

# 华夏双债增强债券型证券投资基金 2017年第三季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十五日

§ 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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23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2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华夏双债增强债券
基金代码	000007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月14日
报告期末基金份额总额	167,103,632.62份
报告期末净值	1.000元
报告期末总资产	人民币167,103,632.62元
报告期末净资产	人民币167,103,632.62元
报告期末基金份额净值	人民币1.000元

注：(1)上述日期为基金成立日，离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。  
(2)2017年10月23日，经中国证监会批准，华夏基金管理有限公司对《华夏双债增强债券型证券投资基金基金合同》进行了修改，修改后的内容详见本报告“§ 1 重要提示”部分。

4.2报告期内地价内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，华夏双债增强A基金份额净值为1.162元，本报告期份额净值增长率为1.1%，华夏双债增强C基金份额净值为1.151元，本报告期份额净值增长率为1.23%，同期业绩比较基准增长率为-0.15%。

4.3报告期内地价内基金的净值预警说明

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元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例 (%)
1	现金投资	7,369,088.12	1.16
2	银行存款	7,369,088.12	1.16
3	企业债券	49,476,000.00	7.14
4	企业债券	304,462,560.00	46.07
5	企业短期融资券	100,324,000.00	15.08
6	中期票据	40,320,000.00	5.93
7	可转换债券	10,861,727.21	1.60
8	权证	—	—
9	股票	42,672,070.00	6.46
10	合计	426,720,700.00	100.00

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贵金属投资明细

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股权类证券投资明细

5.7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债券类证券投资明细

5.8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资产支持证券投资明细

5.9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

5.10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债券投资明细

5.11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贵金属投资明细

5.12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权类证券投资明细

5.13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债券类证券投资明细

5.14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

5.15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

5.16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债券投资明细

5.17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贵金属投资明细

5.18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权类证券投资明细

5.19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债券类证券投资明细

5.20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

5.21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

5.22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债券投资明细

5.23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贵金属投资明细

5.24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权类证券投资明细

5.25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债券类证券投资明细

5.26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

5.27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

5.28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债券投资明细

5.29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贵金属投资明细

5.30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权类证券投资明细

5.31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债券类证券投资明细

5.32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

5.33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

5.34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债券投资明细

5.35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贵金属投资明细

5.36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权类证券投资明细

5.37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债券类证券投资明细

5.38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

5.39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

5.40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债券投资明细

5.41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贵金属投资明细

5.42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权类证券投资明细

5.43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债券类证券投资明细

5.44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

5.45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

5.46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债券投资明细

5.47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贵金属投资明细

5.48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权类证券投资明细

5.49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债券类证券投资明细

5.50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

5.51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

5.52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债券投资明细

5.53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贵金属投资明细

5.54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权类证券投资明细

5.55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债券类证券投资明细

5.56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

5.57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

5.58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债券投资明细

5.59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贵金属投资明细

5.60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权类证券投资明细

5.61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债券类证券投资明细

5.62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

5.63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

5.64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债券投资明细

5.65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贵金属投资明细

5.66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权类证券投资明细

5.67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债券类证券投资明细

5.68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

5.69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

5.70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债券投资明细

5.71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贵金属投资明细

5.72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权类证券投资明细

5.73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债券类证券投资明细

5.74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

5.75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

5.76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债券投资明细

5.77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贵金属投资明细

5.78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权类证券投资明细

5.79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债券类证券投资明细

5.80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

5.81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

5.82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债券投资明细

5.83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贵金属投资明细

5.84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权类证券投资明细

5.85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债券类证券投资明细

5.86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

5.87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

5.88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债券投资明细

5.89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贵金属投资明细

5.90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权类证券投资明细

5.91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债券类证券投资明细

5.92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

5.93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

5.94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债券投资明细

5.95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贵金属投资明细

5.96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权类证券投资明细

5.97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债券类证券投资明细

5.98报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小