

信息披露

Disclosure

(上接B079版)

客户服务电话:400-800-5000
(91) 宏信证券有限责任公司
住所:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址:四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
电话:028-86119028
传真:028-86119032
联系人:廖俊杰
网址:www.hxsec.cn
客户服务电话:400-830-6266
(92) 开源证券股份有限公司
住所:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
电话:029-84476111
传真:029-84447611
联系人:曹欣
网址:www.kysec.cn
客户服务电话:95325,400-860-8866
(93) 方正证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永涛
电话:13762528013
传真:021-50710563
联系人:卢璐璐
网址:http://www.fundsecurities.com/7100/kdtl_xytpx
客户服务电话:400-080-8208
(94) 上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号一幢二楼2805室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛保平
电话:—
传真:010-88066214
联系人:张静
网址:www.huaxiawealth.com

3、本公司可以根据实际情况变化增加或者减少基金销售机构,并另行公告。基金销售机构可以根据情况增加或者减少其销售网点、网点。
(二) 登记机构
名称:华夏基金管理有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号1-2层A区
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
联系人:宋斌
(三) 律师事务所
名称:北京市天津律师事务所
住所:北京市西城区丰盛胡同20号太平保险大厦10层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同20号太平保险大厦10层
法定代表人:毛敏宁
联系电话:010-57763988
传真:010-5763777
经办人:李皓
经办律师:吴冠雄、李皓
(四) 会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
法定代表人:毛振宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58151928
联系人:徐海

四、基金的名称
本基金名称:华夏新消费混合型证券投资基金

五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式

在严格控制风险的前提下,关注新消费主题的投资机会,力争为投资者提供长期稳健增值。

七、基金的投资方向
本基金的投资范围将具有良好成长性的上市公司,包括中国依法发行上市股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市)的股票,港股通标的股票,包括中国内地依法发行上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券、衍生品(包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)以及法律法规和中国证监会允许基金投资的金融工具。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为60%-96%,其中,新消费主题相关证券不低于非现金基金资产的80%,港股通标的股票占股票资产的比例为0-20%,每个交易日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

八、基金的投资策略
(一)资产配置策略
通过宏观经济分析、政策环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场运行,进行积极资产配置,合理确定权益类和固定收益、债券等各类资产类别上的投资比例,并随着各资产价格收益特征相对变化,适时进行动态调整。

(二) 股票投资策略
1、新消费主题的定义
本基金主要投资于新消费主题相关证券。本基金“新消费主题”主要是指立足消费升级,在产业领域中以科技驱动成长的企业,且主要方向涉及人口结构变化、人均支配收入提高或消费方式变革带来的新需求的崛起,传统消费行业中的新模式的出现,包括但不限于:(1)服务型消费,以新需求提供,为满足消费者某种需求而进行的活动,包括教育、文体娱乐、休闲服务、食品安全、商贸零售、医疗保健、汽车服务、房地产产业链、创新金融服务等;(2)升级型消费服务,指由消费升级和消费升级带来的,满足消费升级需求的过程,包括品牌消费、医药消费、美妆消费、轻工消费品、农业、纺织服装、家电、汽车及相关、科技、消费电子等。

鉴于科技产业发展与产业升级等因素,消费升级主题的范围可能会发生扩大或变化,未来如果管理人认为有更适合的新兴消费主题的定义方法,基金管理人可在本基金合同生效后一致同意对新兴消费主题的判断方法进行更新,并在招募说明书更新中公告。

2、个股投资策略
基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

①定性分析主要从公司所处行业的发展特点、行业景气度、行业是否符合国家的战略发展方向及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构、公司所有的资源、供应能力和产业链情况等,通过合理的行业投资价值比较和估值水平,确定基金主要投资公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行评价,从而挑选出具有相对优势的优质公司。

(三) 债券投资策略
结合对宏观经济形势预期、运行中期调整策略,收益利率配置策略,债券类资产配置策略,构建债券组合,通过合理的行业配置和信用分析,选择具有相对优势的债券品种,构建投资组合,保持投资组合的良好组合。

(四) 中小企业私募债券投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(五) 权益投资风险管理
本基金将严格按照风险控制的前提下,主动进行权益投资。权益投资风险管理将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现收益的超额收益。

(六) 股指期货投资策略
本基金将在严格控制的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行情况的分析,结合基金投资组合的实际持仓,对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,选择合理的股指期货合约构建组合,以调整投资组合的风险暴露,降低系统性风险。基金还将利用股指期货为组合流动性提供工具,降低现货市场流动性不足带来的冲击或成本高的风险,提高基金的建仓或变现效率。

(七) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

本基金投资股指期货,基金管理人将根据审慎原则,建立科学的投资决策机制,建立股指期货投资风险评估,通过合理的行业配置和信用分析,选择具有相对优势的债券品种,构建投资组合,保持投资组合的良好组合。

(八) 股指期货投资策略
本基金投资股指期货,将根据风险管理的原则,充分考虑到股指期货的流动性和风险收益特征,在严格控制风险的前提下,适度参与股指期货投资。

(九) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(十) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(十一) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(十二) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(十三) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(十四) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(十五) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(十六) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(十七) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(十八) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(十九) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(二十) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(二十一) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(二十二) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(二十三) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(二十四) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(二十五) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(二十六) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(二十七) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(二十八) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(二十九) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(三十) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(三十一) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(三十二) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(三十三) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(三十四) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(三十五) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(三十六) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(三十七) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(三十八) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

(三十九) 股指期货投资策略
本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式,精选新兴消费主题个股的优质股并重点关注个股。

(四十) 股指期货投资策略
本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,选择流动性佳、交易活跃的股票期权合约进行交易。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
非金融消费品	2,000,266.73	0.26
信息技术	882,447.49	0.11
公用事业	—	—
金融	—	—
医药	—	—
工业	—	—
能源	—	—
房地产	—	—
其他消费品	—	—
合计	2,786,520.20	0.38

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	000619	贵州茅台	8,311	6,906,732.88	7.76
2	000399	金隅股份	237,000	6,381,380.00	7.12
3	000096	广生股份	52,200	5,611,500.00	6.29
4	000617	潍柴动力	113,674	5,506,042.48	6.22
5	000568	岳阳路桥	97,147	4,475,672.67	5.01
6	002788	奇安信	194,800	4,172,760.00	4.69
7	002026	三花智控	134,300	4,035,560.00	4.55
8	002650	壹桥股份	222,708	3,469,343.38	3.91
9	001986	中国中研	415,700	3,466,380.00	3.89
10	002026	华明股份	227,700	3,194,421.00	3.58

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况

5.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.17 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.18 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.20 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.21 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.23 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.24 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.26 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.27 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.29 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.30 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.31 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.32 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.33 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.34 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.36 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.37 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.38 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.39 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.40 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.41 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.42 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.43 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.44 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.45 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.46 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.47 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.48 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.49 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.50 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.51 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.52 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.53 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.54 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.55 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.56 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.57 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.58 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.59 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.60 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.61 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.62 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.63 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.64 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.65 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.66 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.67 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.68 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.69 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.70 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.71 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.72 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.73 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.74 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.75 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.76 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.77 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.78 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.79 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.80 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.81 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.82 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.83 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

申购费(元)

申购费(元)	5,000,000.00
申购费(元)	1,000.00
申购费(元)	4,999,000.00
申购费(元)	1,000.00
申购费(元)	4,998,227.78

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)

申购费(元)