

---

# 华夏鼎融债券型证券投资基金

## 2023 年年度报告

### 2023 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二四年三月二十八日

## §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 2024 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 .....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现 .....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§4 管理人报告 .....	8
§5 托管人报告 .....	16
§6 审计报告 .....	17
§7 年度财务报表 .....	19
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	22
§8 投资组合报告 .....	46
8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
8.3 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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
8.6 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 .....	56
8.7 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 .....	56
8.8 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 .....	56
8.9 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 .....	56
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
§9 基金份额持有人信息 .....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.3 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 .....	59
§10 开放式基金份额变动 .....	59
§11 重大事件揭示 .....	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
§13 备查文件目录 .....	63

## §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	
交易代码	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	714,831,372.37 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	662,709,455.84 份	52,121,916.53 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	主要投资策略包括资产配置策略、债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略等。
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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637228
传真	010-63136700	021-60635778
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	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	张佑君	田国立
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
本期已实现收益	-1,803,595.86	-497,296.32	-17,881,987.23	-57,491.89	8,355,090.58	27,317.51
本期利润	11,038,316.20	-138,157.12	-30,310,040.83	-97,563.11	10,561,253.58	27,523.96
加权平均基金份额本期利润	0.0188	-0.0049	-0.0977	-0.0994	0.1062	0.0883
本期加权平均净值利润率	1.82%	-0.44%	-8.41%	-8.29%	8.48%	7.12%
本期基金份额净值增长率	2.37%	1.98%	-5.17%	-5.55%	8.78%	8.35%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C

期末可供分配利润	18,628,944.59	5,608,298.64	7,458,181.12	195,308.47	29,799,757.88	113,449.94
期末可供分配基金份额利润	0.0281	0.1076	0.0150	0.0988	0.2984	0.2718
期末基金资产净值	688,651,463.75	58,405,741.05	505,551,218.52	2,171,501.10	131,303,946.25	537,525.24
期末基金份额净值	1.0391	1.1206	1.0150	1.0988	1.3147	1.2878
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C	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	27.63%	24.04%	24.67%	21.63%	31.47%	28.78%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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
过去三个月	0.43%	0.09%	0.82%	0.04%	-0.39%	0.05%
过去六个月	0.01%	0.10%	0.83%	0.04%	-0.82%	0.06%
过去一年	2.37%	0.12%	2.06%	0.04%	0.31%	0.08%
过去三年	5.61%	0.20%	4.74%	0.05%	0.87%	0.15%
过去五年	22.87%	0.23%	6.04%	0.06%	16.83%	0.17%
自基金合同生效起至今	27.63%	0.20%	4.74%	0.07%	22.89%	0.13%

##### 华夏鼎融债券 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	0.33%	0.09%	0.82%	0.04%	-0.49%	0.05%
过去六个月	-0.19%	0.10%	0.83%	0.04%	-1.02%	0.06%
过去一年	1.98%	0.12%	2.06%	0.04%	-0.08%	0.08%
过去三年	4.36%	0.20%	4.74%	0.05%	-0.38%	0.15%
过去五年	20.45%	0.23%	6.04%	0.06%	14.41%	0.17%
自基金合同生 效起至今	24.04%	0.20%	4.74%	0.07%	19.30%	0.13%

### 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2023年12月31日)

#### 华夏鼎融债券 A



#### 华夏鼎融债券 C

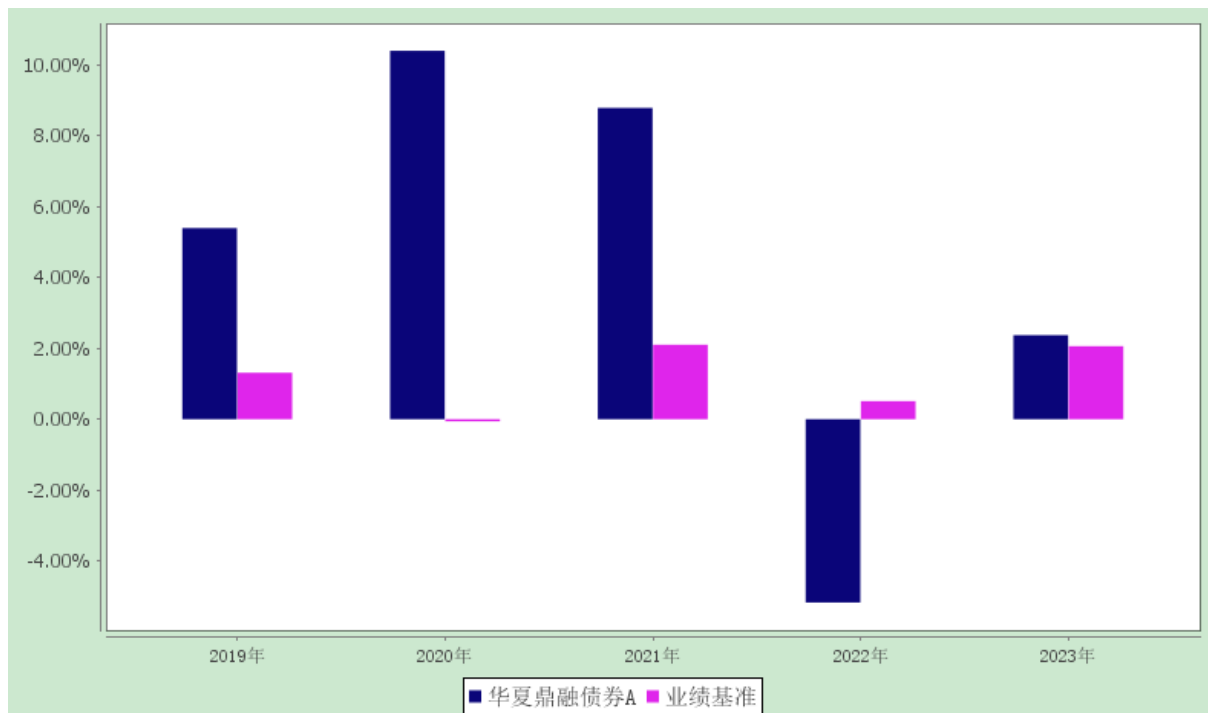


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 华夏鼎融债券型证券投资基金

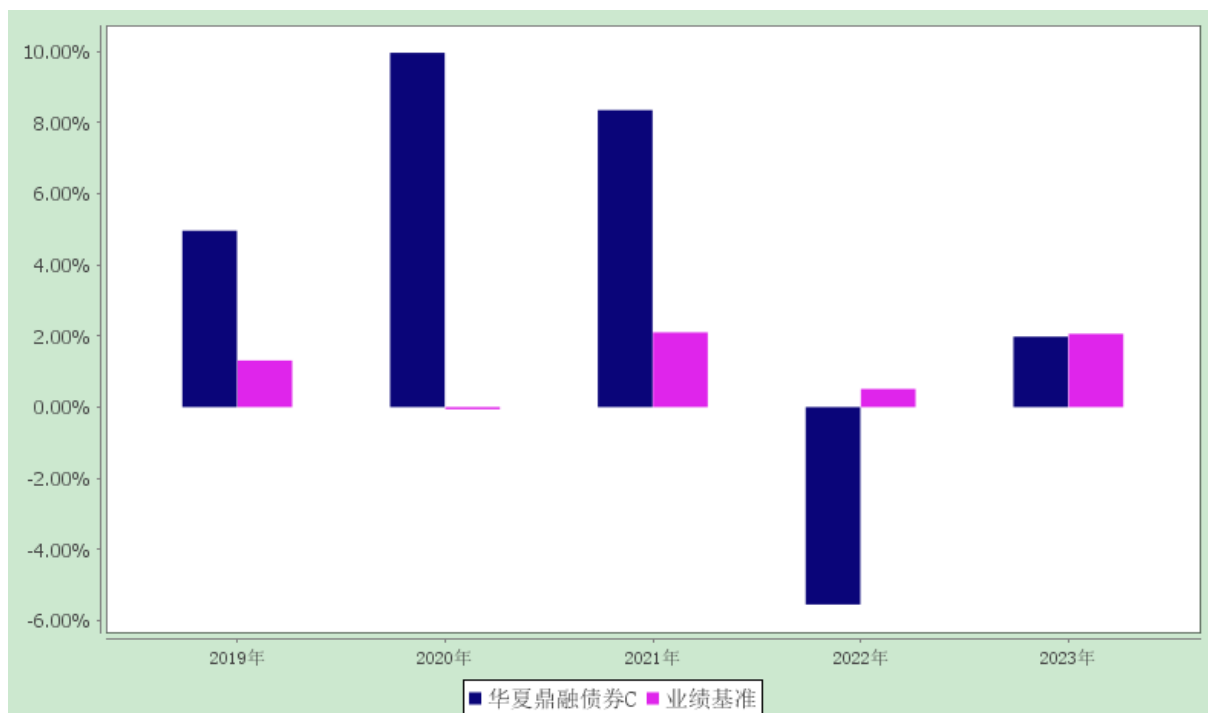
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 华夏鼎融债券 A



#### 华夏鼎融债券 C





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

华夏鼎融债券 A:

单位：人民币元

年度-	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2022 年	2.370	140,280,097.78	27,989,093.96	168,269,191.74	-
合计	2.370	140,280,097.78	27,989,093.96	168,269,191.74	-

华夏鼎融债券 C:

单位：人民币元

年度-	每10份基金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分 配合计	备注
2022 年	1.202	209,524.82	25,576.01	235,100.83	-
合计	1.202	209,524.82	25,576.01	235,100.83	-

## §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、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。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、首批个人养老金基金管理人、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、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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、公募 REITs 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。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

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 2023 年 12 月 31 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：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 1/10；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/68、华夏消费升级混合(A 类)排名第 11/68、华夏消费龙头混合(A 类)排名第 13/68、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 21/68；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 3/10；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)排名第 3/145、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/145、华夏中证 1000 指数增强(A 类)排名第 20/145；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字经济龙头混合发起式(A 类)排名第 4/30；在新能源主题股票型基金(A 类)中华夏能源革新股票(A 类)排名第 4/14；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 4/13；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 4/421、华夏稳增混合排名第 10/421；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 4/216、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 21/216、华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 33/216；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜先锋股票（LOF）(A 类)排名第 8/326、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 15/326。

固收与固收+产品：在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排名第 1/349、华夏稳福六个月持有混合(A 类)排名第 17/349、华夏睿磐泰兴混合(A 类)排名第 28/349；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎成一年定开债券排名第 12/1340、华夏鼎航债券(A 类)

排名第 14/1340；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏稳享增利 6 个月债券(A 类)排名第 13/402、华夏鼎源债券(A 类)排名第 14/402、华夏卓信一年定开债券发起式排名第 25/402、华夏希望债券(A 类)排名第 32/402、华夏鼎泓债券(A 类)排名第 34/402、华夏卓享债券(A 类)排名第 38/402；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排名第 34/137。

指数产品：在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 2/343、华夏中证 5G 通信主题 ETF 排名第 10/343、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 16/343、华夏中证人工智能主题 ETF 排名第 20/343、华夏国证消费电子主题 ETF 排名第 24/343、华夏中证智能汽车主题 ETF 排名第 25/343、华夏中证金融科技主题 ETF 排名第 28/343、华夏中证文化传媒 ETF 排名第 31/343、华夏中证机器人 ETF 排名第 39/343；在策略指数股票 ETF 基金中华夏中证智选 500 价值稳健策略 ETF 排名第 6/37、华夏中证智选 1000 价值稳健策略 ETF 排名第 10/37；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指证券公司 ETF 排名第 10/66；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排名第 17/146、华夏中证 500ETF 排名第 26/146；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A 类)排名第 2/125、华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接(A 类)排名第 6/125、华夏中证人工智能主题 ETF 联接(A 类)排名第 9/125、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 25/125；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证全指证券公司 ETF 联接(A 类)排名第 6/36；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证 1000ETF 发起式联接(A 类)排名第 11/106、华夏中证 500ETF 联接(A 类)排名第 19/106；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 5/16；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏彭博政金债 1-5 年(A 类)排名第 13/115。

在《证券时报》主办的第十八届中国基金业“明星基金奖”评选活动上，华夏基金将两大奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“三年海外投资明星基金公司”；产品层面，华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第二十届“金基金”奖评选活动上，华夏基金荣膺三项大奖，公司层面获得“被动投资基金管理公司奖”，产品层面华夏创新前沿股票和华夏行业景气混合分别荣获股票型基金五年期奖和偏股混合型基金五年期奖。

在客户服务方面，2023 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）华夏基金直销渠道优化页面显示，升级搜索及查询功能，让客户操作更加便利；（2）华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块，上线亲子账户、资产诊断等功能，贴合客户投资需求，进一步提升使用体验；（3）与华润银行、贵州银行、武汉农商行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“帮你问了 ChatGPT”、“指数攻防值来啦！”、“华夏基金模拟投基大赛”、“煎熬的磨底期里找机会”等活动，为客户提供了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		
宋洋	本基金的基金经理	2022-03-07	-	13 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。历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）、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2021 年 8 月 3 日期间）等。
文世伦	本基金的基金经理助理	2023-03-28	-	6 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员，中融基金管理有限公司投资经理。2022 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。
席与焜	本基金的基金经理助理	2023-03-28	-	5 年	硕士。2018 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员。
刘薇	本基金的基金经理助理	2022-11-21	2023-06-30	10 年	硕士。2013 年 1 月加入华夏基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、基金经理助理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。因此，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

#### 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对

同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

#### 4.3.3 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 255 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 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

2023 年债券市场主要交易了两个预期差，一个是疫情影响消退后，对经济的复苏预期太高；另一个是房地产放松后，对住房需求的释放偏乐观。具体来看，2023 年一季度，在政策发力和复苏强预期的影响下，利率高位震荡，随着经济复苏的实际表现低于预期和逆周期政策的逐步退出，二季度利率快速下行；进入三季度，随着地产放松、财政趋宽、货币趋紧，债券有所回调；四季度随着高频数据重新走弱，债券重回下行。

权益市场走势整体偏弱。在 1-4 月的短暂上行之后，5-12 月，市场呈现单边下行的趋势。从经济层面看，今年消费端复苏指标低于预期、投资端持续受到地产的拖累。从政策层面看，今年各类利好救市政策较多，地产、股市印花税、增发国债等维度均有涉及，但整体而言对市场的影响平平。从资金层面看，自 8 月以来，北向资金持续性流出 A 股，至 12 月底已持续流出近 1900 亿，体现出外资对 A 股的预期有所下调。从市场特征方面看，A 股市场的结构性行情依旧非常明显，主题行业轮动较快，低估值高股息投资主线和小市值相对占优。在行业间表现差异比较大：TMT、周期等行业表现较好，而新能源、地产、消费等行业表现较差。

报告期内，本基金在稳定的投资目标与投资风格下持续优化与迭代投资框架与细分投资策略。本基金的债券资产管理方面，合理布局仓位和久期，控制信用风险，根据市场情况进行一定的波段操作。本基金的股票资产管理方面，基金管理人持续践行以客观来认识市场，用策略来表达观点：采用自上而下主观与自下而上系统化进行组合构建的复合投资框架，重视跨资产和跨维度的交叉验证，恪守能力圈，力争实现产品的投资目标。本基金的权益资产管理方面，采取与反脆弱相结合的系统化主观投资策略作为核心策略，并使用多策略的股票组合构建方式追求高夏普比的权益资产特征，在全市场范畴内寻找兼顾安全边际和景气度、具备较高投资性价比的行业和个股，力争穿越市场不同风格与投资主线周期。

在大类资产配置方面，2023 年初制定的全年管理产品的核心理念为寻找不确定性中的确定性投

资机会，把握股票和债券市场的交易节奏。具体地，2023 年年初制定的全年“确定性”基准假设情景的三个关键词为“信心重建”、“政策支持”、“聚焦成长”；全年的“不确定性”的要素是对标对基准假设情景的扰动因素，关键词分为“长尾疫情”、“海外衰退”和“逆全球化”。全年维度产品管理的基准假设围绕着“确定性”制定，而“不确定性”要素是对基准假设场景冲击的扰动因素。基准假设下，2023 年初相对于债券资产更好看权益资产并抬升了权益中枢仓位水平，在市场节奏方面，基金管理人将全年的资产价格节奏的演绎预期划分为 1-2 月、3-9 月和 9-12 月三个阶段，穿插在其中的来自基本面、政策面、资金面和风险偏好的扰动因素放在逐月的对市场的短期分析中去决断，同时密切跟踪来自于股票、债券、商品、汇率跨资产视角的交叉验证以及宏观、中观和微观跨视角交叉验证的情况。2023 年初在权益资产内部细分资产配置基准假设为“弱经济+弱产业+流动性较好+产业政策多”，即稳增长预期下，经济复苏斜率偏弱、行业景气度仍处于恢复期、宏观流动性较好、在财政、货币和产业政策中认为产业政策超预期的概率更高。当前，站在复盘视角来审视 2023 年年初制定的基准假设以及操作：由于内外部超预期事件导致的冲击等复杂因素交叉影响，2023 年权益市场出现系统性下跌且下跌幅度超出预期，而年初制定的基准假设在对权益市场方向和节奏方面与市场实际运行情况出入较大，但针对权益资产结构的基准假设与实际市场演绎情况的适配性较高。针对基准假设与市场实际运行情况之间偏差映射到大类资产配置方面的情况，直到 2023 年下半年才予以调整，这是后续需要在组合管理过程中加强的方面：加强复盘与反思来自于宏观范式转变、交易层面变化和特殊事件对基准假设的冲击，并及时进行调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值为 1.0391 元，本报告期份额净值增长率为 2.37%；华夏鼎融债券 C 基金份额净值为 1.1206 元，本报告期份额净值增长率为 1.98%，同期业绩比较基准增长率为 2.06%。

#### 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 2024 年，预计财政政策适度发力，货币政策灵活适度，总量宏观政策对债券市场的影响偏小；狭义流动性预计会维持在中性水平，资金利率中枢围绕政策利率波动。伴随着经济复苏的有序开展、企业盈利的逐渐修复以及稳定资本市场一系列政策的出台，股票市场整体有望从寻底阶段转向为磨底、企稳阶段，但或仍以结构性收益机会为主，在此过程中将密切关注股票市场剩余流动性的边际变化以及筹码结构的动态变化情况。同时考虑到 2024 年是各国主要经济体领导人的大选换届之年，俄乌冲突、巴以冲突仍在继续以及美联储开启降息时点的不确定仍较高等外部复杂情况和风险事件的间或脉冲影响，预计 2024 年权益市场波动性将进一步加大，行业轮动水平仍将处于高位。基金管理人将紧密跟踪宏观基本面、企业盈利、资金面和风险偏好四个维度的边际变化，及时应对

市场的波动，积极把握收益机会。转债市场方面，密切关注转债市场估值的动态变化，把握转债资产为组合带来的投资收益机会。

债券资产管理方面将继续维持合理的久期和品种分布，关注波段交易机会。对信用风险充分警惕，不做盲目下沉。股票资产管理方面，具备较高估值安全边际、具有确定性溢价的资产结构预计将占优，具体地分为三类投资机会：一是永续经营、高现金流、高股息的资产；二是，以行业龙头核心资产为代表的大盘蓝筹细分资产经过过去近三年的调整，整体估值水平已经大幅降低，我们也将密切关注此类资产的投资机会；第三，在经济仍处于复苏阶段的基准假设下，关注非流动性补偿的溢价收益机会；在权益市场整体剩余流动性处于稳态的时段内，关注基本面质地良好的中小盘股票的阶段性投资收益机会。

本年度，本基金将继续在稳定的投资目标与投资风格的指导下，持续优化与迭代投资框架与细分投资策略。基金管理人将持续践行以客观来认识市场，通过系统化多策略的方式实践适配的资产配置，加强股票、债券、商品、汇率跨资产视角的交叉验证研究以及宏观、中观和微观跨视角的交叉验证研究，注重多资产收益之间的仓位合理分配：纯债收益、转债收益、股票收益——三类资产收益机会之间的捕获，产品的仓位将倾向于分配到预期收益风险比更高的资产上，力争实现产品的投资目标。

基金管理人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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司不断加强合规制度建设，结合法律法规和业务实际，在信息披露、洗钱风险管理、关联交易管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和基金销售等重点业务领域的合规督导培训，强化员工主动合规意识。积极优化合规管理的机制化和系统化，完善合规考核评价机制、子公司管理机制，大力推进合规管理综合服务、制度管理、知识搜索等系统化建设，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续规范基金销售业务，通过严格审查宣传推介材料，认真开展投资者适当性管理工作等，确保基金销售业务依法合规。公司高度重视洗钱风险管理，深入实践风险为本方法，认真贯彻落实各项反洗钱监管要求，持续加强“风险评估+合规检



查”双支柱管理框架，深入推进洗钱风险管理数智化转型，持续提升洗钱风险管理水平。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，定期及不定期开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 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，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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遵规守信、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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明（2024）审字第 70035283\_A37 号

华夏鼎融债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华夏鼎融债券型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏鼎融债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏鼎融债券型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏鼎融债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

华夏鼎融债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏鼎融债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏鼎融债券型证券投资基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏鼎融债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏鼎融债券型证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关

交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）      中国注册会计师  
 蒋燕华 王海彦  
 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层  
 2024 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,380,354.48	38,374,320.82
结算备付金		2,920,391.10	1,456,378.58
存出保证金		60,148.00	44,488.64
交易性金融资产	7.4.7.2	801,078,464.13	536,835,852.81
其中：股票投资		56,077,059.05	85,187,077.53
基金投资		-	-
债券投资		745,001,405.08	451,648,775.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		17,066,719.42	-
应收股利		-	-
应收申购款		15,510,675.93	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		840,016,753.06	576,711,040.85
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		63,115,222.64	55,007,843.84
应付清算款		14,801,641.47	10,006,713.69
应付赎回款		14,007,390.47	3,193,470.00
应付管理人报酬		397,028.46	348,415.47
应付托管费		132,342.82	116,138.50
应付销售服务费		25,043.41	739.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,640.29	16,804.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	448,238.70	298,195.43
负债合计		92,959,548.26	68,988,321.23
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	714,831,372.37	500,069,230.03
未分配利润	7.4.7.8	32,225,832.43	7,653,489.59
净资产合计		747,057,204.80	507,722,719.62
负债和净资产总计		840,016,753.06	576,711,040.85

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值 1.0391 元，华夏鼎融债券 C 基金份额净值 1.1206 元；华夏鼎融债券基金份额总额 714,831,372.37 份（其中 A 类 662,709,455.84 份，C 类 52,121,916.53 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		16,996,746.83	-26,906,887.58
1.利息收入		382,802.56	113,088.22
其中：存款利息收入	7.4.7.9	101,067.20	111,886.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		281,735.36	1,202.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,410,098.75	-14,555,726.07
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-12,993,762.00	-11,980,599.82

基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	14,491,629.16	-2,854,991.48
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,912,231.59	279,865.23
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,201,051.26	-12,468,124.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,794.26	3,875.09
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,096,587.75</b>	<b>3,500,716.36</b>
1.管理人报酬		3,818,135.76	2,156,404.31
2.托管费		1,272,712.01	718,801.45
3.销售服务费		125,017.46	4,683.63
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		638,689.37	391,422.13
其中：卖出回购金融资产支出		638,689.37	391,422.13
6.信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7.税金及附加		25,369.23	10,417.76
8.其他费用	7.4.7.21	216,663.92	218,987.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,900,159.08</b>	<b>-30,407,603.94</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>10,900,159.08</b>	<b>-30,407,603.94</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>10,900,159.08</b>	<b>-30,407,603.94</b>

## 7.3 净资产变动表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	500,069,230.03	7,653,489.59	507,722,719.62
二、本期期初净资产	500,069,230.03	7,653,489.59	507,722,719.62
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	214,762,142.34	24,572,342.84	239,334,485.18
（一）、综合收益总额	-	10,900,159.08	10,900,159.08
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变	214,762,142.34	13,672,183.76	228,434,326.10

动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	550,759,467.18	26,248,491.90	577,007,959.08
2.基金赎回款	-335,997,324.84	-12,576,308.14	-348,573,632.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	714,831,372.37	32,225,832.43	747,057,204.80
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	100,289,880.88	31,551,590.61	131,841,471.49
二、本期期初净资产	100,289,880.88	31,551,590.61	131,841,471.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	399,779,349.15	-23,898,101.02	375,881,248.13
（一）、综合收益总额	-	-30,407,603.94	-30,407,603.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	399,779,349.15	175,013,795.49	574,793,144.64
其中：1.基金申购款	868,481,763.07	215,921,957.52	1,084,403,720.59
2.基金赎回款	-468,702,413.92	-40,908,162.03	-509,610,575.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-168,504,292.57	-168,504,292.57
四、本期期末净资产	500,069,230.03	7,653,489.59	507,722,719.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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（含存托凭证）、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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则（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”）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〈年度报告和中期报告〉》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。



## 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

### (1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### (2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## 2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融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;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内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；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外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交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 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。

由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[2014]81 号

《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[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》、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[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 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。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。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、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 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。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。

(9) 基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,380,354.48	38,374,320.82
等于：本金	3,379,817.99	38,371,369.92
加：应计利息	536.49	2,950.90
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	3,380,354.48	38,374,320.82

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	55,927,170.56	-	56,077,059.05	149,888.49
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债 券	185,501,291.44	1,440,533.93	187,473,688.07	531,862.70
交 易 所 市				

	场				
	银行 间市 场	547,033,307.21	8,056,717.01	557,527,717.01	2,437,692.79
	合计	732,534,598.65	9,497,250.94	745,001,405.08	2,969,555.49
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		788,461,769.21	9,497,250.94	801,078,464.13	3,119,443.98
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		88,286,153.47	-	85,187,077.53	-3,099,075.94
贵金属投资- 金交所黄金 合约		-	-	-	-
债 券	交 易 所 市 场	202,253,039.64	2,371,464.11	202,715,506.51	-1,908,997.24
	银 行 间 市 场	250,623,034.10	3,383,768.77	248,933,268.77	-5,073,534.10
	合计	452,876,073.74	5,755,232.88	451,648,775.28	-6,982,531.34
资产支持证 券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		541,162,227.21	5,755,232.88	536,835,852.81	-10,081,607.28

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债



单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	278,238.70	128,195.43
其中：交易所市场	276,526.20	116,895.43
银行间市场	1,712.50	11,300.00
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	448,238.70	298,195.43

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 华夏鼎融债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	498,093,037.40	498,093,037.40
本期申购	479,055,560.33	479,055,560.33
本期赎回（以“-”号填列）	-314,439,141.89	-314,439,141.89
本期末	662,709,455.84	662,709,455.84

##### 华夏鼎融债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,976,192.63	1,976,192.63
本期申购	71,703,906.85	71,703,906.85
本期赎回（以“-”号填列）	-21,558,182.95	-21,558,182.95
本期末	52,121,916.53	52,121,916.53

#### 7.4.7.8 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	14,495,154.03	-7,036,972.91	7,458,181.12
本期期初	14,495,154.03	-7,036,972.91	7,458,181.12
本期利润	-1,803,595.86	12,841,912.06	11,038,316.20
本期基金份额交易产生的变动数	5,937,386.42	1,508,124.17	7,445,510.59

其中：基金申购款	14,873,955.75	2,657,520.86	17,531,476.61
基金赎回款	-8,936,569.33	-1,149,396.69	-10,085,966.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,628,944.59	7,313,063.32	25,942,007.91

## 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	223,470.27	-28,161.80	195,308.47
本期期初	223,470.27	-28,161.80	195,308.47
本期利润	-497,296.32	359,139.20	-138,157.12
本期基金份额交易产生的变动数	5,882,124.69	344,548.48	6,226,673.17
其中：基金申购款	8,200,463.82	516,551.47	8,717,015.29
基金赎回款	-2,318,339.13	-172,002.99	-2,490,342.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,608,298.64	675,525.88	6,283,824.52

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	45,038.41	83,253.15
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	55,030.71	28,393.49
其他	998.08	239.53
合计	101,067.20	111,886.17

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,993,762.00	-11,980,599.82
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-

合计	-12,993,762.00	-11,980,599.82
----	----------------	----------------

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	725,983,152.16	256,969,843.37
减：卖出股票成本总额	737,650,154.08	268,280,132.97
减：交易费用	1,326,760.08	670,310.22
买卖股票差价收入	-12,993,762.00	-11,980,599.82

## 7.4.7.11 基金投资收益

无。

## 7.4.7.12 债券投资收益

## 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	16,899,253.23	10,497,531.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,407,624.07	-13,352,522.88
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	14,491,629.16	-2,854,991.48

## 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,006,001,343.26	1,205,893,145.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	997,027,706.04	1,204,379,057.94
减：应计利息总额	11,350,418.18	14,829,421.76
减：交易费用	30,843.11	37,188.32
买卖债券差价收入	-2,407,624.07	-13,352,522.88

## 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
股票投资产生的股利收益	1,912,231.59	279,865.23
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,912,231.59	279,865.23

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
1.交易性金融资产	13,201,051.26	-12,468,124.82
——股票投资	3,248,964.43	-3,044,969.76
——债券投资	9,952,086.83	-9,423,155.06
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	13,201,051.26	-12,468,124.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	2,794.26	3,875.09
合计	2,794.26	3,875.09

## 7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

## 7.4.7.20 信用减值损失

无。

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,461.82	11,787.08
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
存托服务费	2.10	-
其他	1,200.00	1,200.00
合计	216,663.92	218,987.08

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2024 年 1 月 18 日发布的分红公告，本基金向 2024 年 1 月 22 日本基金登记结算机构登记在册的华夏鼎融债券 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.165 元，华夏鼎融债券 C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.230 元。

## 7.4.9 关联方关系

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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东

天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：华夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	-	-	236,145,193.73	39.35%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	-	-	111,266,077.89	18.98%

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

		比例		比例
中信证券	-	-	1,122,100,000.00	29.49%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	172,693.27	47.37%	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,818,135.76	2,156,404.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	471,516.01	261,970.72
应支付基金管理人的净管理费	3,346,619.75	1,894,433.59

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 0.60%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×0.60%/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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,272,712.01	718,801.45

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 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 2023年1月1日至2023年12月31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	-	17,871.49	17,871.49
合计	-	17,871.49	17,871.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	-	4,682.34	4,682.34
合计	-	4,682.34	4,682.34

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



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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	3,380,354.48	45,038.41	38,374,320.82	83,253.15

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，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	601916	浙商银行	配股发行	26,700	53,934.00
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	1,000	9,600.00
上年度可比期间					

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	500	2,515.00
中信证券	601377	兴业证券	配股发行	30	156.00

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 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
300096	ST 易联众	2023-12-29	重大事项	6.82	2024-01-02	5.46	11,900	74,758.39	81,158.00	

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 63,115,222.64 元，于 2024 年 1 月 5 日前先后到期。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。

## 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

## 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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内。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。除在“7.4.12 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，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规

模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
货币资金	3,380,354.48	-	-	3,380,354.48
结算备付金	2,920,391.10	-	-	2,920,391.10
结算保证金	60,148.00	-	-	60,148.00
债券投资	142,236,364.66	602,765,040.42	-	745,001,405.08
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	63,115,222.64	-	-	63,115,222.64
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	38,374,320.82	-	-	38,374,320.82
结算备付金	1,456,378.58	-	-	1,456,378.58
结算保证金	44,488.64	-	-	44,488.64
债券投资	134,192,885.97	313,932,868.49	3,523,020.82	451,648,775.28
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	55,007,843.84	-	-	55,007,843.84

注：①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。

②根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》修订版调整，2022 年年度报告中“银行存款”，本年度调整为“货币资金”。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	3,574,564.10	2,199,796.06
利率上升 25 个基点	-3,545,466.32	-2,180,300.90	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.3 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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,077,059.05	7.51	85,187,077.53	16.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	27,731,614.11	3.71	73,892.55	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	83,808,673.16	11.22	85,260,970.08	16.79

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证转债指数×80%+沪深 300 指数×20%以外的其他市场变量保持不变
----	--

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-4,619,839.16	-7,303,378.14
+5%	4,619,839.16	7,303,378.14	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	83,727,515.16	85,234,964.61
第二层次	717,350,948.97	451,600,888.20
第三层次	-	-
合计	801,078,464.13	536,835,852.81

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	56,077,059.05	6.68
	其中：股票	56,077,059.05	6.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	745,001,405.08	88.69
	其中：债券	745,001,405.08	88.69
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,300,745.58	0.75
8	其他各项资产	32,637,543.35	3.89
9	合计	840,016,753.06	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	315,504.00	0.04
B	采矿业	7,059,370.00	0.94
C	制造业	31,308,000.58	4.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,196,591.00	0.16
E	建筑业	1,155,447.00	0.15
F	批发和零售业	1,997,538.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	2,174,899.47	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,020,247.00	0.27
J	金融业	3,557,827.00	0.48
K	房地产业	732,873.00	0.10
L	租赁和商务服务业	136,503.00	0.02

M	科学研究和技术服务业	1,386,329.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,887,935.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	194,104.00	0.03
P	教育	275,835.00	0.04
Q	卫生和社会工作	160,004.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	518,052.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	56,077,059.05	7.51

## 8.3 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	600547	山东黄金	83,900	1,918,793.00	0.26
2	000975	银泰黄金	126,000	1,890,000.00	0.25
3	600489	中金黄金	187,800	1,870,488.00	0.25
4	002533	金杯电工	60,200	486,416.00	0.07
5	002091	江苏国泰	60,900	476,847.00	0.06
6	601717	郑煤机	37,600	475,640.00	0.06
7	600887	伊利股份	17,700	473,475.00	0.06
8	000404	长虹华意	80,100	471,789.00	0.06
9	600502	安徽建工	101,400	471,510.00	0.06
10	600919	江苏银行	70,200	469,638.00	0.06
11	002327	富安娜	52,100	466,295.00	0.06
12	600582	天地科技	85,500	465,120.00	0.06
13	600398	海澜之家	61,900	459,298.00	0.06
14	600710	苏美达	64,700	458,723.00	0.06
15	300478	杭州高新	28,700	362,768.00	0.05
16	603221	爱丽家居	35,500	352,870.00	0.05
17	002171	楚江新材	42,400	317,152.00	0.04
18	002540	亚太科技	44,900	296,789.00	0.04
19	300808	久量股份	18,200	283,556.00	0.04
20	002911	佛燃能源	24,700	283,062.00	0.04
21	688092	爱科科技	9,100	279,916.00	0.04
22	300535	达威股份	15,900	278,409.00	0.04
23	603725	天安新材	25,000	278,250.00	0.04
24	300117	嘉寓股份	95,700	277,530.00	0.04
25	600455	博通股份	11,100	275,835.00	0.04
26	002883	中设股份	22,400	275,072.00	0.04
27	300743	天地数码	19,800	274,824.00	0.04
28	688178	万德斯	15,200	274,816.00	0.04
29	688096	京源环保	29,300	274,541.00	0.04
30	301167	建研设计	16,200	274,104.00	0.04



31	688679	通源环境	21,300	273,279.00	0.04
32	605155	西大门	17,600	272,448.00	0.04
33	688329	艾隆科技	10,900	270,974.00	0.04
34	600444	国机通用	18,000	270,000.00	0.04
35	688129	东来技术	16,300	269,765.00	0.04
36	301156	美农生物	14,300	269,698.00	0.04
37	002357	富临运业	35,700	269,535.00	0.04
38	002899	英派斯	16,100	266,455.00	0.04
39	600493	凤竹纺织	39,500	265,440.00	0.04
40	600302	标准股份	46,400	265,408.00	0.04
41	600883	博闻科技	31,100	264,350.00	0.04
42	688466	金科环境	14,800	262,700.00	0.04
43	002273	水晶光电	18,700	253,198.00	0.03
44	300303	聚飞光电	42,200	250,246.00	0.03
45	300866	安克创新	2,800	248,080.00	0.03
46	603327	福蓉科技	18,494	246,525.02	0.03
47	300861	美畅股份	7,400	246,346.00	0.03
48	603611	诺力股份	13,000	246,090.00	0.03
49	603328	依顿电子	30,100	245,315.00	0.03
50	300627	华测导航	7,900	245,058.00	0.03
51	603050	科林电气	13,600	244,120.00	0.03
52	002833	弘亚数控	13,700	243,038.00	0.03
53	601126	四方股份	17,000	240,720.00	0.03
54	603156	养元饮品	11,300	240,238.00	0.03
55	603866	桃李面包	31,200	238,992.00	0.03
56	000728	国元证券	34,900	238,367.00	0.03
57	600926	杭州银行	23,800	238,238.00	0.03
58	002158	汉钟精机	10,700	238,182.00	0.03
59	000589	贵州轮胎	38,900	238,068.00	0.03
60	002152	广电运通	19,400	237,844.00	0.03
61	600510	黑牡丹	42,000	237,300.00	0.03
62	600497	驰宏锌锗	46,900	236,845.00	0.03
63	605377	华旺科技	12,400	236,716.00	0.03
64	000650	仁和药业	35,700	236,691.00	0.03
65	002035	华帝股份	38,100	236,601.00	0.03
66	000581	威孚高科	15,700	236,599.00	0.03
67	600028	中国石化	42,400	236,592.00	0.03
68	603878	武进不锈	31,300	236,315.00	0.03
69	000887	中鼎股份	19,100	236,267.00	0.03
70	601688	华泰证券	16,900	235,755.00	0.03
71	000895	双汇发展	8,800	235,048.00	0.03
72	002807	江阴银行	66,200	235,010.00	0.03
73	601098	中南传媒	23,100	234,927.00	0.03
74	601163	三角轮胎	16,300	234,883.00	0.03

75	600737	中粮糖业	28,500	234,840.00	0.03
76	601665	齐鲁银行	59,900	234,209.00	0.03
77	603323	苏农银行	56,300	234,208.00	0.03
78	002367	康力电梯	31,100	233,872.00	0.03
79	600750	江中药业	11,200	233,856.00	0.03
80	601211	国泰君安	15,700	233,616.00	0.03
81	600639	浦东金桥	23,100	233,541.00	0.03
82	002948	青岛银行	76,500	233,325.00	0.03
83	600153	建发股份	24,200	233,046.00	0.03
84	601058	赛轮轮胎	19,800	232,650.00	0.03
85	601818	光大银行	80,000	232,000.00	0.03
86	000559	万向钱潮	44,700	231,993.00	0.03
87	601216	君正集团	62,000	231,880.00	0.03
88	601857	中国石油	32,800	231,568.00	0.03
89	002443	金洲管道	33,800	231,530.00	0.03
90	002966	苏州银行	35,800	231,268.00	0.03
91	000538	云南白药	4,700	231,005.00	0.03
92	600863	内蒙华电	59,200	230,880.00	0.03
93	603368	柳药集团	12,200	230,824.00	0.03
94	601128	常熟银行	36,100	230,679.00	0.03
95	002697	红旗连锁	46,300	230,574.00	0.03
96	600757	长江传媒	30,900	230,205.00	0.03
97	600282	南钢股份	62,200	230,140.00	0.03
98	601225	陕西煤业	11,000	229,790.00	0.03
99	600901	江苏金租	47,400	229,416.00	0.03
100	002543	万和电气	25,700	229,244.00	0.03
101	600642	申能股份	35,600	228,552.00	0.03
102	601288	农业银行	62,600	227,864.00	0.03
103	000429	粤高速 A	26,900	227,574.00	0.03
104	600483	福能股份	27,500	227,425.00	0.03
105	002563	森马服饰	39,400	227,338.00	0.03
106	600035	楚天高速	59,500	227,290.00	0.03
107	600637	东方明珠	30,200	227,104.00	0.03
108	600269	赣粤高速	55,200	226,872.00	0.03
109	001965	招商公路	23,211	226,771.47	0.03
110	600461	洪城环境	24,800	226,672.00	0.03
111	600350	山东高速	32,500	225,550.00	0.03
112	600377	宁沪高速	22,000	225,500.00	0.03
113	600019	宝钢股份	37,900	224,747.00	0.03
114	600971	恒源煤电	20,100	224,115.00	0.03
115	600033	福建高速	72,200	223,820.00	0.03
116	600985	淮北矿业	13,300	221,179.00	0.03
117	601000	唐山港	62,700	219,450.00	0.03
118	300243	瑞丰高材	22,200	216,894.00	0.03

119	603041	美思德	16,100	216,706.00	0.03
120	836414	欧普泰	12,123	210,940.20	0.03
121	300736	百邦科技	15,200	194,104.00	0.03
122	830779	武汉蓝电	5,200	187,876.00	0.03
123	301219	腾远钴业	4,700	185,039.00	0.02
124	301096	百诚医药	2,800	182,280.00	0.02
125	688410	山外山	6,200	181,040.00	0.02
126	688332	中科蓝讯	2,400	181,008.00	0.02
127	301333	诺思格	2,800	180,544.00	0.02
128	301153	中科江南	2,300	180,021.00	0.02
129	688147	微导纳米	4,600	179,354.00	0.02
130	688489	三未信安	3,800	178,676.00	0.02
131	835237	力佳科技	10,300	178,396.00	0.02
132	301257	普蕊斯	2,800	177,800.00	0.02
133	301160	翔楼新材	4,200	177,366.00	0.02
134	688223	晶科能源	20,000	177,200.00	0.02
135	688503	聚和材料	3,300	176,880.00	0.02
136	601061	中信金属	22,900	176,559.00	0.02
137	838402	硅烷科技	11,200	176,400.00	0.02
138	301373	凌玮科技	5,900	174,935.00	0.02
139	603130	云中马	8,100	174,555.00	0.02
140	301109	军信股份	11,000	173,800.00	0.02
141	688246	嘉和美康	5,200	173,784.00	0.02
142	836270	天铭科技	10,800	173,556.00	0.02
143	871694	中裕科技	8,600	173,376.00	0.02
144	301127	天源环保	15,700	172,543.00	0.02
145	001323	慕思股份	5,600	170,800.00	0.02
146	301207	华兰疫苗	6,100	169,580.00	0.02
147	688439	振华风光	1,900	169,309.00	0.02
148	301280	珠城科技	4,100	168,428.00	0.02
149	688235	百济神州	1,200	166,848.00	0.02
150	301301	川宁生物	19,500	163,800.00	0.02
151	688607	康众医疗	7,000	142,660.00	0.02
152	688681	科汇股份	9,200	142,140.00	0.02
153	300069	金利华电	8,800	141,680.00	0.02
154	688619	罗普特	10,000	140,600.00	0.02
155	688067	爱威科技	5,900	140,479.00	0.02
156	603679	华体科技	9,400	140,342.00	0.02
157	300387	富邦股份	16,744	139,644.96	0.02
158	300971	博亚精工	5,600	139,440.00	0.02
159	605287	德才股份	8,200	139,154.00	0.02
160	688616	西力科技	10,200	139,128.00	0.02
161	603045	福达合金	8,800	138,952.00	0.02
162	600778	友好集团	22,200	138,750.00	0.02

163	300564	筑博设计	10,300	138,638.00	0.02
164	603709	中源家居	7,700	138,600.00	0.02
165	688511	天微电子	4,400	138,468.00	0.02
166	300854	中兰环保	7,900	137,855.00	0.02
167	300371	汇中股份	11,300	137,747.00	0.02
168	300823	建科机械	6,400	137,664.00	0.02
169	600593	大连圣亚	7,000	137,620.00	0.02
170	002743	富煌钢构	23,000	137,540.00	0.02
171	300929	华骐环保	11,300	137,521.00	0.02
172	301043	绿岛风	4,200	137,466.00	0.02
173	300321	同大股份	7,100	137,385.00	0.02
174	301003	江苏博云	5,500	137,280.00	0.02
175	688171	纬德信息	6,100	137,250.00	0.02
176	603150	万朗磁塑	4,700	136,535.00	0.02
177	300947	德必集团	8,700	136,503.00	0.02
178	603073	彩蝶实业	6,800	136,476.00	0.02
179	001296	长江材料	5,800	136,474.00	0.02
180	300899	上海凯鑫	5,000	135,900.00	0.02
181	603102	百合股份	3,500	135,730.00	0.02
182	002066	瑞泰科技	12,200	135,542.00	0.02
183	301113	雅艺科技	4,200	135,534.00	0.02
184	002830	名雕股份	9,100	135,499.00	0.02
185	600148	长春一东	8,200	135,300.00	0.02
186	001211	双枪科技	5,600	135,296.00	0.02
187	002871	伟隆股份	12,100	135,278.00	0.02
188	605318	法狮龙	8,400	134,988.00	0.02
189	300703	创源股份	12,000	134,880.00	0.02
190	600356	恒丰纸业	16,900	134,862.00	0.02
191	003041	真爱美家	8,076	134,465.40	0.02
192	300819	聚杰微纤	8,600	133,730.00	0.02
193	603506	南都物业	12,100	131,527.00	0.02
194	600322	津投城开	60,700	130,505.00	0.02
195	600097	开创国际	12,200	130,418.00	0.02
196	002098	浔兴股份	19,400	129,592.00	0.02
197	002748	世龙实业	9,200	108,100.00	0.01
198	300389	艾比森	5,300	91,902.00	0.01
199	002313	日海智能	7,800	88,764.00	0.01
200	002521	齐峰新材	10,400	86,008.00	0.01
201	300698	万马科技	2,300	83,950.00	0.01
202	000533	顺钠股份	17,800	83,482.00	0.01
203	300286	安科瑞	3,200	82,976.00	0.01
204	688159	有方科技	2,200	82,830.00	0.01
205	002615	哈尔斯	11,300	82,829.00	0.01
206	002112	三变科技	7,900	82,792.00	0.01

207	002835	同为股份	4,600	82,524.00	0.01
208	300096	ST 易联众	11,900	81,158.00	0.01
209	300851	交大思诺	2,600	81,042.00	0.01
210	002512	达华智能	12,800	81,024.00	0.01
211	002456	欧菲光	9,300	81,003.00	0.01
212	300520	科大国创	3,700	80,438.00	0.01
213	300533	冰川网络	2,900	80,330.00	0.01
214	300195	长荣股份	11,800	80,240.00	0.01
215	603286	日盈电子	3,100	80,197.00	0.01
216	603683	晶华新材	7,100	79,946.00	0.01
217	603283	赛腾股份	1,100	79,816.00	0.01
218	300817	双飞集团	4,700	79,571.00	0.01
219	300204	舒泰神	7,800	79,248.00	0.01
220	603322	超讯通信	2,100	79,191.00	0.01
221	002069	獐子岛	17,600	79,024.00	0.01
222	300753	爱朋医疗	4,600	78,982.00	0.01
223	603197	保隆科技	1,400	78,960.00	0.01
224	002870	香山股份	2,200	78,914.00	0.01
225	688336	三生国健	3,500	78,785.00	0.01
226	688365	光云科技	7,200	78,408.00	0.01
227	002753	永东股份	9,500	78,375.00	0.01
228	300621	维业股份	6,800	78,132.00	0.01
229	603111	康尼机电	14,000	77,980.00	0.01
230	600980	北矿科技	4,400	77,836.00	0.01
231	601003	柳钢股份	24,500	77,665.00	0.01
232	600569	安阳钢铁	36,300	77,319.00	0.01
233	300254	仟源医药	8,000	77,040.00	0.01
234	600571	信雅达	5,600	77,000.00	0.01
235	000868	安凯客车	14,800	76,960.00	0.01
236	002755	奥赛康	7,100	76,822.00	0.01
237	603660	苏州科达	8,700	76,473.00	0.01
238	300103	达刚控股	12,000	76,200.00	0.01
239	600222	太龙药业	12,400	76,012.00	0.01
240	300624	万兴科技	800	75,680.00	0.01
241	688177	百奥泰	1,800	74,232.00	0.01
242	603536	惠发食品	4,600	71,438.00	0.01
243	300232	洲明科技	7,600	66,880.00	0.01
244	300990	同飞股份	1,300	57,863.00	0.01
245	300820	英杰电气	1,000	57,280.00	0.01
246	603315	福鞍股份	3,900	56,667.00	0.01
247	301285	鸿日达	3,500	55,930.00	0.01
248	002847	盐津铺子	800	55,584.00	0.01
249	300443	金雷股份	2,000	55,180.00	0.01
249	301273	瑞晨环保	2,000	55,180.00	0.01

251	601500	通用股份	13,300	55,062.00	0.01
252	300863	卡倍亿	1,100	55,044.00	0.01
253	300671	富满微	1,700	54,961.00	0.01
254	300685	艾德生物	2,500	54,950.00	0.01
255	300394	天孚通信	600	54,912.00	0.01
256	002212	天融信	5,600	54,768.00	0.01
257	300348	长亮科技	5,300	54,643.00	0.01
258	300829	金丹科技	2,600	54,288.00	0.01
259	000811	冰轮环境	4,000	54,280.00	0.01
260	300803	指南针	900	54,234.00	0.01
261	300680	隆盛科技	2,900	54,230.00	0.01
262	603848	好太太	3,500	54,180.00	0.01
262	600237	铜峰电子	7,000	54,180.00	0.01
264	603699	纽威股份	3,900	54,054.00	0.01
265	002967	广电计量	3,600	54,036.00	0.01
266	001218	丽臣实业	2,500	54,025.00	0.01
267	002960	青鸟消防	3,900	53,976.00	0.01
268	301103	何氏眼科	1,800	53,964.00	0.01
269	301331	恩威医药	1,300	53,963.00	0.01
270	300020	银江技术	6,500	53,950.00	0.01
271	301112	信邦智能	1,800	53,946.00	0.01
272	603236	移远通信	1,000	53,750.00	0.01
273	002713	东易日盛	8,100	53,622.00	0.01
274	301322	绿通科技	1,300	53,508.00	0.01
275	300970	华绿生物	3,100	53,506.00	0.01
276	300491	通合科技	2,400	53,472.00	0.01
277	603138	海量数据	3,000	53,400.00	0.01
278	300634	彩讯股份	2,600	53,222.00	0.01
279	301229	纽泰格	1,600	53,200.00	0.01
280	300143	盈康生命	5,000	53,150.00	0.01
281	002646	天佑德酒	3,900	53,079.00	0.01
282	000048	京基智农	2,900	53,070.00	0.01
283	301080	百普赛斯	900	53,046.00	0.01
284	301269	华大九天	500	52,925.00	0.01
285	000681	视觉中国	3,600	52,920.00	0.01
285	301148	嘉戎技术	2,400	52,920.00	0.01
287	002524	光正眼科	8,200	52,890.00	0.01
288	301200	大族数控	1,400	52,878.00	0.01
289	300019	硅宝科技	3,200	52,832.00	0.01
290	000409	云鼎科技	5,700	52,782.00	0.01
291	300961	深水海纳	4,700	52,781.00	0.01
292	300048	合康新能	10,400	52,624.00	0.01
293	002108	沧州明珠	12,800	52,608.00	0.01
294	603992	松霖科技	2,900	52,606.00	0.01

295	300972	万辰集团	1,400	52,556.00	0.01
296	301223	中荣股份	2,900	52,548.00	0.01
297	603587	地素时尚	4,000	52,440.00	0.01
298	301050	雷电微力	900	52,434.00	0.01
299	301290	东星医疗	1,900	52,421.00	0.01
300	002930	宏川智慧	2,700	52,353.00	0.01
301	603906	龙蟠科技	4,200	52,332.00	0.01
302	001316	润贝航科	1,500	52,215.00	0.01
303	000972	中基健康	14,700	52,185.00	0.01
304	301369	联动科技	900	52,083.00	0.01
305	603337	杰克股份	2,400	51,840.00	0.01
306	002478	常宝股份	9,500	51,775.00	0.01
307	300694	蠡湖股份	4,100	51,701.00	0.01
308	300406	九强生物	2,700	51,570.00	0.01
308	002174	游族网络	4,500	51,570.00	0.01
310	603889	新澳股份	7,200	51,264.00	0.01
311	603916	苏博特	5,000	50,950.00	0.01
312	003013	地铁设计	3,100	50,809.00	0.01
313	600026	中远海能	4,100	50,184.00	0.01
314	300419	浩丰科技	7,800	46,020.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	600489	中金黄金	4,723,044.23	0.93
2	600547	山东黄金	4,637,683.35	0.91
3	000975	银泰黄金	4,372,321.00	0.86
4	600519	贵州茅台	4,042,318.00	0.80
5	300750	宁德时代	3,279,816.00	0.65
6	601318	中国平安	3,080,960.00	0.61
7	000538	云南白药	2,465,543.20	0.49
8	603878	武进不锈	2,195,477.20	0.43
9	600639	浦东金桥	2,076,214.00	0.41
10	601155	新城控股	2,071,021.00	0.41
11	603156	养元饮品	2,029,957.00	0.40
12	600028	中国石化	2,012,935.00	0.40
13	600900	长江电力	1,999,877.00	0.39
14	600887	伊利股份	1,945,128.00	0.38
15	000048	京基智农	1,920,917.00	0.38
16	600066	宇通客车	1,911,876.00	0.38

17	600941	中国移动	1,889,826.00	0.37
18	600170	上海建工	1,825,988.00	0.36
19	601857	中国石油	1,806,858.00	0.36
20	000404	长虹华意	1,789,414.00	0.35

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。

#### 8.4.2 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	300750	宁德时代	6,873,302.00	1.35
2	600519	贵州茅台	6,767,444.00	1.33
3	601318	中国平安	4,196,204.00	0.83
4	601166	兴业银行	3,536,264.00	0.70
5	600036	招商银行	3,363,021.00	0.66
6	600489	中金黄金	2,805,559.00	0.55
7	600547	山东黄金	2,751,413.00	0.54
8	000975	银泰黄金	2,648,225.00	0.52
9	600048	保利发展	2,595,724.00	0.51
10	000651	格力电器	2,505,903.00	0.49
11	601857	中国石油	2,455,168.00	0.48
12	600971	恒源煤电	2,441,037.00	0.48
13	300009	安科生物	2,296,723.64	0.45
14	600941	中国移动	2,244,122.18	0.44
15	600900	长江电力	2,235,923.00	0.44
16	300760	迈瑞医疗	2,230,808.00	0.44
17	000538	云南白药	2,130,112.07	0.42
18	001914	招商积余	2,118,216.00	0.42
19	000001	平安银行	2,109,149.00	0.42
20	002594	比亚迪	2,067,462.88	0.41

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。

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	705,291,171.17
卖出股票收入（成交）总额	725,983,152.16

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。

#### 8.5 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	48,723,322.74	6.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	331,486,783.61	44.37
	其中：政策性金融债	5,157,486.30	0.69
4	企业债券	90,705,987.39	12.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	246,353,697.23	32.98
7	可转债（可交换债）	27,731,614.11	3.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	745,001,405.08	99.72

## 8.6 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	019703	23 国债 10	400,000	40,567,890.41	5.43
2	2128042	21 兴业银行二级 02	300,000	30,723,829.51	4.11
3	102381136	23 中电投 MTN015(能源保供特别债)	300,000	30,692,000.00	4.11
4	2128022	21 交通银行永续债	200,000	21,017,846.99	2.81
5	2228003	22 兴业银行二级 01	200,000	20,986,339.73	2.81

## 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	60,148.00
2	应收清算款	17,066,719.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,510,675.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,637,543.35

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127033	中装转 2	1,076,195.38	0.14
2	113033	利群转债	1,071,094.61	0.14
3	127061	美锦转债	1,070,966.69	0.14
4	113589	天创转债	580,991.01	0.08
5	110092	三房转债	577,305.19	0.08
6	127047	帝欧转债	576,048.02	0.08
7	113596	城地转债	575,253.71	0.08
8	128127	文科转债	575,127.93	0.08
9	110072	广汇转债	575,012.15	0.08
10	123168	惠云转债	574,597.85	0.08

11	110043	无锡转债	574,524.35	0.08
12	127019	国城转债	574,332.18	0.08
13	123049	维尔转债	574,172.71	0.08
14	110047	山鹰转债	574,094.95	0.08
15	113600	新星转债	574,038.79	0.08
16	127018	本钢转债	573,900.66	0.08
17	113021	中信转债	573,623.82	0.08
18	118016	京源转债	573,149.18	0.08
19	110063	鹰 19 转债	572,928.29	0.08
20	123096	思创转债	572,366.24	0.08
21	127042	嘉美转债	501,121.90	0.07
22	113053	隆 22 转债	499,979.76	0.07
23	123076	强力转债	499,124.96	0.07
24	127022	恒逸转债	498,868.38	0.07
25	128037	岩土转债	498,761.80	0.07
26	127016	鲁泰转债	498,754.45	0.07
27	127024	盈峰转债	498,525.70	0.07
28	113065	齐鲁转债	497,681.10	0.07
29	123128	首华转债	497,569.90	0.07
30	113584	家悦转债	497,458.91	0.07
31	113052	兴业转债	497,325.48	0.07
32	113516	苏农转债	497,233.66	0.07
33	113056	重银转债	497,173.07	0.07
34	110064	建工转债	497,119.46	0.07
35	127049	希望转 2	497,063.98	0.07
36	127045	牧原转债	496,788.24	0.07
37	118031	天 23 转债	496,499.62	0.07
38	118013	道通转债	495,413.48	0.07
39	128116	瑞达转债	495,234.19	0.07
40	118022	锂科转债	493,460.42	0.07
41	123104	卫宁转债	493,004.31	0.07
42	123146	中环转 2	434,170.73	0.06
43	127017	万青转债	429,597.04	0.06
44	123198	金埔转债	391,593.22	0.05
45	123162	东杰转债	379,462.39	0.05
46	127034	绿茵转债	378,741.69	0.05
47	110087	天业转债	271,249.57	0.04
48	113629	泉峰转债	201,220.03	0.03
49	113530	大丰转债	94,917.70	0.01

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	5,794	114,378.57	653,838,803.75	98.66%	8,870,652.09	1.34%
华夏鼎融债券 C	78	668,229.70	51,931,348.29	99.63%	190,568.24	0.37%
合计	5,872	121,735.59	705,770,152.04	98.73%	9,061,220.33	1.27%

### 9.2 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	1,806.20	0.00%
	华夏鼎融债券 C	325.56	0.00%
	合计	2,131.76	0.00%

### 9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	华夏鼎融债券 A	0
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏鼎融债券 A	0
	华夏鼎融债券 C	0
	合计	0

## §10 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	498,093,037.40	1,976,192.63
本报告期基金总申购份额	479,055,560.33	71,703,906.85
减：本报告期基金总赎回份额	314,439,141.89	21,558,182.95

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	662,709,455.84	52,121,916.53

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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，张佑君先生担任本基金管理人董事长，杨明辉先生离任本基金管理人董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 7 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

根据我行审计报告，本行不存在涉嫌犯罪被依法立案调查的情况，本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施、涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情况；本行或者本行的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚，或者被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况；本行董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
广发证券	1	549,063,700.54	38.37%	240,429.56	38.41%	-
长江证券	3	524,430,984.82	36.65%	229,622.49	36.68%	-
国盛证券	2	180,457,219.59	12.61%	77,831.20	12.43%	-
国泰君安证券	2	166,485,277.12	11.63%	71,807.62	11.47%	-
中金公司	2	10,671,772.26	0.75%	6,274.84	1.00%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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。

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有较强的全方位金融服务能力和水平：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；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、财通证券、长城证券、川财证券、德邦证券、东方证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、国海证券、国投证券、国信证券、海通证券、华创证券、华西证券、汇丰前海证券、江海证券、开源证券、民生证券、平安证券、申万宏源、申万宏源证券、天风证券、万联证券、西部证券、信达证券、银河证券、招商证券、中国银河证券、中航证券、中信建投证券、中信证券、中邮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，中邮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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	378,041,416.04	44.86%	2,644,500,000.00	41.11%	-	-	-	-
长江证券	182,804,204.70	21.69%	1,665,000,000.00	25.88%	-	-	-	-
国盛证券	121,867,858.00	14.46%	1,936,000,000.00	30.10%	-	-	-	-
国泰君安证券	40,031,640.00	4.75%	187,000,000.00	2.91%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	119,925,800.00	14.23%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-06
3	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	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-29
4	华夏基金管理有限公司关于设立武汉分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-20
5	华夏基金管理有限公司关于设立沈阳分公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
6	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-22
7	华夏基金管理有限公司关于杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-27
8	华夏基金管理有限公司关于设立华夏股权投资基金管理（北京）有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-12

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2023-01-05至2023-05-11	93,259,792.99	-	67,520,000.00	25,739,792.99	3.60%
	2	2023-06-21至2023-08-07	39,022,867.40	96,478,533.53	-	135,501,400.93	18.96%
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。</p>							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏鼎融债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏鼎融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。

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二四年三月二十八日