华夏睿磐泰利混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

（原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型）

（2019年2月27日至2019年6月30日）

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月27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。

根据基金管理人于2019年2月27日发布的《华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金触发转型条款并实施转型的公告》，华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金自2019年2月27日正式转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金，转型后的华夏睿磐泰利混合型证券投资基金为每日开放申购、赎回、转换、定期定额申购业务的基金。

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。

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金报告期自2019年2月27日起至2019年6月30日止，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日起至2019年2月26日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏睿磐泰利混合型证券投资基金及原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金。

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

2.1 基金基本情况

2.1.1 华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

基金名称	华夏睿磐泰利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰利混合	
基金主代码	005177	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型日	2019年2月27日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	349,319,594.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰利混合A	华夏睿磐泰利混合C
下属分级基金的交易代码	005177	005178
报告期末下属分级基金的份额总额	324,120,694.89份	25,198,899.36份

注：原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金于2019年2月27日转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金。

2.1.2 原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金

基金名称	华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰利定开混合	
基金主代码	005177	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2017年12月27日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,334,711.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰利定开混合A	华夏睿磐泰利定开混合C
下属分级基金的交易代码	005177	005178
报告期末下属分级基金的份额总额	29,272,313.05份	19,062,398.32份

2.2 基金产品说明

2.2.1 华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。
投资策略	本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例，为更好地适应不断变化的市场环境，本基金还将动态调整各类资产的配置比例。在基于风险均衡资产配置策略应用过程中，本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露，以达到长期稳定、相对积极的波动水平，获得良好的风险调整后的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%＋上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金，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。

2.2.2 原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。
投资策略	本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例，为更好地适应不断变化的市场环境，本基金还将动态调整各类资产的配置比例。 在基于风险均衡资产配置策略应用过程中，本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露，以达到长期稳定、相对积极的波动水平，获得良好的风险调整后的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%＋上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合基金，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 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	石立平
	联系电话	400-818-6666	010-63639180
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-818-6666	95595
传真		010-63136700	010-63639132
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100033	100033
法定代表人		杨明辉	李晓鹏

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	转型后 报告期（2019年2月27日至2019年6月30日）		转型前 报告期（2019年1月1日至2019年2月26日）	
	华夏睿磐泰利混合A	华夏睿磐泰利混合C	华夏睿磐泰利定开混合A	华夏睿磐泰利定开混合C
本期已实现收益	3,644,588.67	482,636.25	498,590.72	391,100.25
本期利润	7,623,787.19	654,340.47	640,468.30	495,228.05
加权平均基金份额本期利润	0.0659	0.0386	0.0179	0.0172
本期加权平均净值利润率	6.52%	3.84%	1.80%	1.73%
本期基金份额净值增长率	2.48%	2.37%	2.79%	2.64%
3.1.2期末数据和指标	报告期末（2019年6月30日）		报告期末（2019年2月26日）	
	华夏睿磐泰利混合A	华夏睿磐泰利混合C	华夏睿磐泰利定开混合A	华夏睿磐泰利定开混合C
期末可供分配利润	-3,057,005.00	-351,118.74	-997,992.32	-713,520.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0094	-0.0139	-0.0341	-0.0374
期末基金资产净值	332,899,039.19	25,765,371.09	29,337,996.48	19,039,780.62
期末基金份额净值	1.0271	1.0225	1.0022	0.9988
3.1.3累计期末指标	报告期末（2019年6月30日）		报告期末（2019年2月26日）	
	华夏睿磐泰利混合A	华夏睿磐泰利混合C	华夏睿磐泰利定开混合A	华夏睿磐泰利定开混合C
基金份额累计净值增长率	2.48%	2.37%	0.22%	-0.12%

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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④自2019年2月27日起，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金。

3.2基金净值表现

3.2.1 华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

3.2.1.1 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

华夏睿磐泰利混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.45%	0.32%	1.22%	0.25%	1.23%	0.07%
过去三个月	1.35%	0.25%	-0.01%	0.32%	1.36%	-0.07%
自基金转型起至今	2.48%	0.23%	1.58%	0.32%	0.90%	-0.09%

华夏睿磐泰利混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.42%	0.32%	1.22%	0.25%	1.20%	0.07%
过去三个月	1.27%	0.25%	-0.01%	0.32%	1.28%	-0.07%
自基金转型起至今	2.37%	0.23%	1.58%	0.32%	0.79%	-0.09%

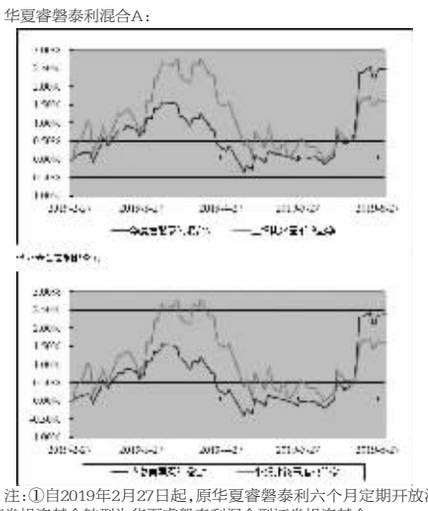
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019年2月27日至2019年6月30日）

华夏睿磐泰利混合A：



注：①自2019年2月27日起，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金。

②根据华夏睿磐泰利混合型证券投资基金的基金合同规定，基金管理人应当自转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第二十部分“基金的转型”的有关约定。

3.2.2 原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金

3.2.2.1 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

华夏睿磐泰利定开混合A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.80%	0.11%	3.38%	0.37%	-2.58%	-0.26%
过去三个月	2.28%	0.09%	4.64%	0.28%	-2.36%	-0.19%
过去六个月	2.79%	0.15%	4.35%	0.31%	-1.56%	-0.16%
过去一年	0.22%	0.21%	2.44%	0.28%	-2.22%	-0.07%
自基金合同生效起至转型前	0.22%	0.21%	3.01%	0.27%	-2.79%	-0.06%

华夏睿磐泰利定开混合C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.78%	0.10%	3.38%	0.37%	-2.60%	-0.27%
过去三个月	2.20%	0.09%	4.64%	0.28%	-2.44%	-0.19%
过去六个月	2.64%	0.15%	4.35%	0.31%	-1.71%	-0.16%
过去一年	-0.07%	0.21%	2.44%	0.28%	-2.51%	-0.07%
自基金合同生效起至转型前	-0.12%	0.21%	3.01%	0.27%	-3.13%	-0.06%

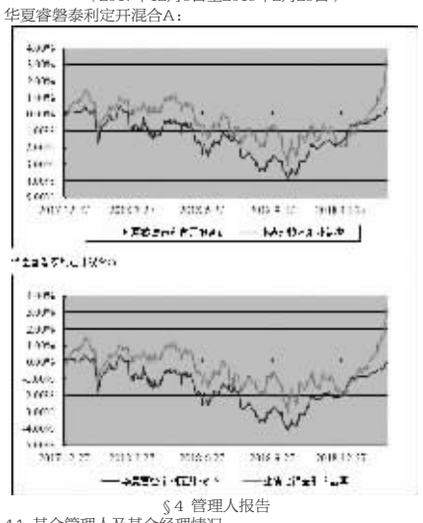
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017年12月6日至2019年2月26日）

华夏睿磐泰利定开混合A：



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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、境内首批中日互通ETF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MSCI中国A股国际通ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港通恒生ETF、华夏野村日经225ETF、华夏中证500ETF、华夏中小板ETF、华夏创业板ETF、华夏中证央企ETF、华夏中证四川国改ETF、华夏战略新兴成指ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏创蓝筹ETF、华夏创成长ETF、华夏快线货币ETF及华夏3-5年中高级可质押信用债ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、A股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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2019年6月30日数据），华夏移动互联混合（QDII）在“QDII基金-QDII混合基金-QDII混合基金（A类）”中排序9/34；华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金（A类）”中排序8/27；华夏回报混合(H类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金（非A类）”中排序8/89；华夏鼎沛债券(A类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A类）”中排序1/228；华夏理财30天债券(A类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金（摊余成本法）（A类）”中排序10/40；华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金（二级）（A类）”中排序7/19；华夏上证50AH优选指数（LOF）(A类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（A类）”中排序8/29；华夏上证50AH优选指数（LOF）(C类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非A类）”中排序4/11；华夏上证50ETF在“股票基金-股票ETF基金-规模指数股票ETF基金”中排序6/61；华夏消费ETF在“股票基金-股票ETF基金-行业指数股票ETF基金”中排序3/31；华夏沪深300ETF联接(C类)在“股票基金-股票ETF联接基金-规模指数股票ETF联接基金（非A类）”中排序9/34。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上，华夏安康债券、华夏收益债券（QDII）和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报QDII明星基金和2018年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏鼎茂债券（004042）荣获“2018年度开放式债券型金牛基金”奖，华夏中小板ETF（159902）荣获“2018年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019年上半年度，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）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币A的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”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）及基金经理助理简介

4.1.2.1华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

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	2017-12-27	2019-2-26	19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联接基金基金经理（2012年8月9日至2017年11月10日期间）、MSCI中国A股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）、MSCI中国A股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基金经理（2014年12月23日至2017年11月10日期间）等。
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2018-04-10	2019-2-26	9年	中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016年3月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年3月24日至2018年9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》等法律法规和基金合同，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，贸易摩擦为全球经济增长带来隐忧，经济增长整体延续疲弱态势。具体来看，美国经济数据初现走弱势头，但整体表现依然相对稳健，增长、就业、消费数据保持了良好局面，短期内步入衰退概率依然有限；贸易摩擦延续及减税周期带来的增长动力消退可能会使得美国经济增长逐步触顶下行，金融市场对美联储由缩表加息的收紧趋向转为预防性降息操作预期较为一致，下半年加息2次左右逐步成为分歧较小的判断。欧日经济起色不大，但增速在低位盘整，维持了相对稳定的表现。国内方面，一季度在前期稳增长政策刺激效应逐步显现的背景下，社融放量，工业产出显著改善，经济增长环比上行明显；4月份政治局会议重新确认了宏观稳杠杆的相对偏鹰经济政策取向，信用扩张步伐减速，广义财政支出趋缓，增长势头有所回落，GDP增速单季录得6.2%，相较于一季度有较为明显的下滑。货币政策方面维持了相对稳健的政策取向，银行间市场流动性合理充裕，包商事件后为防止流动性风险扩散，央行维持了市场充沛的流动性格局，有效遏制了事态的蔓延和信心的骤降。在上半年整体经济增长先升后降的背景下，债券收益率先上后下，宽幅震荡。

报告期内，本基金维持了整体中性的久期仓位，随着收益率起伏参与了一定的利率波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至2019年2月26日，华夏睿磐泰利定开混合A份额净值为1.0022元，2019年1月1日至2月26日期间份额净值增长率为1.81%；华夏睿磐泰利定开混合C份额净值为0.9988元，2019年1月1日至2月26日期间份额净值增长率为1.77%，同期业绩比较基准收益率为4.85%；转型后，截止2019年6月30日，华夏睿磐泰利混合A份额净值为1.0271元，2019年2月27日至6月30日期间份额净值增长率为2.48%；华夏睿磐泰利混合C份额净值为1.0225元，2019年2月27日至6月30日期间份额净值增长率为2.37%，同期业绩比较基准收益率为1.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，三季度经济增长在出口回落的带动下有进一步趋弱的可能，叠加以美国为代表的发达国家和新兴市场国家货币政策重新走入宽松周期，宏观环境有利于债券资产走势向好。本基金将维持中性偏高的久期，适度进攻。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值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，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、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 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金于2019年2月20日至2019年5月16日出现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规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在华夏睿磐泰利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《华夏睿磐泰利混合型证券投资基金2019年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日
资产：		-
银行存款		1,527,978.33
结算备付金		1,948,756.57
存出保证金		22,020.24
交易性金融资产		383,267,138.96
其中：股票投资		62,971,329.96
基金投资		-
债券投资		310,295,809.00
资产支持证券投资		10,000,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		7,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息		6,224,965.55
应收股利		-
应收申购款		645,685.21
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		400,636,544.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		40,000,000.00
应付证券清算款		998,439.18
应付赎回款		373,327.23
应付管理人报酬		213,585.86
应付托管费		53,396.43
应付销售服务费		5,255.49
应付交易费用		209,352.77
应交税费		18,549.34
应付利息		35,758.97
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		64,469.31
负债合计		41,972,134.58
所有者权益：		-
实收基金		349,319,594.25
未分配利润		9,344,816.03
所有者权益合计		358,664,410.28
负债和所有者权益总计		400,636,544.86

注：①自2019年2月27日起，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金，本报告期自2019年2月27日至2019年6月30日。

②报告截止日2019年6月30日，华夏睿磐泰利混合A基金份额净值1.0271元，华夏睿磐泰利混合C基金份额净值1.0225元；华夏睿磐泰利混合基金份额总额349,319,594.25份（其中A类324,120,694.89份，C类25,198,899.36份）。

6.1.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

本报告期：2019年2月27日（基金转型日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年2月27日至2019年6月30日
一、收入		9,185,770.19
1.利息收入		1,483,039.62
其中：存款利息收入		31,641.79
债券利息收入		1,387,133.72
资产支持证券利息收入		37,451.82
买入返售金融资产收入		26,812.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,551,021.62
其中：股票投资收益		2,970,260.69
基金投资收益		-
债券投资收益		-119,859.63
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		700,620.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		4,150,902.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		806.21
减：二、费用		907,642.53
1.管理人报酬		361,304.04
2.托管费		90,326.01
3.销售服务费		17,134.90
4.交易费用		252,350.97
5.利息支出		130,716.43
其中：卖出回购金融资产支出		130,716.43
6.税金及附加		2,345.10
7.其他费用		53,465.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,278,127.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,278,127.66

注：自2019年2月27日起，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金，本报告期自2019年2月27日至2019年6月30日。

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏睿磐泰利混合型证券投资基金

本报告期：2019年2月27日（基金转型日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月27日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	48,334,711.37	43,065.73	48,377,777.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,278,127.66	8,278,127.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	300,984,882.88	1,023,622.64	302,008,505.52
其中：1.基金申购款	319,922,753.26	1,216,325.18	321,138,078.44
2.基金赎回款	-18,937,870.38	-191,702.54	-19,129,572.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	349,319,594.25	9,344,816.03	358,664,410.28

注：自2019年2月27日起，原华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金转型为华夏睿磐泰利混合型证券投资基金，本报告期自2019年2月27日至2019年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 重要会计政策和会计估计

6.1.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计报表的实际编制期间为2019年2月27日（基金转型日）至2019年6月30日。

6.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.1.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.1.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易日最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.1.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.1.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金