# 华夏鼎智债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日

## §1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月27日复核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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019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 | 华夏鼎智债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华夏鼎智债券 | |
| 基金主代码 | 004052 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年1月20日 | |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,202,312,913.86份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004052 | 004053 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,202,166,190.84份 | 146,723.02份 |

### 2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在有效控制风险的前提下,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、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。 |

### 2.3基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华夏基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李彬 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 400-818-6666 | 95559 |
| | 电子邮箱 | service@ChinaAMC.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-818-6666 | 95559 |
| 传真 | | 010-63136700 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 北京市顺义区天竺空港工业区A区 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路188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 | 中国(上海)长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码 | | 100033 | 200336 |
| 法定代表人 | | 杨明辉 | 彭纯 |

### 2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ChinaAMC.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## §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

| 3.1.1期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日至2019年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C |
| 本期已实现收益 | 91,609,823.90 | 3,123.46 |
| 本期利润 | 80,934,306.11 | 2,401.32 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0193 | 0.0161 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.84% | 1.54% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.86% | 1.81% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C |
| 期末可供分配利润 | 163,842,844.35 | 5,614.14 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0390 | 0.0383 |
| 期末基金资产净值 | 4,385,519,594.10 | 153,017.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.0436 | 1.0429 |
| 3.1.3累计期末指标 | 报告期末(2019年6月30日) | |
| | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.47% | 10.24% |

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

华夏鼎智债券A

| 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 | 0.37% | 0.02% | 0.28% | 0.03% | 0.09% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.59% | 0.03% | -0.24% | 0.06% | 0.83% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.86% | 0.03% | 0.24% | 0.06% | 1.62% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.52% | 0.03% | 2.82% | 0.06% | 1.70% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.47% | 0.03% | 1.86% | 0.07% | 8.61% | -0.04% |

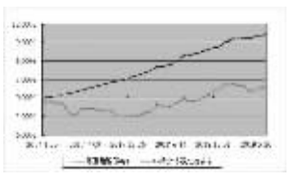
华夏鼎智债券C

| 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 | 0.37% | 0.02% | 0.28% | 0.03% | 0.09% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.57% | 0.03% | -0.24% | 0.06% | 0.81% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.81% | 0.03% | 0.24% | 0.06% | 1.57% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.43% | 0.03% | 2.82% | 0.06% | 1.61% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.24% | 0.03% | 1.86% | 0.07% | 8.38% | -0.04% |

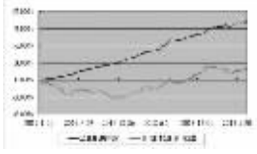
#### 3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎智债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年1月20日至2019年6月30日)

华夏鼎智债券A



华夏鼎智债券C



## §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、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通ETF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。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理华夏上证50ETF、华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改ETF、华夏战略新兴成指ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快线货币ETF及华夏3-5年中高级可质押信用债ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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6月30日数据),华夏移动互联混合(QDII)在“QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金(A类)”中排序9/34;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8/27;华夏回报混合(H类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非A类)”中排序8/89;华夏鼎沛债券(A类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A类)”中排序1/228;华夏理财30天债券(A类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A类)”中排序10/40;华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A类)”中排序7/19;华夏上证50AH优选指数(LOF)(A类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A类)”中排序8/29;华夏上证50AH优选指数(LOF)(C类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非A类)”中排序4/11;华夏上证50ETF在“股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金”中排序6/61;华夏消费ETF在“股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金”中排序3/31;华夏沪深300ETF联接(C类)在“股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金(非A类)”中排序9/34。

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(QDII)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QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中,华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖,华夏鼎茂债券(004042)荣获“2018年度开放式债券型金牛基金”奖,华夏中小板ETF(159902)荣获“2018年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面,2019年上半年度,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)华夏基金客服电话系统上线智能语音功能,客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息,同时系统还可以进行身份信息认证,主动告知业务办理进度,为客户提供全面、准确、便捷的服务,提升客户体验;(2)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;(3)与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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“你的今年收益知否?知否?”、“你的户口本更新了”、“户龄”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 | - | 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)等。 |
| 祝灿 | 本基金的基金经理 | 2017-01-20 | 2019-01-24 | 18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、摩根士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)、华夏新裕祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年9月25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》等法律法规和基金合同,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

2019年上半年,全球经济回落压力显现,海外货币政策持续放松,市场预期美联储下半年降息1-3次,美债收益率大幅向下。国内方面,债市收益率先上后下呈震荡态势。年初央行一系列举措使得资金面极为宽松,债市延续18年年底趋势继续上涨,随中美贸易摩擦趋缓,A股触底大幅反弹,分流了部分债市资金,叠加资金面转为中性,债市小幅调整。1季度受春节效应影响,经济数据较好,4月政治局会议对经济政策表述出现明显调整,市场对政府刺激经济的预期降低,债券收益率大幅上行,超调后又回落。进入5月,中美贸易战再度升级,致A股大跌,下旬包商银行被托管,使得债市风险偏好骤降,银行间资金面一度极度紧张,高等级和低等级信用债信用利差出现分化。此时政策再次微调,一方面,在央行大量释放流动性和监管部门呵护下资金面转好,另一方面,允许将专项债作为符合条件的重大项目资本金,体现了政策对冲经济下行压力的意愿。

报告期内,本基金对于债券资产进行了合理的仓位和久期配置,取得了正收益。

#### 4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,华夏鼎智债券A基金份额净值为1.0436元,本报告期份额净值增长率为1.86%;华夏鼎智债券C基金份额净值为1.0429元,本报告期份额净值增长率为1.81%,同期业绩比较基准增长率为0.24%。

### 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2019年下半年,海外经济增长动能衰减,预计美联储会开启降息周期,国内货币政策有持续宽松的空间。国内经济下行压力犹在,但趋势已边际放缓,货币政策预期将继续保持流动性合理充裕,政策上持续向新兴科技和小微企业倾斜,地产调控持续,地方政府债务依然受到约束,但专项债放松后能一定程度拉动基建投资。在此背景下,利率债和高等级信用债收益率仍有一定下行空间,低资质信用债依然需要规避,信用风险还难以短时间改善,同时应关注基本面企稳的转折点。

2019年下半年,本基金将继续投资于债券资产,并根据市场情况进行适度波段操作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念,规范运作,审慎投资,勤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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期实施利润分配1次,符合相关法规及基金合同的规定。

### 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

2019年上半年度,基金托管人在华夏鼎智债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2019年上半年度,华夏基金管理有限公司在华夏鼎智债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润:40,340,786.64元,向C级份额持有人分配利润:1,372.70元。

### 5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019年上半年度,由华夏基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华夏鼎智债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1资产负债表

会计主体:华夏鼎智债券型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | - | - |
| 银行存款 | | 210,359,473.10 | 208,463,037.52 |
| 结算备付金 | | 2,873,919.83 | 6,210,375.76 |
| 存出保证金 | | 165,711.26 | 38,550.48 |
| 交易性金融资产 | | 4,784,793,913.70 | 4,103,499,327.60 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 4,489,726,913.70 | 3,661,801,327.60 |
| 资产支持证券投资 | | 295,067,000.00 | 441,698,000.00 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | 144,600,416.90 |
| 应收证券清算款 | | 90,566.95 | - |
| 应收利息 | | 70,871,073.54 | 64,366,180.58 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | 136.99 | 136.99 |
| 资产总计 | | 5,069,154,795.37 | 4,527,178,025.83 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负债: | | - | - |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 681,384,595.67 | 179,988,530.02 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,086,643.88 | 1,104,948.58 |
| 应付托管费 | | 362,214.63 | 368,316.18 |
| 应付销售服务费 | | 12.60 | 8.75 |
| 应付交易费用 | | 36,980.51 | 60,847.30 |
| 应交税费 | | 246,276.93 | 356,440.64 |
| 应付利息 | | 269,044.67 | 108,780.25 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 96,414.73 | 80,000.00 |
| 负债合计 | | 683,482,183.62 | 182,067,871.72 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | | 4,202,312,913.86 | 4,202,343,169.46 |
| 未分配利润 | | 183,359,697.89 | 142,766,984.65 |
| 所有者权益合计 | | 4,385,672,611.75 | 4,345,110,154.11 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,069,154,795.37 | 4,527,178,025.83 |

注:报告截止日2019年6月30日,华夏鼎智债券A基金份额净值1.0436元,华夏鼎智债券C基金份额净值1.0429元;华夏鼎智债券基金份额总额4,202,312,913.86份(其中A类4,202,166,190.84份,C类146,723.02份)。

### 6.2利润表

会计主体:华夏鼎智债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 100,056,006.90 | 121,252,460.55 |
| 1.利息收入 | | 91,008,682.37 | 94,490,368.42 |
| 其中:存款利息收入 | | 2,500,329.65 | 2,561,435.17 |
| 债券利息收入 | | 80,305,691.77 | 88,803,922.35 |
| 资产支持证券利息收入 | | 8,003,495.27 | 3,078,368.76 |
| 买入返售金融资产收入 | | 199,165.68 | 46,642.14 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 19,723,542.77 | 14,530,764.62 |
| 其中:股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 19,975,524.35 | 14,681,131.01 |
| 资产支持证券投资收益 | | -251,981.58 | -150,366.39 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | -10,676,239.93 | 12,231,326.66 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | 21.69 | 0.85 |
| 减:二、费用 | | 19,119,299.47 | 16,389,039.04 |
| 1.管理人报酬 | | 6,532,838.02 | 6,333,999.71 |
| 2.托管费 | | 2,177,612.70 | 2,111,333.20 |
| 3.销售服务费 | | 76.57 | 52.82 |
| 4.交易费用 | | 25,682.62 | 32,206.45 |
| 5.利息支出 | | 10,098,849.01 | 7,613,850.81 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 10,098,849.01 | 7,613,850.81 |
| 6.税金及附加 | | 158,223.84 | 206,153.28 |
| 7.其他费用 | | 126,016.71 | 91,442.77 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 80,936,707.43 | 104,863,421.51 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 80,936,707.43 | 104,863,421.51 |

### 6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏鼎智债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 4,202,343,169.46 | 142,766,984.65 | 4,345,110,154.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 80,936,707.43 | 80,936,707.43 |
| 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) | -30,255.60 | -1,834.85 | -32,090.45 |
| 其中:1.基金申购款 | 174,204.78 | 7,451.62 | 181,656.40 |
| 2.基金赎回款 | -204,460.38 | -9,286.47 | -213,746.85 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -40,342,159.34 | -40,342,159.34 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,202,312,913.86 | 183,359,697.89 | 4,385,672,611.75 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 4,202,152,852.61 | 26,767,311.09 | 4,228,920,163.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 104,863,421.51 | 104,863,421.51 |
| 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) | 173,650.09 | 2,045.79 | 175,695.88 |
| 其中:1.基金申购款 | 219,846.64 | 2,742.35 | 222,588.99 |
| 2.基金赎回款 | -46,196.55 | -696.56 | -46,893.11 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -99,173,471.06 | -99,173,471.06 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,202,326,502.70 | 32,459,307.33 | 4,234,785,810.03 |

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:朱威,会计机构负责人:朱威

### 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生变化的情况。

6.4.3.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华夏基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金托管人 |

注:下述关联交易均在正常业务范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

无。

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3债券交易

无。

6.4.4.1.4债券回购交易

无。

6.4.4.1.5应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,532,838.02 | 6,333,999.71 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | 5.43 |

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0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

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× 0.30%/当年天数。

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

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,177,612.70 | 2,111,333.20 |

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0.10%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× 0.10%/当年天数。

6.4.4.2.3销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C | 合计 |
| 华夏基金管理有限公司 | - | 76.57 | 76.57 |
| 合计 | - | 76.57 | 76.57 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 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 | | |
| | 华夏鼎智债券A | 华夏鼎智债券C | 合计 |
| 华夏基金管理有限公司 | - | 52.82 | 52.82 |
| 合计 | - | 52.82 | 52.82 |

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0.10%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× 0.10%/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

无。

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

无。

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情况

华夏鼎智债券A

份额单位:份

| 关联方名称 | 华夏鼎智债券A本期末 2019年6月30日 | | 华夏鼎智债券A上年度末 2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 交通银行 | 4,202,038,638.73 | 100.00% | 4,202,038,638.73 | 99.99% |

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。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

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行活期存款 | 210,359,473.10 | 93,744.38 | 3,938,276.18 | 131,051.29 |

注:本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末(2019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

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券质押式正回购交易形成的卖出回购证券款余额642,884,595.67元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 100204 | 10国开04 | 2019-07-02 | 99.53 | 3,300,000.00 | 328,449,000.00 |
| 120206 | 12国开06 | 2019-07-02 | 96.90 | 1,805,000.00 | 174,904,500.00 |
| 110207 | 11国开07 | 2019-07-02 | 98.54 | 283,000.00 | 27,886,820.00 |
| 120206 | 12国开06 | 2019-07-03 | 96.90 | 1,571,000.00 | 152,229,900.00 |
| 合计 | | | | 6,959,000.00 | 683,470,220.00 |

6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额38,500,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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2019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0元,第二层次的余额为4,784,793,913.70元,第三层次的余额为0元。(截至2018年12月31日止:第一层次的余额为0元,第二层次的余额为4,103,499,327.60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

### 7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,784,793,913.70 | 94.39 |
| | 其中:债券 | 4,489,726,913.70 | 88.57 |
| | 资产支持证券 | 295,067,000.00 | 5.82 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 213,233,392.93 | 4.21 |
| 8 | 其他各项资产 | 71,127,488.74 | 1.40 |
| 9 | 合计 | 5,069,154,795.37 | 100.00 |

### 7.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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。

### 7.3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。

### 7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末持有股票。

7.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末持有股票。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末持有股票。

### 7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,208,754,000.00 | 50.36 |
| | 其中:政策性金融债 | 902,619,000.00 | 20.58 |
| 4 | 企业债券 | 729