

# 华夏经济转型股票型证券投资基金

## 2016年第3季度报告

2016年9月30日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十五日

## §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 2016 年 10 月 21 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华夏经济转型股票
基金主代码	002229
交易代码	002229
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 15 日
报告期末基金份额总额	145,253,543.95 份
投资目标	把握经济深化改革方向，挖掘经济转型中的优秀上市公司，追求基金资产的长期、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	沪深 300 指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、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	中国银行股份有限公司

## §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(2016年7月1日-2016年9月30日)
1.本期已实现收益	11,147,913.92
2.本期利润	8,536,314.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0526

4.期末基金资产净值	156,879,121.78
5.期末基金份额净值	1.080

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 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

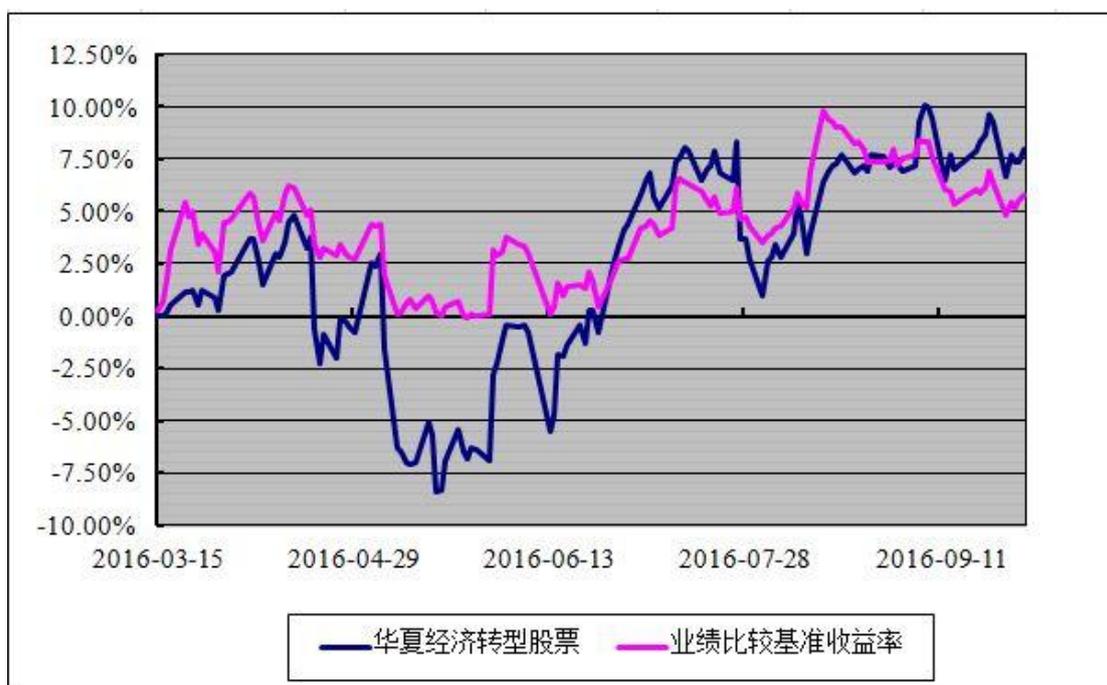
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.75%	1.09%	2.98%	0.72%	0.77%	0.37%

#### 3.2.2 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

##### 华夏经济转型股票型证券投资基金

##### 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

(2016年3月15日至2016年9月30日)



注：①本基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效。

②根据华夏经济转型股票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。

## §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		
彭海伟	本基金的基金经理、股票投资部总监	2016-03-15	-	12 年	中国科学院管理科学与工程硕士。2004 年 9 月加入原中信基金，曾任研究员，华夏基金研究员、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合规守信情况的说明

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，国内经济呈现出阶段性企稳回升迹象。受此影响，A 股市场整体呈现反复震荡、小幅走高态势，各行业分化较大，具体而言，受政府和社会资本合作（PPP）出台相关政策的影响，建筑建材、公用事业等板块走势相对较好，电子、有色金属行业有所回调，计算机、传媒等行业则延续上半年的调整走势。

报告期内，本基金维持了较高的仓位，实现了一定收益。具体行业配置上，本基金在食品饮料、高端装备、信息技术、电子通信等行业上配置比例相对较高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.080 元，本报告期份额净值增长率为 3.75%，同期业绩比较基准增长率为 2.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，工业生产之所以保持平稳，主要依赖于房地产和基建投资拉动，两者难以持续保持强劲，未来经济继续疲软的风险依然存在。从国际方面来看，美国 9 月份没有加息，12 月份加息的概率加大；美国大选、意大利公投等都有可能引发海外市场的震荡。在国内经济改善可持续性不强以及 4 季度美联储加息预期依然存在的背景下，预计 4 季度市场依旧缺乏趋势性上涨行情，更多的是关注结构性与个股行情以及市场调整后的反弹机会。

4 季度，本基金将重点关注以下几个方面：（1）国企改革依然是目前获得超额收益的重要主题，本基金将重点在电子半导体、国防军工等行业中寻找合适的投资标的进行布局；（2）本基金将加大前期回调幅度较大的信息技术、文化传媒、节能环保等行业的持续跟踪研究，寻找业绩存在超市场预期且估值合理的个股；（3）部分行业，包括一些细分周期行业、消费行业等，由于供给格局发生变化，盈利能力有望出现大幅好转，本基金计划精选个股持有。

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 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

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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	146,398,273.05	92.02
	其中：股票	146,398,273.05	92.02
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	12,388,443.56	7.79
7	其他各项资产	301,149.93	0.19
8	合计	159,087,866.54	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	95,021,092.81	60.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,740,800.00	3.66
E	建筑业	5,651,400.00	3.60
F	批发和零售业	4,849,200.00	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,367,626.74	9.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,062,427.00	3.86
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	11,204,800.00	7.14
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	2,500,926.50	1.59
S	综合	-	-
	合计	146,398,273.05	93.32

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002037	久联发展	750,000	13,125,000.00	8.37
2	600529	山东药玻	497,200	10,903,596.00	6.95
3	300103	达刚路机	588,112	10,762,449.60	6.86
4	002059	云南旅游	800,000	7,576,000.00	4.83
5	000977	浪潮信息	273,447	7,153,373.52	4.56
6	300287	飞利信	549,966	6,797,579.76	4.33
7	002690	美亚光电	314,652	6,774,457.56	4.32
8	600208	新潮中宝	1,374,700	6,062,427.00	3.86
9	600283	钱江水利	460,000	5,740,800.00	3.66
10	300092	科新机电	379,975	5,350,048.00	3.41

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	134,423.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,427.08
5	应收申购款	164,298.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,149.93

##### 5.11.4 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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002059	云南旅游	7,576,000.00	4.83	重大事项

#### 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	258,898,812.04
本报告期基金总申购份额	36,305,161.90
减：本报告期基金总赎回份额	149,950,429.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	145,253,543.95

### §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 报告期内披露的主要事项

2016 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司公告。

2016 年 7 月 2 日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

2016 年 7 月 5 日发布关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在兴业证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2016 年 7 月 7 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珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 7 月 26 日发布华夏基金管理有限公司关于华夏经济转型股票型证券投资基金新增上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告。

2016 年 7 月 28 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北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 17 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深圳富济财富管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 18 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乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 19 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深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构的公告。

2016 年 8 月 25 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万联证券开通申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告。

2016 年 8 月 31 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大泰金石投资管理有限公司为代销机构的公告。

2016 年 9 月 20 日发布华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告。

## 8.2 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，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 2016 年 9 月 30 日数据），华夏策略混合在 75 只灵活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 6，华夏医疗健康混合 A 在 58 只偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 5，华夏沪深 300 指数增强 A 在 39 只增强指数股票型基金中排名第 10；固定收益类产品中，华夏理财 30 天债券在 39 只短期理财债券型基金中排名第 11，华夏薪金宝货币在 194 只货币型基金中排名第 7。

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）网上交易上线通联兴业快捷支付方式、定投通业务，进一步升级华夏基金管家客户端，为客户提供更多便捷的理财方式；（2）网上查询系统优化了数据更新时间，提高客户自助查询的及时性；（3）开展“体验定投通，红包大放送”、“数说华夏基金‘投友’十件事儿”、2016 北京马拉松系列宣传等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

## §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 《华夏经济转型股票型证券投资基金基金合同》；
- 9.1.3 《华夏经济转型股票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

二〇一六年十月二十五日