,368,107.73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	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略。在宏观政策、信用债市场、利率债市场、可转债市场、权益市场等方面进行综合分析，动态调整资产配置比例。
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，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、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
下属分级基金的基本情况	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
报告期末基金份额总额	004972 004973
报告期末基金份额总额	101,368,107.73份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
1.本期已实现收益	751,209.84	138,132.80
2.本期公允价值变动收益	805,265.93	140,265.93
3.本期投资收益	805,265.93	140,265.93
4.本期基金资产净值	101,368,107.73	101,368,107.73
5.本期基金份额净值	1.013681	1.013681

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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

3.2.2本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

华夏鼎盛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

华夏鼎盛债券A：

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

基金名称	华夏鼎盛债券A
基金代码	004972
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2017年12月31日
报告期末基金份额总额	101,368,107.73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	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略。在宏观政策、信用债市场、利率债市场、可转债市场、权益市场等方面进行综合分析，动态调整资产配置比例。
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，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、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
下属分级基金的基本情况	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。
报告期末基金份额总额	004972 004973
报告期末基金份额总额	101,368,107.73份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
1.本期已实现收益	751,209.84	138,132.80
2.本期公允价值变动收益	805,265.93	140,265.93
3.本期投资收益	805,265.93	140,265.93
4.本期基金资产净值	101,368,107.73	101,368,107.73
5.本期基金份额净值	1.013681	1.013681

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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

3.2.2本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

华夏鼎盛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

华夏鼎泰债券型证券投资基金

2018年第四季度报告



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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

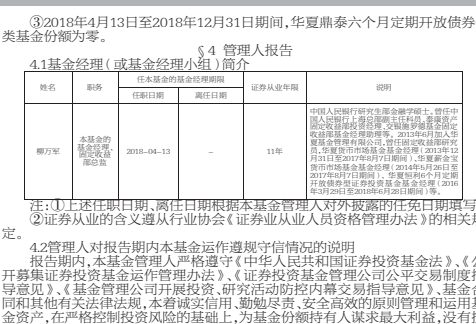
3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎盛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

华夏鼎泰六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



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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

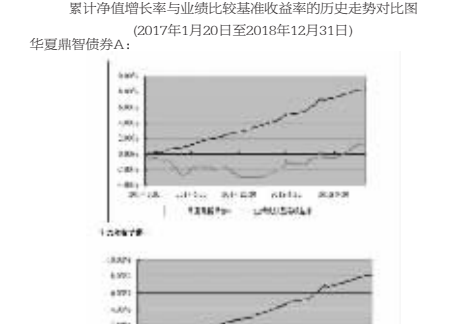
3.2.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎盛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

华夏鼎智债券型证券投资基金

2018年第四季度报告



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

华夏鼎盛债券A：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

华夏鼎盛债券C：

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额
最近三个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近六个月	1.01%	0.82%	0.19%
最近一年	1.01%	0.82%	0.19%

3.2.2本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

华夏鼎盛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

市加息预期的政策方向延续。债市方面，4季度利率债和地方政府债供给较少，利率债一级招标情况较好，10月收发的金融数据公布后，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、地产放松刺激预期增强和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，长端政策债和地方政府债表现较好，各类债券收益率曲线较为平坦，信用利差变动不大，受政策利好带动，长信债、城投债和高等级信用债有所收窄。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，由于政策利好和风险防范修复，股权质押风险有所化解，股市小幅反弹，多数板块表现较好，个股表现分化。

报告期内，本基金优化了组合结构，适度提升了持仓久期，维持了公债的杠杆水平。

4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，华夏鼎盛债券A基金份额净值为1.0418元，本报告期基金份额净值增长率为1.04%；华夏鼎盛债券C基金份额净值为1.0407元，本报告期基金份额净值增长率为1.07%。同期业绩比较基准收益率为1.99%。

4.3报告期内基金持有人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。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	-	-
2	结算备付金	-	-
3	应收利息	75,424,506.10	0.72%
4	应收股利	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	买入返售金融资产	-	-
11	买入返售金融资产	-	-
12	买入返售金融资产	-	-
13	买入返售金融资产	-	-
14	买入返售金融资产	-	-
15	买入返售金融资产	-	-
16	买入返售金融资产	-	-
17	买入返售金融资产	-	-
18	买入返售金融资产	-	-
19	买入返售金融资产	-	-
20	买入返售金融资产	-	-
21	买入返售金融资产	-	-
22	买入返售金融资产	-	-
23	买入返售金融资产	-	-
24	买入返售金融资产	-	-
25	买入返售金融资产	-	-
26	买入返售金融资产	-	-
27	买入返售金融资产	-	-
28	买入返售金融资产	-	-
29	买入返售金融资产	-	-
30	买入返售金融资产	-	-
31	买入返售金融资产	-	-
32	买入返售金融资产	-	-
33	买入返售金融资产	-	-
34	买入返售金融资产	-	-
35	买入返售金融资产	-	-
36	买入返售金融资产	-	-
37	买入返售金融资产	-	-
38	买入返售金融资产	-	-
39	买入返售金融资产	-	-
40	买入返售金融资产	-	-
41	买入返售金融资产	-	-
42	买入返售金融资产	-	-
43	买入返售金融资产	-	-
44	买入返售金融资产	-	-
45	买入返售金融资产	-	-
46	买入返售金融资产	-	-
47	买入返售金融资产	-	-
48	买入返售金融资产	-	-
49	买入返售金融资产	-	-
50	买入返售金融资产	-	-
51	买入返售金融资产	-	-
52	买入返售金融资产	-	-
53	买入返售金融资产	-	-
54	买入返售金融资产	-	-
55	买入返售金融资产	-	-
56	买入返售金融资产	-	-
57	买入返售金融资产	-	-
58	买入返售金融资产	-	-
59	买入返售金融资产	-	-
60	买入返售金融资产	-	-
61	买入返售金融资产	-	-
62	买入返售金融资产	-	-
63	买入返售金融资产	-	-
64	买入返售金融资产	-	-
65	买入返售金融资产	-	-
66	买入返售金融资产	-	-
67	买入返售金融资产	-	-
68	买入返售金融资产	-	-
69	买入返售金融资产	-	-
70	买入返售金融资产	-	-
71	买入返售金融资产	-	-
72	买入返售金融资产	-	-
73	买入返售金融资产	-	-
74	买入返售金融资产	-	-
75	买入返售金融资产	-	-
76	买入返售金融资产	-	-
77	买入返售金融资产	-	-
78	买入返售金融资产	-	-
79	买入返售金融资产	-	-
80	买入返售金融资产	-	-
81	买入返售金融资产	-	-
82	买入返售金融资产	-	-
83	买入返售金融资产	-	-
84	买入返售金融资产	-	-
85	买入返售金融资产	-	-
86	买入返售金融资产	-	-
87	买入返售金融资产	-	-
88	买入返售金融资产	-	-
89	买入返售金融资产	-	-
90	买入返售金融资产	-	-
91	买入返售金融资产	-	-
92	买入返售金融资产	-	-
93	买入返售金融资产	-	-
94	买入返售金融资产	-	-
95	买入返售金融资产	-	-
96	买入返售金融资产	-	-
97	买入返售金融资产	-	-
98	买入返售金融资产	-	-
99	买入返售金融资产	-	-
100	买入返售金融资产	-	-

8	其他资产	77,742,284.67	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。

5.2.2 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。

5.3 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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	6,136,192.03	0.97
4	地方政府债	1,126,100.00	0.18
5	公司债	22,271,793.75	3.79
6	企业短期融资券	45,139,400.00	7.08
7	中期票据	1,987,700.00	0.31
8	可转债(可交换债)	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	其他	-	-
11	合计	76,424,506.10	12.11

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