华夏薪金宝货币市场基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月二十一日

§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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏薪金宝货币
基金主代码	000645
交易代码	000645
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月26日
报告期末基金份额总额	19,162,393,683.36份
投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、个券选择策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	155,249,142.64
2.本期利润	155,249,142.64
3.期末基金资产净值	19,162,393,683.36

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

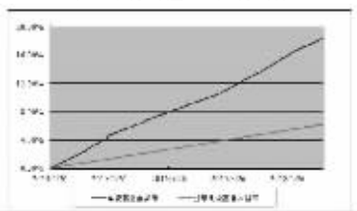
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7752%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.4349%	0.0013%

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

华夏薪金宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年5月26日至2018年12月31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		
曲波	本基金的基金经理、董事总经理	2014-07-25	-	15年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司。曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理、固定收益部总经理助理、现金管理部总经理、华夏安康信用优选债券型证券投资基金基金经理(2012年9月11日至2014年7月25日期间)。华夏货币市场基金基金经理(2012年8月1日至2014年7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

4季度,央行仍然执行了较为宽松的货币政策,市场收益率基本在低水平情况下平稳运行。12月中旬开始,由于年底因素扰动,收益率有所上行,但幅度也明显低于往年,仅有30bp左右。

报告期内,鉴于货币市场利率较低且期限利差明显,本基金基本上以中性杠杆、较高久期操作为主,实现了较好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金本报告期份额净值收益率为0.7752%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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	固定收益投资	15,567,479,051.50	70.18
	其中:债券	15,567,479,051.50	70.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	500,000,000.00	2.25
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,059,223,333.79	27.32
4	其他各项资产	55,950,304.88	0.25
5	合计	22,182,652,690.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.39	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,999,008,076.47	15.65
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	105

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	3.60	15.65
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.08	-
3	60天(含)-90天	40.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	19.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	46.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.48	15.65

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	219,060,377.21	1.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,441,924,901.44	7.52
	其中:政策性金融债	1,441,924,901.44	7.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	270,000,119.08	1.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	13,636,493,653.77	71.16
8	其他	-	-
9	合计	15,567,479,051.50	81.24
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	590,582,371.82	3.08

5.6报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111815645	18民生银行CD045	15,000,000	1,488,330,438.92	7.77
2	1111896900	18徽商银行CD156	14,000,000	1,386,359,031.60	7.23
3	1118094220	18浦发银行CD420	10,000,000	992,218,496.07	5.18
4	1118185391	18成都农商银行CD017	9,500,000	943,227,518.64	4.92
5	1111822095	18厦门国际银行CD179	9,500,000	930,961,204.09	4.86
6	1111838471	18成都银行CD271	8,000,000	790,534,069.63	4.13
7	1111838499	18天津银行CD311	8,000,000	790,453,391.00	4.13
8	1111807083	18招商银行CD083	7,000,000	690,987,258.53	3.61
9	1111821118	18东莞农村商业银行CD071	6,500,000	636,778,856.78	3.32
10	160309	16进出09	6,000,000	590,582,371.82	3.08

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.13%
报告期内偏离度的最低值	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海浦发银行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。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,371,630.40
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	54,144,839.30
4	应收申购款	433,835.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	55,950,304.88

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.9.4.1本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.9.4.2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	21,442,310,609.90
报告期基金总申购份额	23,490,649,684.96
报告期基金总赎回份额	25,770,566,611.50
报告期期末基金份额总额	19,162,393,683.36

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	88,442.52
报告期期间买入/申购总份额	686.15
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	89,128.67
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	-	686.15	686.15	0.00%
合计			686.15	686.15	

注:本基金的收益分配按日结转份额,列示在"红利再投资"项下一并披露。

§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12月7日发布华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告。

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12月31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2/152;华夏圆和混合在"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60%-100%)"中排序9/346;华夏沪港通恒生ETF、华夏金融ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序1/109和9/109;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2/73和10/73。

在客户服务方面,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)华夏基金直销交易系统上线养老基金"申购+定投"功能,为客户提供了更便捷的投资方式;(2)对旗下部分开放式基金申购、赎回、转换和定期定额申购业务的最低数额限制进行调整,降低了客户交易及持有基金的门槛;(3)与长沙银行、网商银行、百度百盈基金等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"华夏邀您重阳登高祈福"、"大胆预测退休金"、"猜'折扣5因素'"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《华夏薪金宝货币市场基金基金合同》;

9.1.3《华夏薪金宝货币市场基金托管协议》;

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
二〇一九年一月二十一日

华夏兴华混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月二十一日

§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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏兴华混合
基金主代码	519908
交易代码	519908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月12日
报告期末基金份额总额	455,441,112.53份
投资目标	密切跟踪经济动向,挖掘中国经济发展过程中所蕴含的机会,更好地分享中国经济较快成长的发展成果。力争实现基金资产的长期、持续增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×70%+上证国债指数×30%。
风险收益特征	本基金为混合基金,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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-24,865,753.47
2.本期利润	-70,408,346.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1546
4.期末基金资产净值	616,271,919.35
5.期末基金份额净值	1.353

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。

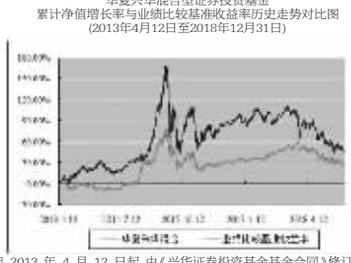
3.2 基金净值表现

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	-10.28%	1.48%	-8.25%	1.15%	-2.03%	0.33%

3.2.2自基金转型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

华夏兴华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
(2013年4月12日至2018年12月31日)



注:自2013年4月12日起,由《兴华证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏兴华混合型证券投资基金基金合同》生效。

§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		
阳晓	本基金的基金经理、公司固定收益部总经理、投资总监	2013-04-12	-	23年	北京大学MBA。曾任宝盈基金基金经理助理、益民基金投资部副门经理、中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部副门经理等。2006年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略研究员、股票投资部副总经理、兴和证券投资基金基金经理(2009年1月1日至2012年1月12日期间)、兴华证券投资基金基金经理(2007年6月12日至2013年4月11日期间)、华夏盛世精选混合型证券投资基金基金经理(2009年12月18日至2015年9月11日期间)、华夏大盘精选证券投资基金基金经理(2015年9月1日至2017年5月2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年第4季度,股票市场创出了年内新低,上证指数跌破2500点。受房地产市场销售下滑的影响,实体经济出现了明显的下行趋势。虽然国家适时调整了货币政策的取向,将稳杠杆、稳增长等一系列目标提上日程,但货币政策向实体经济传导需要时间,社融等宏观经济指标仍继续走弱。本季度市场震荡下行,企业营收增长放缓,汽车等行业销售数据明显下滑,投资者情绪持续低迷,风险偏好下降。本季度,前期机构持仓较集中的防守类资产,如消费、医药等行业,反复走弱。在季度后半期,前期跌幅较大的中小市值股票受到国家支持民营经济的政策刺激影响有所反弹,但同宏观经济关联度较高的银行、地产等权重板块卖压显现,带动指数创出新低。

报告期内,本基金继续保持了较低的股票投资比例,以应对市场低迷的风险。我们继续坚持"自下而上"的个股选择,减少了受宏观经济下行影响较大的板块配置,整体继续向优质企业集中,以个股研究应对市场风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.353元,本报告期份额净值增长率为-10.28%,同期业绩比较基准增长率为-8.25%。

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	402,241,081.53	64.05
	其中:股票	402,241,081.53	64.05
2	固定收益投资	30,208,612.50	4.81
	其中:债券	30,208,612.50	4.81
	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	166,403,169.98	26.50
7	其他各项资产	1,049,321.76	0.17
8	合计	627,982,347.89	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	81,375,696.95	4.76
B	采矿业	22,876,081.00	1.34
C	制造业	651,830,811.14	38.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,588,196.32	2.32
E	建筑业	50,011,683.60	2.93
F	批发和零售业	4,581,744.75	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,771,500.00	0.28
H	住宿和餐饮业	8,684,143.14	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,492,567.90	6.00
J	金融业	175,849,317.32	10.29
K	房地产业	99,599,129.74	5.83
L	租赁和商务服务业	26,495,172.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	14,548,487.80	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	22,889,569.20	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,208,000.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	4,725,600.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	1,314,487,659.86	76.92

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	601318	中国平安	872,423	48,942,930.30	2.86
2	603659	璞泰来	916,628	43,448,167.20	2.54
3	300450	先导智能	1,424,412	41,222,483.28	2.41
4	000002	万科A	1,497,534	35,671,259.88	2.09
5	300750	宁德时代	471,800	34,818,840.00	2.04
6	002299	圣农发展	2,062,075	34,106,720.50	2.00
7	300232	洲明科技	3,473,812	33,140,166.48	1.94
8	002463	沪电股份	4,265,158	30,581,182.86	1.79
9	600048	保利地产	2,564,019	30,229,784.01	1.77
10	300696	利安隆	909,343	28,189,633.00	1.65

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)	30,208,612.50	4.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,208,612.50	4.90

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	30,096,000.00	4.88
2	113513	安井转债	1,050	112,612.50	0.02
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	259,303.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	545,840.90
5	应收申购款	25,798.48
6	其他应收款	218,378.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049,321.76

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	457,158,967.92
报告期基金总申购份额	5,078,008.98
减:报告期基金总赎回份额	6,795,864.37
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	455,441,112.53

§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11月10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大智慧基金销售有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年11月23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12月7日发布华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告。

2018年12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国元证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年12月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构及华夏财富申购、赎回等业务最低数额限制的公告。

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ROFII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12月31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2/152;华夏圆和混合在"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60%-100%)"中排序9/346;华夏沪港通恒生ETF、华夏金融ETF在"股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金"中分别排序1/109和9/109;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2/73和10/73。

在客户服务方面,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)华夏基金直销交易系统上线养老基金"申购+定投"功能,为客户提供了更便捷的投资方式;(2)对旗下部分开放式基金申购、赎回、转换和定期定额申购业务的最低数额限制进行调整,降低了客户交易及持有基金的门槛;(3)与长沙银行、网商银行、百度百盈基金等代销机构合作,为客户提供了更多理财渠道;(4)开展"华夏邀您重阳登高祈福"、"大胆预测退休金"、"猜'折扣5因素'"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兴华转型的文件;

9.1.2《华夏兴华混合型证券投资基金基金合同》;

9.1.3《华夏兴华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