华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华夏网购精选混合
基金主代码	002837
交易代码	002837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	116,979,963.79份
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略,网购消费大数据指的是由蚂蚁金服提供的网上消费行业纯计型趋势大数据,包括销售额存量长期增长、销售额长期增长、成交笔数长期增长、订单量存量长期增长、销售额存量同比、价格同比等数据。 本基金是灵活配置混合型基金,在资产配置策略和股票投资策略上均应用网购消费大数据,充分利用公司大数据研究平台的优势,分析研究网购消费大数据,力求为投资者把握网购消费大数据中的投资机会。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金属于混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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	报告期 (2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	6,391,159.44
2.本期利润	3,684,249.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0274
4.期末基金资产净值	123,616,729.80
5.期末基金份额净值	1.057

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。

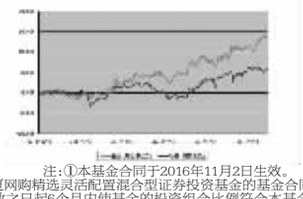
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

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
过去三个月	2.62%	0.51%	5.49%	0.50%	-2.87%	0.01%

3.2.2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

华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月2日至2017年9月30日)



注:①本基金合同于2016年11月2日生效。

②根据华夏网购精选灵活配置混合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

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		
郑煜	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-02	-	19年	中国科技大学管理科学与工程学硕士。曾任华夏证券高级分析师、大成基金高级分析师、投资经理。2004年8月加入鹏华中信基金,曾任股权投资部总监、华夏基金股票投资部副总经理,华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理(2006年8月11日至2011年3月17日期间)、华夏红利混合型证券投资基金基金经理(2010年1月16日至2011年3月17日期间)、华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年1月29日至2017年3月7日期间)等。
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-02	-	17年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理,上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2016年3月28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》、基金合同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 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

3季度,国际方面,美国经济持续复苏,美联储拟定今年10月开始缩表;欧洲、日本经济明显改善。国内方面,受益于海外需求回暖及国内需求逐渐好转,经济企稳态势延续。在供给侧改革、环保限产及需求回暖等因素影响下,周期品价格高企,CPI也有所抬升。本季度,外汇市场人民币升值明显,货币政策维持中性。

市场方面,自6月初市场下跌释放风险之后,大盘走出了比较明显的上升趋势,其中尤以周期股(煤炭、有色、钢铁)表现显著,在此带动下,整个市场风险偏好明显上升,两融余额创阶段新高,中证500为代表的中盘股表现较好。

基金投资运作方面,作为灵活配置型基金,我们依据模型在报告期内进行了量化模型择时,仓位保持在相对稳健的水平。行业和股票选择上,我们结合网购数据以及量化选股模型进行组合构建,获得了较为稳健的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.057元,本报告期份额净值增长率为2.62%,同期业绩比较基准增长率为5.49%。

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 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	52,740,393.49	42.31
	其中:股票	52,740,393.49	42.31
2	固定收益投资	9,989,514.40	8.01
	其中:债券	9,989,514.40	8.01
	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	61,631,760.16	49.45
7	其他各项资产	282,361.07	0.23
8	合计	124,644,029.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	77,783.96	0.06
B	采矿业	2,067,722.00	1.67
C	制造业	25,826,202.11	20.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	495,213.00	0.40
E	建筑业	800,873.00	0.65
F	批发和零售业	1,259,913.00	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	438,957.00	0.36
H	住宿和餐饮业	857,220.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,435,541.50	4.40
J	金融业	8,527,723.00	6.90
K	房地产业	782,608.92	0.63
L	租赁和商务服务业	1,556,099.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,203.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,885,530.00	2.33
S	综合	1,680,804.00	1.36
	合计	52,740,393.49	42.66

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	24,000	1,299,840.00	1.05
2	000009	中国宝安	95,400	857,646.00	0.69
3	600754	锦江股份	27,300	857,220.00	0.69
4	600770	综艺股份	98,700	823,158.00	0.67
5	300144	宋城演艺	42,300	791,856.00	0.64
6	600640	号百控股	42,200	784,498.00	0.63
7	000652	泰达股份	149,800	765,478.00	0.62
8	601992	金隅股份	118,300	751,205.00	0.61
9	600019	宝钢股份	82,000	605,980.00	0.49
10	002065	东华软件	53,086	596,686.64	0.48

5.4 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	9,982,000.00	8.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	7,514.40	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,989,514.40	8.08

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	170003	17附息国债03	100,000	9,982,000.00	8.07
2	113013	国君转债	60	7,514.40	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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。

5.7 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。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,316.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	188,674.63
5	应收申购款	45,369.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	282,361.07

5.11.4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。

5.11.5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。

5.11.6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

单位:份

本报告期期初基金份额总额	160,567,849.97
报告期基金总申购份额	3,122,945.05
减:报告期基金总赎回份额	46,710,831.23
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	116,979,963.79

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 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 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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

2017年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告。

2017年9月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构的公告。

2017年9月22日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增世纪证券有限责任公司为代销机构的公告。

2017年9月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告。

2017年9月29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、境内首批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,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2017年9月29日数据),华夏消费升级混合A在255只灵活配置型基金(股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%)(A类)中排名第8;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在171只绝对收益目标基金(A类)中排名第3和第5;华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金(A类)中排名第5;华夏理财30天债券A在39只短期理财债券型基金(A类)中排名第8;华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金(A类)中排名第3;华夏收益债券(QDII)A及华夏大中华信用债券(QDII)A分别在15只QDII债券型基金(A类)中排名第1和第4。

在客户服务方面,3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)升级华夏基金官网、与支付宝合作上线华夏基金财富号,为客户提供更便捷的基金投资和理财交流平台;(2)升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个渠道的在线客服系统,有效提升客户的服务满意度;(3)与星展银行、民生证券等代销机构合作,提供更多理财渠道,进一步提升客户体验;(4)开展“一门两世界,温差20度”、“华夏回报累计分红78次”、“火热报北马,一触‘基’发”等多项活动,为客户提供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中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6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
二〇一七年十月二十五日

华夏鼎融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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华夏鼎融债券
基金主代码	003301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月7日
报告期末基金份额总额	500,685,472.51份
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	基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断,并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征,在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合指数。
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型基金、混合型基金,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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华夏鼎融债券A / 华夏鼎融债券C
下属分级基金的交易代码	003301 / 003302
报告期末下属分级基金的份额总额	500,494,195.40份 / 91,277.11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	报告期 (2017年7月1日-2017年9月30日)	
	华夏鼎融债券A	华夏鼎融债券C
1.本期已实现收益	4,496,081.58	845.60
2.本期利润	4,392,524.77	812.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0076
4.期末基金资产净值	507,945,350.20	92,303.35
5.期末基金份额净值	1.0149	1.0112

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。

3.2基金净值表现

3.2.1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

华夏鼎融债券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
过去三个月	0.87%	0.04%	-0.15%	0.03%	1.02%	0.01%

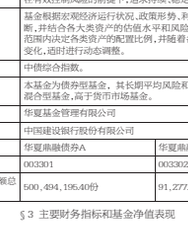
华夏鼎融债券C:

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
过去三个月	0.77%	0.04%	-0.15%	0.03%	0.92%	0.01%

3.2.2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

华夏鼎融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
(2016年11月7日至2017年9月30日)

华夏鼎融债券A:



注:①本基金合同于2016年11月7日生效。

②根据华夏鼎融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

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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2016-12-29	-	17年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理,上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2016年3月28日期间)等。
魏镇江	本基金的基金经理、固定收益部总监	2017-09-08	-	14年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2006年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员、华夏理财21天债券型证券投资基金基金经理(2013年4月26日至2015年4月2日期间)、华夏理财30天债券型证券投资基金基金经理(2013年4月26日至2015年4月2日期间)等。
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-07	2017-09-08	17年	经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000年5月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部副总经理、基金经理助理、固定收益副总监、固定收益部总经理、华夏现金增利证券投资基金基金经理(2006年4月12日至2006年1月24日期间)、华夏债券投资基金基金经理(2004年2月27日至2012年4月5日期间)、华夏保证金理财货币市场基金基金经理(2013年2月4日至2015年4月2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》、基金合同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

2017年3季度,国际方面,美联储在9月议息会议上如期宣布缩表,并预计年内大概率还有一次加息,美元指数继续下探,一方面源于非美货币的强势,另一方面源于投资者对美国长期增长预期的担忧。欧元区PMI维持在相对高位,经济仍处在稳健回升的通道,欧央行对货币政策的偏鹰态度使得欧元在3季度继续上涨。日本经济依旧相对偏弱,日元受到避险情绪等影响在3季度也有所上涨。大宗商品方面,原油价格震荡上行,黑色系商品涨幅较大。国内方面,经济增长略低于预期,通胀压力依然不大。

市场方面,债券市场在3季度基本处于窄幅震荡调整格局,货币政策方面依旧坚持不松不紧、削峰填谷的态度,资金价格依然维持在较高的位置,债券各品种期限之间的利差较低,10年期国债到期收益率一度接近上半年的高点。权益市场在3季度表现继续分化,上半年涨幅较大的消费白马股出现一定调整,而金融、周期和成长类股票则出现交替上涨的局面。可转债市场震荡上行,金融类转债和周期类转债跟随正股涨幅明显。

报告期内,本基金整体依据风险均衡策略进行股票和债券的配置。在股票投资方面,主要通过量化投资管理方式获取全市场大盘和中盘类细分资产的风险溢价收益,债券端则整体维持了较低的杠杆水平和相对适中的久期。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,华夏鼎融债券A基金份额净值为1.0149元,本报告期份额净值增长率0.87%;华夏鼎融债券C基金份额净值为1.0112元,本报告期份额净值增长率0.77%,基准增长率为-0.15%。

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	39,983,988.60	7.33
	其中:股票	39,983,988.60	7.33
2	固定收益投资	480,485,704.62	88.07
	其中:债券	406,451,532.62	74.50
	资产支持证券	74,034,172.00	13.57
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	6,151,219.45	1.13
7	其他各项资产	18,955,720.43	3.47
8	合计	545,576,633.10	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	50,967.00	0.01
B	采矿业	1,402,345.00	0.28
C	制造业	19,871,219.20	3.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,101,163.00	0.22
E	建筑业	1,501,287.00	0.30
F	批发和零售业	1,505,623.80	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,103,526.00	0.22
H	住宿和餐饮业	34,540.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,890,733.40	0.37
J	金融业	7,980,221.00	1.57
K	房地产业	1,887,341.80	0.37
L	租赁和商务服务业	714,366.20	0.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	430,075.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,944.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	325,545.20	0.06
S	综合	144,091.00	0.03
	合计	39,983,988.60	7.87

5.3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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	23,700	1,283,592.00	0.25
2	600519	贵州茅台	1,300	672,932.00	0.13
3	601166	兴业银行	29,800	515,242.00	0.10
4	002008	大族激光	11,600	505,760.00	0.10
5	601169	北京银行	66,500	496,090.00	0.10
6	600016	民生银行	61,500	493,230.00	0.10
7	600000	浦发银行	37,900	487,773.00	0.10
8	600015	华夏银行	52,300	484,821.00	0.10
9	601328	交通银行	76,400	482,848.00	0.10
10	600837	海通证券	31,300	462,614.00	0.09

5.4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	63,969,500.00	12.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	217,940,580.00	42.90
	其中:政策性金融债	217,940,580.00	42.90
4	企业债券	64,285,500.00	12.65
5	企业短期融资券	30,161,000.00	5.94
6	中期票据	29,979,000.00	5.90
7	可转债(可交换债)	115,952.62	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	406,451,532.62	80.00

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	160206	16国开06	900,000	86,400,000.00	17.01
2	150316	15进出16	500,000	48,865,000.00	9.62
3	019561	17国债07	300,000	29,394,000.00	5.79
4	160403	16农发03	300,000	28,878,000.00	5.68
5	011751023	17日照港SCP002	200,000	20,102,000.00	3.96

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比(%)
1	116477	万科4A1	200,000.00	20,000,000.00	3.94
2	1589279	15开元B优先	200,000.00	19,870,000.00	3.91
3	142435	16平安3A	200,000.00	10,256,000.00	2.02
4	116478	京东6优A	100,000.00	10,000,000.00	1.97
5	116455	京东5优A	90,000.00	9,000,000.00	1.77
6	116465	16平安A	200,000.00	4,908,172.00	0.97
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,962.68
2	应收证券清算款	81,625.09
3	应收股利	-
4	应收利息	168,932.45
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,020.22

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5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。

5.11.6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

单位:份

项目	华夏鼎融债券A	华夏鼎融债券C
本报告期期初基金份额总额	500,607,751.64	120,020.64
报告期基金总申购份额	19.80	-
减:报告期基金总赎回份额	113,576.04	28,743.53
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	500,494,195.40	91,277.11

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1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