**亚债中国债券指数基金**

**2019年第3季度报告**

**2019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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十二日

## **§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10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7月1日起至9月30日止。

## **§2基金产品概况**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 基金简称 | 华夏亚债中国指数 | |
| 基金主代码 | 001021 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年5月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,277,816,572.65份 | |
| 投资目标 | 本基金追求取得在扣除各项费用之前与标的指数相似的总回报。 | |
| 投资策略 | 本基金为被动管理基金，主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为Markit指数公司（Markit Indices Limited）编制并发布的iBoxx®亚债中国指数。 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券基金，风险与收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于政府债券，风险和收益低于投资范围包括股票、可转换公司债及普通企业债的债券基金。 | |
| 基金管理人 | 华夏基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华夏亚债中国指数A | 华夏亚债中国指数C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001021 | 001023 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,167,370,021.11份 | 110,446,551.54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7月1日-2019年9月30日) | |
| 华夏亚债中国指数A | 华夏亚债中国指数C |
| 1.本期已实现收益 | 53,216,105.72 | 1,154,724.22 |
| 2.本期利润 | 73,803,128.76 | 1,753,446.95 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0175 | 0.0150 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,215,492,148.63 | 133,900,052.74 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.252 | 1.212 |

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

华夏亚债中国指数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 | 1.46% | 0.10% | 1.38% | 0.10% | 0.08% | 0.00% |

华夏亚债中国指数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 | 1.25% | 0.10% | 1.38% | 0.10% | -0.13% | 0.00% |

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

亚债中国债券指数基金

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

(2011年5月25日至2019年9月30日)

华夏亚债中国指数A：



华夏亚债中国指数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 |
| 柳万军 | 本基金的基金经理、固定收益部总监 | 2015-07-16 | - | 12年 | 中国人民银行研究生部金融学硕士。曾任中国人民银行上海总部副主任科员、泰康资产固定收益部投资经理、交银施罗德基金固定收益部基金经理助理等。2013年6月加入华夏基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员，华夏薪金宝货币市场基金基金经理（2014年5月26日至2017年8月7日期间）、华夏货币市场基金基金经理（2013年12月31日至2017年8月7日期间）、华夏恒利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（2016年3月29日至2018年6月28日期间）、华夏新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年2月23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，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3季度，国际方面，美国增长继续趋缓但在发达经济体中保持一枝独秀,但贸易不确定性对企业信心打击较大，私人部门投资和出口均大幅下滑。为应对下行风险，联储于7月和9月分别进行预防式降息25BP；欧元区经济数据持续下滑，核心国德国9月制造业PMI跌至历史低位，欧央行9月下调存款利率，并宣布将于11月重启资产购买计划（QE）。资本市场方面，8月以来贸易形势急转直下，美债收益率大幅下行近60BP，黄金等避险资产价格大涨。进入9月，贸易战阶段性缓和，美债收益率反弹，美股等风险资产价格修复。

国内方面，三季度贸易摩擦反复，外需下滑幅度较大，经济再下台阶；9月央行进行了全面和定向降准，资金利率高位回落，货币政策有所放松；但猪价快速上涨导致CPI持续上行，制约货币宽松幅度，政策利率迟迟未见下调。本季度，债券收益率先下后上，收益率曲线小幅陡峭化下行。

操作上，本基金在三季度末减持了中长端债券的配置，整体维持了与指数相近的久期。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2019年9月30日，华夏亚债中国指数A基金份额净值为1.252元，本报告期份额净值增长率为1.46%；华夏亚债中国指数C基金份额净值为1.212元，本报告期份额净值增长率为1.25%，同期业绩比较基准增长率为1.38%。

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 | - | - |
|  | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 5,239,939,241.70 | 97.87 |
|  | 其中：债券 | 5,239,939,241.70 | 97.87 |
|  | 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 | 33,500,000.00 | 0.63 |
|  | 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 | 5,535,171.95 | 0.10 |
| 7 | 其他各项资产 | 75,116,217.97 | 1.40 |
| 8 | 合计 | 5,354,090,631.62 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 3,821,928,241.70 | 71.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,418,011,000.00 | 26.51 |
|  | 其中：政策性金融债 | 1,418,011,000.00 | 26.51 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 5,239,939,241.70 | 97.95 |

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 | 150003 | 15附息国债03 | 1,600,000 | 160,512,000.00 | 3.00 |
| 2 | 190210 | 19国开10 | 1,300,000 | 130,507,000.00 | 2.44 |
| 3 | 120004 | 12附息国债04 | 1,200,000 | 122,100,000.00 | 2.28 |
| 4 | 110016 | 11附息国债16 | 1,000,000 | 115,020,000.00 | 2.15 |
| 5 | 160210 | 16国开10 | 1,100,000 | 106,733,000.00 | 2.00 |

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 | 562.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,519,923.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 72,560,074.96 |
| 5 | 应收申购款 | 35,657.23 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 75,116,217.97 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 华夏亚债中国指数A | 华夏亚债中国指数C |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,662,491,536.18 | 70,013,801.63 |
| 报告期基金总申购份额 | 26,852,480.43 | 86,342,445.21 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 521,973,995.50 | 45,909,695.30 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,167,370,021.11 | 110,446,551.54 |

## **§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 | 2019-07-01至2019-09-30 | 4,006,775,694.34 | - | - | 4,006,775,694.34 | 93.66% |
| 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

2019年7月5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瑞士银行（中国）有限公司为代销机构的公告。

2019年7月12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联储证券有限责任公司为代销机构的公告。

2019年7月19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中国人寿保险股份有限公司为代销机构的公告。

2019年7月31日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在新时代证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2019年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019年8月7日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增海银基金销售有限公司为代销机构的公告。

2019年8月19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万和证券股份有限公司为代销机构的公告。

2019年8月30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阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告。

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，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，目前旗下管理华夏上证50ETF、华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改ETF、华夏战略新兴成指ETF、5GETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏证券ETF、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快线货币ETF、华夏3-5年中高级可质押信用债ETF、华夏豆粕ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、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基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至2019年9月30日数据），华夏移动互联混合(QDII)及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2/33和7/33；华夏海外收益债券(QDII)( C类)及华夏大中华信用债券(QDII)(C类)在“QDII基金-QDII债券基金-QDII债券型基金（非A类）”中分别排序4/29和8/29；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2/225；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A类）”中排序8/18；华夏债券(C类)及华夏双债债券(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）”分别排序9/105和7/105；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）”中排名9/169；华夏医疗健康混合(C类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（非A类）”中排序4/19；华夏创业板ETF在“股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金”中排序7/59；华夏消费ETF在“股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金” 排序4/31；华夏战略新兴成指ETF在“股票基金-股票ETF基金-主题指数股票ETF基金”排序8/31；华夏创业板ETF联接 (A类)及华夏MSCI中国A股国际通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5/46和9/46。

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）直销电子交易平台开通华夏沃利货币A的快速赎回业务，华夏基金管家APP、华夏基金微信公众号上线智能快取功能，满足了广大投资者对资金流动的迫切需求；（2）华夏基金净值服务全面升级为微信实时查看、订阅推送模式，方便客户及时、精准查询基金净值变动情况；（3）与万和证券、五矿证券、阳光人寿等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“微信全勤奖”、“户龄（第三期）”、“看谁能猜中”、“寻人启事”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

## **§9备查文件目录**

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件；

9.1.2《亚债中国债券指数基金基金合同》；

9.1.3《亚债中国债券指数基金托管协议》；

9.1.4法律意见书；

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年十月二十二日