
华夏可转债增强债券型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：二〇二一年十月二十六日

§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 2021 年 10 月 22 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏可转债增强债券
基金主代码	001045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	1,385,305,893.97 份
投资目标	在控制风险的前提下，追求较高的当期收入和总回报。
投资策略	主要投资策略包括可转债投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、国债期货投资策略等。在可转债投资策略上，本基金将着重对可转债对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择，并在对应可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从

	财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。		
业绩比较基准	中证可转换债券指数。		
风险收益特征	本基金属于债券基金,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	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 C	华夏可转债增强债券 I
下属分级基金的交易代码	001045	012887	001046
报告期末下属分级基金的份额总额	1,382,378,491.97 份	2,927,402.00 份	-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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)		
	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 C	华夏可转债增强债券 I
1. 本期已实现收益	-2,758,768.92	5,945.70	-
2. 本期利润	41,443,363.84	-167,840.68	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0320	-0.1872	-
4. 期末基金资产净值	2,299,766,346.35	4,891,609.74	-

5. 期末基金份额净值	1.664	1.671	-
-------------	-------	-------	---

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根据《华夏基金管理有限公司关于华夏可转债增强债券型证券投资基金增加 C 类基金份额类别的公告》，本基金自 2021 年 7 月 7 日增加 C 类基金份额类别。

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

华夏可转债增强债券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	2.21%	0.82%	6.39%	0.67%	-4.18%	0.15%
过去六个月	2.97%	0.66%	11.13%	0.53%	-8.16%	0.13%
过去一年	25.87%	0.99%	13.49%	0.56%	12.38%	0.43%
过去三年	81.07%	1.11%	43.45%	0.67%	37.62%	0.44%
过去五年	66.40%	0.96%	38.47%	0.63%	27.93%	0.33%
自基金合同 生效起至今	66.40%	0.95%	38.90%	0.63%	27.50%	0.32%

华夏可转债增强债券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
2021 年 7 月 7 日起至今	2.70%	0.85%	6.13%	0.69%	-3.43%	0.16%

注：根据《华夏基金管理有限公司关于华夏可转债增强债券型证券投资基金增加 C 类基金份额类别的公告》，本基金自 2021 年 7 月 7 日增加 C 类基金份额类别。

华夏可转债增强债券I:

2016 年 9 月 27 日至 2021 年 9 月 30 日期间，华夏可转债增强债券 I 类基金份额为零。

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

华夏可转债增强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 9 月 27 日至 2021 年 9 月 30 日)

华夏可转债增强债券 A:



华夏可转债增强债券 C:



注：①根据《华夏基金管理有限公司关于华夏可转债增强债券型证券投资基金增加 C 类基金份额类别的公告》，本基金自 2021 年 7 月 7 日增加 C 类基金份额类别。

②2016 年 9 月 27 日至 2021 年 9 月 30 日期间，华夏可转债增强债券 I 类基金份额为零。

§ 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	本基金的基金经理	2016-11-18	-	9 年	硕士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。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）、华夏永康添福混合型证券投资基金基金经理（2018 年 2 月 1 日至 2019 年 7 月 18 日期间）、华夏新锦程灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2019 年 12 月 17 日期间）、华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 28 日至 2020 年 3 月 12 日期间）、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 12 月 17 日至 2020 年 3 月 12 日期间）、华夏新锦顺灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 12 月 17 日至 2020 年 3 月 12 日期间）、华夏鼎略债券型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 25 日至 2020 年 3 月 12 日期间）、华夏鼎顺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 8 月 6 日至 2020 年 5 月 7 日期间）、华夏鼎福三个月定期

					开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 21 日至 2020 年 5 月 7 日期间）、华夏鼎琪三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019 年 7 月 24 日至 2021 年 1 月 27 日期间）、华夏恒益 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 4 日至 2021 年 1 月 27 日期间）等。
--	--	--	--	--	--

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 14 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2021 年三季度，国际方面，德尔塔病毒在全球范围内肆虐，对国内外经济造成一定影响。考虑到通胀和就业情况，美联储已经非常接近调整其货币政策的时间点，且对明年的加息预期也有所上升，美债利率触底回升，美元指数走强。国内经济在三季度继续承压，9 月 PMI 跌破 50

的荣枯线，个别地产企业出现危机导致市场出现一定的挤兑，大宗商品价格在“双碳”和“双限”政策的作用下持续走高。

三季度央行下调了存款准备金利率，资金面整体平稳，债券收益率下行后低位震荡，权益市场波动较大，且风格转换较快，整体看部分周期板块在商品价格的强势上涨下表现较好，消费医药等板块跌幅较大。

报告期内，本组合对含权仓位灵活操作，并在债券市场上涨过程中逐步降低了组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，华夏可转债增强债券 A 基金份额净值为 1.664 元，本报告期份额净值增长率为 2.21%，同期业绩比较基准增长率为 6.39%；华夏可转债增强债券 C 基金份额净值为 1.671 元，本报告期份额净值增长率为 2.70%，同期业绩比较基准增长率为 6.13%。

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	464,649,997.63	18.96
	其中：股票	464,649,997.63	18.96
2	固定收益投资	1,964,701,505.13	80.17
	其中：债券	1,964,701,505.13	80.17
	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	8,997,201.24	0.37

7	其他各项资产	12,463,593.64	0.51
8	合计	2,450,812,297.64	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	55,800,543.75	2.42
C	制造业	287,752,857.34	12.49
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	5,378,918.40	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,981,171.84	0.30
J	金融业	101,156,097.30	4.39
K	房地产业	7,580,409.00	0.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	464,649,997.63	20.16

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

5.3.1 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	000983	山西焦煤	1,970,735	23,372,917.10	1.01

2	601658	邮储银行	4,536,400	23,044,912.00	1.00
3	601857	中国石油	2,838,800	17,061,188.00	0.74
4	600036	招商银行	299,134	15,091,310.30	0.65
5	600893	航发动力	269,400	14,329,386.00	0.62
6	002013	中航机电	997,158	13,202,371.92	0.57
7	600760	中航沈飞	189,500	12,950,430.00	0.56
8	601166	兴业银行	628,150	11,495,145.00	0.50
9	600438	通威股份	221,300	11,273,022.00	0.49
10	000932	华菱钢铁	1,694,000	11,231,220.00	0.49

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	120,104,000.00	5.21
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）	1,844,597,505.13	80.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,964,701,505.13	85.25

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	113011	光大转债	3,738,250	425,674,527.50	18.47
2	110075	南航转债	742,350	90,566,700.00	3.93
3	127045	牧原转债	637,984	84,966,709.12	3.69
4	113025	明泰转债	254,690	83,785,369.30	3.64
5	110073	国投转债	700,090	80,545,354.50	3.49

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	327,447.37
2	应收证券清算款	1,190,507.41
3	应收股利	-
4	应收利息	8,024,746.71
5	应收申购款	2,920,892.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	12,463,593.64

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	113011	光大转债	425,674,527.50	18.47
2	110075	南航转债	90,566,700.00	3.93
3	113025	明泰转债	83,785,369.30	3.64
4	110073	国投转债	80,545,354.50	3.49
5	110043	无锡转债	70,811,256.00	3.07
6	128128	齐翔转 2	62,647,991.68	2.72
7	127005	长证转债	58,937,413.92	2.56
8	128134	鸿路转债	53,106,845.40	2.30
9	128081	海亮转债	44,648,901.60	1.94
10	110063	鹰 19 转债	43,714,568.40	1.90
11	128113	比音转债	37,637,961.53	1.63
12	127029	中钢转债	37,156,977.76	1.61
13	128136	立讯转债	35,426,567.80	1.54
14	110053	苏银转债	30,257,186.40	1.31
15	123103	震安转债	26,971,810.20	1.17
16	113582	火炬转债	26,603,032.50	1.15
17	128046	利尔转债	25,486,209.00	1.11
18	127018	本钢转债	22,631,758.22	0.98
19	128109	楚江转债	20,411,652.36	0.89
20	113013	国君转债	20,265,202.60	0.88
21	123096	思创转债	20,041,804.20	0.87
22	128141	旺能转债	17,519,420.38	0.76
23	123083	朗新转债	17,490,767.40	0.76
24	127017	万青转债	17,019,535.98	0.74
25	128057	博彦转债	17,008,345.90	0.74
26	110074	精达转债	14,010,890.60	0.61
27	110059	浦发转债	12,366,329.10	0.54
28	110067	华安转债	10,760,121.00	0.47
29	113621	彤程转债	10,513,599.20	0.46
30	113034	滨化转债	10,364,086.40	0.45
31	127024	盈峰转债	9,072,885.81	0.39
32	123104	卫宁转债	8,599,560.56	0.37
33	110047	山鹰转债	8,359,578.70	0.36
34	128094	星帅转债	8,009,400.00	0.35
35	127022	恒逸转债	7,407,000.00	0.32

36	127030	盛虹转债	6,746,785.04	0.29
37	113043	财通转债	6,650,988.00	0.29
38	113504	艾华转债	5,773,155.90	0.25
39	128029	太阳转债	5,672,004.00	0.25
40	127027	靖远转债	5,498,201.00	0.24
41	113616	韦尔转债	5,316,675.00	0.23
42	110052	贵广转债	5,214,000.00	0.23
43	113545	金能转债	3,878,600.00	0.17
44	127012	招路转债	2,002,500.00	0.09
45	128034	江银转债	1,054,774.60	0.05

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	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 C	华夏可转债增强债券 I
本报告期期初基金份 额总额	1,209,934,671.02	-	-
报告期期间基金总申 购份额	467,533,411.29	3,196,233.05	-
减：报告期期间基金 总赎回份额	295,089,590.34	268,831.05	-
报告期期间基金拆分 变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,382,378,491.97	2,927,402.00	-

注：根据《华夏基金管理有限公司关于华夏可转债增强债券型证券投资基金增加 C 类基金份额类别的公告》，本基金自 2021 年 7 月 7 日增加 C 类基金份额类别。

§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

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	2021-07-14 至 2021-07-29	237,143,897.07	-	-	237,143,897.07	17.12%

产品特有风险

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。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正常运作水平，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。

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

2021 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏可转债增强债券型证券投资基金增加 C 类基金份额的公告。

2021 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司关于修订华夏可转债增强债券型证券投资基金基金合同的公告。

2021 年 8 月 11 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 8 月 14 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

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

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，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 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，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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 基金资产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，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品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《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 9 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 2/35、华夏新时代混合（QDII）排序第 8/35；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 3/37；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 3/614、华夏盛世混合排序第 20/614；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 6/130；在消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏新兴消费混合（A 类）排序第 8/24；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 10/174、华夏兴华混合（A 类）排序第 16/174；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 33/494、华夏国企改革混合排序第 66/494、华夏新起点混合（A 类）排序第 78/494；在标准股票型基金（A 类）中华夏潜龙精选股票排序第 38/240、华夏优势精选股票排序第 43/240、华夏创新前沿股票排序第 76/240。

指数与量化产品：在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏创业板 ETF 排序第 1/101；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 3/90、华夏中证四川国改 ETF 排序第 8/90、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 16/90、华夏中证央企 ETF 排序第 24/90、华夏战略新兴成指 ETF 排序第 26/90；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强（A 类）排序第 4/101；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排序第 8/43、华夏医药 ETF 排序第 9/43、华夏消费 ETF 排序第 11/43。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）（A 类）排序第 2/25；在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中华夏聚利债券排序第 3/206、华夏双债债券（A 类）排序第 7/206、华夏债券（A/B 类）排序第 23/206；

在偏债型基金(A类)中华夏永康添福混合排序第 4/191、华夏睿磐泰利混合(A类)排序第 23/191、华夏睿磐泰兴混合排序第 24/191、华夏睿磐泰茂混合(A类)排序第 29/191、华夏睿磐泰荣混合(A类)排序第 35/191；在短期纯债债券型基金(A类)中华夏短债债券(A类)排序第 6/54；在定期开放式纯债债券型基金(摊余成本法)(A类)中华夏恒泰 64 个月定开债券排序第 12/78；在绝对收益目标基金(A类)中华夏永福混合(A类)排序第 39/138；在可转换债券型基金(A类)中华夏可转债增强债券(A类)排序第 8/34；在中短期纯债债券型基金(A类)中华夏中短债债券(A类)排序第 14/76；在普通债券型基金(二级)(A类)中华夏鼎泓债券(A类)排序第 31/254、华夏鼎利债券(A类)排序第 72/254；在长期纯债债券型基金(A类)中华夏鼎航债券(A类)排序第 27/586、华夏鼎通债券(A类)排序第 33/586。

养老&FOF 产品：在养老目标日期 FOF(2040)(A类)中华夏养老 2040 三年持有混合(FOF)排序第 1/10；在混合型 FOF(权益资产 0-30%)(A类)中华夏聚丰混合(FOF)(A类)排序第 1/10、华夏聚惠 FOF(A类)排序第 2/10；在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A类)中华夏稳健养老一年持有混合(FOF)排序第 5/27。

3 季度，在《中国证券报》第十八届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”，成为业内唯一连续 6 年获此殊荣的基金公司。在《证券时报》第十六届中国基金业明星基金奖评选中，公司层面，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“三年持续回报股票型明星基金奖”，华夏永福混合荣获“三年持续回报绝对收益策略明星基金奖”，华夏移动互联混合(QDII)“三年持续回报主动权益类 QDII 明星基金奖”。在已经举办的十六届基金业明星基金奖评选中，华夏基金累计斩获奖杯数已达 49 座。第三届济安群星汇颁奖盛典获奖名单已发布，华夏基金共获得了 10 个奖项，分别是“基金公司单项奖-指数型”、“基金公司单项奖-一级债”、华夏上证 50ETF 获得“基金产品单项奖-指数型”、华夏聚利债券获得“基金产品单项奖-一级债”、华夏能源革新股票、华夏上证 50ETF、华夏双债债券、华夏新时代混合(QDII)、华夏移动互联混合(QDII)获得“五星基金明星奖”。在《上海证券报》主办的第十八届“金基金”奖评选活动中，华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”，华夏创新前沿股票荣获“金基金 股票型基金三年期奖”，华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”，华夏能源革新股票荣获“金基金 社会责任投资(ESG)基金奖”。

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) 华夏基金直销上线招商银行卡大额支付业务，进一步满足客户支付需求；(2) 华夏基金管家客户端增加累计收益率、持有收益率、定投标志等信息，并对登录方式进行便捷优化；(3) 与泰信财富等销售机构开展代销合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；(4) 开展“准备好了

吗？来跟我们一起碳中和！”、“定位在太空的朋友圈”、“铁柱姑娘想对你说的话”等活动，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

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏可转债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏可转债增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 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
二〇二一年十月二十六日