

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年四月二十日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏鼎利债券	
基金主代码	002459	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 18 日	
报告期末基金份额总额	103,977,042.27 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基金、混合基金，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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C
下属分级基金的交易代码	002459	002460
报告期末下属分级基金的份 额总额	47,543,380.47 份	56,433,661.80 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 (2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日)	
	华夏鼎利债券 A	华夏鼎利债券 C

1.本期已实现收益	878,642.82	1,988,766.89
2.本期利润	2,551,472.60	5,368,142.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1040	0.1124
4.期末基金资产净值	52,285,180.74	61,905,222.26
5.期末基金份额净值	1.100	1.097

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

华夏鼎利债券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	12.24%	0.61%	0.47%	0.05%	11.77%	0.56%

华夏鼎利债券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	12.17%	0.62%	0.47%	0.05%	11.70%	0.57%

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

华夏鼎利债券型发起式证券投资基金

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18日至2019年3月31日)

华夏鼎利债券A:



华夏鼎利债券C:



§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		
何家琪	本基金的基金	2016-11-18	-	7 年	清华大学应用经济学硕士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公

	经理、 固定收 益部高 级副总 裁			司，曾任固定收益部研究员、基金 经理助理，华夏新锦泰灵活配 置混合型证券投资基金基金经 理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 5 月 25 日期间）、华夏新锦鸿灵 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 7 月 23 日期间）、华夏新起航 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 7 月 30 日期间）、华夏新 锦绣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 12 月 17 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》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 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

2019 年一季度，国际方面，美国经济依然保持不错的状态，但市场对于未来经济步入衰退充

满了担忧，美联储表示将停止加息并在下半年停止缩表，美国 3 个月和 10 年期国债收益率在 2008 年之后再次倒挂。欧元区 PMI 快速下滑，继续低于 50 的分界线，欧央行也表示将有可能重启货币宽松政策。日本经济也表现不佳。各发达国家的债券收益率均出现明显下行。大宗商品方面，原油价格上涨明显，黄金亦有一定的表现。国内经济下行压力仍然较大，一季度国内货币政策继续维持相对宽松，财政政策加快发力，社融增速企稳回升，通胀水平由于季节性因素压力不大。

债券市场一季度表现平稳，10 年期国债到期收益率窄幅震荡，信用利差收窄，信用债表现好于利率债，中短久期品种好于长久期品种。中债财富指数今年以来上涨超过 1%。可转债在一季度伴随股市的上涨表现出色，成为债券类资产中超额收益的主要来源。股市表现亦超出市场预期，尤其是春节后中小创板块涨幅巨大，成为今年以来表现最好的大类资产。

报告期内，本基金对可转债资产灵活操作，同时控制纯债类仓位和久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 03 月 31 日，华夏鼎利债券 A 基金份额净值为 1.100 元，本报告期份额净值增长率为 12.24%；华夏鼎利债券 C 基金份额净值为 1.097 元，本报告期份额净值增长率为 12.17%，同期业绩比较基准增长率为 0.47%。

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	22,668,031.44	16.99
	其中：股票	22,668,031.44	16.99
2	固定收益投资	101,380,599.54	75.96
	其中：债券	101,380,599.54	75.96
	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	7,504,936.40	5.62
7	其他各项资产	1,904,251.29	1.43
8	合计	133,457,818.67	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,853,789.44	2.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,943,760.00	6.96
J	金融业	10,377,368.00	9.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	801,500.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	691,614.00	0.61
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,668,031.44	19.85

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	600109	国金证券	300,000	3,222,000.00	2.82
2	000686	东北证券	242,500	2,468,650.00	2.16
3	300033	同花顺	24,600	2,456,310.00	2.15
4	601555	东吴证券	231,900	2,346,828.00	2.06
5	300383	光环新网	110,000	2,062,500.00	1.81
6	300059	东方财富	100,000	1,938,000.00	1.70
7	600031	三一重工	143,448	1,833,265.44	1.61
8	300339	润和软件	115,000	1,486,950.00	1.30
9	601318	中国平安	15,900	1,225,890.00	1.07
10	601398	工商银行	200,000	1,114,000.00	0.98

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,230,600.00	40.49
	其中：政策性金融债	46,230,600.00	40.49
4	企业债券	26,355,991.00	23.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,794,008.54	25.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,380,599.54	88.78

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	108602	国开 1704	100,000	10,141,000.00	8.88

2	018007	国开 1801	100,000	10,110,000.00	8.85
3	108902	农发 1802	100,000	10,063,000.00	8.81
4	190205	19 国开 05	100,000	9,916,000.00	8.68
5	018005	国开 1701	60,000	6,000,600.00	5.25

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	65,409.59

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,679,910.54
5	应收申购款	158,931.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,904,251.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	航电转债	2,771,086.00	2.43
2	123007	道氏转债	1,927,232.84	1.69
3	128045	机电转债	1,545,247.20	1.35
4	128015	久其转债	1,205,285.20	1.06
5	128024	宁行转债	1,187,766.10	1.04
6	123002	国祯转债	1,120,728.92	0.98
7	113011	光大转债	1,056,804.00	0.93
8	113019	玲珑转债	865,350.20	0.76
9	113516	苏农转债	862,467.80	0.76
10	113505	杭电转债	771,270.50	0.68
11	113509	新泉转债	769,906.20	0.67
12	113508	新风转债	650,443.00	0.57
13	113015	隆基转债	638,120.80	0.56
14	113018	常熟转债	567,968.90	0.50
15	123006	东财转债	431,809.54	0.38

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	华夏鼎利债券A	华夏鼎利债券C
----	---------	---------

本报告期期初基金份额总额	13,199,154.38	45,212,437.94
报告期基金总申购份额	36,628,474.08	34,885,875.32
减：报告期基金总赎回份额	2,284,247.99	23,664,651.46
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	47,543,380.47	56,433,661.80

§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

单位：份

项目	华夏鼎利债券A	华夏鼎利债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,833.52	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,833.52	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	21.04	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,833.52	9.62%	10,000,000.00	9.62%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,833.52	9.62%	10,000,000.00	9.62%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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

2019 年 2 月 19 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏鼎利债券型发起式证券投资基金新增代销机构的公告。

2019 年 3 月 2 日发布华夏基金管理有限公司公告。

2019 年 3 月 7 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏鼎利债券型证券投资基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019 年 3 月 8 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏鼎茂债券型证券投资基金新增招商银行股份有限公司为代销机构的公告。

2019 年 3 月 11 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厦门银行股份有限公司为代销机构的公告。

2019 年 3 月 14 日发布华夏鼎利债券型发起式证券投资基金第九次分红公告。

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,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 2019 年 3 月 31 日数据),华夏移动互联混合(QDII)、华夏全球科技先锋混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中分别排序 2/34 和 7/34;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 3/27;华夏兴华混合(H 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(非 A 类)”

中排序 5/23; 华夏可转债增强债券(A 类)在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金(A 类)”中排序 6/28; 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 3/230; 华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债 A 类)”中排序 3/174; 华夏债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债非 A 类)”中排序 7/107; 华夏中小板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 7/62; 华夏中小企业板 ETF 联接(A 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)”中排序 6/47。

1 季度, 公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。2019 年 3 月, 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。

在客户服务方面, 1 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) 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; (2) 微信公众号上线基金分红通知和净值查询功能, 让客户及时掌握分红信息和净值变动情况, 提升客户体验; (3) 与华融湘江银行、微众银行等代销机构合作, 为投资者提供更多便捷的理财渠道; (4) 开展“四人拼团瓜分红包”、“今天能破亿么?”、“你的今年收益知否? 知否?”等活动, 为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 10.1.1 中国证监会准予基金注册的文件;
- 10.1.2 《华夏鼎利债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- 10.1.3 《华夏鼎利债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- 10.1.4 法律意见书;
- 10.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 10.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 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。

10.3 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

二〇一九年四月二十日