

华夏可转债增强债券型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十九日

§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 2020 年 8 月 27 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 2020 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.....	10
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	34
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.....	34
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.....	34
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.....	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34
7.12 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息.....	36
§9 开放式基金份额变动.....	37
§10 重大事件揭示.....	37
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§12 备查文件目录.....	39

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏可转债增强债券型证券投资基金	
基金简称	华夏可转债增强债券	
基金主代码	001045	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月27日	
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	122,364,194.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 I
下属分级基金的交易代码	001045	001046
报告期末下属分级基金的份额总额	122,364,194.59 份	-份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，追求较高的当期收入和总回报。
投资策略	本基金主要通过采取可转债投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中证可转换债券指数。
风险收益特征	本基金属于债券基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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	李申
	联系电话	400-818-6666	021-60637102
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637111
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		杨明辉	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	基金管理人和基金托管人的住所

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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 I
本期已实现收益	6,731,371.78	-
本期利润	2,288,087.44	-
加权平均基金份额本期利润	0.0159	-
本期加权平均净值利润率	1.39%	-
本期基金份额净值增长率	5.97%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 I
期末可供分配利润	6,235,369.22	-
期末可供分配基金份额利润	0.0510	-
期末基金资产净值	145,554,241.38	-
期末基金份额净值	1.190	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 I
基金份额累计净值增长率	19.00%	-

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③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

华夏可转债增强债券 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	7.69%	0.80%	0.46%	0.41%	7.23%	0.39%
过去三个月	9.27%	0.84%	-1.86%	0.45%	11.13%	0.39%
过去六个月	5.97%	1.33%	-1.84%	0.72%	7.81%	0.61%
过去一年	23.19%	1.05%	8.42%	0.58%	14.77%	0.47%
过去三年	17.94%	0.94%	18.17%	0.65%	-0.23%	0.29%
自基金合同生效起至今	19.00%	0.85%	17.03%	0.62%	1.97%	0.23%

华夏可转债增强债券 I

2016 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日期间，华夏可转债增强债券 I 类基金份额为零。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华夏可转债增强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 9 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日)

华夏可转债增强债券 A



注：2016 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日期间，华夏可转债增强债券 I 类基金份额为零。

§4 管理人报告

4.1 基金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、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人,首批商品期货 ETF 基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF,初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告,2020 年在基金分类排名中(截至 2020 年 6 月 30 日数据),华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(可投转债)(非 A 类)”中排序 1/123;华夏鼎利债券(A 类)和华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中分别排序 2/248 和 6/248;华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金(A 类)”中排序 2/345;华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 9/22;华夏创新前沿股票和华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A 类)”中排序 2/203 和

10/203；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 1/10；华夏医疗健康混合(A 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 5/225；华夏乐享健康混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中排序 5/490；华夏磐泰混合(LOF)在“混合基金-偏债型基金-偏债型基金（A 类）”中分别排序 6/125；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/36 和 7/36；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数(C 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 6/21，华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 3/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 7/35 和 4/35；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/53；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/17 和 3/17；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 9/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 3/28。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端部分基金上线定投止盈功能，同时对资料上传功能进行升级优化，为广大投资者管理定期定额交易、以及业务办理提供了便利；（2）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（3）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“难忘，因为不用记”、“凡是家人，都有户口本”、“人未动，心已跳”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		
何家琪	本基金的基	2016-11-18	-	8 年	清华大学应用经济学硕

	金经理、固定收益部总监			士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任固定收益部研究员、基金经理助理，华夏新锦泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 5 月 25 日期间）、华夏新锦鸿灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 7 月 23 日期间）、华夏新起航灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 7 月 30 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏永康添福混合型证券投资基金基金经理（2018 年 2 月 1 日至 2019 年 7 月 18 日期间）、华夏新锦程灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2019 年 12 月 17 日期间）等。
--	-------------	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 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

2020 年上半年，突如其来的新冠疫情席卷全球，成为今年资本市场最大的外生变量。国际方面，美国为应对新冠疫情紧急将联邦利率下降至 0，并动用各种流动性工具缓解市场压力，其他各主要经济体也都公布了财政刺激计划，以缓解因为疫情带来的短期经济停摆压力。目前除了美国和一些欠发达地区呈现较高的新增病例外，其他国家在控制疫情方面已经取得了较好成效，并陆续解除封锁，经济动能逐步恢复。全球股市上半年剧烈波动，在大幅下跌之后猛烈反弹，其中全球的科技和医药上市公司表现最为突出，美元指数高位回落，黄金大幅上涨接近历史新高。国内疫情虽然早于海外爆发，但由于措施得力短期即被完全控制，虽有一些本土病例零星出现，但从现在的响应速度和控制力度来看对整体经济影响较低，随着经济出现边际好转的迹象越发明显，央行在货币政策上也更加注重风险防范，对于一些应急性质的临时性货币政策也在考虑逐步退出，而中国也成为上半年全球唯一实现正增长的经济体。

上半年国内债券市场受疫情和政策的影响波动巨大，起初为了应对疫情爆发，央行向市场投入巨量流动性，并降低了政策利率，导致货币资金市场极度宽松，债券收益率明显下行，曲线陡峭化下行，5 月之后随着疫情被有效控制央行在货币政策取向上更加偏向防风险，货币市场利率逐步抬升，叠加巨大的利率债一级市场供给，短期市场供需出现失衡，债券市场出现了比较明显的下跌，信用利差被动有所收窄，各期限债券收益率基本回到了年初疫情前的水平。权益市场受疫情影响同样波动率明显上升，内部结构极端分化，科技、消费和医药板块成为上半年表现最好的板块，同时跟经济活动相关度较高的周期和金融地产板块表现落后。

报告期内，本基金维持了较高的股票和可转债仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，华夏可转债增强债券 A 基金份额净值为 1.190 元，本报告期份额净值增长率为 5.97%，同期业绩比较基准增长率为-1.84%。

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 2020 年下半年，市场的重心将从应对疫情向经济恢复转变，在疫情没有大规模二次爆发的情况下，预计国内经济年底之前可以恢复到疫情前水平，目前需要密切关注经济恢复的强度以及受疫情冲击最大的服务类行业的恢复情况，此外中美之间的对抗在下半年美国大选之前预计会更加频繁出现，也会对市场造成一定的扰动。

在经济基本面大方向向上的背景下，预计债券市场下半年总体机会有限，虽然二季度债券市场经历了比较剧烈的调整，但从整个下半年维度看债券作为大类资产配置的价值仍偏低，此外还需要警惕的风险来自如果美元指数趋势性下行导致大宗商品超预期的上涨，随之带来 PPI 可能的超预期上行风险。虽然权益市场上半年表现较好，但从经济周期、企业盈利以及估值水平的角度看，权益市场相对债券市场依然有不错的投资价值，伴随经济复苏进程加快，前期受抑制的周期类板块有望获得一定的估值修复的机会，从而体现出比上半年更加均衡的市场表现。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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合规守信、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，本基金未实施利润分配。

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：华夏可转债增强债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	710,077.33	5,165,367.99
结算备付金		1,860,336.07	383,075.63
存出保证金		31,029.17	10,280.17
交易性金融资产	6.4.7.2	172,973,895.74	103,459,091.56
其中：股票投资		41,272,173.16	25,252,091.13
基金投资		-	-
债券投资		131,701,722.58	78,207,000.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,630,248.69	-
应收利息	6.4.7.5	466,108.11	263,958.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,274,112.30	2,402,013.33
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		181,945,807.41	111,683,786.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		30,000,000.00	11,400,000.00
应付证券清算款		-	4,386,517.64
应付赎回款		6,112,033.45	202,450.15
应付管理人报酬		86,148.22	45,192.50
应付托管费		24,613.76	12,912.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	95,049.47	23,022.59
应交税费		1,223.05	664.11
应付利息		7,853.50	6,006.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	64,644.58	100,000.00
负债合计		36,391,566.03	16,176,765.67
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	122,364,194.59	85,009,134.51
未分配利润	6.4.7.10	23,190,046.79	10,497,886.65
所有者权益合计		145,554,241.38	95,507,021.16
负债和所有者权益总计		181,945,807.41	111,683,786.83

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，华夏可转债增强债券 A 基金份额净值 1.190 元，华夏可转债增强债券基金份额总额 122,364,194.59 份（其中 A 类 122,364,194.59 份，I 类 0.00 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏可转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,588,970.26	6,942,760.43
1.利息收入		501,492.91	224,195.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,902.32	12,523.48
债券利息收入		471,100.73	208,454.84
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		489.86	3,217.10
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,004,471.32	4,850,567.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,218,578.98	858,475.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,460,376.81	3,888,741.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	325,515.53	103,349.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-4,443,284.34	1,524,721.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,526,290.37	343,276.52
减：二、费用		1,300,882.82	485,685.61
1.管理人报酬		574,096.88	242,975.39
2.托管费		164,027.68	69,421.53
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	193,101.90	71,790.72
5.利息支出		290,815.64	42,183.07
其中：卖出回购金融资产支出		290,815.64	42,183.07
6.税金及附加		642.58	313.44
7.其他费用	6.4.7.21	78,198.14	59,001.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,288,087.44	6,457,074.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,288,087.44	6,457,074.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏可转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	85,009,134.51	10,497,886.65	95,507,021.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,288,087.44	2,288,087.44
三、本期基金份额交易产	37,355,060.08	10,404,072.70	47,759,132.78

生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	172,457,420.34	29,208,801.38	201,666,221.72
2.基金赎回款	-135,102,360.26	-18,804,728.68	-153,907,088.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	122,364,194.59	23,190,046.79	145,554,241.38
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	57,145,891.89	-8,281,226.80	48,864,665.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,457,074.82	6,457,074.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	17,244,543.33	-697,354.21	16,547,189.12
其中: 1.基金申购款	57,648,921.83	-241,352.43	57,407,569.40
2.基金赎回款	-40,404,378.50	-456,001.78	-40,860,380.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	74,390,435.22	-2,521,506.19	71,868,929.03

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：杨明辉，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

华夏可转债增强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[2015]110号《关于准予华夏可转债增强债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]1457号《关于华夏可转债增强债券型证券投资基金延期募集备案的回函》，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》、《华夏可转债增强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 8 月 29 日至 2016 年 9 月 23 日共募集 290,918,310.02 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 0924 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏可转债增强债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 291,059,125.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 140,815.75 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《华夏可转债增强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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债（含中小企业私募债）、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、银行存款（含同业存款、协议存款、定期存款及其他银行存款、大额存单）等固定收益类资产。

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》、各项具体会计准则及其他相关规定（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基金净值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》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。

(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 5%、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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	710,077.33
定期存款	-
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	-
合计	710,077.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	37,038,067.36	41,272,173.16	4,234,105.80

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	131,462,891.48	131,701,722.58
	银行间市场	-	-
	合计	131,462,891.48	131,701,722.58
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	168,500,958.84	172,973,895.74	4,472,936.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	152.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	837.10
应收债券利息	465,104.75
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	14.00
合计	466,108.11

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	95,049.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	95,049.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-
预提费用	64,644.58
合计	64,644.58

6.4.7.9 实收基金

华夏可转债增强债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	85,009,134.51	85,009,134.51
本期申购	172,457,420.34	172,457,420.34
本期赎回（以“-”号填列）	-135,102,360.26	-135,102,360.26
本期末	122,364,194.59	122,364,194.59

华夏可转债增强债券 I

无。

6.4.7.10 未分配利润

华夏可转债增强债券 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	53,795.41	10,444,091.24	10,497,886.65
本期利润	6,731,371.78	-4,443,284.34	2,288,087.44
本期基金份额交易产生的变动数	-549,797.97	10,953,870.67	10,404,072.70
其中：基金申购款	3,200,563.30	26,008,238.08	29,208,801.38
基金赎回款	-3,750,361.27	-15,054,367.41	-18,804,728.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,235,369.22	16,954,677.57	23,190,046.79

华夏可转债增强债券 I

无。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	10,863.49
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	18,844.57
其他	194.26
合计	29,902.32

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	73,689,434.61
减：卖出股票成本总额	71,470,855.63
买卖股票差价收入	2,218,578.98

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	63,664,917.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,912,363.71
减：应收利息总额	292,177.05
买卖债券差价收入	3,460,376.81

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	325,515.53
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	325,515.53

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-4,443,284.34
——股票投资	168,612.12
——债券投资	-4,611,896.46
——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	-4,443,284.34

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	1,526,290.37
合计	1,526,290.37

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	193,101.90
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	193,101.90

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	4,553.56
银行间账户维护费	9,000.00
合计	78,198.14

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	110,137,375.03	76.23%	28,262,386.15	56.65%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	77,261,662.06	48.35%	90,449,806.59	68.24%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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
中信证券	968,852,000.00	36.56%	401,900,000.00	93.34%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	80,543.60	77.20%	80,543.60	84.74%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	26,320.43	62.47%	26,320.43	62.47%

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。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	574,096.88	242,975.39
其中：支付销售机构的客户维护费	151,387.63	46,385.74

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 0.70% 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 × 0.70% / 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	164,027.68	69,421.53

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

无。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	华夏可转债增强债券A	华夏可转债增强债券I	华夏可转债增强债券A	华夏可转债增强债券I
期初持有的基金份额	-	-	3,411,013.48	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	3,411,013.48	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	4.59%	-

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	710,077.33	10,863.49	350,922.76	8,776.76

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

无。

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

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020 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 2020 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 30,000,000.00 元，于 2020 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內。

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 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	710,077.33	-	-	710,077.33
结算备付金	1,860,336.07	-	-	1,860,336.07
结算保证金	31,029.17	-	-	31,029.17
债券投资	128,685,505.06	3,016,217.52	-	131,701,722.58
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	30,000,000.00	-	-	30,000,000.00
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	5,165,367.99	-	-	5,165,367.99
结算备付金	383,075.63	-	-	383,075.63
结算保证金	10,280.17	-	-	10,280.17
债券投资	76,154,805.53	2,052,194.90	-	78,207,000.43
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	11,400,000.00	-	-	11,400,000.00

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	利率下降 25 个基点	3,124.69	2,060.52
	利率上升 25 个基点	-3,120.21	-2,057.20

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	41,272,173.16	28.36	25,252,091.13	26.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	123,994,722.58	85.19	73,593,470.43	77.06
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	165,266,895.74	113.54	98,845,561.56	103.50

注：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。

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	+5%	11,378,378.07	5,971,882.71
	-5%	-11,378,378.07	-5,971,882.71

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允

价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(2) 各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 152,648,778.22 元，第二层次的余额为 20,325,117.52 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2019 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 90,246,700.66 元，第二层次的余额为 13,212,390.90 元，第三层次的余额为 0 元。）

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	41,272,173.16	22.68
	其中：股票	41,272,173.16	22.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,701,722.58	72.39
	其中：债券	131,701,722.58	72.39
	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	2,570,413.40	1.41
8	其他各项资产	6,401,498.27	3.52
9	合计	181,945,807.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	998,240.00	0.69
C	制造业	31,061,735.16	21.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,479,814.00	1.70
J	金融业	6,732,384.00	4.63
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,272,173.16	28.36

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	300750	宁德时代	35,400	6,172,344.00	4.24
2	601688	华泰证券	239,800	4,508,240.00	3.10
3	002384	东山精密	101,500	3,039,925.00	2.09
4	002050	三花智控	137,270	3,006,213.00	2.07

5	300073	当升科技	88,400	2,923,388.00	2.01
6	300253	卫宁健康	108,100	2,479,814.00	1.70
7	600438	通威股份	130,969	2,276,241.22	1.56
8	600837	海通证券	176,800	2,224,144.00	1.53
9	002475	立讯精密	32,200	1,653,470.00	1.14
10	002271	东方雨虹	38,532	1,565,555.16	1.08
11	000651	格力电器	26,200	1,482,134.00	1.02
12	002460	赣锋锂业	27,600	1,478,532.00	1.02
13	603799	华友钴业	38,000	1,476,680.00	1.01
14	300450	先导智能	27,398	1,266,061.58	0.87
15	002850	科达利	17,000	1,176,400.00	0.81
16	000063	中兴通讯	29,200	1,171,796.00	0.81
17	603993	洛阳钼业	272,000	998,240.00	0.69
18	000547	航天发展	65,000	888,550.00	0.61
19	603179	新泉股份	35,080	794,211.20	0.55
20	603659	璞泰来	6,700	690,234.00	0.47

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	601688	华泰证券	4,721,189.06	4.94
2	300232	洲明科技	4,577,721.35	4.79
3	300750	宁德时代	4,436,186.00	4.64
4	000002	万科A	4,284,520.00	4.49
5	600438	通威股份	4,091,955.78	4.28
6	000961	中南建设	4,019,505.00	4.21
7	002271	东方雨虹	3,742,937.20	3.92
8	000651	格力电器	3,514,455.00	3.68
9	300073	当升科技	2,974,903.00	3.11
10	002384	东山精密	2,965,094.00	3.10
11	002050	三花智控	2,649,317.80	2.77
12	300033	同花顺	2,625,506.00	2.75
13	601601	中国太保	2,547,213.00	2.67
14	002402	和而泰	2,313,367.56	2.42
15	600116	三峡水利	1,900,415.00	1.99
16	600362	江西铜业	1,869,917.05	1.96
17	300059	东方财富	1,835,963.00	1.92
18	600048	保利地产	1,814,147.00	1.90
19	600233	圆通速递	1,803,352.50	1.89
20	002541	鸿路钢构	1,772,972.00	1.86

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	300232	洲明科技	4,376,644.22	4.58
2	000002	万科A	3,832,919.00	4.01
3	000961	中南建设	3,371,936.00	3.53
4	601601	中国太保	3,018,190.00	3.16
5	002271	东方雨虹	2,967,889.14	3.11
6	002402	和而泰	2,923,577.46	3.06
7	300750	宁德时代	2,566,869.00	2.69
8	300033	同花顺	2,268,513.00	2.38
9	002541	鸿路钢构	2,227,660.32	2.33
10	000651	格力电器	2,101,495.00	2.20
11	000951	中国重汽	1,946,285.93	2.04
12	300059	东方财富	1,827,636.00	1.91
13	600233	圆通速递	1,791,074.70	1.88
14	600116	三峡水利	1,780,009.36	1.86
15	600048	保利地产	1,615,296.00	1.69
16	002001	新和成	1,604,531.00	1.68
17	600438	通威股份	1,587,840.00	1.66
18	600031	三一重工	1,531,789.10	1.60
19	600362	江西铜业	1,519,155.00	1.59
20	603179	新泉股份	1,505,474.00	1.58

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

买入股票的成本（成交）总额	87,322,325.54
卖出股票的收入（成交）总额	73,689,434.61

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,707,000.00	5.29

	其中：政策性金融债	7,707,000.00	5.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	123,994,722.58	85.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,701,722.58	90.48

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	123041	东财转 2	109,621	16,534,135.43	11.36
2	113011	光大转债	143,020	16,312,861.20	11.21
3	113558	日月转债	78,690	10,437,441.60	7.17
4	132005	15 国资 EB	89,320	9,601,900.00	6.60
5	113551	福特转债	52,390	8,999,554.20	6.18

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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，中国光大银行股份有限公司、华泰证券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	31,029.17
2	应收证券清算款	4,630,248.69
3	应收股利	-
4	应收利息	466,108.11
5	应收申购款	1,274,112.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,401,498.27

7.12.4 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	113011	光大转债	16,312,861.20	11.21
2	113558	日月转债	10,437,441.60	7.17
3	132005	15 国资 EB	9,601,900.00	6.60
4	113551	福特转债	8,999,554.20	6.18
5	128028	赣锋转债	4,438,008.00	3.05
6	123017	寒锐转债	4,356,632.20	2.99
7	128081	海亮转债	3,633,684.21	2.50
8	113547	索发转债	3,578,268.90	2.46
9	113548	石英转债	3,439,345.50	2.36
10	128045	机电转债	3,072,260.96	2.11
11	110042	航电转债	2,998,281.00	2.06
12	113013	国君转债	2,830,241.90	1.94
13	128019	久立转 2	2,578,473.00	1.77
14	110063	鹰 19 转债	2,488,409.50	1.71
15	113025	明泰转债	2,465,782.80	1.69

16	110053	苏银转债	2,042,137.60	1.40
17	127005	长证转债	1,970,282.88	1.35
18	113019	玲珑转债	1,969,622.40	1.35
19	113509	新泉转债	1,935,892.40	1.33
20	113516	苏农转债	1,926,137.60	1.32
21	123002	国祯转债	1,597,641.60	1.10
22	113557	森特转债	1,542,280.40	1.06
23	127007	湖广转债	1,519,319.80	1.04
24	127011	中鼎转 2	1,483,464.40	1.02
25	128048	张行转债	1,135,116.18	0.78
26	113028	环境转债	1,112,063.00	0.76
27	113554	仙鹤转债	805,521.60	0.55

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
华夏可转债增强债券 A	6,000	20,394.03	5,221,244.95	4.27%	117,142,949.64	95.73%
华夏可转债增强债券 I	-	-	-	-	-	-
合计	6,000	20,394.03	5,221,244.95	4.27%	117,142,949.64	95.73%

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	华夏可转债增强债券 A	53,172.40	0.04%
	华夏可转债增强债券 I	-	-
	合计	53,172.40	0.04%

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	华夏可转债增强债券 A	0

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏可转债增强债券 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏可转债增强债券 A	0
	华夏可转债增强债券 I	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏可转债增强债券 A	华夏可转债增强债券 I
基金合同生效日(2016年9月27日)基金份额总额	291,059,125.77	-
本报告期期初基金份额总额	85,009,134.51	-
本报告期基金总申购份额	172,457,420.34	-
减：本报告期基金总赎回份额	135,102,360.26	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	122,364,194.59	-

§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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报

告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
中信证券	3	110,137,375.03	76.23%	80,543.60	77.20%	-
光大证券	1	15,662,433.03	10.84%	11,454.15	10.98%	-
东方证券	1	14,288,352.70	9.89%	10,448.78	10.01%	-
华创证券	1	4,383,220.00	3.03%	1,890.55	1.81%	-

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，在近一年内无重大违规行为。

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 有较强的研究能力，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。

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 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财通证券、长城证券、长江证券、川财证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、国海证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、华西证券、汇丰前海证券、开源证券、民生证券、平安证券、申万宏源证券、天风证券、万和证券、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、中金公司、中泰证券、中信建投证券、中信证券（华南）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，方正证券的部分交易单元、华西证券、开源证券、中航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。

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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	77,261,662.06	48.35%	968,852,000.00	36.56%
光大证券	59,427,705.43	37.19%	211,000,000.00	7.96%
东方证券	8,693,408.55	5.44%	1,138,600,000.00	42.97%
华创证券	14,413,998.60	9.02%	331,500,000.00	12.51%

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	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
2	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
3	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01

§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、《华夏可转债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏可转债增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

二〇二〇年八月二十九日