

华夏鼎融债券型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	7
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 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.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 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贵金属投资明细.....	48
7.9 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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏鼎融债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	500,727,772.28 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	500,607,751.64 份	120,020.64 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	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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
本期已实现收益	3,855,244.34	1,138.83
本期利润	3,248,675.98	-575.27
加权平均基金份额本期利润	0.0065	-0.0027
本期加权平均净值利润率	0.65%	-0.27%
本期基金份额净值增长率	0.65%	0.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
期末可供分配利润	3,060,048.02	420.39
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0035
期末基金资产净值	503,667,799.66	120,441.03
期末基金份额净值	1.0061	1.0035
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
基金份额累计净值增长率	0.61%	0.35%

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

华夏鼎融债券 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	1.11%	0.06%	0.90%	0.06%	0.21%	0.00%
过去三个月	0.49%	0.08%	-0.88%	0.08%	1.37%	0.00%
过去六个月	0.65%	0.07%	-2.11%	0.08%	2.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.61%	0.07%	-4.50%	0.11%	5.11%	-0.04%

华夏鼎融债券 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	1.08%	0.06%	0.90%	0.06%	0.18%	0.00%
过去三个月	0.39%	0.08%	-0.88%	0.08%	1.27%	0.00%
过去六个月	0.45%	0.07%	-2.11%	0.08%	2.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.35%	0.07%	-4.50%	0.11%	4.85%	-0.04%

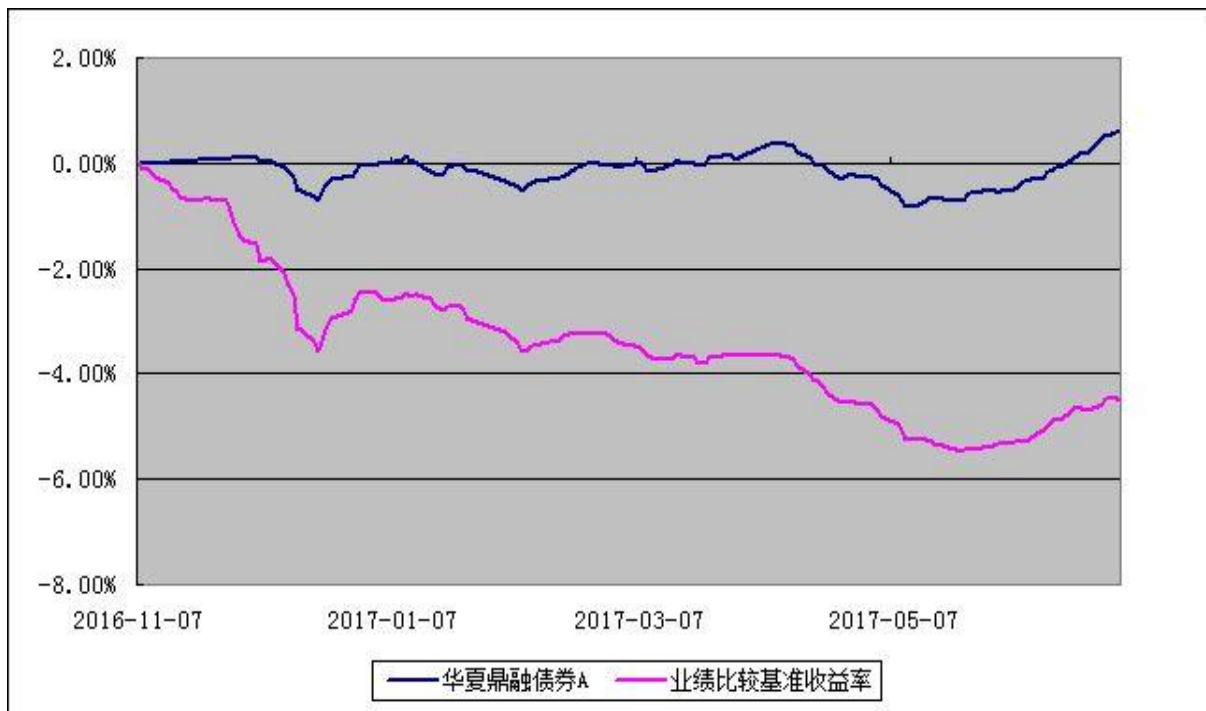
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏鼎融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

(2016 年 11 月 7 日至 2017 年 6 月 30 日)

华夏鼎融债券 A



华夏鼎融债券 C



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,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 6 月 30 日数据),华夏大盘精选混合在 137 只普通偏股型基金(A 类)中排名第 5;华夏消费升级混合 A 在 256 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 2;华夏回报混合 A 和华夏回报二号混合分别在 172 只绝对收益目标基金(A 类)中排名第 2 和第 3;华夏全球股票(QDII)在 56 只 QDII 股票型基金(A 类)中排名第 3;华夏安康债券 C 在 126 只普通债券型基金(二级非 A 类)中排名第 9;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 3。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中,华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面,2017 年上半年,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)下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制,更好地满足客户理财需求;(2)新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务,并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份,更好地满足了投资者的流动性需求;(3)网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务,并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作,拓宽客户交易渠道,提高客户交易便利性;(4)开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长,定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动,为客户提供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		
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-07	-	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（2005 年 4 月 12 日至 2006 年 1 月 24 日期间，2007 年 1 月 6 日至 2008 年 2 月 4 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。
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。

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合规守信情况的说明

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 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

本基金的投资目标为通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。风险均衡策略的本质为从风险贡献的维度确定基金内部的股票和债券的配置比例，在不同经济周期和不同市场环境中，捕获不同资产风险溢价水平的策略，以期获取长期绝对收益。当前本基金处于建仓期，整体操作风格目标以稳健为主。

上半年，国际方面，美国经济复苏，美联储两次加息，并明确即将开启缩表进程，特朗普交易逆转，美元指数和美债收益率回落；欧洲经济继续复苏。国内方面，经济平稳运行，消费与固定资产投资平稳增长，由于外围经济复苏势头良好，出口明显回暖。通胀在食品价格走低影响下保持温和，工业品价格高位回落。在多部门配合下，金融去杠杆初显成效。货币政策方面，上半年央行维持中性货币政策，人民币汇率稳中有升。

市场方面，在基本面平稳、金融去杠杆的宏观背景下，债券方面，上半年收益率曲线平坦化上行，中债总财富指数上半年下跌 0.64%，而信用利差处于历史低位，信用债估值偏贵；股票市场，保持分化走势，低估值大盘蓝筹股票走势较强，创业板等中小市值股票走势偏弱。

报告期内，本基金在债券端基于基本面和政策变化，1 季度维持了较短的久期，2 季度加强了中段配置，适度拉长了久期；在股票端，我们基于对市场的理解和判断，主要以多因子量化策略进行投资管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值为 1.0061 元，本报告期份额净值增长率为 0.65%；华夏鼎融债券 C 基金份额净值为 1.0035 元，本报告期份额净值增长率为 0.45%；同期业绩比较基准增长率为-2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，预计美联储仍会加息，并逐步推进缩表。国内方面，经济依旧会维持

平稳，不会出现明显下滑，通胀压力温和可控。虽然加强金融监管依然是大势所趋，但经历了上半年对资产价格的大幅冲击，监管已明显注意协调；金融去杠杆带来的非信贷融资大幅下降对经济的负面影响可能逐渐显现。总体来说下半年债市的基本面较上半年更为有利；股票市场方面，如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，股票市场也会有相对较好的表现。

投资策略上，本基金将继续沿用风险均衡投资策略，通过分散化配置资产与稳健的投资理念，以实现基金资产长期持续增值。

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，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履

行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：华夏鼎融债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,378,649.95	2,057,696.47
结算备付金		306,651.52	13,586,363.64
存出保证金		14,968.25	-
交易性金融资产	6.4.7.2	523,709,695.55	478,710,027.00
其中：股票投资		33,780,808.44	28,025,027.00
基金投资		-	-
债券投资		401,024,715.11	354,989,000.00
资产支持证券投资		88,904,172.00	95,696,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	10,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,926,754.44	5,876,366.12
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		534,336,719.71	510,230,453.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		30,000,000.00	8,150,000.00
应付证券清算款		-	51,257.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		246,757.09	254,582.15
应付托管费		82,252.34	84,860.71
应付销售服务费		41.72	161.70
应付交易费用	6.4.7.7	129,352.49	27,069.68
应交税费		-	-
应付利息		10,732.22	420.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,343.16	-
负债合计		30,548,479.02	8,568,352.76
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	500,727,772.28	501,853,084.95
未分配利润	6.4.7.10	3,060,468.41	-190,984.48
所有者权益合计		503,788,240.69	501,662,100.47
负债和所有者权益总计		534,336,719.71	510,230,453.23

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值 1.0061 元，华夏鼎融债券 C 基金份额净值 1.0035 元；华夏鼎融债券基金份额总额 500,727,772.28 份（其中 A 类 500,607,751.64 份，C 类 120,020.64 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		5,669,023.41
1.利息收入		7,847,682.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	58,017.30
债券利息收入		5,913,386.21
资产支持证券利息收入		1,824,592.12
买入返售金融资产收入		51,687.27

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,570,382.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-525,672.37
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,330,319.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	6,882.87
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	278,726.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-608,282.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	5.02
减：二、费用		2,420,922.70
1.管理人报酬		1,489,120.88
2.托管费		496,373.57
3.销售服务费		437.06
4.交易费用	6.4.7.20	301,698.98
5.利息支出		35,166.75
其中：卖出回购金融资产支出		35,166.75
6.其他费用	6.4.7.21	98,125.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,248,100.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,248,100.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	501,853,084.95	-190,984.48	501,662,100.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,248,100.71	3,248,100.71
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）	-1,125,312.67	3,352.18	-1,121,960.49
其中：1.基金申购款	23,008.50	2.56	23,011.06

2.基金赎回款	-1,148,321.17	3,349.62	-1,144,971.55
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）	500,727,772.28	3,060,468.41	503,788,240.69

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：汪贵华，会计机构负责人：汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏鼎融债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1963 号《关于准予华夏鼎融债券型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 11 月 2 日共募集 501,730,574.69 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 1052 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 501,853,084.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,510.26 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、国债期货以及法律法规或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）。本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债和公司债（含中小企业私募债券）、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、债券回购、同业存单、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证

监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、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公允价值变动计入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。

6.4.4.4 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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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，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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、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估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾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实收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前或折算前的基金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实收基金变动分别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实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，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确认为投资收益，其中包括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。

6.4.4.10 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直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估

值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

4、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，于2015年3月20日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香

港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。其中对内地投资者取得上述收入按照 20% 代扣代缴个人所得税，应纳税所得额按如下方式确认：基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税；对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。
- 7、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- 8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	4,378,649.95
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	4,378,649.95	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	32,132,194.02	33,780,808.44	1,648,614.42	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	69,157,313.90	68,575,715.11	-581,598.79
	银行间市场	335,458,185.07	332,449,000.00	-3,009,185.07

	合计	404,615,498.97	401,024,715.11	-3,590,783.86
	资产支持证券	89,126,139.13	88,904,172.00	-221,967.13
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	525,873,832.12	523,709,695.55	-2,164,136.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,579.35
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	138.00
应收债券利息	5,304,464.72
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	619,572.37
合计	5,926,754.44

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	127,452.49
银行间市场应付交易费用	1,900.00
合计	129,352.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	79,343.16
合计	79,343.16

6.4.7.9 实收基金

华夏鼎融债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	501,374,679.32	501,374,679.32
本期申购	9,965.22	9,965.22
本期赎回（以“-”号填列）	-776,892.90	-776,892.90
本期末	500,607,751.64	500,607,751.64

华夏鼎融债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	478,405.63	478,405.63
本期申购	13,043.28	13,043.28
本期赎回（以“-”号填列）	-371,428.27	-371,428.27
本期末	120,020.64	120,020.64

注：本基金自 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 11 月 2 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 501,730,574.69 元。根据《华夏鼎融债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金的认购资金在募集期间产生的利息 122,510.26 元在本基金合同生效后，折算为 122,510.26 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

华夏鼎融债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,363,850.61	-1,554,371.25	-190,520.64
本期利润	3,855,244.34	-606,568.36	3,248,675.98
本期基金份额交易产生的	-4,860.90	6,753.58	1,892.68

变动数			
其中：基金申购款	85.80	-60.96	24.84
基金赎回款	-4,946.70	6,814.54	1,867.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,214,234.05	-2,154,186.03	3,060,048.02

华夏鼎融债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,019.02	-1,482.86	-463.84
本期利润	1,138.83	-1,714.10	-575.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,220.18	2,679.68	1,459.50
其中：基金申购款	54.79	-77.07	-22.28
基金赎回款	-1,274.97	2,756.75	1,481.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	937.67	-517.28	420.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	43,628.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,304.93
其他	83.97
合计	58,017.30

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	104,331,299.74
减：卖出股票成本总额	104,856,972.11
买卖股票差价收入	-525,672.37

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	186,593,917.10

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	185,377,380.00
减：应收利息总额	2,546,856.55
买卖债券差价收入	-1,330,319.45

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	37,178,672.71
减：卖出资产支持证券成本总额	36,646,228.00
减：应收利息总额	525,561.84
资产支持证券投资收益	6,882.87

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	278,726.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	278,726.90

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	-608,282.46
——股票投资	2,311,116.88
——债券投资	-2,787,399.34
——资产支持证券投资	-132,000.00
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-608,282.46

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	5.02
合计	5.02

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	297,898.98
银行间市场交易费用	3,800.00
合计	301,698.98

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	39,671.58
银行费用	7,982.30
银行间账户维护费	10,500.00
其他	300.00
合计	98,125.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	134,236,080.99	63.14%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	39,254,963.90	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	144,120,000.00	29.33%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	101,514.56	58.18%	54,471.04	42.74%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,489,120.88
其中：支付销售机构的客户维护费	176.44

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 0.6% 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 × 0.6% / 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	496,373.57

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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	318.72	318.72
华夏财富	-	118.34	118.34
合计	-	437.06	437.06

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 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	4,378,649.95	43,628.40

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	11,400	187,378.00	166,326.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	16.31	2017-08-02	16.48	8,200	124,007.14	133,742.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	15,700	120,873.25	97,497.00	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项	5.76	2017-08-10	6.19	16,700	98,615.00	96,192.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	6.85	2017-08-21	8.22	13,300	87,599.15	91,105.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	3,700	73,188.00	82,473.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	7,950	89,391.00	82,123.50	-
300201	海伦哲	2017-02-06	重大事项	8.69	2017-08-21	8.99	9,400	74,634.00	81,686.00	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项	6.54	2017-07-05	5.92	11,800	71,462.00	77,172.00	-
600136	当代明诚	2017-02-13	重大事项	16.79	-	-	4,500	69,252.00	75,555.00	-
002675	东诚药业	2017-01-03	重大事项	14.26	2017-07-17	12.84	5,100	78,502.00	72,726.00	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项	10.57	-	-	6,700	72,899.00	70,819.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	16,600	58,274.30	59,760.00	-
300440	运达科技	2017-02-20	重大事项	13.12	-	-	4,400	63,252.56	57,728.00	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大事项	23.36	-	-	2,400	54,926.00	56,064.00	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.32	-	-	4,800	53,297.00	54,336.00	-
600602	云赛智联	2017-06-22	重大事项	7.51	2017-07-04	7.80	6,900	47,965.00	51,819.00	-
002076	雪莱特	2017-03-20	重大事项	7.07	-	-	7,200	48,119.00	50,904.00	-

002070	*ST 众和	2017-05-02	重大事项	10.17	-	-	4,900	65,205.00	49,833.00	-
002499	科林环保	2017-04-20	重大事项	28.92	2017-07-11	26.03	1,700	49,008.00	49,164.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	3,100	43,555.41	43,772.00	-
002331	皖通科技	2017-05-02	重大事项	14.16	-	-	2,600	40,423.00	36,816.00	-
600559	老白干酒	2017-01-23	重大事项	22.69	-	-	1,600	37,930.67	36,304.00	-
002312	*ST 三泰	2017-03-31	重大事项	6.82	2017-07-24	7.16	4,960	38,709.60	33,827.20	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	5,200	14,709.68	12,688.00	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项	17.02	2017-07-12	16.68	700	13,547.07	11,914.00	-
000571	新大洲 A	2017-05-15	重大事项	8.11	2017-08-14	8.41	1,000	7,679.71	8,110.00	-
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项	18.50	2017-07-07	18.88	80	1,651.78	1,480.00	-
000061	农产品	2017-06-28	重大事项	9.06	-	-	60	686.03	543.60	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 30,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险

管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	4,378,649.95	-	-	4,378,649.95
结算备付金	306,651.52	-	-	306,651.52

结算保证金	14,968.25	-	-	14,968.25
债券投资	114,842,895.11	266,259,820.00	19,922,000.00	401,024,715.11
资产支持证券	57,350,172.00	31,554,000.00	-	88,904,172.00
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	30,000,000.00	-	-	30,000,000.00
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	2,057,696.47	-	-	2,057,696.47
结算备付金	13,586,363.64	-	-	13,586,363.64
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	99,956,000.00	235,561,000.00	19,472,000.00	354,989,000.00
资产支持证券	39,962,000.00	55,734,000.00	-	95,696,000.00
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	8,150,000.00	-	-	8,150,000.00

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	2,986,810.58	3,047,081.29
	利率上升 25 个基点	-2,950,147.67	-3,047,081.29

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 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 102,717,030.65 元，第二层次的余额为 420,992,664.90 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 103,759,027.00 元，第二层次的余额为 374,951,000.00 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

6.4.14.4 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。

6.4.14.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关

问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	33,780,808.44	6.32
	其中：股票	33,780,808.44	6.32
2	固定收益投资	489,928,887.11	91.69
	其中：债券	401,024,715.11	75.05
	资产支持证券	88,904,172.00	16.64
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	4,685,301.47	0.88
7	其他各项资产	5,941,722.69	1.11
8	合计	534,336,719.71	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

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	85,731.00	0.02
B	采矿业	1,186,436.40	0.24
C	制造业	15,459,110.16	3.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,546,316.00	0.31
E	建筑业	1,187,140.26	0.24
F	批发和零售业	1,518,768.50	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	965,543.50	0.19
H	住宿和餐饮业	23,268.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,696,718.82	0.34
J	金融业	6,542,187.60	1.30
K	房地产业	2,553,488.00	0.51
L	租赁和商务服务业	403,285.80	0.08
M	科学研究和技术服务业	32,253.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	52,576.00	0.01
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	489,538.20	0.10
S	综合	38,447.20	0.01
	合计	33,780,808.44	6.71

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	16,700	828,487.00	0.16
2	000002	万科 A	32,540	812,523.80	0.16
3	600900	长江电力	39,200	602,896.00	0.12
4	601668	中国建筑	51,400	497,552.00	0.10
5	600519	贵州茅台	900	424,665.00	0.08
6	000651	格力电器	10,060	414,170.20	0.08
7	002142	宁波银行	18,200	351,260.00	0.07
8	600036	招商银行	14,500	346,695.00	0.07
9	600309	万华化学	12,000	343,680.00	0.07
10	601398	工商银行	65,200	342,300.00	0.07
11	601009	南京银行	30,100	337,421.00	0.07
12	601166	兴业银行	19,900	335,514.00	0.07
13	600016	民生银行	40,600	333,732.00	0.07
14	601988	中国银行	89,300	330,410.00	0.07
15	601997	贵阳银行	20,600	325,686.00	0.06
16	600919	江苏银行	35,000	325,150.00	0.06
17	601211	国泰君安	15,700	322,007.00	0.06
18	000623	吉林敖东	13,780	315,424.20	0.06
19	600089	特变电工	29,138	300,995.54	0.06
20	601899	紫金矿业	84,800	290,864.00	0.06
21	600031	三一重工	31,300	254,469.00	0.05
22	000750	国海证券	43,100	237,050.00	0.05
23	600816	安信信托	17,400	236,466.00	0.05
24	000338	潍柴动力	17,820	235,224.00	0.05
25	600637	东方明珠	10,800	234,036.00	0.05
26	601390	中国中铁	26,000	225,420.00	0.04

27	000563	陕国投 A	42,200	218,174.00	0.04
28	000725	京东方 A	50,340	209,414.40	0.04
29	000776	广发证券	11,400	196,650.00	0.04
30	600837	海通证券	13,200	196,020.00	0.04
31	000686	东北证券	19,400	194,970.00	0.04
32	600999	招商证券	11,300	194,586.00	0.04
33	601555	东吴证券	17,300	194,279.00	0.04
34	600271	航天信息	9,200	189,888.00	0.04
35	600886	国投电力	24,000	189,600.00	0.04
36	600104	上汽集团	6,100	189,405.00	0.04
37	600705	中航资本	33,500	189,275.00	0.04
38	600887	伊利股份	8,600	185,674.00	0.04
39	000540	中天金融	26,680	185,426.00	0.04
40	000425	徐工机械	48,300	181,125.00	0.04
41	600804	鹏博士	9,900	175,725.00	0.03
42	601601	中国太保	5,000	169,350.00	0.03
43	600485	信威集团	11,400	166,326.00	0.03
44	600023	浙能电力	30,400	165,984.00	0.03
45	601000	唐山港	31,600	164,952.00	0.03
46	600674	川投能源	16,200	159,084.00	0.03
47	601766	中国中车	15,600	157,872.00	0.03
48	000333	美的集团	3,660	157,526.40	0.03
49	600219	南山铝业	45,300	153,567.00	0.03
50	002491	通鼎互联	11,400	153,216.00	0.03
51	000630	铜陵有色	53,500	151,940.00	0.03
52	600048	保利地产	14,800	147,556.00	0.03
53	002195	二三四五	20,300	145,145.00	0.03
54	002001	新和成	7,400	143,634.00	0.03
55	600717	天津港	11,300	141,137.00	0.03
56	600873	梅花生物	24,100	136,647.00	0.03
57	000709	河钢股份	32,600	136,594.00	0.03
58	300136	信维通信	3,400	136,068.00	0.03
59	002271	东方雨虹	3,640	135,044.00	0.03
60	002146	荣盛发展	13,600	134,232.00	0.03
61	600028	中国石化	22,600	134,018.00	0.03
62	000402	金融街	11,420	133,842.40	0.03
63	600643	爱建集团	8,200	133,742.00	0.03
64	002223	鱼跃医疗	5,600	132,608.00	0.03
65	600498	烽火通信	5,200	131,820.00	0.03
66	600718	东软集团	8,400	130,620.00	0.03
67	002460	赣锋锂业	2,800	129,500.00	0.03
68	600252	中恒集团	32,000	129,280.00	0.03
69	600201	生物股份	3,600	128,052.00	0.03

70	603198	迎驾贡酒	6,500	123,695.00	0.02
71	600741	华域汽车	5,100	123,624.00	0.02
72	600487	亨通光电	4,400	123,420.00	0.02
73	002152	广电运通	14,850	123,403.50	0.02
74	600649	城投控股	11,600	121,916.00	0.02
75	000876	新希望	14,620	120,176.40	0.02
76	600703	三安光电	6,000	118,200.00	0.02
77	601012	隆基股份	6,900	117,990.00	0.02
78	000050	深天马 A	5,700	117,249.00	0.02
79	002470	金正大	15,200	114,456.00	0.02
80	601607	上海医药	3,900	112,632.00	0.02
81	601006	大秦铁路	13,300	111,587.00	0.02
82	600039	四川路桥	26,100	108,576.00	0.02
83	600606	绿地控股	13,600	106,352.00	0.02
84	601333	广深铁路	23,200	104,864.00	0.02
85	002304	洋河股份	1,200	104,172.00	0.02
86	002092	中泰化学	8,200	104,140.00	0.02
87	300296	利亚德	5,500	103,400.00	0.02
88	000625	长安汽车	7,100	102,382.00	0.02
89	000786	北新建材	6,400	101,376.00	0.02
90	600755	厦门国贸	11,000	100,320.00	0.02
91	600518	康美药业	4,600	100,004.00	0.02
92	601225	陕西煤业	14,100	99,687.00	0.02
93	600380	健康元	10,900	98,972.00	0.02
94	002236	大华股份	4,300	98,083.00	0.02
95	601989	中国重工	15,700	97,497.00	0.02
96	600183	生益科技	7,800	96,252.00	0.02
97	600657	信达地产	16,700	96,192.00	0.02
98	600019	宝钢股份	14,300	95,953.00	0.02
99	000516	国际医学	17,200	95,804.00	0.02
100	600884	杉杉股份	5,800	95,526.00	0.02
101	000063	中兴通讯	4,000	94,960.00	0.02
102	600120	浙江东方	3,500	94,080.00	0.02
103	000538	云南白药	1,000	93,850.00	0.02
104	000423	东阿阿胶	1,300	93,457.00	0.02
105	000413	东旭光电	8,300	93,126.00	0.02
106	600383	金地集团	8,100	92,907.00	0.02
107	000793	华闻传媒	9,100	92,092.00	0.02
108	600050	中国联通	13,300	91,105.00	0.02
109	600811	东方集团	13,600	88,672.00	0.02
110	002153	石基信息	3,900	88,647.00	0.02
111	600522	中天科技	7,300	87,965.00	0.02
112	600176	中国巨石	7,960	87,400.80	0.02

113	601186	中国铁建	7,200	86,616.00	0.02
114	600312	平高电气	6,300	86,562.00	0.02
115	000581	威孚高科	3,300	85,470.00	0.02
116	002450	康得新	3,780	85,125.60	0.02
117	600893	航发动力	3,100	84,630.00	0.02
118	002589	瑞康医药	5,480	84,392.00	0.02
119	002670	国盛金控	5,300	84,270.00	0.02
120	600597	光明乳业	6,600	84,150.00	0.02
121	300182	捷成股份	8,800	84,128.00	0.02
122	600582	天地科技	18,200	83,538.00	0.02
123	601857	中国石油	10,800	83,052.00	0.02
124	000960	锡业股份	6,100	83,021.00	0.02
125	601088	中国神华	3,700	82,473.00	0.02
126	000090	天健集团	7,400	82,140.00	0.02
127	002013	中航机电	7,950	82,123.50	0.02
128	002646	青青稞酒	4,700	82,062.00	0.02
129	600160	巨化股份	6,800	81,804.00	0.02
130	002456	欧菲光	4,500	81,765.00	0.02
131	300201	海伦哲	9,400	81,686.00	0.02
132	000703	恒逸石化	5,700	81,168.00	0.02
133	600073	上海梅林	8,400	80,220.00	0.02
134	600266	北京城建	5,500	79,970.00	0.02
135	000963	华东医药	1,600	79,520.00	0.02
136	600216	浙江医药	8,000	79,280.00	0.02
137	601928	凤凰传媒	8,100	79,056.00	0.02
138	002572	索菲亚	1,900	77,900.00	0.02
139	000656	金科股份	11,800	77,172.00	0.02
140	600166	福田汽车	27,000	76,680.00	0.02
141	600029	南方航空	8,800	76,560.00	0.02
142	600835	上海机电	3,600	76,104.00	0.02
143	600136	当代明诚	4,500	75,555.00	0.01
144	002024	苏宁云商	6,700	75,375.00	0.01
145	000418	小天鹅 A	1,600	74,864.00	0.01
146	600221	海航控股	23,200	74,704.00	0.01
147	000528	柳工	8,600	74,304.00	0.01
148	600415	小商品城	10,100	73,124.00	0.01
149	601628	中国人寿	2,700	72,846.00	0.01
150	600585	海螺水泥	3,200	72,736.00	0.01
151	002675	东诚药业	5,100	72,726.00	0.01
152	002354	天神娱乐	3,380	72,670.00	0.01
153	600547	山东黄金	2,500	72,325.00	0.01
154	600967	内蒙一机	5,300	72,239.00	0.01
155	600959	江苏有线	6,700	70,819.00	0.01

156	600639	浦东金桥	3,900	70,668.00	0.01
157	600535	天士力	1,700	70,618.00	0.01
158	603993	洛阳钼业	13,900	70,334.00	0.01
159	002317	众生药业	5,600	69,552.00	0.01
160	000157	中联重科	15,400	69,146.00	0.01
161	600850	华东电脑	3,200	68,384.00	0.01
162	300083	劲胜精密	7,400	68,376.00	0.01
163	300269	联建光电	3,400	68,102.00	0.01
164	600875	东方电气	7,100	68,018.00	0.01
165	600694	大商股份	1,700	66,249.00	0.01
166	000021	深科技	7,700	66,066.00	0.01
167	600500	中化国际	6,800	65,008.00	0.01
168	002277	友阿股份	10,000	64,500.00	0.01
169	600068	葛洲坝	5,600	62,944.00	0.01
170	002714	牧原股份	2,300	62,606.00	0.01
171	002601	龙蟠佰利	3,800	62,244.00	0.01
172	002550	千红制药	10,400	61,776.00	0.01
173	600177	雅戈尔	6,100	61,732.00	0.01
174	600551	时代出版	3,900	61,581.00	0.01
175	002436	兴森科技	9,700	61,110.00	0.01
176	600325	华发股份	7,300	60,955.00	0.01
177	600060	海信电器	4,000	60,680.00	0.01
178	600795	国电电力	16,600	59,760.00	0.01
179	601098	中南传媒	3,200	59,648.00	0.01
180	002449	国星光电	3,600	59,580.00	0.01
181	600729	重庆百货	2,200	59,048.00	0.01
182	600497	驰宏锌锗	8,900	58,295.00	0.01
183	002463	沪电股份	12,700	57,785.00	0.01
184	300440	运达科技	4,400	57,728.00	0.01
185	600978	宜华生活	5,700	57,285.00	0.01
186	000823	超声电子	3,920	56,526.40	0.01
187	300134	大富科技	2,400	56,064.00	0.01
188	300166	东方国信	4,160	55,868.80	0.01
189	600118	中国卫星	2,000	55,680.00	0.01
190	000541	佛山照明	6,000	54,660.00	0.01
191	600894	广日股份	4,600	54,464.00	0.01
192	600655	豫园商城	4,800	54,336.00	0.01
193	601888	中国国旅	1,800	54,252.00	0.01
194	300339	润和软件	4,300	54,180.00	0.01
195	600018	上港集团	8,500	53,890.00	0.01
196	601699	潞安环能	6,700	52,394.00	0.01
197	002376	新北洋	3,800	52,136.00	0.01
198	600602	云赛智联	6,900	51,819.00	0.01

199	601985	中国核电	6,600	51,546.00	0.01
200	002727	一心堂	2,800	51,520.00	0.01
201	300316	晶盛机电	4,100	51,209.00	0.01
202	002007	华兰生物	1,400	51,100.00	0.01
203	002027	分众传媒	3,700	50,912.00	0.01
204	002076	雪莱特	7,200	50,904.00	0.01
205	002518	科士达	3,480	50,877.60	0.01
206	601800	中国交建	3,200	50,848.00	0.01
207	002070	*ST 众和	4,900	49,833.00	0.01
208	300251	光线传媒	6,060	49,631.40	0.01
209	002499	科林环保	1,700	49,164.00	0.01
210	300032	金龙机电	3,500	48,825.00	0.01
211	601233	桐昆股份	3,500	48,510.00	0.01
212	000685	中山公用	4,400	48,180.00	0.01
213	600699	均胜电子	1,500	48,135.00	0.01
214	600037	歌华有线	3,300	48,048.00	0.01
215	000027	深圳能源	7,100	47,783.00	0.01
216	002425	凯撒文化	5,200	47,528.00	0.01
217	002400	省广股份	5,900	47,377.00	0.01
218	000830	鲁西化工	6,800	46,920.00	0.01
219	000030	富奥股份	5,220	46,666.80	0.01
220	600761	安徽合力	3,500	45,850.00	0.01
221	603368	柳州医药	800	45,800.00	0.01
222	600348	阳泉煤业	6,700	45,426.00	0.01
223	600064	南京高科	3,000	45,300.00	0.01
224	002573	清新环境	2,400	45,168.00	0.01
225	000952	广济药业	3,000	45,090.00	0.01
226	000732	泰禾集团	2,700	45,036.00	0.01
227	601992	金隅股份	6,800	43,996.00	0.01
228	600100	同方股份	3,100	43,772.00	0.01
229	601636	旗滨集团	9,700	43,747.00	0.01
230	000778	新兴铸管	6,500	43,550.00	0.01
231	600826	兰生股份	2,400	43,440.00	0.01
232	603858	步长制药	600	42,984.00	0.01
233	600067	冠城大通	6,200	42,594.00	0.01
234	000488	晨鸣纸业	3,300	42,570.00	0.01
235	000597	东北制药	3,800	42,484.00	0.01
236	600373	中文传媒	1,800	42,318.00	0.01
237	300138	晨光生物	3,220	42,246.40	0.01
238	600297	广汇汽车	5,600	42,168.00	0.01
239	300274	阳光电源	3,800	42,142.00	0.01
240	000036	华联控股	4,600	41,860.00	0.01
241	600382	广东明珠	2,900	41,789.00	0.01

242	002419	天虹股份	2,900	41,702.00	0.01
243	600269	赣粤高速	8,000	41,680.00	0.01
244	000926	福星股份	3,400	41,480.00	0.01
245	000921	海信科龙	2,400	41,304.00	0.01
246	002501	利源精制	3,600	40,932.00	0.01
247	002106	莱宝高科	4,000	40,520.00	0.01
248	600879	航天电子	4,600	40,434.00	0.01
249	002118	紫鑫药业	5,900	40,297.00	0.01
250	300020	银江股份	2,900	40,136.00	0.01
251	002308	威创股份	3,040	39,672.00	0.01
252	600711	盛屯矿业	5,900	39,176.00	0.01
253	300049	福瑞股份	2,300	38,801.00	0.01
254	000883	湖北能源	7,700	38,654.00	0.01
255	300102	乾照光电	4,500	38,430.00	0.01
256	601018	宁波港	6,800	38,420.00	0.01
257	002202	金风科技	2,480	38,365.60	0.01
258	000807	云铝股份	5,300	38,266.00	0.01
259	000039	中集集团	2,120	38,223.60	0.01
260	002131	利欧股份	11,550	37,999.50	0.01
261	300317	珈伟股份	2,600	37,960.00	0.01
262	600138	中青旅	1,800	37,908.00	0.01
263	002078	太阳纸业	5,100	37,485.00	0.01
264	300073	当升科技	1,500	37,410.00	0.01
265	002561	徐家汇	2,800	36,988.00	0.01
266	002331	皖通科技	2,600	36,816.00	0.01
267	002244	滨江集团	5,300	36,676.00	0.01
268	600022	山东钢铁	17,780	36,626.80	0.01
269	600642	申能股份	5,800	36,540.00	0.01
270	600782	新钢股份	10,000	36,500.00	0.01
271	600559	老白干酒	1,600	36,304.00	0.01
272	002640	跨境通	1,700	36,125.00	0.01
273	600033	福建高速	9,400	35,814.00	0.01
274	600808	马钢股份	9,900	35,046.00	0.01
275	002484	江海股份	3,500	34,720.00	0.01
276	300206	理邦仪器	4,000	34,520.00	0.01
277	002701	奥瑞金	5,400	34,506.00	0.01
278	601179	中国西电	6,200	34,472.00	0.01
279	300439	美康生物	1,600	34,400.00	0.01
280	002312	*ST 三泰	4,960	33,827.20	0.01
281	002191	劲嘉股份	3,600	33,696.00	0.01
282	002093	国脉科技	3,800	33,440.00	0.01
283	300310	宜通世纪	2,500	33,050.00	0.01
284	600260	凯乐科技	1,300	32,942.00	0.01

285	600482	中国动力	1,300	32,877.00	0.01
286	000701	厦门信达	2,600	32,500.00	0.01
287	000828	东莞控股	2,700	32,400.00	0.01
288	300008	天海防务	3,900	32,253.00	0.01
289	000825	太钢不锈	7,400	32,190.00	0.01
290	600640	号百控股	1,900	32,110.00	0.01
291	002680	长生生物	2,100	32,109.00	0.01
292	600567	山鹰纸业	8,900	31,862.00	0.01
293	002465	海格通信	2,940	31,575.60	0.01
294	002582	好想你	2,600	31,252.00	0.01
295	002726	龙大肉食	1,700	30,787.00	0.01
296	600020	中原高速	6,100	30,744.00	0.01
297	600185	格力地产	4,500	30,555.00	0.01
298	601700	风范股份	5,100	30,549.00	0.01
299	000690	宝新能源	5,100	30,498.00	0.01
300	300006	莱美药业	4,700	30,456.00	0.01
301	002233	塔牌集团	2,500	30,425.00	0.01
302	002503	搜于特	4,300	30,229.00	0.01
303	000429	粤高速 A	3,500	29,890.00	0.01
304	300037	新宙邦	1,300	29,874.00	0.01
305	002251	步步高	2,400	29,736.00	0.01
306	600307	酒钢宏兴	10,400	29,640.00	0.01
307	300026	红日药业	6,280	29,578.80	0.01
308	600552	凯盛科技	3,800	29,336.00	0.01
309	002496	辉丰股份	5,900	29,264.00	0.01
310	600736	苏州高新	4,100	28,987.00	0.01
311	600596	新安股份	3,400	28,730.00	0.01
312	600845	宝信软件	1,700	28,645.00	0.01
313	600106	重庆路桥	5,500	28,435.00	0.01
314	002179	中航光电	900	28,071.00	0.01
315	300194	福安药业	4,000	27,800.00	0.01
316	300158	振东制药	1,700	27,574.00	0.01
317	601222	林洋能源	3,700	27,491.00	0.01
318	000758	中色股份	3,900	27,339.00	0.01
319	002370	亚太药业	900	26,388.00	0.01
320	600820	隧道股份	2,600	26,260.00	0.01
321	002187	广百股份	2,100	26,187.00	0.01
322	002339	积成电子	1,900	25,916.00	0.01
323	600861	北京城乡	2,000	25,700.00	0.01
324	000726	鲁泰 A	2,120	25,143.20	0.00
325	000547	航天发展	2,400	25,080.00	0.00
326	600282	南钢股份	6,700	24,857.00	0.00
327	600742	一汽富维	1,300	24,843.00	0.00

328	600053	九鼎投资	700	24,472.00	0.00
329	601388	怡球资源	6,900	24,426.00	0.00
330	600075	新疆天业	2,800	24,416.00	0.00
331	600583	海油工程	3,900	24,336.00	0.00
332	600435	北方导航	1,700	24,327.00	0.00
333	600291	西水股份	1,100	24,200.00	0.00
334	600743	华远地产	5,700	24,054.00	0.00
335	600105	永鼎股份	2,900	23,403.00	0.00
336	002444	巨星科技	1,500	23,370.00	0.00
337	000735	罗牛山	3,700	23,125.00	0.00
338	601579	会稽山	1,900	23,104.00	0.00
339	000949	新乡化纤	5,000	23,100.00	0.00
340	002664	信质电机	800	22,896.00	0.00
341	600038	中直股份	500	22,885.00	0.00
342	600619	海立股份	2,100	22,848.00	0.00
343	600566	济川药业	600	22,818.00	0.00
344	600170	上海建工	5,943	22,702.26	0.00
345	603806	福斯特	700	22,407.00	0.00
346	000530	大冷股份	3,080	22,176.00	0.00
347	600664	哈药股份	3,800	22,078.00	0.00
348	000937	冀中能源	3,600	22,032.00	0.00
349	002408	齐翔腾达	1,980	21,938.40	0.00
350	002406	远东传动	2,700	21,843.00	0.00
351	600963	岳阳林纸	2,900	21,837.00	0.00
352	300116	坚瑞沃能	2,000	21,500.00	0.00
353	603012	创力集团	2,600	21,476.00	0.00
354	000598	兴蓉环境	3,800	21,356.00	0.00
355	000712	锦龙股份	1,300	21,281.00	0.00
356	600438	通威股份	3,800	21,204.00	0.00
357	002603	以岭药业	1,200	20,952.00	0.00
358	002026	山东威达	2,300	20,861.00	0.00
359	300230	永利股份	1,260	20,840.40	0.00
360	603345	安井食品	800	20,480.00	0.00
361	000601	韶能股份	2,800	19,964.00	0.00
362	600737	中粮糖业	2,100	19,824.00	0.00
363	600200	江苏吴中	1,500	19,800.00	0.00
364	002221	东华能源	1,760	19,201.60	0.00
365	000789	万年青	2,700	19,143.00	0.00
366	600509	天富能源	2,500	19,025.00	0.00
367	002048	宁波华翔	900	18,774.00	0.00
368	002604	龙力生物	2,000	18,620.00	0.00
369	600528	中铁工业	1,300	18,577.00	0.00
370	600390	五矿资本	1,500	18,165.00	0.00

371	600770	综艺股份	2,400	18,000.00	0.00
372	603669	灵康药业	800	17,856.00	0.00
373	603123	翠微股份	2,000	17,760.00	0.00
374	002100	天康生物	2,200	17,666.00	0.00
375	300379	东方通	900	17,640.00	0.00
376	600308	华泰股份	3,100	17,608.00	0.00
377	600267	海正药业	1,500	17,520.00	0.00
378	600220	江苏阳光	5,100	17,493.00	0.00
379	000652	泰达股份	3,300	17,490.00	0.00
380	000536	华映科技	3,000	17,430.00	0.00
381	300099	精准信息	1,800	17,262.00	0.00
382	002269	美邦服饰	4,600	17,158.00	0.00
383	002403	爱仕达	1,300	17,134.00	0.00
384	002707	众信旅游	1,300	17,069.00	0.00
385	002534	杭锅股份	1,800	17,028.00	0.00
386	002615	哈尔斯	1,500	16,950.00	0.00
387	002437	誉衡药业	2,300	16,744.00	0.00
388	002533	金杯电工	2,200	16,632.00	0.00
389	600754	锦江股份	600	16,260.00	0.00
390	300050	世纪鼎利	1,600	16,112.00	0.00
391	600236	桂冠电力	2,800	15,960.00	0.00
392	600759	洲际油气	2,600	15,756.00	0.00
393	300336	新文化	1,000	15,460.00	0.00
394	600395	盘江股份	2,100	15,393.00	0.00
395	000552	靖远煤电	4,300	15,351.00	0.00
396	600338	西藏珠峰	400	15,196.00	0.00
397	600426	华鲁恒升	1,290	15,144.60	0.00
398	600188	兖州煤业	1,200	14,688.00	0.00
399	000550	江铃汽车	700	14,490.00	0.00
400	002322	理工环科	600	14,376.00	0.00
401	600098	广州发展	1,800	14,238.00	0.00
402	002110	三钢闽光	1,100	14,102.00	0.00
403	002042	华孚色纺	1,300	13,897.00	0.00
404	600765	中航重机	1,000	13,780.00	0.00
405	000635	英力特	800	13,560.00	0.00
406	600483	福能股份	1,300	13,481.00	0.00
407	601689	拓普集团	400	13,396.00	0.00
408	002788	鹭燕医药	400	13,320.00	0.00
409	002254	泰和新材	1,000	13,300.00	0.00
410	000589	黔轮胎 A	2,300	12,765.00	0.00
411	002610	爱康科技	5,200	12,688.00	0.00
412	603520	司太立	400	12,556.00	0.00
413	600345	长江通信	600	12,366.00	0.00

414	002431	棕榈股份	1,120	12,342.40	0.00
415	002358	森源电气	700	11,914.00	0.00
416	300071	华谊嘉信	1,400	11,340.00	0.00
417	002064	华峰氨纶	2,300	11,086.00	0.00
418	600461	洪城水业	1,500	10,815.00	0.00
419	600960	渤海活塞	1,400	10,682.00	0.00
420	600704	物产中大	1,450	10,570.50	0.00
421	600628	新世界	900	10,395.00	0.00
422	002181	粤传媒	1,900	10,279.00	0.00
423	300433	蓝思科技	340	9,890.60	0.00
424	600867	通化东宝	540	9,849.60	0.00
425	601566	九牧王	600	9,672.00	0.00
426	300494	盛天网络	400	9,276.00	0.00
427	600469	风神股份	1,200	9,012.00	0.00
428	600716	凤凰股份	1,700	8,738.00	0.00
429	600801	华新水泥	900	8,577.00	0.00
430	603567	珍宝岛	500	8,415.00	0.00
431	000571	新大洲 A	1,000	8,110.00	0.00
432	600475	华光股份	400	7,972.00	0.00
433	000661	长春高新	60	7,746.60	0.00
434	002699	美盛文化	560	7,728.00	0.00
435	000978	桂林旅游	800	7,408.00	0.00
436	600295	鄂尔多斯	700	7,140.00	0.00
437	300532	今天国际	300	7,086.00	0.00
438	600258	首旅酒店	300	7,008.00	0.00
439	002493	荣盛石化	700	6,832.00	0.00
440	600326	西藏天路	600	6,624.00	0.00
441	603889	新澳股份	400	6,056.00	0.00
442	002502	骅威文化	600	5,634.00	0.00
443	600797	浙大网新	400	4,956.00	0.00
444	000065	北方国际	200	4,756.00	0.00
445	002652	扬子新材	600	4,326.00	0.00
446	300443	金雷风电	200	4,284.00	0.00
447	000049	德赛电池	80	4,144.80	0.00
448	002508	老板电器	90	3,913.20	0.00
449	002032	苏泊尔	90	3,694.50	0.00
450	000513	丽珠集团	40	2,724.00	0.00
451	000999	华润三九	80	2,540.00	0.00
452	000858	五粮液	40	2,226.40	0.00
453	002396	星网锐捷	80	1,548.00	0.00
454	002690	美亚光电	80	1,534.40	0.00
455	300085	银之杰	80	1,480.00	0.00
456	002311	海大集团	80	1,461.60	0.00

457	000400	许继电气	80	1,436.80	0.00
458	001979	招商蛇口	60	1,281.60	0.00
459	000792	盐湖股份	120	1,254.00	0.00
460	002415	海康威视	30	969.00	0.00
461	000915	山大华特	26	958.62	0.00
462	300137	先河环保	40	952.00	0.00
463	002479	富春环保	80	952.00	0.00
464	000919	金陵药业	80	865.60	0.00
465	300059	东方财富	72	865.44	0.00
466	300144	宋城演艺	40	834.80	0.00
467	300146	汤臣倍健	60	824.40	0.00
468	000026	飞亚达 A	60	746.40	0.00
469	002758	华通医药	50	702.00	0.00
470	000009	中国宝安	80	647.20	0.00
471	000739	普洛药业	80	587.20	0.00
472	002475	立讯精密	20	584.80	0.00
473	002626	金达威	40	570.00	0.00
474	002507	涪陵榨菜	50	562.00	0.00
475	000061	农产品	60	543.60	0.00
476	002492	恒基达鑫	50	466.50	0.00
477	002281	光迅科技	20	444.40	0.00
478	000863	三湘印象	60	439.20	0.00
479	000620	新华联	60	426.60	0.00
480	000728	国元证券	30	366.60	0.00
481	002414	高德红外	20	366.00	0.00
482	002482	广田集团	40	359.60	0.00
483	000650	仁和药业	60	358.80	0.00
484	002068	黑猫股份	40	336.40	0.00
485	000415	渤海金控	40	269.20	0.00
486	002279	久其软件	20	251.00	0.00
487	000727	华东科技	80	226.40	0.00
488	002155	湖南黄金	20	191.40	0.00
489	002169	智光电气	20	150.40	0.00
490	000882	华联股份	40	144.40	0.00
491	002519	银河电子	10	78.70	0.00
492	002148	北纬通信	4	43.08	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	1,045,499.00	0.21

2	600036	招商银行	985,712.04	0.20
3	601211	国泰君安	901,080.00	0.18
4	600000	浦发银行	870,890.69	0.17
5	002142	宁波银行	863,825.96	0.17
6	000002	万科 A	784,000.00	0.16
7	601318	中国平安	737,478.00	0.15
8	600016	民生银行	673,094.00	0.13
9	601328	交通银行	657,825.00	0.13
10	601166	兴业银行	654,027.00	0.13
11	000776	广发证券	646,516.00	0.13
12	600900	长江电力	617,702.00	0.12
13	600999	招商证券	551,929.00	0.11
14	601398	工商银行	508,422.00	0.10
15	601555	东吴证券	504,954.00	0.10
16	000783	长江证券	488,397.00	0.10
17	601601	中国太保	480,570.00	0.10
18	002024	苏宁云商	480,499.00	0.10
19	600309	万华化学	440,806.00	0.09
20	600015	华夏银行	426,341.13	0.08

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	975,212.40	0.19
2	600837	海通证券	972,007.00	0.19
3	600036	招商银行	848,488.00	0.17
4	601328	交通银行	726,747.00	0.14
5	600015	华夏银行	713,610.85	0.14
6	601211	国泰君安	592,449.62	0.12
7	002142	宁波银行	531,332.46	0.11
8	601318	中国平安	510,815.00	0.10
9	000776	广发证券	472,580.60	0.09
10	002294	信立泰	459,905.25	0.09
11	000783	长江证券	449,546.20	0.09
12	000999	华润三九	432,137.87	0.09
13	600688	上海石化	428,451.00	0.09
14	000858	五粮液	427,601.22	0.09
15	601688	华泰证券	420,811.00	0.08
16	601601	中国太保	418,328.00	0.08
17	000876	新希望	415,945.55	0.08
18	601988	中国银行	402,702.00	0.08

19	600585	海螺水泥	393,413.00	0.08
20	601169	北京银行	391,438.00	0.08

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	108,301,636.67
卖出股票的收入（成交）总额	104,331,299.74

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	44,520,000.00	8.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	247,124,817.90	49.05
	其中：政策性金融债	247,124,817.90	49.05
4	企业债券	19,274,000.00	3.83
5	企业短期融资券	70,243,000.00	13.94
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	86,897.21	0.02
8	同业存单	19,776,000.00	3.93
9	其他	-	-
10	合计	401,024,715.11	79.60

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	160206	16 国开 06	1,200,000	115,248,000.00	22.88
2	150316	15 进出 16	500,000	49,000,000.00	9.73
3	160403	16 农发 03	300,000	28,908,000.00	5.74
4	011698991	16 冀中能源 SCP005	200,000	20,086,000.00	3.99
5	011698989	16 河钢集 SCP006	200,000	20,072,000.00	3.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116477	万科 4A1	200,000.00	20,000,000.00	3.97
2	1589279	15 开元 8 优先	200,000.00	19,830,000.00	3.94
3	142435	16 平安 3A	200,000.00	12,554,000.00	2.49
4	146139	17 京保 2A	100,000.00	10,000,000.00	1.98
5	116478	京东 6 优 A	100,000.00	10,000,000.00	1.98
6	116455	京东 5 优 A	90,000.00	9,000,000.00	1.79
7	116465	16 平安 A	200,000.00	7,520,172.00	1.49

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	14,968.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,926,754.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,941,722.69

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏鼎融债券 A	185	2,705,987.85	500,121,222.22	99.90%	486,529.42	0.10%
华夏鼎融债券 C	70	1,714.58	-	-	120,020.64	100.00%
合计	255	1,963,638.32	500,121,222.22	99.88%	606,550.06	0.12%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏鼎融债券 A	115,251.88	0.02%
	华夏鼎融债券 C	18,572.10	15.47%
	合计	133,823.98	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人负责	华夏鼎融债券 A	0~10
	华夏鼎融债券 C	0

人持有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏鼎融债券 A	0~10
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0~10

§9 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
基金合同生效日(2016年11月7日)基金份额总额	501,374,679.32	478,405.63
本报告期期初基金份额总额	501,374,679.32	478,405.63
本报告期基金总申购份额	9,965.22	13,043.28
减：本报告期基金总赎回份额	776,892.90	371,428.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	500,607,751.64	120,020.64

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	134,236,080.99	63.14%	101,514.56	58.18%	-
华泰证券	1	78,368,619.96	36.86%	72,981.45	41.82%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择东方证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、中信建投证券、平安证券、申万宏源证券、中国银河证券、招商证券、中金公司、西部证券、方正证券、高华证券、万联证券、东莞证券、国海证券、广州证券、长江证券、长城证券、信达证券、华创证券、民族证券、国盛证券、万和证券、东兴证券、天风证券、民生证券、东吴证券和川财证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，天风证券的部分交易单元、国盛证券、万和证券和东兴证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	39,254,963.90	100.00%	144,120,000.00	29.33%
华泰证券	-	-	347,200,000.00	70.67%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏鼎融债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换转出业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-03
2	关于限制华夏鼎融债券型证券投资基金申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-04
3	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-06-30	500,121,222.22	-	-	500,121,222.22	99.88%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于5000万元，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏鼎融债券型证券投资基金托管协议》;

12.1.4 法律意见书;

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年八月二十六日