华夏短债债券型证券投资基金

（原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型）

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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4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。

华夏鼎盛债券型证券投资基金于2018年11月29日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于华夏鼎盛债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,会议议案于2019年1月4日获得通过,大会决议自同日起生效。自2019年1月8日起,“华夏鼎盛债券型证券投资基金”正式转型为“华夏短债债券型证券投资基金”。

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。

华夏短债债券型证券投资基金报告期自2019年1月8日起至2019年3月31日止,原华夏鼎盛债券型证券投资基金报告期自2019年1月1日起至2019年1月7日止。如无特殊说明,本报告中“本基金”指华夏短债债券型证券投资基金及原华夏鼎盛债券型证券投资基金。

§2基金产品概况

2.1华夏短债债券型证券投资基金

基金简称	华夏短债债券
基金主代码	004672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月8日
报告期末基金份额总额	48,082,145.25份
投资目标	本基金将在保持资产良好流动性的前提下,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资配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。
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	华夏短债债券A	华夏短债债券C
下属分级基金的交易代码	004672	004673
报告期末下属分级基金的份额总额	36,965,319.29份	11,116,825.96份

注:华夏短债债券型证券投资基金由原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型而来,自2018年1月8日起,《华夏短债债券型证券投资基金基金合同》生效。

2.2原华夏鼎盛债券型证券投资基金

基金简称	华夏鼎盛债券
基金主代码	004672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月6日
报告期末基金份额总额	59,133,835.72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	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
下属分级基金的交易代码	004672	004673
报告期末下属分级基金的份额总额	49,997,738.09份	9,136,097.63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	转型后		转型前	
	报告期(2018年1月8日-2019年3月31日)		报告期(2019年1月1日-2019年1月7日)	
	华夏短债债券A	华夏短债债券C	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
1.本期已实现收益	604,158.91	89,067.56	20,750.12	3,459.11
2.本期利润	562,586.84	74,377.42	123,396.30	21,741.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0074	0.0071	0.0025	0.0025
4. 期末基金资产净值	38,883,617.48	11,677,944.71	52,213,152.03	9,530,068.32
5. 期末基金份额净值	1.0519	1.0505	1.0443	1.0431

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华夏短债债券型证券投资基金由原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型而来,自2019年1月8日起,《华夏短债债券型证券投资基金基金合同》生效。

3.2基金净值表现

3.2.1华夏短债债券型证券投资基金

3.2.1.1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

华夏短债债券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
2019年1月8日-2019年3月31日	0.73%	0.02%	0.68%	0.01%	0.05%	0.01%

华夏短债债券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
2019年1月8日-2019年3月31日	0.71%	0.02%	0.68%	0.01%	0.03%	0.01%

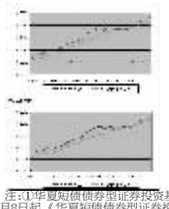
3.2.1.2自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏短债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

(2019年1月8日至2019年3月31日)

华夏短债债券A:



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华夏短债债券型证券投资基金由原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型而来,自2019年1月8日起,《华夏短债债券型证券投资基金基金合同》生效。

③根据华夏短债债券型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。

3.2.2原华夏鼎盛债券型证券投资基金

3.2.2.1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
2019年1月1日-2019年1月7日	0.24%	0.01%	0.36%	0.06%	-0.12%	-0.05%

华夏鼎盛债券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
2019年1月1日-2019年1月7日	0.23%	0.02%	0.36%	0.06%	-0.13%	-0.04%

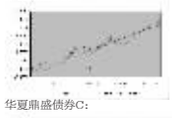
3.2.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎盛债券型证券投资基金

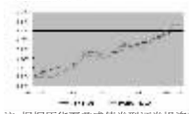
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年12月6日至2019年1月7日)

华夏鼎盛债券A:



华夏鼎盛债券C:



注:根据原华夏鼎盛债券型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。

§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

4.1.1华夏短债债券型证券投资基金

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	2019-01-08	-	10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,华夏鼎实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)。

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。

4.1.2华夏短债债券型证券投资基金

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		
祝灿	本基金的基金经理、机构债券投资部总监	2017-12-06	2019-01-07	17年	芝加哥大学工商管理硕士。曾任中信证券投资管理部投资经理、德意志银行新加坡分行交易员等。2013年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构债券投资部投资经理,华夏鼎益债券型证券投资基金基金经理(2016年12月27日至2017年12月28日期间)、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理(2017年6月15日至2018年3月14日期间)、华夏鼎茂债券型证券投资基金基金经理(2017年3月15日至2018年3月29日期间)等。
刘明宇	本基金的基金经理、固定收益部执行总经理	2017-12-19	2019-01-07	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,华夏鼎实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》,基金公司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或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6.8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

转型前,截至2019年1月7日,华夏鼎盛债券A基金份额净值为1.0443元,2019年1月1日至1月7日期间份额净值增长率为0.24 %;华夏鼎盛债券C基金份额净值为1.0431元,2019年1月1日至1月7日期间份额净值增长率为0.23 %,同期业绩比较基准收益率为0.36%;转型后,截止2019年3月31日,华夏短债债券A基金份额净值为1.0519元,2019年1月8日至3月31日期间份额净值增长率为0.73%;华夏短债债券C基金份额净值为1.0505元,2019年1月8日至3月31日期间份额净值增长率为0.71%,同期业绩比较基准收益率为0.68%。

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华夏短债债券型证券投资基金

(报告期末为2019年3月31日,报告期间为2019年1月8日至2019年3月31日)

5.1.1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	64,409,875.80	96.21
	其中:债券	64,409,875.80	96.21
	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	1,128,615.97	1.69
7	其他各项资产	1,406,542.63	2.10
8	合计	66,945,034.40	100.00

5.1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1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。

5.1.3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。

5.1.4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	8,749,200.00	17.30
	其中:政策性金融债	2,713,500.00	5.37
4	企业债券	28,466,275.80	56.30
5	企业短期融资券	27,194,400.00	53.78
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,409,875.80	127.39

5.1.5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	011801759	18路安SCP006	50,000	5,033,000.00	9.95
2	122295	13川投01	50,000	5,007,000.00	9.90
3	011801680	18融德资产SCP001	40,000	4,032,800.00	7.98
4	136600	16穗建01	40,000	3,997,600.00	7.91
5	041800219	18大同煤矿CP002	30,000	3,039,600.00	6.01

5.1.6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。

5.1.7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。

5.1.8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。

5.1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1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。

5.1.9.2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。

5.1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1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。

5.1.10.2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。

5.1.10.3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。

5.1.11投资组合报告附注

5.1.11.1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。

5.1.11.2其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,497.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,397,424.44
5	应收申购款	7,620.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,406,542.63

5.1.11.4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。

5.1.11.5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。

5.1.11.6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。

5.2 原华夏鼎盛债券型证券投资基金

(报告期末为2019年1月7日,报告期间为2019年1月1日至2019年1月7日)

5.2.1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	75,745,434.80	95.79
	其中:债券	75,745,434.80	95.79
	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	1,171,695.38	1.48
7	其他各项资产	2,153,619.09	2.72
8	合计	79,070,749.27	100.00

5.2.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1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。

5.2.3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。

5.2.4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	6,143,081.60	9.95
	其中:政策性金融债	3,125,381.60	5.06
4	企业债券	23,266,553.20	37.68
5	企业短期融资券	41,243,800.00	66.80
6	中期票据	5,092,000.00	8.25
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,745,434.80	122.68

5.2.5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	101456059	14云能投MTN003	50,000	5,092,000.00	8.25
2	122295	13川投01	50,000	5,037,500.00	8.16
3	011801759	18路安SCP006	50,000	5,028,500.00	8.14
4	041800344	18银钢CP004	50,000	5,025,000.00	8.14
5	011801022	18川能投SCP002	40,000	4,034,800.00	6.53

5.2.6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。

5.2.7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。

5.2.8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。

5.2.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1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。

5.2.9.2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。

5.2.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1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。

5.2.10.2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。

5.2.10.3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。

5.2.11投资组合报告附注

5.2.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体中,国信证券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。

5.2.11.2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。

5.2.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,210.63
2	应收证券清算款	800,730.85
3	应收股利	-
4	应收利息	882,203.90
5	应收申购款	107.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	
9	合计	1,693,252.38

5.2.11.4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。

5.2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.6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

6.1华夏短债债券型证券投资基金

单位:份

项目	华夏短债债券A	华夏短债债券C
基金合同生效日基金份额总额	49,997,738.09	9,136,097.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	50,290,545.18	7,162,717.21
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	63,322,963.98	5,181,988.88
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	36,965,319.29	11,116,825.96

注:华夏短债债券型证券投资基金由原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型而来,自2019年1月8日起,《华夏短债债券型证券投资基金基金合同》生效。

6.2原华夏鼎盛债券型证券投资基金

项目	华夏鼎盛债券A	华夏鼎盛债券C
本报告期期初基金份额总额	50,054,331.00	8,911,586.17
报告期基金总申购份额	39,312.82	369,321.11
减:报告期基金总赎回份额	95,905.73	144,809.65
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,997,738.09	9,136,097.63

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1华夏短债债券型证券投资基金

7.1.1基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.1.2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。

7.2 原华夏鼎盛债券型证券投资基金

7.2.1基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.2.2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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	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	2019-01-24至2019-03-26	-	47,781,918.96	47,781,918.96	-	0.00%
	2	2019-03-27至2019-03-31	9,770,373.27	-	-	9,770,373.27	20.32%
	3	2019-01-08至2019-01-23、2019-03-15至2019-03-31	19,441,042.09	-	-	19,441,042.09	40.43%

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。

8.2 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

2019年1月5日发布华夏鼎盛债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告。

2019年1月14日发布华夏基金管理有限公司关于华夏短债债券型证券投资基金新增代销机构的公告。

2019年1月16日发布华夏基金管理有限公司关于华夏短债债券型证券投资基金新增代销机构的公告。

2019年1月21日发布华夏基金管理有限公司关于华夏短债债券型证券投资基金新增代销机构的公告。

2019年2月25日发布华夏基金管理有限公司关于华夏短债债券型证券投资基金新增代销机构的公告。

2019年2月28日发布华夏基金管理有限公司关于华夏短债债券型证券投资基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019年3月2日发布华夏基金管理有限公司公告。

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2019年3月31日数据),华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A类)”中排序3/27;华夏兴华混合(H类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非A类)”中排序5/23;华夏可转债增强债券(A类)在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金(A类)”中排序3/230;华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债A类)”中排序3/174;华夏债券(C类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债非A类)”中排序7/107;华夏中小板ETF在“股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金”中排序7/62;华夏中小企业板ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(A类)”中排序6/47。

1季度,公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。2019年3月,在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上,华夏安康债券、华夏收益债券(ODII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报ODII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。

在客户服务方面,1季度,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)直销电子交易平台开通华夏惠利货币A的快速赎回业务,为广大投资者的资金使用提供便利;(2)微信公众号上线基金分红通知和净值查询功能,让客户及时掌握分红信息和净值变动情况,提升客户体验;(3)与华融湘江银行、微众银行等代销机构合作,为投资者提供更多便捷的理财渠道;(4)开展“四人拼团瓜分红包”、“今天能破亿么?”、“你的今年收益知否?知否?”等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会准予华夏鼎盛债券型证券投资基金注册的文件;

9.1.2中国证监会准予华夏鼎盛债券型证券投资基金变更注册的文件;

9.1.3《华夏短债债券型证券投资基金基金合同》;

9.1.4《华夏短债债券型证券投资基金托管协议》;

9.1.5《华夏鼎盛债券型证券投资基金基金合同》;

9.1.6《华夏鼎盛债券型证券投资基金托管协议》;

9.1.7法律意见书;

9.1.8基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.9基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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

二〇一九年四月二十日

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

（原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型）

2019年第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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。

华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金截至第二个开放期届满时,基金资产净值低于5000万元,触发基金合同约定的转型条款,经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,根据基金管理人2019年2月27日书登的《华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金触发转型条款并确定实施转型的公告》,自2019年2月27日起,“华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金”正式转型为“华夏睿磐泰利混合型证券投资基金”,转型后的华夏睿磐泰利混合型证券投资基金为每日开放申购、赎回业务的普通开放式基金。

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。

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金报告期自2019年2月27日起至2019年3月31日止,原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日起至2019年2月26日止。如无特殊说明,本报告中“本基金”指华夏睿磐泰利混合型证券投资基金及原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金。

§2基金产品概况

2.1华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

基金简称	华夏睿磐泰利混合
基金主代码	005177
基金运作方式	契约型开放式
基金转型日	2019年2月27日
报告期末基金份额总额	42,479,445.08份
投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置,积极管理,力求有效控制风险,实现基金资产长期持续增值。
投资策略	本基金以风险均衡作为主要资产配置策略,通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献,合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例,为更好地适应不断变化的市场环境,本基金还将动态调整各类资产的配置比例。在基于风险均衡资产配置策略应用过程中,本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露,以达到长期稳定、相对积极的波动水平,获得良好的风险调整后的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、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	中国光大银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰利混合A	华夏睿磐泰利混合C
下属分级基金的交易代码	005177	005178
报告期末下属分级基金的份额总额	25,841,458.43份	16,637,986.65份

注:自2019年2月27日起,原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金。

2.2原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金

基金简称	华夏睿磐泰利定开混合
基金主代码	005177
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017年12月27日
报告期末基金份额总额	48,334,711.37份
投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置,积极管理,力求有效控制风险,实现基金资产长期持续增值。
投资策略	本基金以风险均衡作为主要资产配置策略,通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献,合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例,为更好地适应不断变化的市场环境,本基金还将动态调整各类资产的配置比例。 在基于风险均衡资产配置策略应用过程中,本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露,以达到长期稳定、相对积极的波动水平,获得良好的风险调整后的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、货币市场基金