华夏新锦图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	华夏新锦图混合
基金主代码	003906
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
报告期末基金份额总额	199,143,172.83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	本基金的业绩比较基准: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	华夏新锦图混合A / 华夏新锦图混合C
下属分级基金的交易代码	003906 / 003907
报告期末下属分级基金的份额总额	199,143,172.83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9月30日)	
	华夏新锦图混合A	华夏新锦图混合C
1.本期已实现收益	7,936,142.73	–
2.本期利润	13,051,115.69	–
3.加权平均基金份额本期利润	0.0655	–
4.期末基金资产净值	218,182,952.45	–
5.期末基金份额净值	1.0956	–

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

华夏新锦图混合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	6.36%	0.48%	2.41%	0.30%	3.95%	0.18%

华夏新锦图混合C:

2016年12月29日至2017年9月30日期间,华夏新锦图混合C类基金份额为零。

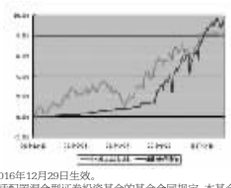
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新锦图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12月29日至2017年9月30日)

华夏新锦图混合A:



注:①本基金合同于2016年12月29日生效。

②根据华夏新锦图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。

③2016年12月29日至2017年9月30日期间,华夏新锦图混合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		
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2017–03–24	–	7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等。
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2017–09–08	–	15年	北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员等。2003年8月加入原中信基金,曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员等。
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016–12–29	2017–09–08	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(2005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。

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

2017年3季度,国际方面,全球经济继续呈现经济稳和通胀低的特点,通胀预期继续走低,美国如期启动缩表,长端利率下行,欧洲计划退出宽松政策。国内方面,实体经济较为平稳,人民币汇率在美元走弱后明显走强,外汇流出减弱,环保限产导致商品价格明显上行。

市场方面,债券市场横盘整理,市场情绪偏弱,过剩产能债券受供给侧改革的影响,利差明显下行。权益市场表现继续分化,上半年涨幅较大的消费白马股出现了一定的调整,而金融、周期和成长类股票则出现了交替上涨的局面。转债市场小幅走强,9月受信用发行放量的影响,估值调整较为显著。

报告期内,本基金维持了权益仓位,调整了信用债持仓品种,并积极参与了新股申购。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,华夏新锦图混合A份额净值为1.0956元,本报告期份额净值增长率为6.36%,同期业绩比较基准增长率为2.41%。

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	151,174,023.01	67.81
	其中:股票	151,174,023.01	67.81
2	固定收益投资	67,091,930.00	30.10
	其中:债券	38,003,330.00	17.05
	资产支持证券	29,088,600.00	13.05
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	3,512,854.39	1.58
7	其他各项资产	1,152,328.01	0.52
8	合计	222,931,135.41	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	274,884.00	0.13
B	采矿业	5,671,279.60	2.60
C	制造业	75,432,940.80	34.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,108,855.00	2.34
E	建筑业	4,962,153.40	2.27
F	批发和零售业	5,984,997.50	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	4,006,694.91	1.84
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,747,822.03	3.09
J	金融业	25,553,388.00	11.71
K	房地产业	8,998,468.00	4.12
L	租赁和商务服务业	4,485,545.00	2.06
M	科学研究和技术服务业	387,149.27	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,200,630.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	69,586.00	0.03
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	1,773,026.50	0.81
S	综合	516,603.00	0.24
	合计	151,174,023.01	69.29

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	68,700	3,720,792.00	1.71
2	601288	农业银行	654,900	2,501,718.00	1.15
3	601988	中国银行	595,800	2,454,696.00	1.13
4	601398	工商银行	353,000	2,118,000.00	0.97
5	000725	京东方A	416,300	1,831,720.00	0.84
6	600522	中天科技	113,300	1,619,057.00	0.74
7	000776	广发证券	79,800	1,514,604.00	0.69
8	300122	智飞生物	54,900	1,470,771.00	0.67
9	000783	长江证券	142,800	1,390,872.00	0.64
10	600837	海通证券	93,500	1,381,930.00	0.63

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	9,980,000.00	4.57
	其中:政策性金融债	9,980,000.00	4.57
4	企业债券	17,966,800.00	8.23
5	企业短期融资券	9,991,000.00	4.58
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	65,530.00	0.03
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	38,003,330.00	17.42

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	011768003	17中铝业SCP008	100,000	9,991,000.00	4.58
2	170301	17进出01	100,000	9,980,000.00	4.57
3	143182	17建材01	100,000	9,920,000.00	4.55
4	143306	17不动产	50,000	5,000,000.00	2.29
5	112190	11亚迪02	30,000	3,046,800.00	1.40

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	116515	徐工2A7	140,000.00	14,000,000.00	6.42
2	142911	YX优A	90,000.00	5,088,600.00	2.33
3	116539	京东7优A	50,000.00	5,000,000.00	2.29
4	142636	汇通9A5	50,000.00	5,000,000.00	2.29
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	39,018.71
2	应收证券清算款	171,626.42
3	应收股利	–
4	应收利息	941,583.48
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,152,328.01

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	110032	三一转债	59,030.00	0.03

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

项目	华夏新锦图混合A	华夏新锦图混合C
本报告期期初基金份额总额	199,612,851.26	–
报告期基金总申购份额	475,067.62	–
减:报告期基金总赎回份额	944,746.05	–
报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	199,143,172.83	–

§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2017–09–30	198,136,516.74	–	–	198,136,516.74	99.49%
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5000万元,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

2017年9月9日发布华夏基金管理有限公司关于调整华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告。

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,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《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金合同》;

9.1.3《华夏新锦图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
二〇一七年十月二十五日

华夏新锦略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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华夏新锦略混合
基金主代码	003964
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月22日
报告期末基金份额总额	1,000,147,566.66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	本基金的业绩比较基准: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,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
下属分级基金的基金简称	华夏新锦略混合A / 华夏新锦略混合C
下属分级基金的交易代码	003964 / 003965
报告期末下属分级基金的份额总额	1,000,147,566.66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9月30日)	
	华夏新锦略混合A	华夏新锦略混合C
1.本期已实现收益	12,894,521.04	–
2.本期利润	9,366,416.05	–
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094	–
4.期末基金资产净值	1,032,750,567.65	–
5.期末基金份额净值	1.0326	–

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

华夏新锦略混合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	0.92%	0.04%	2.41%	0.30%	–1.49%	–0.26%

华夏新锦略混合C:

2017年1月22日至9月30日期间,华夏新锦略混合C类基金份额为零。

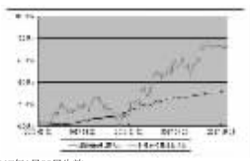
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新锦略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

(2017年1月22日至2017年9月30日)

华夏新锦略混合A:



注:①本基金合同于2017年1月22日生效。

②根据华夏新锦略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。

③2017年1月22日至9月30日期间,华夏新锦略混合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		
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2017–09–08	–	15年	北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员等。2003年8月加入原中信基金,曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员等。
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2017–01–22	2017–09–08	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(2005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。

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》、《基金管理公司开展投资、研究活动的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,央行货币政策继续维持稳健中性水平,操作上继续削峰填谷,保持资金面基本稳定。由于银行体系提前备战3季度考核,同业存单利率在9月初即创出本季度高点,且供需两旺,发行量仍较大。以全国性股份制商业银行三个月存单利率为例,收益率在达到4.65%附近后迅速回落,季末稳定在4.4%附近。

报告期内,本基金在资产的类别配置上绝大部分为同业存款及存单,获取了较为稳定的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,华夏新锦略混合A份额净值为1.0326元,本报告期份额净值增长率为0.92%,同期业绩比较基准增长率为2.41%。

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	61,753,448.62	5.88
	其中:股票	61,753,448.62	5.88
2	固定收益投资	920,863,746.20	87.71
	其中:债券	819,117,746.20	78.02
	资产支持证券	101,746,000.00	9.69
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	27,600,000.00	2.63
	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	31,024,696.04	2.96
7	其他各项资产	8,616,909.96	0.82
8	合计	1,049,858,800.82	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	6,740,593.60	0.65
C	制造业	17,643,009.73	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,068,900.00	0.39
E	建筑业	4,825,600.00	0.47
F	批发和零售业	5,486,580.90	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	11,410,071.91	1.10
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	0.00
J	金融业	11,530,000.00	1.12
K	房地产业	–	–
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	0.00
S	综合	–	–
	合计	61,753,448.62	5.98

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	600690	青岛海尔	679,895	10,259,615.55	0.99
2	601088	中国神华	320,000	6,700,800.00	0.65
3	601398	工商银行	1,070,000	6,420,000.00	0.62
4	600104	上汽集团	193,000	5,826,670.00	0.56
5	600009	上海机场	150,000	5,697,000.00	0.55
6	601006	大秦铁路	650,000	5,687,500.00	0.55
7	601607	上海医药	230,000	5,460,200.00	0.53
8	600036	招商银行	200,000	5,110,000.00	0.49
9	601668	中国建筑	520,000	4,825,600.00	0.47
10	600900	长江电力	270,000	4,068,900.00	0.39

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	108,736,000.00	10.53
	其中:政策性金融债	108,736,000.00	10.53
4	企业债券	71,847,746.20	6.96
5	企业短期融资券	140,200,000.00	13.58
6	中期票据	89,918,000.00	8.71
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	408,416,000.00	39.55
9	其他	–	–
10	合计	819,117,746.20	79.31

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	111711403	17平安银行CD403	2,000,000	195,600,000.00	18.94
2	111719209	17恒丰银行CD209	800,000	79,120,000.00	7.66
3	170210	17国开10	600,000	58,794,000.00	5.69
4	111719289	17恒丰银行CD289	500,000	47,745,000.00	4.62
5	111721147	17渤海银行CD147	500,000	47,735,000.00	4.62

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	116563	万科5A1	400,000.00	40,000,000.00	3.87
2	142914	花呗21A1	200,000.00	20,000,000.00	1.94
3	116539	京东7优A	200,000.00	20,000,000.00	1.94
4	146050	PR诚1A2	200,000.00	19,356,000.00	1.87
5	1789133	17开元1A	500,000.00	1,390,000.00	0.13
6	142761	17聚01A2	10,000.00	1,000,000.00	0.10
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	17,359.41
2	应收证券清算款	1,101,121.28
3	应收股利	–
4	应收利息	7,498,429.27
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	8,616,909.96

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。

§