

# 华夏永康添福混合型证券投资基金

基金管理人：华夏基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

## § 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。本半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。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月23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2018年2月1日起至6月30日止。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

基金名称	华夏永康添福混合型证券投资基金
基金简称	华夏永康添福混合
基金代码	006128
交易代码	006128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月1日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
截至期末基金份额总额	203,960,826.38份
基金合同存续期限	不定期

## 2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过定量分析宏观经济、政策形势、证券市场走势的综合分析，合理确定权益类、固定收益类、货币类等资产的配置比例。本基金将主要投资于沪深两市A股以及符合要求的科创板股票。同时根据资产配置比例适当参与可转债及场外衍生品投资，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×15%+中债综合指数收益率×85%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金、货币市场基金。

## 2.3基金管理人及基金托管人

名称	华夏基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
姓名	李刚	职务	董事长
联系电话	400-818-6666	010-66000000	
电子邮箱	service@cniam.com.cn	service@cniam.com.cn	
注册地址	北京市西城区金融大街33号	北京市西城区金融大街33号	
办公地址	北京市西城区金融大街33号	北京市西城区金融大街33号	
邮政编码	100033	100033	
法定代表人	杨明辉	副行长	

## 2.4信息披露方式

基金半年度报告备查地点	基金管理人及基金托管人的住所
-------------	----------------

## § 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

3.1.1期间数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	本报告期末(2018年6月30日)
本期已实现收益	9,742,641.86	
本期利润	1,546,041.83	
加权平均基金份额本期利润	0.0074	
本期加权平均基金份额利润	-0.0348	
本期基金份额净值增长率	-2.17%	
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-4,420,209.07	
期末可供分配基金份额利润	-0.0217	
期末基金资产净值	199,530,617.1	
期末基金份额净值	0.9783	
3.1.3期末基金份额净值增长率	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额净值增长率	-2.17%	

注：①上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据。

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)扣除相关费用后的净额，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基金资产净值中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰孰数。

④本基金合同于2018年2月1日生效。

3.2基金净值表现

3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②	①-②	
过去一个月	-2.83%	0.07%	-0.88%	0.19%	-1.96%	0.48%
过去三个月	-3.21%	0.51%	-0.69%	0.18%	-2.63%	0.33%
自基金合同生效以来	-2.17%	0.41%	-1.04%	0.19%	-1.31%	0.22%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华夏永康添福混合型证券投资基金历史走势图

华夏永康添福混合型证券投资基金历史走势图

注：①本基金合同于2018年2月1日生效。

②根据华夏永康添福混合型证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1基金管理人及基金情况

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设立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有办事处。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、首批内地与联合国责任投资原则组织的公募基金管理人、首批公募FOF基金管理人，以及特定客户资产管理人、国际公募基金投资管理人，香港子公司首批ROPII基金管理人。华夏基金是业务领域广泛的基金管理公司之一。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中(截至2018年6月30日数据)，华夏转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A类)”中排序3/154；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2/152；华夏消费升级ETF、华夏消费升级ETF在“股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金”中分别排序2/115、8/115、9/115。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金业协会颁发的多项奖项。在中国证券报“2017年度上市公司社会责任报告”中荣获“中国基金20周年卓越投资价值基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永康混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报报收奖明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的2018中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金20周年“金基金”TOP基金大奖，华夏沪深300ETF获得第“五届”“金基金”指数基金奖(一年期)，华夏上投ETF获得第“三届”“金基金”指数基金奖(三年期)。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永康混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报报收奖明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报报收奖明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提升客户使用的便利性和服务体验：(1)华夏基金电子交易平台开展华夏财智财富宝A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供更便捷更优质的基金投资方式；(2)微信服务上云端存储取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动情况；华夏基金网上交易平台上线手机扫码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；(3)与中银银行、长城华西银行、西安银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；(4)开展“华夏明星基金有奖寻人”，“华夏基金20周年庆典感恩二十年”、“华夏基金20周年献礼”、“华夏基金客户口碑”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)及基金经理履历的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业资格	说明
何晓斌	本基金的基金经理、助理	2018-02-01	-	6年

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管理人报告期内本基金运作遵信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》及中国证监会其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的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管理人报告期内本基金投资情况的专项说明

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持有管理的所有基金组合，制定并严格执行相应的制度和流程，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，本基金严格执行了《证券投资基金销售管理办法》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价格同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### 4.4报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年上半年，国际方面，美国经济依旧保持稳健的复苏态势，美联储在3月和6月各加息一次，货币政策进一步回归正常化，同时美元指数持续强劲的美国经济以及特朗普政府的减税政策在上半年出现较明显的上涨，此外全球范围内掀起贸易战，全球资本市场波动加剧。欧元区PMI高位回落，经济虽然还处在回升通道但与美国相比稍显疲弱，意大利政局的不确定性一度对市场造成较大的扰动，货币政策方面尚未明确收紧。日本经济表现亦跟随发达国家，今年以来一直在非货币资产上表现相对强势。大宗商品方面原油价格受益于全球经济的复苏其供需叠加通胀预期的升温和政治地缘政治而震荡上行，国内经济表现总体平稳，地产投资和销售在上半年表现依旧靓丽，超出市场预期，社会融资规模增速受到金融去杠杆政策的影响持续下降，通胀水平依旧保持温和。

债券市场上半年表现总体向好但分化加剧，利率债和高等级信用债到期收益率出现明显下行，而中低等级信用债则受到紧缩信用的政策环境影响，到期收益率不断上行，信用利差明显扩大。银行间流动性相较去年明显宽松，同业存单收益率大幅下行，由于受到国内金融去杠杆政策和中美贸易战的持续负面影响，可转债和股票等风险资产在上半年总体表现欠佳。

报告期内，本基金增持了权益资产，提高了组合久期，并维持了一定的杠杆水平。

### 4.4.2报告期内基金的投资组合

截至2018年6月30日，华夏永康添福混合基金份额净值为0.9783元，本报告期基金份额净值增长率为-2.17%，同期业绩比较基准增长率为-1.04%。

### 4.5管理人代表基金投资的股票投资组合的说明

展望下半年，国际方面，美国经济预计还将继续温和复苏，美联储也将按部就班加息以促使其政策进一步正常化。国内货币政策和财政政策都进行了一定程度的调整，在货币政策方面保持流动性的合理充裕，而积极的财政政策将更加积极，这有助于上半年相对从紧的政策环境的一种修正，而积极修正一方面对冲来自下半年经济内生性存在的下行压力，另一方面对冲外部贸易战带来的不确定性。预计下半年基建增速有望企稳回升，消费平稳，全年GDP增速完成6.5%的目标难度不大。通胀方面，PPI随着基数影响逐步回落，CPI稳中向上，整体通胀压力不大。

投资策略方面，随着国内政策基调的改变，前期受抑制的风险资产有望得到阶段修复，而前期表现较好的风险资产也将阶段性承压。具体来看，信用债有望继续看跌，信用利差具有一定的压缩空间，其表现可能好于下半年的债券市场，而利率债的考验则相对更大，市场分歧和预期波动亦明显加大。权益市场短期受到政策催化具备估值修复的机会，尤其是前期受到金融去杠杆政策明显抑制的板块，弹性将会更大。但中期来看，上市公司整体利润增速的下滑，以及可预期的外部环境的持续扰动，股债依然会承受比较大的压力，这些负面影响需要一定的时间去消化。从结构上看，下半年更好看与经济周期相关性相对较弱的新兴成长板块。

2018年上半年，本基金将适度增加信用债，控制权益仓位同时优化持仓结构，并积极参与可转债市场的投资机会。

珍惜基金份额持有人的一份信任和一份责任，本基金将继续秉承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管理人代表基金投资的股票投资组合的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人以公允价值进行权益类估值和份额净值计价，制定了权益类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，进行完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人华夏基金管理有限公司的估值和核算、并复核、审查基金资产净值和基金份额净值、赎回价格，会计师事务所和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管理人代表基金投资的股票投资组合的说明

本基金报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同约定。  
4.8报告期内管理人代表基金资产持有或交易证券品种的说明  
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人数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信情况说明  
在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵循《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司2018年2月1日至2018年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2管理人代表基金投资的股票投资组合的说明  
本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支和利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵循了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3托管人对基金管理人报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见  
本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有需要对报告所载数据进行调整的情形。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1资产负债表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
报告截止日：2018年6月30日  
单位：人民币元

资产	附注	本期末 2018年6月30日
货币资金		1,069,580.27
结算备付金		2,897,389.36
存出保证金		54,977.94
应收利息		227,669,067.93
应收股利		58,933,838.30
其他应收款		168,706,218.49
买入返售金融资产		-
其他流动资产		-
长期股权投资		-
投资性房地产		-
固定资产		-
无形资产		-
递延所得税资产		246,012,579.61
其他资产		-
资产总计		246,012,579.61
负债和所有者权益	附注	本期末 2018年6月30日
负债：		-
应付短期融资券		-
应付票据		-
应付账款		-
应付利息		-
应付股利		-
其他应付款		-
预收账款		-
递延所得税负债		-
其他流动负债		-
长期应付款		-
长期应付债券		-
其他负债		-
所有者权益：		-
实收资本		203,960,826.38
未分配利润		-4,420,209.07
所有者权益合计		199,530,617.31
负债和所有者权益总计		246,012,579.61

注：①报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9783元，基金份额总额203,960,826.38份。

②本基金合同于2018年2月1日生效，本报告期自2018年2月1日至2018年6月30日。

#### 6.2利润表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
本报告期：2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日  
单位：人民币元

项目	附注	2018年2月1日至(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		4,426,697.89
1.利息收入		6,094,427.72
其中：存款利息收入		1,566,292.61
债券利息收入		2,966,417.24
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”号填列)		2,560,719.28
其中：股权投资收益		149,009.63
基金投资收益		-
债券投资收益		1,965,301.68
其他投资收益		-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		646,420.31
其他收入		-116,509.93
二、费用		4,039,098.71
其中：管理费用		2,910,626.06
销售费用		2,022,088.28
其他费用		404,418.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,546,041.83
减：所得税费用		-
净利润(净亏损以“-”号填列)		1,546,041.83

注：本基金合同于2018年2月1日生效，本报告期自2018年2月1日至2018年6月30日。

#### 6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
本报告期：2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日  
单位：人民币元

项目	附注	2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、期初余额		2,022,088.28
二、本期增减变动金额		767,083.94
其中：基金份额持有人申购/赎回款		-
三、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		646,420.31
四、本期期末余额		2,789,172.22

注：①支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理费

②支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费

③支付销售服务费

④支付其他费用

⑤其他

注：本基金合同于2018年2月1日生效，本报告期自2018年2月1日至2018年6月30日。

#### 6.4现金流量表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
本报告期：2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日  
单位：人民币元

项目	2018年2月1日至(基金合同生效日)至2018年6月30日
经营活动产生的现金流量	2,022,088.28
其中：支付给销售机构的客户维护费	767,083.94
投资活动产生的现金流量	767,083.94
其中：支付购买金融资产	-
筹资活动产生的现金流量	-
其中：发行权益工具	-
发行债务工具	-
支付利息	-
支付股利	-
其他	-
汇率变动对现金及现金等价物的影响	-
现金及现金等价物净增加额	2,789,172.22
期初现金及现金等价物余额	94,000,000.00
期末现金及现金等价物余额	96,789,172.22

注：①支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理费

②支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费

③支付销售服务费

④支付其他费用

⑤其他

注：本基金合同于2018年2月1日生效，本报告期自2018年2月1日至2018年6月30日。

#### 6.5所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
本报告期：2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日  
单位：人民币元

项目	附注	2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、期初余额		2,022,088.28
二、本期增减变动金额		767,083.94
其中：基金份额持有人申购/赎回款		-
三、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		646,420.31
四、本期期末余额		2,789,172.22

注：①支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理费

②支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费

③支付销售服务费

④支付其他费用

⑤其他

注：本基金合同于2018年2月1日生效，本报告期自2018年2月1日至2018年6月30日。

#### 6.6现金流量表

会计主体：华夏永康添福混合型证券投资基金  
本报告期：2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年6月30日  
单位：人民币元

项目	2018年2月1日至(基金合同生效日)至2018年6月30日
经营活动产生的现金流量	2,022,088.28
其中：支付给销售机构的客户维护费	767,083.94
投资活动产生的现金流量	767,083.94
其中：支付购买金融资产	-
筹资活动产生的现金流量	-
其中：发行权益工具	-
发行债务工具	-
支付利息	-
支付股利	-
其他	-
汇率变动对现金及现金等价物的影响	-
现金及现金等价物净增加额	2,789,172.22</