# 华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金 2017年第4季度报告 2017年12月31日

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:二〇一八年一月二十二日

## §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 2018 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

# № 基金产品概况

基金简称	华夏新锦源混合		
基金主代码	002871		
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	370,852.88 份		
投资目标	在控制风险的前提下,把握市	市场机会,追求资产的稳健增值。	
	本基金主要通过采取资产配置	置策略、股票投资策略、固定收益	
投资策略	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	
/八四年末 面 有 加	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	华夏新锦源混合 A	华夏新锦源混合 C	
下属分级基金的交易代码	002871 002872		
报告期末下属分级基金的份	370,852.88 份	<i>II</i>	
额总额	370,032.00 Д	-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

	扌	<b></b>	
主要财务指标	(2017年10月1日	月1日-2017年12月31日)	
	华夏新锦源混合 A	华夏新锦源混合 C	

1.本期已实现收益	-30,163.01	-
2.本期利润	-30,163.01	-
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0789	-
4.期末基金资产净值	392,241.90	-
5.期末基金份额净值	1.0577	-

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

#### 华夏新锦源混合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	-6.94%	0.10%	2.60%	0.40%	-9.54%	-0.30%

#### 华夏新锦源混合C:

2016年8月9日至2017年12月31日期间,华夏新锦源混合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

华夏新锦源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12月31日)

华夏新锦源混合A:



注:①根据华夏新锦源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12月31日期间,华夏新锦源混合C类基金份额为零。

## 84 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	说明	
		任职日期	离任日期	年限		
佟巍	本的 经股资 监	2016-09-14	-	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部交易员等。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)、华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年9月14日至2017年8月17日期间)、华夏新锦福灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年9月14日至2017年8月17	

					日期间)等。
陈伟彦	本的经股资级基基理票部副裁	2017-03-07	-	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,华夏新锦安灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年3月7日至2017年8月17日期间)、华夏新锦福灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年3月7日至2017年8月17日期间)、华夏回报二号证券投资基金基金经理(2015年12月14日至2017年8月29日期间)、华夏回报证券投资基金基金经理(2015年11月19日至2017年8月29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

4 季度,全球经济整体延续复苏态势。国内经济虽有短期波动,但整体仍处于平稳区间。A 股有较大波动,大盘蓝筹股整体上涨,周期股和创业板股有所下跌。

报告期末,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 12 月 31 日,华夏新锦源混合 A 基金份额净值为 1.0577 元,本报告期份额净值增长率为-6.94%,同期业绩比较基准增长率为 2.60%。

#### 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 10月 1日至 2017年 12月 31日出现基金资产净值低于五千万元及基金份额持有人数量低于 200人的情形。基金管理人已向中国证监会报告通过召开基金份额持有人大会实施基金转型的方案,方案已获中国证监会批准。基金管理人已于 2018年 1月 20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源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》,审议关于本基金转型事项的议案。

## %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	432,446.93	99.98

7	其他各项资产	104.75	0.02
8	合计	432,551.68	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

本基金本报告期末未持有股票。

- 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本基金本报告期未持有股票。
- 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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	104.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104.75

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。

## % 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	华夏新锦源混合A	华夏新锦源混合C
本报告期期初基金份额总额	391,770.11	-
报告期基金总申购份额	-	-
减: 报告期基金总赎回份额	20,917.23	-

报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	370,852.88	-

### **\$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。

## **88** 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		报告期内持有基金	2份额变化情况			报告期末持有	基金情况	
者类别	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	
个人	1	2017-10-01 至 2017-12-31	301,258.11	1	1	301,258.11	81.23%	
	立日胚方同院							

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

本基金本报告期无已披露的重大事项。

#### 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、首批公募 FOF 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 ROFII 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 12 月 31 日数据),华夏大盘精选混合在 135 只混合偏股型基金中排名第 7,华夏消费升级混合 A 在 263 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 10;华夏回报混合 A 和华夏回报二号混合分别在 174 只绝对收益目标基金(A 类)中排名第 3 和第 4;华夏安康债券 A 在 177 只普通债券型基金(二级 A 类)中排名第 7;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 4;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 3。

在客户服务方面,4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)企业理财微信端、基金管家APP固定业务自助办理功能陆续上线,为客户提供了更丰富的基金投资方式和更便捷的业务办理平台;(2)与嘉实财富、基煜基金、上海华信证券等多家基金销售机构合作,为客户提供更多理财渠道,进一步提升客户体验;(3)开展"FOF基金知识大挑战"、"QDII基金知识大闯关"、"和老乡一起分红包"、"货家三兄弟迎新年"等活动,为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

## **89** 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《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 9.1.3《华夏新锦源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 二〇一八年一月二十二日