华夏大中华信用精选债券型证券投资基金（QDII）

2017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:二〇一七年十月二十五日

§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2017年10月23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2017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	644,907,093.42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区域(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	605,474,755.31份 / 39,432,338.11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(2017年7月1日-2017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	1,792,026.68	71,963.55
2.本期利润	5,677,888.63	315,808.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0081	0.0060
4.期末基金资产净值	601,346,351.26	38,937,332.88
5.期末基金份额净值	0.993	0.987

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	0.91%	0.14%	-0.38%	0.09%	1.29%	0.05%

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	0.71%	0.13%	-0.38%	0.09%	1.09%	0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净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

华夏大中华信用债券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7月27日至2017年9月30日）

华夏大中华信用债券（QDII）A:

注:根据华夏大中华信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

§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	-	16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等。
刘鲁且	本基金的基金经理,董事总经理、固定收益总监	2016-07-27	2017-09-08	13年	美国波士顿学院金融学专业博士。曾任德意志银行美国公司全球市场策略新兴市场研究员、美国SAC资本管理公司高级分析师、美国摩根士丹利资产管理公司固定收益投资部投资经理,副总裁等。2009年5月加入华夏基金管理有限公司,曾任固定收益部投资经理、固定收益部副总经理等。

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,全球经济运行总体平稳,发达经济体仍处于缓慢的经济扩张进程中,新兴经济体则依然保持良好发展势头。美国经济增速开始有所反弹,制造业、投资等复苏明显,但消费快速增长势头放缓。通胀方面,在经历了2季度和3季度初的低迷后,CPI终于在8月超预期反弹。美联储在9月议息会议上宣布将于10月开始缩表操作,每月减少60亿美元国债和40亿美元MBS再投资,同时仍然预期12月底加息一次。美元指数受外围货币走强和自身经济数据不佳等诸多因素影响下跌近4%。欧洲经济增长持续超出预期。地缘政治风险屡屡冲击市场,市场频繁出现风险偏好上升和避险情绪增加的切换,导致相关资产波动,但美国主要股指仍在3季度末接近或创下新高。

3季度人民币大幅升值,在岸人民币对美元一度升至6.5下方。自5月人民银行推出“逆周期因子”调节中间价后,前期积累已久的结汇盘终于在3季度随着美元进一步下跌而集中大量交易,在美元买盘不足的情况下,人民币单边大幅上涨,市场此前的贬值预期被完全扭转。9月初,人民银行采取了一系列措施,升值趋势得到遏制。

市场方面,3季度亚洲美元债券市场在弱美元和长端收益率走低的环境下景气度依然较高。高收益债券方面,随着H股中报陆续出炉,中资房地产债价格目近期低点快速反弹,内房发行人也频频选择新发债券满足市场需求;但非地产类高收益债券则屡屡爆出负面新闻,导致信用利差走宽。境内部分股份制商业银行也开始在海外积极筹备发行优先股用于补充资本金。境内短端利率仍保持高位,曲线已处于较为平坦的位置。

报告期内,本基金在境内人民币债券的策略上相对保守,保持久期稳定和低杠杆,积极管理组合流动性。境外方面,本基金整体增加了高等级债券比重,适当增加久期,降低信用风险敞口。本季度人民币份额净值下跌完全由境外美元资产汇率计价损失造成,美元份额净值则继续增长。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,华夏大中华信用债券（QDII）A基金份额净值为0.993元,本报告期份额净值增长率为0.91%;华夏大中华信用债券（QDII）C基金份额净值为0.987元,本报告期份额净值增长率为0.71%,同期业绩比较基准增长率为-0.38%。

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	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	642,884,176.95	93.66
	其中:债券	558,624,976.95	81.38
	资产支持证券	84,259,200.00	12.27
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	33,019,109.03	4.81
8	其他各项资产	10,543,152.49	1.54
9	合计	686,446,438.47	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-	133,922,349.60	20.92
AA+至AA-	134,233,269.05	20.96
A+至A-	13,283,622.61	2.07
BBB+至BBB-	39,205,933.72	6.12
BB+至BB-	108,984,710.78	17.02
B+至B-	128,995,091.19	20.15

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	136634	16黔高速	50,000,000	47,545,000.00	7.43
2	108601	国开1703	37,000,000	36,926,000.00	5.77
3	US780097BB64	ROYAL BK SCOTLND GRP PLC	33,184,500	36,746,856.08	5.74
4	136638	16海资01	34,000,000	30,851,600.00	4.82
5	XS1627599654	CHINA EVER-GRANDE GROUP	29,096,170	29,466,563.84	4.60

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	33,577,600.00	5.24
2	116418	万科3A1	250,000.00	25,000,000.00	3.90
3	142400	聚肆A2	200,000.00	20,000,000.00	3.12
4	142297	PR一A2	40,000.00	3,967,600.00	0.62
5	142399	PR聚肆A1	100,000.00	1,714,000.00	0.27
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

本基金本报告期末未持有基金。

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	5,402.94
2	应收证券清算款	3,015,540.78
3	应收股利	-
4	应收利息	7,522,208.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,543,152.49

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	745,970,927.03	62,319,796.96
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	140,496,171.72	22,887,458.85
报告期基金拆分变动份额		-
本报告期期末基金份额总额	605,474,755.31	39,432,338.11

§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

2017年9月9日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏大中华信用精选债券型证券投资基金（QDII）基金经理的公告。

2017年9月29日发布华夏基金管理有限公司公告。

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、境内首批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,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2017年9月29日数据）,华夏消费升级混合A在255只灵活配置型基金（股票上下限0-95%+基准股票比例30%-60%）（A类）中排名第8;华夏回报混合A和华夏回报二号混合分别在171只绝对收益目标基金（A类）中排名第3和第5;华夏可转债增强债券A在17只可转换债券型基金（A类）中排名第5;华夏理财30天债券A在39只短期理财债券型基金（A类）中排名第8;华夏全球股票(QDII)在56只QDII股票型基金（A类）中排名第3;华夏收益债券(QDII)A及华夏大中华信用债券(QDII)A分别在15只QDII债券型基金（A类）中排名第1和第4。

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）升级华夏基金官网、与支付宝合作上线华夏基金财富号,为客户提供更便捷的基金投资和理财交流平台;（2）升级华夏基金官网、微官网、APP、微信、财富社区等多个渠道的在线客服系统,有效提升客户的服务满意度;（3）与星展银行、民生证券等代销机构合作,提供更多理财渠道,进一步提升客户体验;（4）开展“一门两世界,温差20度”、“华夏回报累计分红78次”、“火热报北马,一触‘基’发”等多项活动,为客户提供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

二〇一七年十月二十五日

华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金

2017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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月23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。

基金管理人于2017年7月15日发布《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,审议关于终止本基金基金合同有关事项的议案，议案已于2017年8月15日获得通过,基金份额持有人大会决议自同日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2017年8月17日,并自2017年8月18日起进入清算流程。基金财产清算小组已将清算报告报中国证监会备案。

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2017年7月1日起至8月17日（基金最后运作日）止。

§2基金产品概况

基金简称	华夏新锦安灵活
基金主代码	002875
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9日
报告期末基金份额总额	203,628.42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	本基金主要通过采取资产配置策略、股票投资策略、固定收益品种投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、期权投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
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	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华夏新锦安灵活A / 华夏新锦安灵活C
下属分级基金的交易代码	002875 / 002876
报告期末下属分级基金的份额总额	203,628.42份 / -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(2017年7月1日-2017年8月17日)	
	华夏新锦安灵活A	华夏新锦安灵活C
1.本期已实现收益	9,951.90	-
2.本期利润	9,951.90	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0106	-
4.期末基金资产净值	244,679.09	-
5.期末基金份额净值	1.2016	-

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

华夏新锦安灵活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
2017年7月1日至2017年8月17日	5.65%	0.77%	0.81%	0.36%	4.84%	0.41%

华夏新锦安灵活C:

2016年8月9日至2017年8月17日期间，华夏新锦安灵活C类基金份额为零。

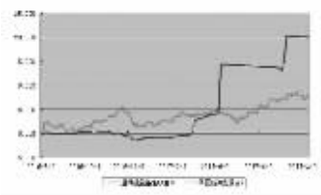
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新锦安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的历史走势对比图

(2016年8月9日至2017年8月17日)

华夏新锦安灵活A:



注:①根据华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

②2016年8月9日至2017年8月17日期间， 华夏新锦安灵活C类基金份额为零。

§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		
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016-08-09	2017-08-17	17年	经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000年5月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部副总经理、基金经理助理、固定收益副总监、固定收益部总经理、华夏现金增利证券投资基金基金经理（2006年4月12日至2006年1月24日期间、2007年1月6日至2008年2月4日期间）、华夏债券投资基金基金经理（2004年2月27日至2012年4月5日期间）、华夏保证金理财货币市场基金基金经理（2013年2月4日至2015年4月2日期间）等。
佟巍	本基金的基金经理、股票投资部总监	2016-09-14	2017-08-17	9年	美国密歇根大学工业工程、金融工程硕士。曾任雷曼兄弟亚洲投资有限公司、野村国际（香港）有限公司结构化信贷交易席交易员等。2009年1月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、投资经理、华夏大盘精选证券投资基金基金经理（2015年2月27日至2017年5月2日期间）等。
陈伟彦	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2017-03-07	2017-08-17	10年	厦门大学统计学硕士。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员等。2010年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理等。

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,全球经济整体仍处于复苏通道。国内经济走势仍处于平稳区间,消费稳中趋好,消费升级也在持续。A股呈现出与上半年不同的行情特征,部分周期股和中小成长股涨幅较好。

报告期内,本基金未持有股票。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年8月17日,华夏新锦安混合A份额净值为1.2016,本报告期份额净值增长率为5.65%,同期业绩比较基准增长率为0.81%。

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2017年7月1日至2017年8月17日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已通过召开基金份额持有人大会审议关于终止本基金基金合同有关事项,大会议案已于2017年8月15日获得通过,基金份额持有人大会决议自同日起生效。根据决议生效公告,本基金自2017年8月18日起进入清算流程。基金财产清算小组已将清算报告报中国证监会备案。

§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:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,486,345.66	2.04
7	其他各项资产	2,384,971.66	1.08
8	合计	220,054,119.25	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	1,781,640.60	0.81
C	制造业	16,581,088.24	7.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	385,682.00	0.18
E	建筑业	3,119,842.00	1.42
F	批发和零售业	26,380.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,868,607.21	3.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
J	金融业	33,826,752.50	15.40
K	房地产业	1,531,516.00	0.70
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	31,224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	64,170,201.93	29.21

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	13,354	6,912,564.56	3.15
2	601318	中国平安	120,000	6,499,200.00	2.96
3	600104	上汽集团	165,000	4,981,350.00	2.27
4	601398	工商银行	652,000	3,912,000.00	1.78
5	600004	白云机场	289,970	3,795,707.30	1.73
6	600036	招商银行	114,300	2,920,365.00	1.33
7	601006	大秦铁路	311,500	2,725,625.00	1.24
8	601166	兴业银行	138,100	2,387,749.00	1.09
9	600016	民生银行	261,900	2,100,438.00	0.96
10	601328	交通银行	304,400	1,923,808.00	0.88

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	10,010,000.00	4.56
	其中:政策性金融债	10,010,000.00	4.56
4	企业债券	19,846,000.00	9.03
5	企业短期融资券	50,126,000.00	22.82
6	中期票据	28,567,000.00	13.01
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,778,000.00	9.00
9	其他	-	-
10	合计	128,327,000.00	58.42

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	112419	16可钢01	200,000	19,846,000.00	9.03
2	111712178	17北京银行CD178	200,000	19,778,000.00	9.00
3	101664062	16中铝业MTN003	200,000	19,724,000.00	8.98
4	011753001	17问钢集SCP001	100,000	10,063,000.00	4.58
5	011764049	17阳煤SCP005	100,000	10,040,000.00	4.57

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	142579	花明15A1	200,000.00	20,000,000.00	9.11
2	142399	PR聚肆A1	40,000.00	685,600.00	0.31
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	24,648.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,003.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,651.62

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	华夏新锦安灵活A	华夏新锦安灵活C
本报告期期初基金份额总额	2,859,822.32	-
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	2,656,193.90	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	203,628.42	-

§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
	1	2017-07-01至2017-07-13	2,600,428.55	-	2,600,428.55	-	-
	1	2017-07-14至2017-08-17	99,898.14	-	-	99,898.14	49.33%
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