

华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金

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 | 华夏睿磐泰兴混合 |
| 基金主代码 | 004202 |
| 交易代码 | 004202 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 7 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 571,210,866.29 份 |
| 投资目标 | 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。 |
| 投资策略 | 主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、期权投资策略等。在资产配置策略上，本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例。在股票投资策略上，本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×10%+上证国债指数收益率×90%。 |
| 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 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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 |
|--------|-----|
|--------|-----|

| | (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |
|----------------|----------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 32,950,417.13 |
| 2.本期利润 | 15,364,150.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0272 |
| 4.期末基金资产净值 | 789,337,171.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3819 |

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

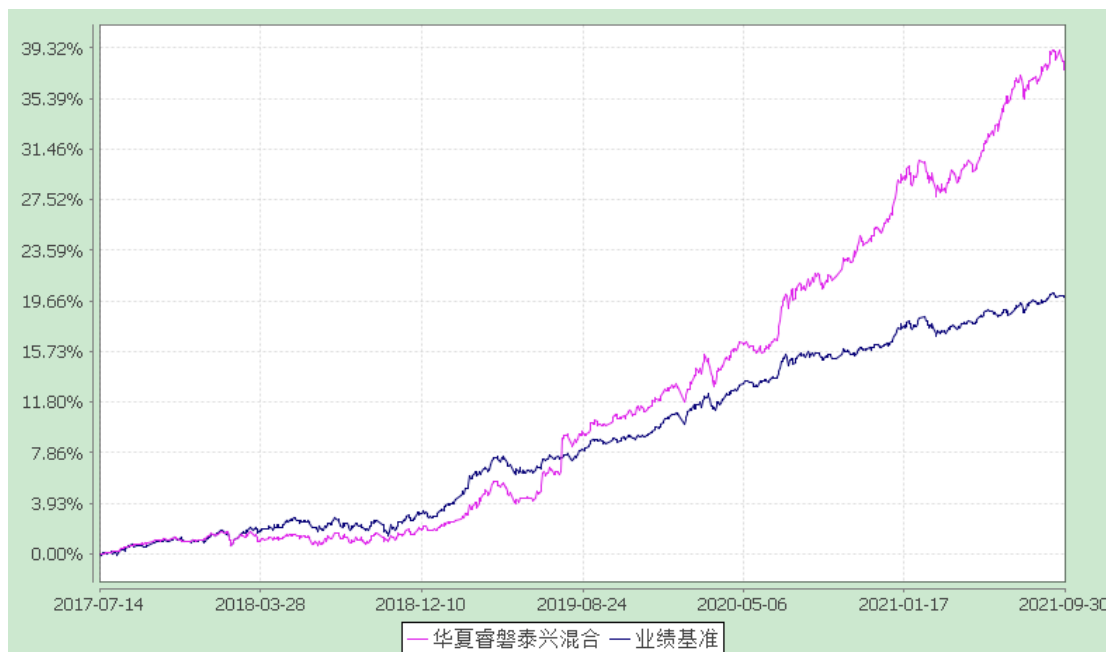
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.93% | 0.26% | 0.91% | 0.12% | 1.02% | 0.14% |
| 过去六个月 | 7.09% | 0.24% | 2.18% | 0.10% | 4.91% | 0.14% |
| 过去一年 | 13.67% | 0.24% | 4.16% | 0.12% | 9.51% | 0.12% |
| 过去三年 | 36.00% | 0.23% | 16.94% | 0.13% | 19.06% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.19% | 0.20% | 20.01% | 0.13% | 18.18% | 0.07% |

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

华夏睿磐泰兴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

(2017 年 7 月 14 日至 2021 年 9 月 30 日)



§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 | | |
| 宋洋 | 本基金的基金经理 | 2017-08-29 | - | 11 年 | 博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2018 年 4 月 10 日至 2019 年 2 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 8 月 29 日 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理 (2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 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》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

3 季度，内需在国内偏紧的财政及地产政策影响下压力显现，叠加 delta 病毒对消费需求压制，能耗双控也一定程度影响到了工业生产，尽管外需保持相对强劲，但整体经济下行压力相对于上半年有所加大，7 月政治局会议中，也并未再强调“当前处于稳增长压力较小

的窗口期”。货币政策体现了一定前瞻性，及时预判应对，7月全面降准释放流动性对冲，扭转了上半年以来市场一直存在的“不急转弯”预期，并让市场对经济下行、货币放松形成了相对一致的预期判断。在此基础上，上半年债券市场慢牛格局有所加速，7月国债期货大幅走牛，收益率曲线陡峭化下行；8月、9月市场整体回归震荡，短端利率对较为强烈的放松预期有所修正。

报告期内，权益市场整体呈现震荡。权益市场整体分化较大：分行业来看，煤炭、有色金属、钢铁、基础化工等周期板块表现较为强劲，而纺织服装、家电、食品饮料、医药和消费者服务等板块表现相对落后。

本基金报告期内，产品端力争实现控回撤绝对收益目标的产品定位，投资端围绕着产品定位匹配相应的投资策略。在产品中的股票资产和债券资产分工方面，债券端提供低波动稳健收益，产品整体的风险收益特征更多由股票端来决定。产品的股票端投资基于定量与定性结合的复合方法论，力争实现相对稳健低波动的投资收益，穿越市场周期，为客户实现稳健型的收益回报，同时积极使用股指期货进行降低组合波动率，并控制组合的回撤水平；债券端组合保持了相对积极的进攻姿态，中高杠杆、中长久期，有效获得了票息及资本利得收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年9月30日，本基金份额净值为1.3819元，本报告期份额净值增长率为1.93%，同期业绩比较基准增长率为0.91%。

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 | 138,885,416.59 | 17.57 |
| | 其中：股票 | 138,885,416.59 | 17.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 576,473,499.19 | 72.91 |
| | 其中：债券 | 576,473,499.19 | 72.91 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 30,000,245.00 | 3.79 |
| | 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 | 32,049,908.98 | 4.05 |
| 7 | 其他各项资产 | 13,244,911.29 | 1.68 |
| 8 | 合计 | 790,653,981.05 | 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 | 528,342.00 | 0.07 |
| B | 采矿业 | 4,430,664.00 | 0.56 |
| C | 制造业 | 96,597,054.18 | 12.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,336,271.22 | 0.80 |
| E | 建筑业 | 446,903.39 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | 568,949.52 | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,672,658.40 | 0.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,219,089.35 | 1.04 |
| J | 金融业 | 14,998,741.60 | 1.90 |
| K | 房地产业 | 1,345,871.00 | 0.17 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,203,078.28 | 0.28 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,401,978.37 | 0.18 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 104,696.94 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 23,848.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,925.22 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 138,885,416.59 | 17.60 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 6,299,875.22 | 0.80 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 2,200 | 4,026,000.00 | 0.51 |
| 3 | 300122 | 智飞生物 | 25,100 | 3,990,649.00 | 0.51 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 6,500 | 3,417,245.00 | 0.43 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 59,400 | 2,872,584.00 | 0.36 |
| 6 | 600438 | 通威股份 | 47,144 | 2,401,515.36 | 0.30 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 6,580 | 2,075,990.00 | 0.26 |
| 8 | 688598 | 金博股份 | 5,900 | 2,070,723.00 | 0.26 |
| 9 | 002709 | 天赐材料 | 13,600 | 2,068,832.00 | 0.26 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 39,800 | 2,007,910.00 | 0.25 |

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 | 38,114,800.00 | 4.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 418,248,747.50 | 52.99 |
| | 其中：政策性金融债 | 152,833,747.50 | 19.36 |
| 4 | 企业债券 | 2,001,000.00 | 0.25 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 73,088,400.00 | 9.26 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 45,020,551.69 | 5.70 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 576,473,499.19 | 73.03 |

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 | 1928018 | 19 工商银行永续债 | 620,000 | 63,519,000.00 | 8.05 |
| 2 | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 400,000 | 40,896,000.00 | 5.18 |
| 3 | 2028014 | 20 中国银行永续债 01 | 400,000 | 39,540,000.00 | 5.01 |
| 4 | 180321 | 18 进出 21 | 330,000 | 34,131,900.00 | 4.32 |
| 5 | 1928025 | 19 交通银行永续债 | 300,000 | 30,489,000.00 | 3.86 |

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

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|-------------------|----------------------|-----|----------------|-------------|---------------------------------|
| IH2110 | 上证 50 股指期货 IH2110 合约 | -25 | -23,998,500.00 | -501,720.00 | 买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理,实现投资目标。 |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -501,720.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 1,693,862.91 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -431,040.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在风险可控的前提下,根据基金合同规定投资股指期货旨在配合基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,实现投资目标。

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

本基金投资国债期货,根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特

征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值 (元) | 公允价值变 动(元) | 风险指标说明 |
|-------------------|-------|--------------|---------------------|---------------|------------------------------|
| T2112 CFX | T2112 | -130.00 | -129,863,500. 00 | -280,500.00 | 参与国债期货投资是为了对冲组合债券持仓久期，降低净值波动 |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -280,500.00 |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -2,569,041.52 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 547,000.00 |

5.10.3 本期国债期货投资评价

基金参与国债期货投资目的在于利用利率衍生品对冲债券持仓的利率风险，降低组合整体的净值波动率。本期国债期货投资符合基金合同约定的关于衍生品的投资政策，投资过程及策略符合风险控制的要求。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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 | 5,503,284.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 108,941.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,374,226.90 |
| 5 | 应收申购款 | 258,458.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,244,911.29 |

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 | 110053 | 苏银转债 | 7,005,600.00 | 0.89 |
| 2 | 128107 | 交科转债 | 6,678,695.10 | 0.85 |
| 3 | 127018 | 本钢转债 | 5,799,412.60 | 0.73 |
| 4 | 128081 | 海亮转债 | 4,166,156.00 | 0.53 |
| 5 | 113024 | 核建转债 | 2,283,070.40 | 0.29 |
| 6 | 127020 | 中金转债 | 2,263,583.76 | 0.29 |
| 7 | 110061 | 川投转债 | 1,921,397.00 | 0.24 |
| 8 | 128057 | 博彦转债 | 1,425,228.00 | 0.18 |
| 9 | 127027 | 靖远转债 | 1,144,340.02 | 0.14 |
| 10 | 128134 | 鸿路转债 | 546,014.00 | 0.07 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600905 | 三峡能源 | 6,299,875.22 | 0.80 | 新发流通受限 |

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 | 585,723,567.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 106,314,996.16 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 120,827,697.26 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 571,210,866.29 |

§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

2021 年 7 月 3 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 7 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。

2021 年 7 月 23 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 7 月 24 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金限制申购、定期定额申购业务的公告。

2021 年 7 月 24 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 7 月 26 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 5 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 7 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 13 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 9 月 9 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金限制申购、定期定额申购及转换转入业务的公告。

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、《华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏睿磐泰兴混合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