华夏新机遇灵活配置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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	华夏新机遇混合
基金主代码	002411
交易代码	002411
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月30日
报告期末基金份额总额	154,457,717.79份
投资目标	在控制风险的前提下,把握市场机会,追求资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势,采用"自上而下"的分析视角,综合考量宏观经济发展前景,评估各类资产的预期收益与风险,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时做出动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合基金,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	中信银行股份有限公司

§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	-11,969,800.87
2.本期利润	-1,593,267.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0099
4.期末基金资产净值	152,847,048.10
5.期末基金份额净值	0.990

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	-0.10%	0.66%	-0.44%	0.68%	0.34%	-0.02%

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

华夏新机遇灵活配置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

(2016年3月30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		
柳万军	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016-03-30	-	11年	中国人民银行研究生部金融学硕士。曾任中国人民银行上海总部副主任科员、泰康资产固定收益部投资经理、交银施罗德基金固定收益部基金经理助理等。2013年6月加入华夏基金管理有限公司,曾任固定收益部研究员,华夏货币市场基金基金经理(2013年12月31日至2017年8月7日期间)、华夏薪金宝货币市场基金基金经理(2014年5月26日至2017年8月7日期间)、华夏恒利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(2016年3月29日至2018年6月28日期间)等。
祝灿	本基金的基金经理、机构债券投资部总监	2016-04-14	-	17年	芝加哥大学工商管理硕士。曾任中信证券投资管理部投资经理、德意志银行新加坡分行交易员等。2013年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构债券投资部投资经理,华夏鼎益债券型证券投资基金基金经理(2016年12月27日至2017年12月28日期间)、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理(2017年6月15日至2018年3月14日期间)、华夏鼎茂债券型证券投资基金基金经理(2017年3月15日至2018年3月29日期间)等。
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2017-09-08	-	10年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理、投资经理,华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2013年3月11日至2017年2月24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

国内方面,受金融去杠杆向实体去杠杆传导,宏观经济在3季度步入下行轨道,投资增速持续下滑,房地产投资仍然是唯一亮点;社零增速继续回落,主要受家电家具等后房地产周期产业链及汽车板块拖累。但从政策面来看,季度中期中央接连出台稳增长政策,对理财新规、信用传导、财政支出等均有放松刺激措施出台,信贷社融已有边际恢复,经济硬着陆的可能性较低。利率层面,总体看流动性较为宽松,但淤积在银行间,向实体传导通道不畅。国外经济整体平稳,贸易战目前暂未明显影响贸易增长,美国仍然处于一枝独秀状态。

3季度,受贸易战持续升级和宏观经济下行影响,整体市场承压,但在财政货币刺激政策出台后,风格分化严重,典型特征为上证50录得正收益,中小板跌幅在10%以上。受益于去杠杆转向,金融,周期,地产涨幅居前,大消费行业受社零数据影响跌幅较大,其中家电、医药、纺织服装跌幅居前;题材类5G,军工则录得区间不错表现。

报告期内,本基金大幅减持与经济相关度较高的金融板块股票,减仓食品饮料以及医药等消费股,主要加仓与经济相关度较低的化工板块以及5G相关股票。

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0.990元,本报告期份额净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准增长率为-0.44%。

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	52,989,728.05	30.30
	其中:股票	52,989,728.05	30.30
2	固定收益投资	114,819,500.00	65.66
	其中:债券	110,600,500.00	63.25
	资产支持证券	4,219,000.00	2.41
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	3,300,351.26	1.89
7	其他各项资产	3,752,418.46	2.15
8	合计	174,861,997.77	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	36,923,319.05	24.16
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	2,763,000.00	1.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,063,681.00	5.93
L	租赁和商务服务业	2,383,392.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	1,851,000.00	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	5,336.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,989,728.05	34.67

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	000002	万科A	300,000	7,290,000.00	4.77
2	002258	利尔化学	340,200	6,491,016.00	4.25
3	002557	洽洽食品	360,000	6,213,600.00	4.07
4	300232	洲明科技	600,000	5,850,000.00	3.83
5	002821	凯莱英	78,600	5,674,134.00	3.71
6	000739	普洛药业	500,000	3,515,000.00	2.30
7	300121	阳谷华泰	289,330	3,208,669.70	2.10
8	300326	凯利泰	303,800	2,931,670.00	1.92
9	002373	千方科技	245,600	2,763,000.00	1.81
10	002127	南极电商	325,600	2,383,392.00	1.56

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	11,066,000.00	7.24
	其中:政策性金融债	11,066,000.00	7.24
4	企业债券	54,439,600.00	35.62
5	企业短期融资券	45,094,900.00	29.50
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	110,600,500.00	72.36

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	122488	15金地01	130,000	12,875,200.00	8.42
2	011801761	18金融街投SCP001	120,000	12,009,600.00	7.86
3	136499	16洪市政	120,000	11,685,600.00	7.65
4	018005	国开1701	110,000	11,066,000.00	7.24
5	136046	15中海01	110,000	11,025,300.00	7.21

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	081800005	18狮桥融资ABN001优先A	100,000.00	4,219,000.00	2.76
2	-	-	-	-	-
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	439,488.33
2	应收证券清算款	1,727,455.05
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,275.38
5	应收申购款	199.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,752,418.46

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	233,800,640.72
报告期基金总申购份额	497,914.46
减:报告期基金总赎回份额	79,840,837.39
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	154,457,717.79

§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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	2018-07-09至2018-09-30	31,467,084.85	-	-	31,467,084.85	20.37%
	2	2018-07-09至2018-09-30	41,956,462.78	-	-	41,956,462.78	27.16%
	3	2018-07-09至2018-09-30	41,956,462.78	-	-	41,956,462.78	27.16%
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。

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中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏新机遇灵活配置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

华夏大中华信用精选债券型证券投资基金(QDII)

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	华夏大中华信用债券(QDII)	
基金主代码	002877	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年7月27日	
报告期末基金份额总额	322,545,083.60份	
投资目标	力争本金安全的基础上,发掘境内外中资企业信用债债券价值洼地,把握不同市场的轮动上涨规律,追求持续、稳定的收益。	
投资策略	本基金主要通过采取国家/地区配置策略、债券类属配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、久期管理策略、国债期货投资策略、汇率避险策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	50%*中债综合指数+50%*摩根大通亚洲信用债指数中国子指数(J.P. Morgan Asia Credit Index China)。	
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,属于较低风险、较低收益的品种。同时,本基金为全球证券投资的基金,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited	
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏大中华信用债券(QDII)A	华夏大中华信用债券(QDII)C
下属分级基金的交易代码	002877	002880
报告期末下属分级基金的份额总额	300,481,849.00份	22,063,234.60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)	
	华夏大中华信用债券(QDII)A	华夏大中华信用债券(QDII)C
1.本期已实现收益	3,851,866.47	243,276.90
2.本期利润	12,424,105.12	828,860.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0395	0.0361
4.期末基金资产净值	305,069,498.23	22,157,319.35
5.期末基金份额净值	1.015	1.004

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

华夏大中华信用债券(QDII)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	3.89%	0.18%	2.71%	0.16%	1.18%	0.02%

华夏大中华信用债券(QDII)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	3.83%	0.19%	2.71%	0.16%	1.12%	0.03%

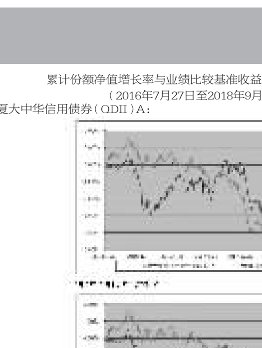
3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏大中华信用精选债券型证券投资基金(QDII)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年7月27日至2018年9月30日)

华夏大中华信用债券(QDII)A:



§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		
祝灿	本基金的基金经理、机构债券投资部总监	2017-09-08	-	17年	芝加哥大学工商管理硕士。曾任中信证券投资管理部投资经理、德意志银行新加坡分行交易员等。2013年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任机构债券投资部投资经理,华夏鼎益债券型证券投资基金基金经理(2016年12月27日至2017年12月28日期间)、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理(2017年6月15日至2018年3月14日期间)、华夏鼎茂债券型证券投资基金基金经理(2017年3月15日至2018年3月29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

回顾3季度,发达经济体数据总体稳健,美国经济增长保持强劲,主要反映在劳动力市场持续收紧、工资增长明显上行和内需持续增长,但PMI受贸易战影响略有下滑,前期持续超预期的CPI也意外走低。欧元区经济较2季度略有改善,但制造业增长仍相对疲软。货币政策方面,美联储依旧维持渐进的加息策略,今年9月和12月两次加息已经完全被市场预期,而欧央行在9月的会议上下调了经济预期,预计今年欧元区经济增长2.0%,2019年和2020年经济增长1.8%和1.7%。欧洲央行行长德拉吉指出,欧洲央行下调经济预期的主因是全球保护主义加剧、新兴市场脆弱、金融市场动荡造成了外部不确定性日益加剧。美元的涨势在3季度有所放缓,美元指数在8月中旬冲高至97附近后回落到3季度初的水平,欧元反弹至1.17上方,人民币对美元从低点6.90反弹至6.85。3季度末,美国十年期国债收益率随着工资增长超预期和贸易战短期利空出尽影响突破上行,并已接近年内高点3.10%。国内经济数据显示增长进一步放缓,但政府适时推出了一系列稳定增长的政策,市场预期趋于稳定。受外部利率上行和国内通胀担忧出现,国内债券利率水平自前期低点有所反弹。

3季度的前两个月,亚洲美元债券市场出现显著的反弹,主要因素在于国内开始通过宽信用松货币的措施稳定经济下行的预期,境外发债的中资企业信用风险和再融资风险显著降低,前期做空中资离岸美元债的市场参与者开始回补空仓,导致债券价格迅速反弹。从板块看,中资城投债和濒临流动性危机的工业企业债券涨幅最大。房地产板块债券有所反弹,但内部有所分化。9月中资美元债市场部分回吐涨幅,但成交量已经逐渐放大,新债发行节奏加快,市场信心复苏迹象明显。国内债券市场方面,国债与国开债利率在3季度先下后上;信用债方面,3季度的前两月,高等级城投信用利差出现明显收窄,但资质较差的民企债券收益率仍处于较高水平。

报告期内,本基金利用宽信用带来的市场上涨窗口,积极调仓换券,增配了受益于宏观政策确定性大的公司债券,继续减持再融资风险未充分暴露的债券。3季度新发行的中资离岸美元债券,票息和资质都具有明显优势,组合也积极参与了配置。由于境外美元债收益已经见顶回落,且收益率绝对水平较境内同等级信用债具备较大优势,本基金增加了美元债的配置比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华夏大中华信用债券(QDII)A基金份额净值为1.015元,本报告期份额净值增长率为3.89%;华夏大中华信用债券(QDII)C基金份额净值为1.004元,本报告期份额净值增长率为3.83%,同期业绩比较基准增长率为2.71%。

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	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	1,399,881.43	0.35
3	固定收益投资	358,886,682.88	88.99
	其中:债券	342,462,282.88	84.92
	资产支持证券	16,424,400.00	4.07
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,977,207.58	4.21
8	其他各项资产	26,006,416.45	6.45
9	合计	403,270,188.34	100.00

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
AAA+至AAA-	136,582,720.00	41.74
AA+至AA-	16,386,850.00	5.01
A+至A-	30,349,545.30	9.27
BBB+至BBB-	29,885,838.27	9.13
BB+至BB-	62,977,414.00	19.25
B+至B-	66,279,915.31	20.26

注:本债券投资组合采用专业评级机构提供的债券信用评级信息,未提供评级信息的可适用内部评级。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	18005	国开1701	20,714,000	20,838,284.00	6.37
2	143658	18金地04	20,000,000	20,140,000.00	6.15
3	122410	15龙湖03	20,000,000	19,766,000.00	6.04
4	112307	15投资01	20,000,000	19,582,000.00	5.98
5	XS1628314889	HILONG HOLDING LTD 7	15,134,240	14,999,242.58	4.58

注:①债券代码为ISIN或当地市场代码。

②数量列示债券面值,外币按照期末估值汇率折为人民币,四舍五入保留整数。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142392	PR远东5A	560,000.00	15,428,000.00	4.71
2	142297	PR一A2	40,000.00	996,400.00	0.30
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

注:证券代码采用当地市场代码。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	DOUBLE-LINE FUNDS/USA	债券型	封闭式基金	Doubleline Capital LP	1,399,881.43	0.43
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,553.74
2	应收证券清算款	20,907,131.72
3	应收股利	9,355.64
4	应收利息	5,040,181.07
5	应收申购款	39,194.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,006,416.45

5.10.4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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6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	华夏大中华信用债券(QDII)A	华夏大中华信用债券(QDII)C
本报告期期初基金份额总额	331,336,177.96	22,615,849.06
报告期基金总申购份额	5,737,017.77	4,738,187.14
减:报告期基金总赎回份额	36,591,346.73	5,290,801.60
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	300,481,849.00	22,063,234.60

§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中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏大中华信用精选债券型证券投资基金(QDII)基金合同》;

9.1.3《华夏大中华信用精选债券型证券投资基金(QDII)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

华夏网购精选灵活配置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	华夏网购精选混合
基金主代码	002837
交易代码	002837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	56,171,913.84份
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略,力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略,网购消费大数据指的是由蚂蚁金服提供的网上消费行业统计型趋势大数据,包括销售额存量长期增长、销售额长期增长、成交笔数长期增长、订单量存量长期增长、销售额存量同比、价格同比等数据。本基金是灵活配置混合型基金,在资产配置策略和股票投资策略上均应用网购消费大数据,充分利用公司大数据研究平台的优势,分析研究网购消费大数据,力求为投资者把握网购消费大数据中的投资机会。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金属于混合基金,风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金,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	中国工商银行股份有限公司

§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	上期金额
1.本期已实现收益	-306,399.81
2.本期利润	-3,030,341.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0534
4.期末基金资产净值	48,635,805.84
5.期末基金份额净值	0.866

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

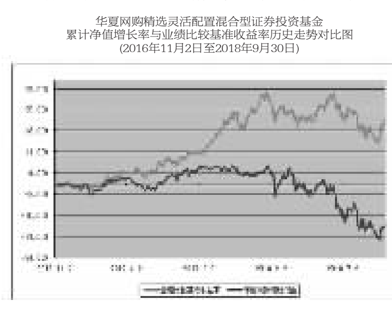
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.77%	1.31%	-1.98%	0.85%	-3.79%	0.46%

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

华夏网购精选灵活配置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

(2016年11月2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	2016-11-02	-	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。

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

3季度,国际方面,美国经济数据良好,美联储进行了本年度的第3次加息,并将每个月的缩表上限提高至500亿美元;欧洲则复苏态势有所放缓。国内方面,经济本身较为平稳,但也存在较大下行压力。生产端,继续进行供给侧改革,并侧重于提供有效供给;需求端,美国发动的贸易战增加了出口的不确定性,成为未来经济运行最大的不确定性因素。为确保经济的平稳运行,政府强调要加大基建补短板力度,稳定有效投资。在金融去杠杆方面,政策执行上逐渐转向稳杠杆。汇率方面,报告期初美元升值明显,人民币贬值幅度较大,央行重启逆周期因子,人民币汇率波幅收窄。

市场方面,受贸易战、新兴市场汇率风险、社保补缴等诸多因素影响,市场风险偏好明显降低,A股市场经历了较大幅度的调整;报告期末,随着国务院常务会议强调降税减费、有关部门发文提高企业研发费用税前扣除比例及富时罗素将A股纳入其指数体系等利好因素累积,市场情绪有所修复。

基金投资运作方面,作为灵活配置型基金,我们依据模型在报告期内进行了量化模型择时,仓位保持在相对稳健的水平。行业和股票选择上,我们结合网购数据以及量化选择模型进行组合构建。

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0.866元,本报告期份额净值增长率为-5.77%,同期业绩比较基准增长率为-1.98%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2018年8月15日至2018年9月30日出现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	42,992,140.29	87.48
	其中:股票	42,992,140.29	87.48
2	固定收益投资	36,496.83	0.07
	其中:债券	36,496.83	0.07
	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	5,597,853.10	11.39
7	其他各项资产	518,511.74	1.06
8	合计	49,145,001.96	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	801,227.00	1.65
C	制造业	25,587,030.73	52.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	903,154.00	1.86
E	建筑业	935,570.60	1.92
F	批发和零售业	2,682,070.20	5.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,105,298.00	2.27
H	住宿和餐饮业	50,160.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,784,051.06	3.67
J	金融业	5,576,004.20	11.46
K	房地产业	1,498,135.62	3.08
L	租赁和商务服务业	1,088,149.88	2.24
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	981,289.00	2.02
S	综合	-	-
	合计	42,992,140.29	88.40

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	600519	贵州茅台	1,800	1,314,000.00	2.70
2	601318	中国平安	14,000	959,000.00	1.97
3	000651	格力电器	22,774	915,514.80	1.88
4	601186	中国铁建	58,000	646,700.00	1.33
5	601166	兴业银行	40,200	641,190.00	1.32
6	600016	民生银行	97,680	619,291.20	1.27
7	601328	交通银行	96,100	561,224.00	1.15
8	600486	扬农化工	12,000	556,320.00	1.14
9	601601	中国太保	13,900	493,589.00	1.01
10	600606	绿地控股	74,300	475,520.00	0.98

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	36,496.83	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	36,496.83	0.08

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	110040	生益转债	180	19,224.00	0.04
2	128017	金禾转债	105	10,776.15	0.02
3	113013	国君转债	60	6,276.00	0.01
4	128029	太阳转债	2	220.68	0.00
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	1,160.06
2	应收证券清算款	500,465.75
3	应收股利	-
4	应收利息	1,898.90
5	应收申购款	14,987.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	518,511.74

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	110040	生益转债	19,224.00	0.04
2	128017	金禾转债	10,776.15	0.02
3	113013	国君转债	6,276.00	0.01
4	128029	太阳转债	220.68	0.00

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	57,673,527.66
报告期基金总申购份额	1,194,819.76
减:报告期基金总赎回份额	2,696,433.58
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	56,171,913.84

§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。

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中国证监会准予基金注册的文件;

9.1.2《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏网购精选灵活配置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