

华夏鼎融债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 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：二〇二四年八月三十日

§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。本中期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 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	43
7.7 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.....	43
7.8 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.....	43
7.9 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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48

§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	849,698,527.46 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	765,002,332.21 份	84,696,195.25 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	王小飞
	联系电话	021-6063 7103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.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	张金良
-------	-----	-----

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
本期已实现收益	10,315,498.56	735,257.36
本期利润	13,957,136.11	889,714.95
加权平均基金份额本期利润	0.0190	0.0144
本期加权平均净值利润率	1.83%	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.87%	1.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	华夏鼎融债券 A	华夏鼎融债券 C
期末可供分配利润	19,548,128.46	8,250,742.09
期末可供分配基金份额利润	0.0256	0.0974
期末基金资产净值	796,936,275.36	94,518,846.43
期末基金份额净值	1.0417	1.1160
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	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	30.02%	26.12%

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
过去一个月	-0.20%	0.06%	0.65%	0.03%	-0.85%	0.03%
过去三个月	0.92%	0.09%	1.06%	0.07%	-0.14%	0.02%
过去六个月	1.87%	0.10%	2.42%	0.07%	-0.55%	0.03%
过去一年	1.88%	0.10%	3.27%	0.06%	-1.39%	0.04%
过去三年	3.96%	0.17%	6.58%	0.05%	-2.62%	0.12%
自基金合同生效起至今	30.02%	0.20%	7.27%	0.07%	22.75%	0.13%

华夏鼎融债券 C

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
过去一个月	-0.22%	0.06%	0.65%	0.03%	-0.87%	0.03%
过去三个月	0.83%	0.09%	1.06%	0.07%	-0.23%	0.02%
过去六个月	1.68%	0.10%	2.42%	0.07%	-0.74%	0.03%
过去一年	1.49%	0.10%	3.27%	0.06%	-1.78%	0.04%
过去三年	2.75%	0.17%	6.58%	0.05%	-3.83%	0.12%
自基金合同生效起至今	26.12%	0.20%	7.27%	0.07%	18.85%	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 2024 年 6 月 30 日)

华夏鼎融债券 A



华夏鼎融债券 C



§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 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、SmartBeta 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 2024 年 6 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)华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22;在 QDII 混合基金(A 类)中华夏全球科技先锋混合(QDII)排名第 2/48;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 3/17;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 3/78、华夏消费臻选混合发起式(A 类)排名第 7/78。

固收与固收+产品:在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏收益债券(QDII)(A 类)排名第 1/24、华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排名第 2/24;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 2/18;在定开纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎华一年定开债券排名第 5/616、华夏鼎成一年定开债券排名第 14/616;在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏稳定双利债券(A 类)排名第 12/241;在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排名第 7/793、华夏鼎茂债券(A 类)排名第 19/793、华夏鼎英债券(A 类)排名第 25/793、华夏鼎隆债券(A 类)排名第 26/793、华夏鼎信债券(A 类)排名第 52/793;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 13/416、华夏鼎源债券(A 类)排名第 27/416、华夏希望债券(A 类)排名第 29/416。

在《中国证券报》第二十届中国基金业金牛奖评选中，华夏基金荣获“金牛奖 20 周年特别贡献公司”，连续 8 年荣获“被动投资金牛基金公司”，产品层面华夏创新前沿股票荣获“五年期开放式股票型持续优胜金牛基金”，华夏中证 5G 通信主题 ETF 荣获“开放式指数型金牛基金”。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“三年期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，华夏基金将三大金基金奖项收入囊中：公司层面，华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”；产品层面，华夏创新前沿股票荣获“金基金·股票型基金五年期奖”，华夏行业景气混合荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

在客户服务方面，2024 年上半年，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）华夏基金直销渠道继续优化页面显示，升级搜索及查询等功能，给客户更方便直观的使用体验；（2）华夏基金管家客户端上线亲子账户，通过亲子账户客户可以为子女创建专属理财账户，管理和储备孩子的零花钱、教育资金，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与常熟农商银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“送你长期主义的花朵”、“领定制户口本”、“打工人又爱又怕的一天要来了”、“希望高考也这么简单”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	-	14 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。
席与焜	本基金的基金经理助理	2023-03-28	-	6 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。
文世伦	本基金的基金经理助理	2023-03-28	-	7 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。

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。

4.2 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 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 119 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

上半年，宏观经济表现分化。外需保持平稳，出口有韧性；内需偏弱，社融增速明显下滑，投资链条景气度较去年进一步走弱；消费增速在 1-2 月短暂回升后，3 月开始逐渐下滑。二季度以来，经济数据有所回落。

债券市场方面，基本面缓慢走弱，资金面宽松背景下，债券市场总体走出牛市行情，收益率快速走低，各类利差大幅压缩。债市收益率总体走低，期间经历两次回调，利率曲线陡峭。具体来看，行情可分为三个阶段。第一阶段（1 月至 3 月初）主线为“降准降息预期博弈+基本面信息扰动”，期间债市收益率总体下行，利率曲线陡峭，30 年国债表现占优。第二阶段（3 月初至 4 月下旬）主线为“地产宽松预期+超长债供给预期+机构行为扰动”，利率曲线总体下行，中短端表现较优。第三阶段（4 月下旬至 6 月底）主线为“央行提示长债风险+超长债供给落地+地产政策扰动+手工补息被禁止”，债市经历一轮急跌后缓慢修复，利率曲线走陡，短端表现较优，30 年国债收益率向下突破 2.5% 关键点位。截至半年末 1Y、3Y、5Y、7Y、10Y、30Y 国债收益率分别下行 54BP、49BP、42BP、43BP、35BP、40BP。

权益市场方面，上半年整体呈现 N 型震荡态势。1 月份市场受到去年悲观情绪的影响延续下行，待 2 月上证指数达到低点 2635 后开始反弹，反弹持续至 5 月下旬，此后 6 月有所回调。从宏观基本面维度看，一季度国内经济景气较去年下半年有所回升，统计局口径公布的工业增加值、固定资产投资均超预期，二季度相关指标稍有回落，但出口增速等维度有一定的亮点；从政策面维度看，总量政策继续维持“稳增长、调结构、防风险”的政策基调，主要体现在特别国债的陆续投放和后续增量供应、以旧换新、更新改造、地产的存量置换等维度；从企业盈利维度看，一季报全市场企业盈利增速仍处于寻底过程中；从资金面维度看，上半年整体权益市场仍处于存量博弈市场态势，有意愿加仓权益市场的投资者以保险机构为代表的长久期负债投资者为主；风险偏好维度看，市场的风险偏好仍处于历史较低水平；风格方面，今年小微盘股风格和大盘风格存在一定的分化，除春节前的微盘股闪崩外，伴随着资本市场“国九条”的颁布，市场在去劣逐良的过程中，小微盘在 4 月中旬与 6 月初，分别出现了两次小微盘股阶段性急速下跌，整体上今年上半年呈现出大盘价值风格占优的特征。今年上半年，行业与主题的轮动速度仍在历史高位，结构分化较为严重。银行、电力、家电、交运等板块表现较好，传媒、计算机、消费者服务、商贸零售等板块出现一定幅度的回调。

转债市场方面，今年前五个月转债市场的运行逻辑是符合传统研究框架范畴的，但在 5 月 17 日出现转债市场历史上首次转债的实质性违约之后，后续投资者在“国九条”制度框架指导下对小微盘股票退市风险担忧加剧的背景下，转债市场对预期民企信用违约的交易热度急速提升。自 5 月中旬至 6 月底，转债市场较过往正在经历信用风险重定价和转股期权重定价下的转债估值重塑的过程。

本基金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，力争实现具备稳定收益风险特征的投资结果。报告期内本基金持续践行以客观来认识市场，通过策略表达观点实践资产配置的组合管理方式，产品管理过程中，基于客观的视角审视各类资产的投资性价比，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，力争实现产品兼顾收益与回撤性价比的投资目标。报告期内，基于“五维度+十跟踪”的研究分析框架指导，权益仓位经历了先增后减的过程，股票市场内部主要配置具备一定确定性溢价的永续经营、高现金流、高股息资产，适度参与估值盈利性价比视角下性价比较高的资产，并紧密监控市场风险偏好与细分行业景气度边际抬升的情况，动态应对，以期增强组合的反脆弱性。在转债投资方面，阶段性配置了具有债底保护及低估特征的转债资产，但在一定程度上低估了极端避险情绪下“国九条”对中小盘债性转债债底保护的冲击，发现此情况后进行了积极的应对。在债券上涨的过程中，动态微调二永等高波动资产的占比，以达到控制组合整体回撤和波动的目的。债券端组合以稳健的票息策略为主，配置了合理的仓位和久期，根据市场情况进行一定的波段操作。我们重视票息收益，通过精细择券提升组合静态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值为 1.0417 元，本报告期份额净值增长率为 1.87%；华夏鼎融债券 C 基金份额净值为 1.1160 元，本报告期份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准增长率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场预计将继续面临外部环境不确定较大、国内有效需求有待提升、经济运行出现分化、部分重点领域风险隐患仍然较多、新旧动能转换存在阵痛的宏观条件，同时“资产荒”格局等有利债券市场环境的大概率延续，权益市场经历了上半年的调整后有望迎来企稳，但仍需等待更多积极信号触发市场的上行。具体地，从财政和房地产市场的情况看，叠加上半年供给扩张一定程度上透支了下半年的空间总需求难以明显回升，经济压力仍存，宽货币仍有必要，料宽松周期仍未结束。权益市场在经历了对宏观基本面偏悲观预期的充分定价以及雪球、量化 DMA、融资盘等杠杆资金阶段性出清的过程后，市场内部韧性有所增强，后续紧密跟踪宏观基本面、政策面、企业盈利的边际变化，并关注不同类别投资者的资金面和风险偏好的边际调整；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，积极把握权益市场结构性投资机会为组合带来的投资收益机会。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，适合作为中期策略进行底仓配置；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几年的调整，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，关注基本面质地良好但被市场错杀的中小盘股票的阶段性投资收益机会。转债资产管理方面，密切关注信用风险重定价和转股期权重定价下的转债估值重塑的定价过程，积极把握转债资产为组合带来的投资收益机会。

下半年，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，在控制产品整体绝对回撤水平的前提下，践行绝对收益投资目标。基金管理人将持续秉承以客观来认识市场，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份投资和每一份信任，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 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合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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 托管人对本中期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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	17,222,880.86	3,380,354.48
结算备付金		6,232,874.76	2,920,391.10
存出保证金		118,857.11	60,148.00
交易性金融资产	6.4.7.2	878,786,432.04	801,078,464.13
其中：股票投资		43,788,935.35	56,077,059.05
基金投资		-	-
债券投资		834,997,496.69	745,001,405.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	17,066,719.42

应收股利		-	-
应收申购款		21,590.00	15,510,675.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		902,382,634.77	840,016,753.06
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,807,225.14	63,115,222.64
应付清算款		30,238.27	14,801,641.47
应付赎回款		87,914.05	14,007,390.47
应付管理人报酬		440,612.19	397,028.46
应付托管费		146,870.72	132,342.82
应付销售服务费		30,952.60	25,043.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,753.23	32,640.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	356,946.78	448,238.70
负债合计		10,927,512.98	92,959,548.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	849,698,527.46	714,831,372.37
未分配利润	6.4.7.8	41,756,594.33	32,225,832.43
净资产合计		891,455,121.79	747,057,204.80
负债和净资产总计		902,382,634.77	840,016,753.06

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，华夏鼎融债券 A 基金份额净值 1.0417 元，华夏鼎融债券 C 基金份额净值 1.1160 元；华夏鼎融债券基金份额总额 849,698,527.46 份（其中 A 类 765,002,332.21 份，C 类 84,696,195.25 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏鼎融债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		19,013,771.59	14,056,090.38
1.利息收入		130,768.84	80,561.37

其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,994.24	56,494.38
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		61,774.60	24,066.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,082,766.49	3,949,721.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	769,626.76	-2,203,076.05
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	12,807,607.88	4,893,618.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,505,531.85	1,259,178.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,796,095.14	10,025,765.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,141.12	41.87
减：二、营业总支出		4,166,920.53	2,476,746.42
1.管理人报酬		2,480,954.86	1,445,562.37
2.托管费		826,984.95	481,854.19
3.销售服务费		136,595.71	3,961.10
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		595,184.02	429,822.93
其中：卖出回购金融资产支出		595,184.02	429,822.93
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		18,701.28	8,817.01
8.其他费用	6.4.7.21	108,499.71	106,728.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,846,851.06	11,579,343.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,846,851.06	11,579,343.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,846,851.06	11,579,343.96

6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	714,831,372.37	32,225,832.43	747,057,204.80
二、本期期初净资产	714,831,372.37	32,225,832.43	747,057,204.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	134,867,155.09	9,530,761.90	144,397,916.99
（一）、综合收益总额	-	14,846,851.06	14,846,851.06
（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）	134,867,155.09	7,530,426.98	142,397,582.07
其中：1.基金申购款	246,350,826.28	12,681,030.14	259,031,856.42
2.基金赎回款	-111,483,671.19	-5,150,603.16	-116,634,274.35
（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）	-	-12,846,516.14	-12,846,516.14
四、本期期末净资产	849,698,527.46	41,756,594.33	891,455,121.79
项目	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	163,561,345.24	19,520,350.34	183,081,695.58
（一）、综合收益总额	-	11,579,343.96	11,579,343.96
（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）	163,561,345.24	7,941,006.38	171,502,351.62
其中：1.基金申购	283,636,181.32	11,447,579.34	295,083,760.66

款			
2.基金赎回款	-120,074,836.08	-3,506,572.96	-123,581,409.04
(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	663,630,575.27	27,173,839.93	690,804,415.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	17,222,880.86
等于：本金	17,221,826.09
加：应计利息	1,054.77
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	17,222,880.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	45,355,362.87	-	43,788,935.35	-1,566,427.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	215,391,887.45	2,841,723.84	220,030,223.84	1,796,612.55
	银行间市场	601,217,145.91	7,064,772.85	614,967,272.85	6,685,354.09
	合计	816,609,033.36	9,906,496.69	834,997,496.69	8,481,966.64
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	861,964,396.23	9,906,496.69	878,786,432.04	6,915,539.12	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	272,411.42
其中：交易所市场	268,923.92
银行间市场	3,487.50
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	356,946.78

6.4.7.7 实收基金

华夏鼎融债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	662,709,455.84	662,709,455.84
本期申购	190,605,314.02	190,605,314.02
本期赎回（以“-”号填列）	-88,312,437.65	-88,312,437.65
本期末	765,002,332.21	765,002,332.21

华夏鼎融债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	52,121,916.53	52,121,916.53
本期申购	55,745,512.26	55,745,512.26
本期赎回（以“-”号填列）	-23,171,233.54	-23,171,233.54

本期末	84,696,195.25	84,696,195.25
-----	---------------	---------------

6.4.7.8 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	18,628,944.59	7,313,063.32	25,942,007.91
本期期初	18,628,944.59	7,313,063.32	25,942,007.91
本期利润	10,315,498.56	3,641,637.55	13,957,136.11
本期基金份额交易产生的变动数	2,251,288.35	1,431,113.82	3,682,402.17
其中：基金申购款	3,708,692.71	2,807,420.29	6,516,113.00
基金赎回款	-1,457,404.36	-1,376,306.47	-2,833,710.83
本期已分配利润	-11,647,603.04	-	-11,647,603.04
本期末	19,548,128.46	12,385,814.69	31,933,943.15

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	5,608,298.64	675,525.88	6,283,824.52
本期期初	5,608,298.64	675,525.88	6,283,824.52
本期利润	735,257.36	154,457.59	889,714.95
本期基金份额交易产生的变动数	3,106,099.19	741,925.62	3,848,024.81
其中：基金申购款	5,068,138.09	1,096,779.05	6,164,917.14
基金赎回款	-1,962,038.90	-354,853.43	-2,316,892.33
本期已分配利润	-1,198,913.10	-	-1,198,913.10
本期末	8,250,742.09	1,571,909.09	9,822,651.18

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	40,609.69
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	27,692.19
其他	692.36
合计	68,994.24

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	443,611,284.87
减：卖出股票成本总额	442,176,412.93
减：交易费用	665,245.18
买卖股票差价收入	769,626.76

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	11,338,108.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,469,499.84
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	12,807,607.88

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,175,173,473.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,163,355,045.58
减：应计利息总额	10,298,537.63
减：交易费用	50,390.12
买卖债券差价收入	1,469,499.84

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,505,531.85
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	1,505,531.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	3,796,095.14
——股票投资	-1,716,316.01
——债券投资	5,512,411.15
——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	3,796,095.14

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,141.12
合计	4,141.12

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,364.35
银行间账户维护费	18,000.00
存托服务费	-
其他	600.00
合计	108,499.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,480,954.86	1,445,562.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	307,466.25	184,943.21
应支付基金管理人的净管理费	2,173,488.61	1,260,619.16

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	826,984.95	481,854.19

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。

6.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年6月30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	-	32,710.03	32,710.03
合计	-	32,710.03	32,710.03
获得 销售 服务 费的 各关 联方 名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	-	985.27	985.27
合计	-	985.27	985.27

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	17,222,880.86	40,609.69	4,061,189.95	25,472.39

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。

6.4.10.7 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 2024年1月1日至2024年6月30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	601033	永兴股份	新股发行	500	8,100.00
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

华夏鼎融债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024-01-22	-	2024-01-22	0.1650	7,865,805.52	3,781,797.52	11,647,603.04	-
合计				0.1650	7,865,805.52	3,781,797.52	11,647,603.04	-

华夏鼎融债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024-01-22	-	2024-01-22	0.2300	22,132.17	1,176,780.93	1,198,913.10	-
合计				0.2300	22,132.17	1,176,780.93	1,198,913.10	-

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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 9,807,225.14 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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“6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
货币资金	17,222,880.86	-	-	17,222,880.86
结算备付金	6,232,874.76	-	-	6,232,874.76
结算保证金	118,857.11	-	-	118,857.11
债券投资	371,192,267.23	368,269,689.37	95,535,540.09	834,997,496.69
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	9,807,225.14	-	-	9,807,225.14
上年度末 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

注：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。

6.4.13.4.1.2 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	利率下降 25 个基点	5,424,744.98	3,574,564.10
	利率上升 25 个基点	-5,288,445.37	-3,545,466.32

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	43,788,935.35	4.91	56,077,059.05	7.51
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
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	43,788,935.35	4.91	83,808,673.16	11.22

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。

6.4.13.4.3.2 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-3,065,387.56	-4,619,839.16
	+5%	3,065,387.56	4,619,839.16

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	43,788,935.35
第二层次	834,997,496.69
第三层次	-
合计	878,786,432.04

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	43,788,935.35	4.85
	其中：股票	43,788,935.35	4.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	834,997,496.69	92.53
	其中：债券	834,997,496.69	92.53
	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	23,455,755.62	2.60
8	其他各项资产	140,447.11	0.02
9	合计	902,382,634.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	283,222.00	0.03
B	采矿业	1,529,176.00	0.17
C	制造业	22,248,372.40	2.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,368,515.00	0.38
E	建筑业	699,423.00	0.08

F	批发和零售业	918,339.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,191,837.40	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	971,950.20	0.11
J	金融业	11,483,959.35	1.29
K	房地产业	213,144.00	0.02
L	租赁和商务服务业	372,690.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	237,068.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	104,520.00	0.01
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	166,719.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	43,788,935.35	4.91

7.3 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	601398	工商银行	480,000	2,736,000.00	0.31
2	600900	长江电力	93,600	2,706,912.00	0.30
3	601288	农业银行	594,200	2,590,712.00	0.29
4	601988	中国银行	556,300	2,570,106.00	0.29
5	600660	福耀玻璃	9,900	474,210.00	0.05
6	002027	分众传媒	61,500	372,690.00	0.04
7	000333	美的集团	5,700	367,650.00	0.04
8	600887	伊利股份	13,800	356,592.00	0.04
9	601126	四方股份	16,500	317,130.00	0.04
10	601169	北京银行	54,100	315,944.00	0.04
11	002304	洋河股份	3,900	314,886.00	0.04
12	002463	沪电股份	8,440	308,060.00	0.03
13	601186	中国铁建	35,700	305,949.00	0.03
14	601088	中国神华	6,400	283,968.00	0.03
15	603156	养元饮品	13,200	280,764.00	0.03
16	601717	郑煤机	18,600	275,280.00	0.03
17	002273	水晶光电	16,100	273,378.00	0.03
18	600582	天地科技	38,100	262,509.00	0.03
19	601766	中国中车	34,200	256,842.00	0.03
20	603299	苏盐井神	27,000	256,500.00	0.03
21	600066	宇通客车	9,900	255,420.00	0.03
22	300679	电连技术	6,100	245,403.00	0.03
23	601000	唐山港	51,900	243,930.00	0.03

24	000030	富奥股份	49,300	242,063.00	0.03
25	600642	申能股份	27,300	241,059.00	0.03
26	002563	森马服饰	41,400	240,534.00	0.03
27	605337	李子园	24,200	237,644.00	0.03
28	000423	东阿阿胶	3,500	219,100.00	0.02
29	605599	菜百股份	17,100	217,683.00	0.02
30	000581	威孚高科	13,300	216,524.00	0.02
31	000568	泸州老窖	1,500	215,235.00	0.02
32	300308	中际旭创	1,560	215,092.80	0.02
33	601138	工业富联	7,800	213,720.00	0.02
34	300628	亿联网络	5,800	213,266.00	0.02
35	000589	贵州轮胎	41,900	212,433.00	0.02
36	688076	诺泰生物	2,700	211,356.00	0.02
37	003006	百亚股份	8,900	210,930.00	0.02
38	000975	银泰黄金	12,900	210,141.00	0.02
39	600987	航民股份	29,300	206,858.00	0.02
40	002415	海康威视	6,600	204,006.00	0.02
41	003000	劲仔食品	16,800	202,440.00	0.02
42	600309	万华化学	2,500	202,150.00	0.02
43	600132	重庆啤酒	3,300	200,310.00	0.02
44	600210	紫江企业	37,600	200,032.00	0.02
45	600916	中国黄金	20,100	193,362.00	0.02
46	600284	浦东建设	35,700	190,638.00	0.02
47	600809	山西汾酒	900	189,792.00	0.02
48	600406	国电南瑞	7,500	187,200.00	0.02
49	002327	富安娜	18,500	185,925.00	0.02
50	000915	华特达因	6,100	183,976.00	0.02
51	002601	龙佰集团	9,900	183,843.00	0.02
52	601636	旗滨集团	28,200	181,890.00	0.02
53	000651	格力电器	4,600	180,412.00	0.02
54	300750	宁德时代	1,000	180,030.00	0.02
55	002572	索菲亚	11,700	179,361.00	0.02
56	605377	华旺科技	13,520	179,140.00	0.02
57	601163	三角轮胎	11,500	175,030.00	0.02
58	300502	新易盛	1,600	168,880.00	0.02
59	601811	新华文轩	11,900	166,719.00	0.02
60	688008	澜起科技	2,900	165,764.00	0.02
61	688128	中国电研	9,600	165,216.00	0.02
62	000400	许继电气	4,800	165,168.00	0.02
63	601328	交通银行	21,800	162,846.00	0.02
64	601009	南京银行	15,300	158,967.00	0.02
65	601006	大秦铁路	22,100	158,236.00	0.02
66	601658	邮储银行	31,100	157,677.00	0.02

67	688036	传音控股	2,060	157,672.40	0.02
68	600863	内蒙华电	33,900	157,296.00	0.02
69	600028	中国石化	24,600	155,472.00	0.02
70	603605	珀莱雅	1,400	155,386.00	0.02
71	002533	金杯电工	15,600	155,220.00	0.02
72	601166	兴业银行	8,800	155,056.00	0.02
73	601225	陕西煤业	6,000	154,620.00	0.02
74	601211	国泰君安	11,400	154,470.00	0.02
75	600036	招商银行	4,500	153,855.00	0.02
76	600016	民生银行	40,500	153,495.00	0.02
77	000538	云南白药	3,000	153,450.00	0.02
78	601818	光大银行	48,400	153,428.00	0.02
79	000883	湖北能源	25,400	152,654.00	0.02
80	600104	上汽集团	11,000	152,460.00	0.02
81	600282	南钢股份	30,600	152,388.00	0.02
82	601665	齐鲁银行	30,900	151,719.00	0.02
83	603288	海天味业	4,400	151,668.00	0.02
84	601319	中国人保	29,300	150,895.00	0.02
85	002483	润邦股份	33,300	150,183.00	0.02
86	300790	宇瞳光学	11,100	149,850.00	0.02
87	603165	荣晟环保	14,100	149,742.00	0.02
88	601318	中国平安	3,600	148,896.00	0.02
89	600585	海螺水泥	6,300	148,617.00	0.02
90	000776	广发证券	12,200	148,474.00	0.02
91	002469	三维化学	25,900	147,630.00	0.02
92	600690	海尔智家	5,200	147,576.00	0.02
93	000157	中联重科	19,200	147,456.00	0.02
94	603897	长城科技	8,400	147,420.00	0.02
95	600598	北大荒	11,800	147,382.00	0.02
96	000895	双汇发展	6,200	147,374.00	0.02
97	002906	华阳集团	5,500	147,180.00	0.02
98	600919	江苏银行	19,800	147,114.00	0.02
99	600019	宝钢股份	22,100	146,965.00	0.02
100	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.02
101	601107	四川成渝	27,900	146,475.00	0.02
102	000983	山西焦煤	14,200	146,402.00	0.02
103	600648	外高桥	16,500	146,190.00	0.02
104	601668	中国建筑	27,500	146,025.00	0.02
105	002807	江阴银行	38,700	145,899.00	0.02
106	002948	青岛银行	43,250	145,752.50	0.02
107	600015	华夏银行	22,700	145,280.00	0.02
108	600938	中国海油	4,400	145,200.00	0.02
109	002839	张家港行	35,900	144,318.00	0.02

110	000001	平安银行	14,200	144,130.00	0.02
111	002053	云南能投	11,900	143,871.00	0.02
112	600426	华鲁恒升	5,400	143,856.00	0.02
113	600845	宝信软件	4,500	143,685.00	0.02
114	300673	佩蒂股份	10,900	143,008.00	0.02
115	002984	森麒麟	5,900	142,131.00	0.02
116	300181	佐力药业	9,400	142,128.00	0.02
117	601601	中国太保	5,100	142,086.00	0.02
118	601222	林洋能源	22,600	141,702.00	0.02
119	603786	科博达	2,200	141,130.00	0.02
120	600737	中粮糖业	14,700	140,973.00	0.02
121	000858	五粮液	1,100	140,844.00	0.02
122	002048	宁波华翔	10,800	139,752.00	0.02
123	600177	雅戈尔	19,600	139,552.00	0.02
124	603871	嘉友国际	7,860	139,043.40	0.02
125	605007	五洲特纸	11,000	138,930.00	0.02
126	603369	今世缘	3,000	138,600.00	0.02
127	605305	中际联合	5,300	136,687.00	0.02
128	300761	立华股份	6,000	135,840.00	0.02
129	603558	健盛集团	13,500	134,325.00	0.02
130	300783	三只松鼠	6,100	133,407.00	0.01
131	002215	诺普信	17,700	131,865.00	0.01
132	002928	华夏航空	20,700	131,238.00	0.01
133	000567	海德股份	23,185	130,067.85	0.01
134	600761	安徽合力	6,000	129,840.00	0.01
135	002345	潮宏基	27,000	127,440.00	0.01
136	601699	潞安环能	7,000	126,910.00	0.01
137	000596	古井贡酒	600	126,642.00	0.01
138	600566	济川药业	3,900	123,669.00	0.01
139	603993	洛阳钼业	14,100	119,850.00	0.01
140	688009	中国通号	19,800	118,800.00	0.01
141	600741	华域汽车	7,200	117,936.00	0.01
142	600350	山东高速	13,300	117,705.00	0.01
143	603886	元祖股份	7,600	114,456.00	0.01
144	601869	长飞光纤	4,700	114,351.00	0.01
145	002152	广电运通	10,900	114,014.00	0.01
146	603508	思维列控	6,000	112,500.00	0.01
147	601998	中信银行	16,700	111,890.00	0.01
148	600901	江苏金租	22,100	111,605.00	0.01
149	002949	华阳国际	11,800	111,038.00	0.01
150	002911	佛燃能源	12,100	110,594.00	0.01
151	688358	祥生医疗	4,200	109,074.00	0.01
152	603309	维力医疗	9,900	108,999.00	0.01

153	603967	中创物流	11,700	108,810.00	0.01
154	002788	鹭燕医药	13,800	108,744.00	0.01
155	002545	东方铁塔	15,900	108,279.00	0.01
156	000517	荣安地产	40,200	107,736.00	0.01
157	600967	内蒙一机	14,900	107,280.00	0.01
158	605118	力鼎光电	7,200	107,208.00	0.01
159	603758	秦安股份	14,100	107,160.00	0.01
160	300616	尚品宅配	9,600	106,176.00	0.01
161	300394	天孚通信	1,200	106,104.00	0.01
162	601952	苏垦农发	11,700	105,534.00	0.01
163	600007	中国国贸	4,800	105,408.00	0.01
164	601369	陕鼓动力	13,100	105,062.00	0.01
165	600475	华光环能	12,000	104,520.00	0.01
166	002895	川恒股份	5,700	104,367.00	0.01
167	000559	万向钱潮	23,300	103,918.00	0.01
168	002947	恒铭达	2,900	102,080.00	0.01
169	002088	鲁阳节能	8,400	101,556.00	0.01
170	603519	立霸股份	8,900	100,659.00	0.01
171	601216	君正集团	26,900	99,261.00	0.01
172	603868	飞科电器	2,500	96,000.00	0.01
173	300115	长盈精密	7,900	94,721.00	0.01
174	300017	网宿科技	11,800	93,220.00	0.01
175	600612	老凤祥	1,600	93,104.00	0.01
176	603556	海兴电力	1,900	88,977.00	0.01
177	300735	光弘科技	4,100	88,560.00	0.01
178	300705	九典制药	3,300	88,242.00	0.01
179	688100	威胜信息	2,300	87,745.00	0.01
180	000429	粤高速 A	8,400	87,444.00	0.01
181	601899	紫金矿业	4,900	86,093.00	0.01
182	000933	神火股份	4,200	84,966.00	0.01
183	002020	京新药业	7,900	82,713.00	0.01
184	002422	科伦药业	2,700	81,891.00	0.01
185	600862	中航高科	4,300	80,754.00	0.01
186	002032	苏泊尔	1,600	80,160.00	0.01
187	688253	英诺特	2,100	80,031.00	0.01
188	002519	银河电子	16,200	79,542.00	0.01
189	002938	鹏鼎控股	2,000	79,520.00	0.01
190	688016	心脉医疗	800	78,440.00	0.01
191	300002	神州泰岳	9,400	76,328.00	0.01
192	603228	景旺电子	2,400	76,320.00	0.01
193	300492	华图山鼎	800	75,360.00	0.01
194	603201	常润股份	3,100	75,020.00	0.01
195	002833	弘亚数控	4,100	74,784.00	0.01

196	688188	柏楚电子	400	73,820.00	0.01
197	301345	涛涛车业	1,300	71,630.00	0.01
198	301015	百洋医药	2,700	63,531.00	0.01
199	002916	深南电路	600	63,462.00	0.01
200	600183	生益科技	3,000	63,180.00	0.01
201	300627	华测导航	2,100	62,685.00	0.01
202	601231	环旭电子	3,900	62,595.00	0.01
203	301000	肇民科技	4,340	62,279.00	0.01
204	300996	普联软件	4,200	61,614.00	0.01
205	603730	岱美股份	6,120	60,832.80	0.01
206	002835	同为股份	3,600	60,804.00	0.01
207	300303	聚飞光电	12,300	59,778.00	0.01
208	600850	电科数字	3,300	59,730.00	0.01
209	002001	新和成	3,100	59,520.00	0.01
210	603927	中科软	3,280	59,335.20	0.01
211	002922	伊戈尔	2,700	59,022.00	0.01
212	600018	上港集团	10,200	58,956.00	0.01
213	300880	迦南智能	3,000	58,890.00	0.01
214	603589	口子窖	1,500	58,785.00	0.01
215	603025	大豪科技	4,200	58,044.00	0.01
216	603088	宁波精达	7,700	57,981.00	0.01
217	605277	新亚电子	4,480	57,881.60	0.01
218	003025	思进智能	4,700	57,857.00	0.01
219	300529	健帆生物	2,100	57,141.00	0.01
220	002128	电投能源	2,700	56,970.00	0.01
221	600820	隧道股份	8,700	56,811.00	0.01
222	603239	浙江仙通	4,100	56,211.00	0.01
223	300415	伊之密	2,700	56,106.00	0.01
224	688663	新风光	2,400	55,848.00	0.01
225	688586	江航装备	6,000	55,800.00	0.01
226	600332	白云山	1,900	55,727.00	0.01
227	300559	佳发教育	5,800	55,506.00	0.01
228	600511	国药股份	1,800	55,422.00	0.01
229	002980	华盛昌	2,500	54,725.00	0.01
230	300009	安科生物	6,400	54,656.00	0.01
231	002206	海利得	14,300	54,626.00	0.01
232	603611	诺力股份	3,200	54,528.00	0.01
233	603319	湘油泵	3,400	54,366.00	0.01
234	002315	焦点科技	2,000	53,920.00	0.01
235	002558	巨人网络	5,700	53,808.00	0.01
236	002401	中远海科	3,600	53,784.00	0.01
237	000999	华润三九	1,260	53,650.80	0.01
238	601688	华泰证券	4,300	53,277.00	0.01

239	000550	江铃汽车	2,400	52,104.00	0.01
240	603035	常熟汽饰	4,100	51,988.00	0.01
241	600479	千金药业	5,100	51,867.00	0.01
242	001309	德明利	600	51,840.00	0.01
243	002158	汉钟精机	3,100	51,832.00	0.01
244	601965	中国汽研	3,000	50,670.00	0.01
245	601567	三星医疗	1,300	45,500.00	0.01
246	600256	广汇能源	6,500	43,550.00	0.00
247	002371	北方华创	100	31,989.00	0.00
248	002475	立讯精密	600	23,586.00	0.00
249	600883	博闻科技	2,700	16,605.00	0.00
250	002884	凌霄泵业	600	11,520.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601288	农业银行	8,956,421.00	1.20
2	601398	工商银行	8,906,822.00	1.19
3	601988	中国银行	8,001,646.00	1.07
4	600900	长江电力	7,250,188.00	0.97
5	600642	申能股份	3,209,061.00	0.43
6	000651	格力电器	2,864,265.00	0.38
7	600282	南钢股份	2,717,207.00	0.36
8	000581	威孚高科	2,615,538.00	0.35
9	600919	江苏银行	2,488,273.00	0.33
10	600887	伊利股份	2,466,504.00	0.33
11	000429	粤高速 A	2,460,105.00	0.33
12	600350	山东高速	2,429,931.00	0.33
13	601717	郑煤机	2,427,354.00	0.32
14	600015	华夏银行	2,263,331.00	0.30
15	601665	齐鲁银行	2,207,364.00	0.30
16	603323	苏农银行	2,203,926.00	0.30
17	600737	中粮糖业	2,200,829.00	0.29
18	003000	劲仔食品	2,187,046.00	0.29
19	002966	苏州银行	2,181,223.00	0.29
20	600461	洪城环境	2,177,340.04	0.29

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。

7.4.2 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	601288	农业银行	6,776,548.00	0.91
2	601398	工商银行	6,439,713.00	0.86
3	601988	中国银行	5,601,722.00	0.75
4	600900	长江电力	5,123,072.00	0.69
5	600642	申能股份	3,431,632.00	0.46
6	000975	银泰黄金	2,979,843.00	0.40
7	600282	南钢股份	2,923,264.00	0.39
8	600919	江苏银行	2,877,815.00	0.39
9	000651	格力电器	2,861,496.00	0.38
10	601717	郑煤机	2,716,028.00	0.36
11	000581	威孚高科	2,685,082.00	0.36
12	000429	粤高速 A	2,676,461.00	0.36
13	600350	山东高速	2,637,196.00	0.35
14	600887	伊利股份	2,555,159.00	0.34
15	603323	苏农银行	2,521,208.00	0.34
16	600398	海澜之家	2,520,568.00	0.34
17	600461	洪城环境	2,512,575.69	0.34
18	002966	苏州银行	2,474,274.00	0.33
19	601665	齐鲁银行	2,429,492.00	0.33
20	600033	福建高速	2,423,664.98	0.32

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。

7.4.3 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	431,604,605.24
卖出股票收入（成交）总额	443,611,284.87

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。

7.5 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	86,259,078.11	9.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	418,870,090.69	46.99
	其中：政策性金融债	104,449,904.38	11.72
4	企业债券	92,690,791.24	10.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	237,177,536.65	26.61

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	834,997,496.69	93.67

7.6 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	190311	19 进出 11	600,000	61,753,131.15	6.93
2	019733	24 国债 02	450,000	45,482,880.82	5.10
3	2222003	22 国开金融债	350,000	36,148,937.81	4.06
4	2028024	20 中信银行二级	300,000	31,627,140.98	3.55
5	212380027	23 华夏银行债 05	300,000	31,028,426.23	3.48

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	118,857.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,590.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,447.11

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	5,069	150,917.80	754,842,224.82	98.67%	10,160,107.39	1.33%
华夏鼎	73	1,160,221.85	84,445,439.41	99.70%	250,755.84	0.30%

融 债 券 C						
合 计	5,142	165,246.70	839,287,664.23	98.77%	10,410,863.23	1.23%

8.2 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	1,749.39	0.00%
	华夏鼎融债券 C	328.36	0.00%
	合计	2,077.75	0.00%

8.3 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 投资和研究部 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

§9 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	662,709,455.84	52,121,916.53
本报告期基金总申购份额	190,605,314.02	55,745,512.26
减：本报告期基金总赎回份额	88,312,437.65	23,171,233.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	765,002,332.21	84,696,195.25

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	2	499,071,603.81	57.02%	220,107.45	56.87%	-
长江证券	3	301,632,964.13	34.46%	134,509.32	34.75%	-
国泰君安证券	2	73,052,395.95	8.35%	31,464.55	8.13%	-
中金公司	2	1,450,826.22	0.17%	979.26	0.25%	-
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、国盛证券、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、申万宏源证券、天风证券、万联证券、西部证券、信达证券、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，广发证券的部分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。

10.7.2 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	667,081,587.92	59.66%	2,896,900,000.00	91.31%	-	-	-	-
长江证券	239,094,613.49	21.38%	122,500,000.00	3.86%	-	-	-	-
国泰君安	151,627,278.30	13.56%	153,300,000.00	4.83%	-	-	-	-

证券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	60,307,900.00	5.39%	-	-	-	-	-	-

10.8 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	华夏鼎融债券型证券投资基金限制申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-17
2	华夏鼎融债券型证券投资基金第四次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-18
3	华夏鼎融债券型证券投资基金恢复大额申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二四年八月三十日