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年半年度报告摘要

2019年6月30日

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。

基金托管人招商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。

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及其更新。

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6月30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。

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

2.1.1 华夏短债债券型证券投资基金

基金名称	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	
基金转型日	2019年1月8日	
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	
报告期末基金份额总额	66,667,141.73份	
基金合同存续期	不定期	
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	34,955,325.78份	31,711,815.95份

注：原华夏鼎盛债券型证券投资基金于2019年1月8日转型为华夏短债债券型证券投资基金。

2.1.2 原华夏鼎盛债券型证券投资基金

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	59,133,835.72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

2.2 基金产品说明

2.2.1 华夏短债债券型证券投资基金

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、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。

2.2.2 原华夏鼎盛债券型证券投资基金

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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张燕
	联系电话	400-818-6666	0755-83199084
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		杨明辉	李建红

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

3.1.1期间数据和指标	转型后 报告期（2019年1月8日至2019年6月30日）		转型前 报告期（2019年1月1日至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
本期已实现收益	1,038,260.58	246,751.25	20,750.12	3,469.11
本期利润	933,464.18	226,316.39	123,396.30	21,741.63
加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0199	0.0025	0.0025
本期加权平均净值利润率	1.70%	1.89%	0.24%	0.24%
本期基金份额净值增长率	1.96%	1.92%	0.24%	0.23%
3.1.2期末数据和指标	报告期末（2019年6月30日）		报告期末（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
期末可供分配利润	2,246,060.33	1,982,810.65	2,043,834.45	362,623.16
期末可供分配基金份额利润	0.0643	0.0625	0.0409	0.0397
期末基金资产净值	37,221,790.28	33,713,296.61	52,213,152.03	9,530,068.32
期末基金份额净值	1.0648	1.0631	1.0443	1.0431
3.1.3累计期末指标	报告期末（2019年6月30日）		报告期末（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
基金份额累计净值增长率	1.96%	1.92%	4.43%	4.31%

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。
④自2019年1月8日起，原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型为华夏短债债券型证券投资基金。

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 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	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	0.50%	0.03%	0.27%	0.01%	0.23%	0.02%
过去三个月	1.23%	0.04%	0.68%	0.01%	0.55%	0.03%
自基金转型起至今	1.96%	0.03%	1.36%	0.01%	0.60%	0.02%

华夏短债债券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	0.49%	0.03%	0.27%	0.01%	0.22%	0.02%
过去三个月	1.20%	0.04%	0.68%	0.01%	0.52%	0.03%
自基金转型起至今	1.92%	0.03%	1.36%	0.01%	0.56%	0.02%

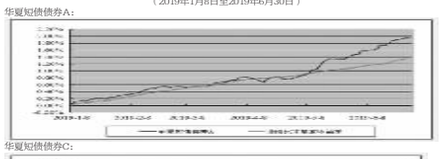
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏短债债券型证券投资基金

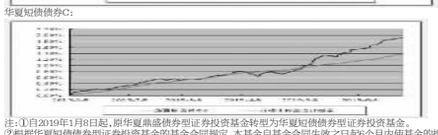
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019年1月8日至2019年6月30日）

华夏短债债券A：



华夏短债债券C：



注：①自2019年1月8日起，原华夏鼎盛债券型证券投资基金转型为华夏短债债券型证券投资基金。
②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 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	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	0.38%	0.03%	0.69%	0.07%	－0.31%	－0.04%
过去三个月	1.28%	0.02%	2.36%	0.05%	－1.08%	－0.03%
过去六个月	2.13%	0.03%	2.68%	0.06%	－0.55%	－0.03%
过去一年	3.96%	0.05%	5.04%	0.07%	－1.08%	－0.02%
自基金合同生效起至转型前	4.43%	0.05%	5.10%	0.07%	－0.67%	－0.02%

华夏鼎盛债券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	0.38%	0.03%	0.69%	0.07%	－0.31%	－0.04%
过去三个月	1.25%	0.02%	2.36%	0.05%	－1.11%	－0.03%
过去六个月	2.07%	0.03%	2.68%	0.06%	－0.61%	－0.03%
过去一年	3.84%	0.05%	5.04%	0.07%	－1.20%	－0.02%
自基金合同生效起至转型前	4.31%	0.05%	5.10%	0.07%	－0.79%	－0.02%

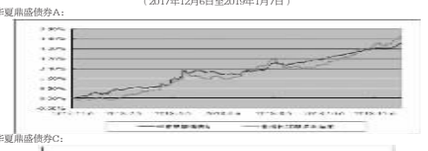
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

原华夏鼎盛债券型证券投资基金

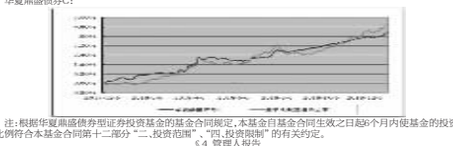
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（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 基金管理人及其管理基金的经验

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。公司是首批全国社会保障基金投资管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首批RQFII基金管理人、境内首批沪港通ETF基金管理人、首批沪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基金产品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500沪川雄安ETF、华夏越南新兴成指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1-5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1/229；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（赚余成本法）（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联接基金-行业指数股票ETF联接金”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，公司发展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权益债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。在中国证券投资基金业年度评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金生基金公司”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，方客户提供全面、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人的快速赎回业务，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）及基金经理助理简介

4.1.2.1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生效日期填写。
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。

4.1.2.2原华夏鼎盛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	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。

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生效日期填写。
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、研究活动的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，未出现涨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，全球经济呈现同涨压力，海外货币政策持续放松，市场预计美联储下半年降息1-3次，美债收益率大幅下行。国内债券市场呈现震荡行情，收益率先上后下，与2018年年底相比变动不大。年初央行降低普惠金融定向降准小型和微型企业贷款考核标准并下调金融机构存款准备金率替代MLF，资金面稳松，债市延续2018年年底趋势继续上涨，随着中美贸易摩擦缓和，人股触底大幅反弹，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季度受刺春节效应影响，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，趋调后开始回调。5月中美贸易战重新升级，入股大跌，5月下旬危险银行被托管，债券市场风险偏好骤降，银行间资金面一度极为紧张，高等级和低等级信用债信用利差有所分化。政策内次出现微调，一方面，在央行大量释放流动性和监管部门不断呵护下，资金面逐渐好转，另一方面，允许将专项债券作为符合条件的重大项目资本金，体现政策对冲经济下行压力的意图。

报告期内，本基金对债券券产配置了合理的仓位和久期，并根据市场情况进行了一定的波段操作。

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0.22％，同期业绩比较基准收益率为0.36％；转型后，截止2019年6月30日，华夏短债债券A基金份额净值为1.0648元，2019年1月8日至6月30日期间份额净值增长率为1.96％；华夏短债债券C基金份额净值为1.0631元，2019年1月8日至6月30日期间份额净值增长率为1.92％，同期业绩比较基准收益率为1.36％。

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，海外经济增长动能有所衰减，预计美联储会开启降息周期，国内货币政策有继续宽松的空间。国内经济下行压力依然存在，但趋势已经过际放缓，货币政策将继续保持流动性合理充裕，预计政策上将持续向新兴科技和小微企业倾斜，房地产方面将坚持房住不炒的原则，地方政府债务负担受到约束，但专项债发行规模一定程度带动基建投资。在此背景下，利率债和高等级信用债有一定下行空间，低资质信用债依然需要规避，同时应关注基本面企稳的转折点。

2019年下半年，基本面对债市较有利，长端利率债和中高等级信用债收益率依然有下行空间，低等级信用债的信用风险还不能显著改善。本基金将继续投资在债券资产上，并根据市场情况进行一定的波段操作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续本着恪尽基金管理有限公司“为信任奉献诚实服务”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的约定，本基金管理人为估值、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业务管理制度，建立了估值委员会，组织运行规范的估值业务系统，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、审查基金净产值和基金份额申购、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

本基金本报告期未进行利润分配，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

本基金于2019年4月16日至2019年6月20日出现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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部控制系统和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 华夏短债债券型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：华夏短债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
资产：		
银行存款		14,728,001.09
结算备付金		605,375.29
存出保证金		2,837.36
交易性金融资产		64,117,843.50
其中：股票投资		－
基金投资		－
债券投资		64,117,843.50
资产支持证券投资		－
贵金属投资		－
衍生金融资产		－
买入返售金融资产		－
应收证券清算款		9,867,060.68
应收利息		755,460.07
应收股利		－
应收申购款		5,602,201.90
递延所得税资产		－
其他资产		－
资产总计		95,678,779.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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		24,000,000.00
应付证券清算款		－
应付赎回款		654,393.67
应付管理人报酬		11,799.11
应付托管费		3,933.02
应付销售服务费		1,390.32
应付交易费用		2,990.00
应交税费		3,269.93
应付利息		1,450.18
应付利润		－
递延所得税负债		－
其他负债		64,466.77
负债合计		24,743,693.00
所有者权益：		
实收基金		66,667,141.73
未分配利润		4,267,945.16
所有者权益合计		70,935,086.89
负债和所有者权益总计		95,678,779.89

注：截止至2019年1月7日，华夏鼎盛债券型证券投资基金转型为华夏短债债券型证券投资基金。
②报告截止日2019年6月30日，华夏短债债券A基金份额净值1.0648元，华夏短债债券C基金份额净值1.0631元；华夏短债债券基金份额总额66,667,141.73份（其中A类34,955,325.78份，C类31,711,815.95份）。

6.1.2 利润表

会计主体：华夏短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月8日（基金转型日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月8日至2019年6月30日
一、收入		1,613,534.77
1.利息收入		1,429,213.42
其中：存款利息收入		20,893.98
债券利息收入		1,408,319.44
资产支持证券利息收入		－
买入返售金融资产收入		－
其他利息收入		－
2.投资收益（损失以“－”填列）		300,276.83
其中：股票投资收益		－
基金投资收益		－
债券投资收益		300,276.83
资产支持证券投资收益		－
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）		－125,231.26
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		－
5.其他收入（损失以“－”号填列）		9,275.78
减：二、费用		453,754.20
1.管理人报酬		97,089.77
2.托管费		32,363.28
3.销售服务费		5,667.11
4.交易费用		5,877.85
5.利息支出		222,314.25
其中：卖出回购金融资产支出		222,314.25
6.税金及附加		3,783.04
7.其他费用		86,658.90
三、利润总额（亏损总额以“－”号填列）		1,159,780.57
减：所得税费用		－
四、净利润（净亏损以“－”号填列）		1,159,780.57

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月8日（基金转型日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月8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）	59,133,835.72	2,609,384.63	61,743,220.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	1,159,780.57	1,159,780.57
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）	7,533,306.01	498,779.96	8,032,085.97
其中：1.基金申购款	103,129,796.65	5,417,636.52	108,547,432.17
2.基金赎回款	－95,596,489.64	－4,918,856.56	－100,515,346.20
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）	－	－	－
五、期末所有者权益（基金净值）	66,667,141.73	4,267,945.16	70,935,086.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4财务报表由下列负责人签署：

杨明辉　朱威　朱威

基金管理人负责人　主管会计工作负责人　会计机构负责人

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 重要会计政策和会计估计

6.1.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计报表的实际编制期间为2019年1月8日（基金转型日）至2019年6月30日。

6.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

1.金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前有无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2.金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.1.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的应收项目单独确认为应收款项。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，将终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.1.4.1.5 金融资产和金融负债的价值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1.存在活跃市场的金融工具按其价值日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等。如果该限制是针对资产持有者的，那么在价值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2.当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3.如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.1.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和负债扣减为负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.1.4.1.7 交易基金

交易基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除赎回款项平准金分摊部分后的余额。对于管经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的交易基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分或折算的份额变动份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的交易基金份额变动于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的交收基金份额加和转出基金的交收基金减少。

6.1.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末金额转入未分配利润。

6.1.4.1.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税税额后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收取的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在处置日所发生的增值税后的净额确认为投资收益。

其中已经从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.1.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按