**华夏基金-东莞农商债券1号资产管理计划2018年第1季度报告**

i_2资产管理人：华夏基金管理有限公司

i_2报告日期：2018-01-01至2018-03-31

资产管理人基本信息

单位名称：华夏基金管理有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

资格批复文号：证监许可[2008]295号

法定代表人：杨明辉

注册资本：2.38亿

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区A区 100033

联系方式：8610 8806 6688

主要财务指标

（一）组合表现

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 主要会计数据和财务指标 | |
| 1 | 本期利润 | 1,841,934.90 |
| 2 | 本期已实现收益 | 1,841,934.90 |
| 3 | 期末资产净值 | 383,915,512.95 |
| 4 | 期末单位净值 | 1.1386 |

（二）净值表现

报告期内，特定资产管理组合净值增长率与同期业绩基准的比较如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 投资时间 | 净值增长率(1)（%） | 业绩比较基准增长率(2)（%） | (1)-(2)（%） |
| 本报告期 | 0.49 | - | 0.49 |

投资组合报告

（一）报告期末投资资产组合情况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 资产种类 | | 金额(元) | 占总资产比例（%） |
| 1 | 股票 | - | - |
| 2 | 债券 | 380,000,000.00 | 98.88 |
| 3 | 权证 | - | - |
| 4 | 基金 | - | - |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 8 | 银行活期存款及清算备付金 | 638.47 | 0.00 |
| 9 | 银行定期存款(定期存款、通知存款、协议存款) | - | - |
| 10 | 其他资产(交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款等) | 4,316,027.51 | 1.12 |
|  | 资产总计 | 384,316,665.98 | 100.00 |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的股票投资组合-A股

2、报告期末按行业分类的股票投资组合-港股

*注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。*

（三）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占资产净值比例（%） |
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| 4 | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 5 | 企业债券 | - | - |
| 6 | 企业短期融资券 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | 380,000,000.00 | 98.99 |
|  | 债券总计 | - | 0.00 |

（四）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名股票明细

（五）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名债券明细

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占资产净值比例（%） |
| 1 | 125714 | 15威国01 | 1,200,000 | 120,000,000.00 | 31.26 |
| 2 | 125702 | 15政通债 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 26.05 |
| 3 | 118413 | 15翔控04 | 800,000 | 80,000,000.00 | 20.84 |
| 4 | 118402 | 15星海02 | 800,000 | 80,000,000.00 | 20.84 |

（六）报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前十名基金明细

（七）报告期末的衍生金融资产明细

（八）报告期内股票投资组合的重大变动

报告期内累计买入价值超出期初组合资产净值2%（至多只列示前20名）的股票明细：

投资组合管理情况

(一) 市场回顾

(二) 组合回顾

(三) 投资展望

其他需要说明的情况

声明

**华夏基金管理有限公司**

**2018年6月28日**