

# 信息披露

# Disclosure

(上接B058版)

办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼  
法定代表人：段颖  
电话：021-33228888  
传真：021-62877833  
网址：www.aqzq.com  
客户服务电话：400-196-2502  
(72) 华融证券股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街8号  
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人寿大厦  
法定代表人：祝敏忠  
电话：010-85656048  
传真：010-85656088  
联系人：孙燕波  
网址：www.hrsc.com.cn  
客户服务电话：96390  
(73) 天风证券股份有限公司  
住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼  
法定代表人：余磊  
电话：027-8718882  
传真：027-87618863  
联系人：程耀  
网址：www.tfzq.com  
客户服务电话：400-400-5000  
(74) 宏信证券有限责任公司  
住所：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼  
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼  
法定代表人：魏玉刚  
电话：028-86190278  
传真：028-86193832  
联系人：郝俊文  
网址：www.hxzq.cn  
客户服务电话：400-836-6366  
(75) 开源证券股份有限公司  
住所：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
法定代表人：李刚  
电话：029-88447611  
传真：029-88447611  
联系人：曹欣  
网址：www.kysec.cn  
客户服务电话：96325、400-860-8866  
(76) 联储证券有限责任公司  
住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼  
办公地址：北京市朝阳区望京区望泰楼中建材财富中心27层  
法定代表人：吕春卫  
电话：010-86494277  
传真：010-86494901  
联系人：丁倩云  
网址：www.lczq.com  
客户服务电话：400-620-6868  
(77) 中国人寿保险股份有限公司  
住所：中国北京市西城区金融大街16号  
办公地址：中国北京市西城区金融大街16号  
法定代表人：王滨  
电话：010-63631536  
传真：010-66222276  
联系人：柳亚娜  
网址：www.e-chinalife.com  
客户服务电话：96519  
(78) 上海华夏财富投资管理有限公司  
住所：上海市虹口区东大名路687号一幢2楼268室  
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法定代表人：毛圣平  
电话：010-88066214  
联系人：张静  
网址：www.huaxiafortune.com  
客户服务电话：400-817-6666  
3. 本公司可以根据情况增加或者减少基金销售机构，并另行公告。  
基金销售机构将根据实际情况增加或者减少其销售基金网点。  
(二) 登记机构  
名称：华夏基金管理有限公司  
住所：北京市西城区义顺街2号A区A区  
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法定代表人：杨明辉  
客户服务电话：400-818-6666  
传真：010-57763777  
联系人：李越  
经办律师：吴冠雄、李晗  
(四) 会计师事务所  
名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室  
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层  
法定代表人：毛贻净  
联系电话：010-58153030  
传真：010-58188298  
联系人：徐海  
4. 基金的历史沿革  
华夏短债债券型证券投资基金由华夏鼎盛债券型证券投资基金转型而来。  
华夏鼎盛债券型证券投资基金经中国证监会2017年5月3日证监许可[2017]6388号文予以注册，基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。《华夏鼎盛债券型证券投资基金合同》于2017年12月6日生效。2019年1月4日华夏鼎盛债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于华夏鼎盛债券型证券投资基金变更投资范围、基金名称、基金管理人、基金托管人、基金名称变更为华夏短债债券型证券投资基金、变更基金经理、投资范围、投资目标、投资策略、投资限制、调整基金费用以及修订基金合同等》。基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，并自2019年1月8日起，《华夏鼎盛债券型证券投资基金合同》失效，《华夏短债债券型证券投资基金合同》生效，《华夏鼎盛债券型证券投资基金正式变更为华夏短债债券型证券投资基金。  
5. 基金名称  
本基金名称：华夏短债债券型证券投资基金  
6. 基金的投资目标  
本基金类型：契约型开放式。  
7. 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。  
8. 基金的投资方向  
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市的国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转债、可转换债券、纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。(但须符合中国证监会相关规定)  
9. 基金的投资策略  
本基金不直接买入股票、权证，可转换仅投资可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将基金的投资范围扩大。  
本基金的投资组合比例为：本基金为债券型基金，投资于债券资产不低于基金资产的80%，其中投资于短期融资券的比例不低于非现金资产的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于该资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。  
本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过367天(含)的债券资产，主要包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。  
10. 基金的风险收益特征  
(一) 债券类资产配置策略  
本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类资产配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择预期风险匹配品种，同时又能获得较好持有期收益的类债券资产配置比例。  
(二) 久期管理策略  
本基金将根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。  
(三) 收益策略曲线策略  
本基金资产组合中的中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预期，适时采用期限收益曲线策略的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的预期，适时采用期限收益曲线策略的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的预期，适时采用期限收益曲线策略的骑乘策略。  
(四) 信用债投资策略  
本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对外部评级、利差研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。  
(五) 资产支持证券投资策略  
本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产支持证券的风险和预期收益率，并根据资产证券化收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。  
(六) 国债期货投资策略  
本基金投资国债期货，将根据风险管理原则，充分考量国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，适度参与国债期货投资。  
此外，在严格控制风险的前提下，本基金将适度参与回购交易等投资，以增加收益。  
未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。  
11. 基金业绩比较基准  
本基金业绩比较基准：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%。  
本基金业绩比较基准，主要投资于短期债券，力争取得比业绩比较基准的稳定增值，以中债综合财富(1年以下)指数收益率作为业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征。中债综合财富(1年以下)指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场短期债券指数，能够较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。  
未来，如中国国债期货结算清算有限责任公司调整或停止发布该指数，或市场有其他更适合本基金的基准时，本基金管理人可根据具体情况，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，取得基金托管人同意并履行适当程序后，对该业绩比较基准进行变更。  
12. 基金的风险收益特征  
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。  
13. 基金的投资组合报告  
以下内容摘自本基金2019年第2季度报告：  
5.1 报告期末基金资产组合情况

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	14,388,403.00	20.28
2	央行票据	—	—
3	金融债	9,901,889.00	13.96
4	企业债	3,815,539.00	5.38
5	企业债	29,816,074.50	42.03
6	企业债	10,011,400.00	14.11
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	64,117,843.50	90.39
10	合计	114,326,696.00	160.39

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

序号	债券品种	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019011	19国开01	144,000	4,001,200.00	5.68
2	120612	12国债02	40,000	3,064,000.00	4.31
3	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
4	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27
5	143430	14国债02	30,000	3,028,000.00	4.27

本基金A类、C类基金份额均收取赎回费,赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取,所收取赎回费全部归入基金资产。

A类、C类基金份额赎回费率如下:

持有期限	赎回费率
7天以内	1.5%
7天(含7天)-30天	0.1%