华夏希望债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	华夏希望债券	
基金主代码	001011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年3月10日	
报告期末基金份额总额	934,291,198.92份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收入和总回报。	
投资策略	基金将坚持稳健投资,在严格控制风险的基础上,追求较高的当期收入和总回报。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为"中证综合债券指数"。	
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基金、混合基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏希望债券A	华夏希望债券C
下属分级基金的交易代码	001011	001013
报告期末下属分级基金的份额总额	534,385,626.72份	399,905,572.20份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	华夏希望债券A	华夏希望债券C
1.本期已实现收益	-24,176,013.40	-18,394,616.51
2.本期利润	-4,070,530.03	-3,311,112.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0073	-0.0079
4.期末基金资产净值	578,290,818.31	425,749,075.67
5.期末基金份额净值	1.082	1.065

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏希望债券A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.73%	0.24%	1.32%	0.06%	-2.05%	0.18%

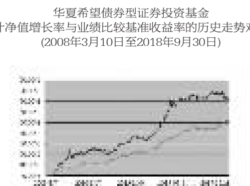
华夏希望债券C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.75%	0.24%	1.32%	0.06%	-2.07%	0.18%

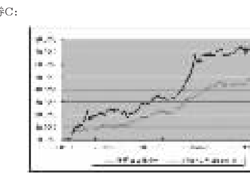
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏希望债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年3月10日至2018年9月30日)

华夏希望债券A:



华夏希望债券C:



§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何家琪	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2017-09-08	-	6年	清华大学应用经济学硕士。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)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遵规守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规,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公平交易专项说明

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,本公司严格执行了《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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度,国际方面,美国经济依然领跑全球,美联储也在加快加息步伐,美元指数冲高回落,整个季度基本持平。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,市场预期2019年欧元区将进入加息周期,欧元出现一定幅度的反弹。日本经济亦跟随发达国家,平均地价27年来首次上涨。大宗商品方面,原油价格受益于全球经济的复苏共振叠加通胀预期的升温和地缘政治影响而震荡上行。国内经济受到内部金融去杠杆政策以及外部贸易战的影响有下行压力,但总体运行仍在年初预定的目标之内,通胀预期伴随油价以及食品价格上升有所升温。

债券市场3季度先扬后抑,前半季度央行通过对MLF质押规则的改变大力支持信用扩张,且超预期的投放大量MLF,资金利率创下年内新低,债券市场收益率出现快速下行,信用利差也出现了明显收缩。后半季度央行通过开展定向正回购维持一定的资金利率水平,且通胀预期开始升温,债券市场收益率开始上行。权益市场维持低位震荡,权重股表现好于中小创,在9月初美国抛出的2000亿关税落地后市场出现一定的反弹。

报告期内,本基金减持了权益资产,降低了组合久期,并维持了一定的杠杆水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华夏希望债券A基金份额净值为1.082元,本报告期份额净值增长率为-0.73%;华夏希望债券C基金份额净值为1.065元,本报告期份额净值增长率为-0.75%,同期业绩比较基准增长率为1.32%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	73,705,531.97	6.07
	其中:股票	73,705,531.97	6.07
2	固定收益投资	996,148,594.56	82.01
	其中:债券	985,345,539.77	81.12
	资产支持证券	10,803,054.79	0.89
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,500,000.00	0.12
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	123,654,949.20	10.18
7	其他各项资产	19,612,305.60	1.61
8	合计	1,214,621,381.33	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	-	-
C	制造业	33,340,445.81	3.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,491,063.00	0.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,896,620.00	0.29
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	8,358,658.00	0.83
J	金融业	22,586,272.16	2.25
K	房地产业	4,059,540.00	0.40
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	972,933.00	0.10
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	73,705,531.97	7.34

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	1,561,500	6,074,235.00	0.60
2	002202	金风科技	407,400	4,892,874.00	0.49
3	600867	通化东宝	172,500	3,129,150.00	0.31
4	600036	招商银行	101,564	3,116,999.16	0.31
5	601166	兴业银行	189,700	3,025,715.00	0.30
6	600487	亨通光电	124,800	2,981,472.00	0.30
7	600705	中航资本	634,300	2,962,181.00	0.30
8	000963	华东医药	69,000	2,896,620.00	0.29
9	600885	宏发股份	94,700	2,130,750.00	0.21
10	000002	万科A	84,900	2,063,070.00	0.21

5.4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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,516,000.00	9.02
	其中:政策性金融债	90,516,000.00	9.02
4	企业债券	581,421,489.70	57.91
5	企业短期融资券	90,445,000.00	9.01
6	中期票据	168,197,200.00	16.75
7	可转债(可交换债)	54,765,850.07	5.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	985,345,539.77	98.14

5.5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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041800176	18绿城房产CP003	500,000	50,395,000.00	5.02
2	018005	国开1701	500,000	50,300,000.00	5.01
3	124548	14裕峰债	400,000	41,884,000.00	4.17
4	122956	09常高新	411,770	41,592,887.70	4.14
5	124753	14海控01	300,000	30,918,000.00	3.08

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比(%)
1	146426	17易鑫B	100,000.00	10,034,654.79	1.00
2	142911	PR优A	170,000.00	768,400.00	0.08
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.7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。
5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1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。
5.9.2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。
5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1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。
5.10.2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。
5.10.3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。
5.11投资组合报告附注
5.11.1报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.11.2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。
5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	150,112.17
2	应收证券清算款	1,335,419.31
3	应收股利	-
4	应收利息	18,031,708.90
5	应收申购款	95,065.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,612,305.60

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110042	航电转债	10,217,056.00	1.02
2	113019	玲珑转债	8,290,848.00	0.83
3	128024	宁行转债	7,420,323.09	0.74
4	123007	道氏转债	6,903,128.00	0.69
5	128015	久其转债	6,871,049.28	0.68
6	110032	三一转债	6,732,367.20	0.67
7	123006	东财转债	1,993,364.10	0.20

5.11.5报告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。
5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏希望债券A	华夏希望债券C
本报告期期初基金份额总额	550,598,270.60	416,587,278.51
报告期基金总申购份额	179,734,956.49	97,145,513.19
减:报告期基金总赎回份额	195,947,600.37	113,827,219.50
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	534,385,626.72	399,905,572.20

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1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。
8.2影响投资者决策的其他重要信息
1、报告期内披露的主要事项
2018年7月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。
2018年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增开源证券股份有限公司为代销机构的公告。
2018年8月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告。
2018年8月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国国际金融股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。
2、其他相关信息
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,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9月28日数据),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1/153;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8/151;华夏沪港通恒生ETF、华夏医药ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序2/113、8/113;华夏沪深300指数增强(C类)在"股票基金-指数股票型基金-增强指数股票型基金(非A类)"中排序7/18,华夏沪港通恒生ETF联接(A类)、华夏上证50ETF联接(A类)在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF联接基金(A类)"中分别排序1/75和9/75。
在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;
9.1.2《华夏希望债券型证券投资基金基金合同》;
9.1.3《华夏希望债券型证券投资基金托管协议》;
9.1.4法律意见书;
9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;
9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。
9.2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。
9.3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
二〇一八年十月二十六日

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	华夏沪深300ETF联接	
基金主代码	000051	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年7月10日	
报告期末基金份额总额	11,658,829,313.28份	
投资目标	采用指数化投资方式,追求对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。	
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率,评价时应按期间折算)。	
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏沪深300ETF联接A	华夏沪深300ETF联接C
下属分级基金的交易代码	000051	005658
报告期末下属分级基金的份额总额	10,654,862,905.32份	1,003,966,407.96份

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	华夏沪深300ETF联接A	华夏沪深300ETF联接C
1.本期已实现收益	61,185,486.13	4,999,398.60
2.本期利润	-20,231,751.93	7,156,339.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0021	0.0079
4.期末基金资产净值	12,167,369,287.52	1,143,653,027.95
5.期末基金份额净值	1.142	1.139

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

华夏沪深300ETF联接A:

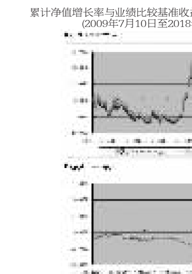
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.78%	1.29%	-1.70%	1.29%	0.92%	0.00%

华夏沪深300ETF联接C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.87%	1.28%	-1.70%	1.29%	0.83%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年7月10日至2018年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2009-07-10	-	18年	硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理,上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日至2016年3月28日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年8月9日至2017年11月10日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年2月12日至2017年11月10日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年1月13日至2017年11月10日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2012年8月21日至2017年11月10日期间)、华夏MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2015年2月12日至2017年11月10日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2014年12月23日至2017年11月10日期间)等。
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2017-04-17	-	10年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员,嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理,嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016年11月加入华夏基金管理有限公司。

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遵规守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规,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 公平交易专项说明

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,本公司严格执行了《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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深300指数,业绩基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率,评价时应按期间折算)。沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成,于2005年4月8日正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深300指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金的投资策略主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF(华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金)的份额,从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

3季度,国际贸易、世界经济仍在复苏,但部分指标表现不尽人意,波罗的海干散货指数(BDI指数)8月末比月初下降了10.3%,世界贸易组织(WTO)公布的世界贸易景气指数3季度为100.3,较1季度和2季度分别回落了2%和1.5%,贸易保护给世界经济复苏包括国际贸易扩张蒙上了阴影。国内方面,主要的经济指标增速有所放缓,但工业增加值、服务业生产指数、社会消费品零售总额以及固定资产投资等主要指标总体稳定;经济结构继续优化,装备制造业、战略性新兴产业和高技术产业都保持较快的增长;经济运行总体平稳、稳中向好的发展态势仍在持续。

市场方面,随着市场风险偏好的下降,A股指数震荡走低,两市成交持续萎缩,融资余额继续下降,跨境资金继续流入。9月初,A股纳入MSCI指数第二步实施完成,纳入比例提高到5%,A股国际化进程加速。

基金投资运作方面,报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华夏沪深300ETF联接A份额净值为1.142元,本报告期份额净值增长率为-0.78%,同期业绩比较基准增长率-1.70%,华夏沪深300ETF联接A本报告期跟踪偏离度为+0.92%;华夏沪深300ETF联接C份额净值为1.139元,本报告期份额净值增长率为-0.87%,同期业绩比较基准增长率为-1.70%,华夏沪深300ETF联接C本报告期跟踪偏离度为+0.83%。与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	134,513,065.49	1.01
	其中:股票	134,513,065.49	1.01
2	基金投资	12,479,938,027.16	93.67
3	固定收益投资	422,018,928.50	3.17
	其中:债券	422,018,928.50	3.17
	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	10,000,000.00	0.08
	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	259,350,299.93	1.95
8	其他各项资产	16,925,018.43	0.13
9	合计	13,322,745,339.51	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	12,479,938,027.16	93.76

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1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	407,306.00	0.00
B	采矿业	3,800,731.00	0.03
C	制造业	62,462,443.65	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,994,374.00	0.02
E	建筑业	3,500,132.90	0.03
F	批发和零售业	2,854,967.51	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,143,779.10	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,704,751.07	0.04
J	金融业	36,891,215.88	0.28
K	房地产业	7,537,982.73	0.06
L	租赁和商务服务业	2,295,586.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	613,870.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,136,459.05	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,169,466.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	134,513,065.49	1.01

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	108,000	7,398,000.00	0.06
2	000333	美的集团	99,600	4,190,172.00	0.03
3	000651	格力电器	102,346	4,114,309.20	0.03
4	600519	贵州茅台	5,300	3,869,000.00	0.03
5	600036	招商银行	102,800	3,154,932.00	0.02
6	000858	五粮液	42,645	2,897,727.75	0.02
7	000002	万科A	103,300	2,510,190.00	0.02
8	002415	海康威视	78,450	2,254,653.00	0.02
9	000001	平安银行	182,496	2,016,580.80	0.02
10	601166	兴业银行	124,300	1,982,585.00	0.01

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	422,008,000.00	3.17
	其中:政策性金融债	422,008,000.00	3.17
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)	10,928.50	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	422,018,928.50	3.17

5.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180404	18农发04	3,200,000	321,568,000.00	2.42
2	180201	18国开01	1,000,000	100,440,000.00	0.75
3	110045	海澜转债	110	10,928.50	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。
5.8 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。
5.9 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.1 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。
5.11.2 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。
5.11.3 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。
5.12投资组合报告附注
5.12.1报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.12.2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。
5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	743,922.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,310,055.31
5	应收申购款	5,871,041.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,925,018.43

5.12.4报告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。
5.12.5报告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。
5.12.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华夏沪深300ETF联接A	华夏沪深300ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	8,898,064,863.08	453,883,665.63
报告期基金总申购份额	2,305,323,902.39	569,934,324.09
减:报告期基金总赎回份额	548,525,860.15	19,851,581.76
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,654,862,905.32	1,003,966,407.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018-07-01至2018-09-30	3,165,171,812.25	-	-	3,165,171,812.25	27.15%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
1、报告期内披露的主要事项
2018年7月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。
2018年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年8月8日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增开源证券股份有限公司为代销机构的公告。
2018年8月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告。
2018年8月20日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国国际金融股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。
2018年9月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构的公告。
2018年9月12日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告。
2018年9月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中民财富基金销售(上海)有限公司为代销机构的公告。
2、其他相关信息
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,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、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏MSCI中国A股国际通ETF、华夏中小板ETF、华夏中证500ETF、华夏创业板ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏快线货币ETF和华夏3-5年中高级可质押信用债ETF等,初步形成了覆盖宽基指数、行业指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、A股市场指数、海外市场指数、信用债指数等较为完整的产品线。
在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;
9.1.2《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;
9.1.3《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;
9.1.4法律意见书;
9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;
9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。
9.2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。
9.3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
二〇一八年十月二十六日

华夏盛世精选混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏盛世混合
基金主代码	000061
交易代码	000061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	1,471,934,718.98份
投资目标	紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。
投资策略	本基金以周期优选投资策略为核心,并辅以个股精选和积极债券管理策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%。
风险收益特征	本基金风险与收益高于债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-86,863,452.08
2.本期利润	-62,871,928.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0429
4.期末基金资产净值	897,220,321.34
5.期末基金份额净值	0.610

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。

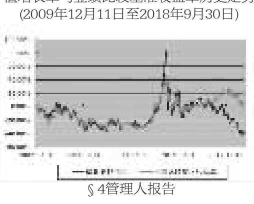
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.58%	1.75%	-1.38%	1.09%	-5.20%	0.66%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

华夏盛世精选混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年12月11日至2018年9月30日)



§4管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
代瑞亮	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-07-09	-	8年	北京大学金融学硕士。2010年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理,华夏回报二号证券投资基金基金经理(2015年3月17日至2017年2月24日期间)、华夏回报证券投资基金基金经理(2015年3月17日至2017年2月24日期间)、华夏高端制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年5月11日至2018年1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遵规守信情况的说明

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》、基金合同和其他有关法律法规,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 公平交易专项说明

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,本公司严格执行了《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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度,全球经济态势较为平稳,美国经济延续超预期增长,美联储再次加息。全球不确定性因素有增无减,中美贸易战持续升温,中美关系和全球贸易格局面临大变格局。美元指数高位震荡,人民币经历了2季度末快速贬值后3季度暂时维持稳定,原油价格强势突破,美国主要股票指数保持稳定。中国仍然延续去杠杆、严监管、控风险的政策导向,高杠杆、重资产类企业压力巨大,上市公司大股东股票质押预警甚至平仓的风险事件在相关部门重视下得到一定缓解。在"房住不炒"的大政指引下,房地产成交数据惨淡,土地拍卖流拍现象严重。主要工业数据出现不同程度的下滑,消费数据也显著变差。A股主要指数震荡寻底,5G主题阶段性表现突出,在富时指数对A股提升配置比例计划的刺激下,3季度末上证50表现强势。

报告期内,本基金坚持寻找行业趋势较好、执行力较强的优质公司进行长期跟踪与投资,基于宏观背景发生巨大变化和我国面临的产业变化,本基金持续优化配置,重点配置了半导体、国产软件、军工等领域,继续减持了资金面紧张的个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为0.610元,本报告期份额净值增长率为-6.58%,同期业绩比较基准增长率为-1.38%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	793,265,142.12	86.49
	其中:股票	793,265,142.12	86.49
2	固定收益投资	30,051,000.00	3.28
	其中:债券	30,051,000.00	3.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	92,956,528.30	10.13
7	其他各项资产	932,805.19	0.10
8	合计	917,205,475.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	44,016,000.00	4.91
C	制造业	524,152,767.77	58.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33.28	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,374,373.50	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	38,035,000.00	4.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,353,717.70	16.09
J	金融业	212,249.87	0.02
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	39,121,000.00	4.36
S	综合	-	-
	合计	793,265,142.12	88.41

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600760	中航沈飞	1,489,952	56,767,171.20	6.33
2	002371	北方华创	1,130,000	53,177,800.00	5.93
3	000636	风华高科	3,300,000	49,632,000.00	5.53
4	601857	中国石油	4,800,000	44,016,000.00	4.91
5	000681	视觉中国	1,450,000	39,121,000.00	4.36
6	000977	浪潮信息	1,599,950	38,526,796.00	4.29
7	002368	太极股份	1,250,000	38,262,500.00	4.26
8	600536	中国软件	1,249,998	36,437,441.70	4.06
9	600372	中航电子	2,343,030	33,880,213.80	3.78
10	300661	圣邦股份	350,891	33,264,466.80	3.71

5.4 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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,051,000.00	3.35
	其中:政策性金融债	30,051,000.00	3.35
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,051,000.00	3.35

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180209	18国开09	300,000	30,051,000.00	3.35
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。
5.7 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。
5.8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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1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。
5.9.2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。
5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 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。
5.11投资组合报告附注
5.11.1 2018年8月7日风华高科受到中国证券监督管理委员会立案调查。2018年9月7日风华高科收到了深圳证券交易所《关于对广东风华高新科技股份有限公司及相关当事人给予纪律处分的决定》。本基金投资该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。
5.11.2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。
5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	611,252.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	245,546.62
5	应收申购款	76,005.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	932,805.19

5.11.4报告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。
5.11.5报告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。
5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,459,177,432.85
报告期基金总申购份额	39,643,892.27
减:报告期基金总赎回份额	26,886,606.14
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,471,934,718.98

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
1、报告期内披露的主要事项
2018年7月5日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年7月5日发布关于华夏基金管理有限公司旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。
2018年7月26日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。
2018年8月9日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告。
2、其他相关信息
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,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9月28日数据),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1/153;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8/151;华夏沪港通恒生ETF、华夏医药ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序2/113、8/113;华夏沪深300指数增强(C类)在"股票基金-指数股票型基金-增强指数股票型基金(非A类)"中排序7/18,华夏沪港通恒生ETF联接(A类)、华夏上证50ETF联接(A类)在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF联接基金(A类)"中分别排序1/75和9/75。
在客户服务方面,3季度,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)华夏基金网上交易平台上线闪购业务,为客户提供了更便捷的基金交易方式;(2)对在线智能服务进行全新升级,将机器人小夏全面升级为理财小助手,帮助投资人一搜即达,让投资理财更加便捷、高效;(3)与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"世界那么大,定投华夏基金再出发"、"揭秘'团长与团员默契度'"等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;
9.1.2《华夏盛世精选混合型证券投资基金基金合同》;
9.1.3《华夏盛世精选混合型证券投资基金托管协议》;
9.1.4法律意见书;
9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;
9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。
9.2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。
9.3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
二〇一八年十月二十六日