

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型)

2018 年半年度报告

2018 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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。

华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 20 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于 2018 年 2 月 26 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2018 年 3 月 6 日起，“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”正式转型为“华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金”。

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。

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金报告期自 2018 年 3 月 6 日起至 2018 年 6 月 30 日止，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 3 月 5 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§5 托管人报告.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金.....	14
6.1.1 资产负债表.....	14
6.1.2 利润表.....	16
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.1.4 报表附注.....	18
6.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金.....	36
6.2.1 资产负债表.....	36
6.2.2 利润表.....	38
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	39
6.2.4 报表附注.....	40
§7 投资组合报告.....	53
7.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金.....	53
7.1.1 期末基金资产组合情况.....	53
7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	54
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
7.1.6 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.....	62
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62
7.1.8 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贵金属投资明细.....	62
7.1.9 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.....	62
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.1.12 投资组合报告附注.....	62
7.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金.....	63
7.2.1 期末基金资产组合情况.....	63
7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	64
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
7.2.6 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.....	64
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.2.8 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贵金属投资明细.....	64
7.2.9 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.....	64
7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.2.12 投资组合报告附注.....	65

§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金.....	65
8.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金.....	67
§10 重大事件揭示.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§12 备查文件目录.....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

基金名称	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华夏智胜价值成长股票	
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	2018年3月6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	
报告期末基金份额总额	11,112,413.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏智胜价值成长股票A	华夏智胜价值成长股票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额总额	11,112,413.33份	-

注：原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金。

#### 2.1.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

基金名称	华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	10,903,772.92份	
基金合同存续期	不定期	
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额总额	10,903,772.92份	-

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略，把握市场机会，追求资产的长期增值。
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	中证中信稳健成长策略指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为股票基金,其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于中高风险品种。

### 2.2.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

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。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95555
传真	010-63136700	0755-83195201
注册地址	北京市顺义区天竺空港工业区A区	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

### §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(2018年3月6日至2018 年6月30日)	转型前 报告期(2018年1月1日 至2018年3月5日)
本期已实现收益	-254,718.18	-20,836.01
本期利润	-1,442,559.93	-20,836.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1309	-0.0490
本期加权平均净值利润率	-14.18%	-4.97%
本期基金份额净值增长率	-13.52%	-16.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	报告期末(2018年3月5日)
期末可供分配利润	-1,833,772.86	-376,090.65
期末可供分配基金份额利润	-0.1650	-0.0345
期末基金资产净值	9,278,640.47	10,527,682.27
期末基金份额净值	0.8350	0.9655
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	报告期末(2018年3月5日)
基金份额累计净值增长率	-13.52%	-3.45%

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 2018 年 3 月 6 日起，由《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》生效。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

### 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

华夏智胜价值成长股票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	-7.13%	1.45%	-6.98%	1.40%	-0.15%	0.05%
过去三个月	-12.81%	1.16%	-11.67%	1.14%	-1.14%	0.02%
自基金转型起至今	-13.52%	1.14%	-11.99%	1.14%	-1.53%	0.00%

华夏智胜价值成长股票C:

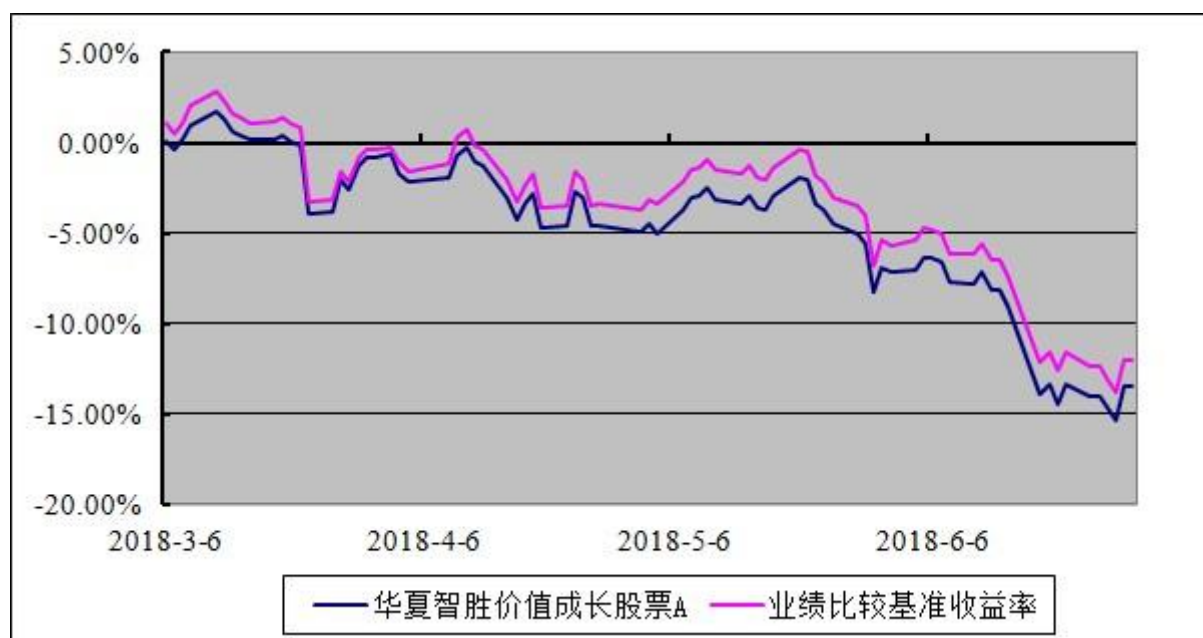
2018年3月6日至2018年6月30日期间,华夏智胜价值成长股票C类基金份额为零。

### 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

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
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

(2018年3月6日至2018年6月30日)

华夏智胜价值成长股票A:



注: ①自2018年3月6日起,原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金。

②根据华夏智胜价值成长股票型发起式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。

③2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日期间，华夏智胜价值成长股票 C 类基金份额为零。

### 3.2.2 原华夏新锦源灵活配置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

华夏新锦源混合 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	-1.53%	0.12%	-2.74%	0.90%	1.21%	-0.78%
过去三个月	-10.66%	0.27%	0.21%	0.57%	-10.87%	-0.30%
过去六个月	-16.54%	0.21%	2.64%	0.46%	-19.18%	-0.25%
过去一年	-3.15%	0.72%	9.19%	0.39%	-12.34%	0.33%
自基金合同生效起至转型前	-3.45%	0.58%	12.86%	0.38%	-16.31%	0.20%

华夏新锦源混合C:

2016 年 8 月 9 日至 2018 年 3 月 5 日期间，华夏新锦源混合 C 类基金份额为零。

#### 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

原华夏新锦源灵活配置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

(2016年8月9日至2018年3月5日)

华夏新锦源混合A:



注：2016年8月9日至2018年3月5日期间，华夏新锦源混合C类基金份额为零。

## §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2018年6月30日数据），华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A类)”中排序3/154；华夏医疗健康混合(A类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金(A类)”中排序2/152；华夏医药ETF、华夏消费ETF、华夏沪港通恒生ETF在“股票基金-指数股票型基金-股票ETF基金”中分别排序2/115、8/115、9/115。

“中国基金业20周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“中国基金业20周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖

项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（一年期）、华夏上证 50ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018 年上半年，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）华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动的情况；华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；（3）与中原银行、长城华西银行、西安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“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年司庆感恩二十年”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”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 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2018-03-06	-	8 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、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。

4.1.2.2原华夏新锦源灵活配置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		
佟巍	本基金的基金经理、股票投资部总监	2016-09-14	2018-03-05	10 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）、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）等。
陈伟彦	本基金的基金经理、股票投资部总监	2017-03-07	2018-03-05	11 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 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，国际方面，美国经济仍较为强劲，通胀率略有上升，失业率维持低位；欧元区经济延续复苏格局，但走势趋于温和，受贸易保护主义、宽松货币政策退出等影响，半年末市场下调了全年增速预期；日本经济 1 季度意外下挫后，央行继续维持超宽松货币政策不变，但通胀水平依然较低；新兴市场经济体总体经济增长较快，但内部表现继续分化，部分经济体仍面临调整与转型压力。国内方面，供给侧结构性改革深入推进，实现了投资继续保持增长、投资内生性增强、投资结构不断改善的运行态势；消费品市场规模进一步扩大、商品结构持续优化，充分体现了消费对我国经济发展的基础性作用，是拉动我国经济增长的最重要引擎；出口增速总体保持稳定，进口超预期增长，进出口产品结构持续优化；整体而言，中国经济延续了总体平稳、稳中向好的发展态势，转型升级成效明显，新动能加快成长，但贸易摩擦和社融增长减速使得市场对未来经济前景的顾虑提升。

市场方面，受中美贸易战持续发酵、美联储加息节奏加快、地缘政治变局等影响，A 股市场情绪承压，市场成交呈现较为明显的萎缩态势，大盘指数经历了较大幅的回撤。

基金投资运作方面，华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金由华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型而来，自 3 月 6 日《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》生效起正式转型。报告期内，本基金主要做好基金的建仓工作，根据基金合同

范围内的量化选股模型完成组合构建和调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前,截至2018年3月5日,华夏新锦源混合A份额净值为0.9655元,2018年1月1日至3月5日期间份额净值增长率为-8.72%,同期业绩比较基准收益率为0.31%;转型后,截至2018年6月30日,华夏智胜价值成长股票A份额净值为0.8350元,2018年3月6日至6月30日期间份额净值增长率为-13.52%,同期业绩比较基准收益率为-11.99%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国际方面,贸易战和国际金融环境变化的影响仍不确定,但预计美国经济增长仍较为乐观,美联储仍会加息,缩表进程或将加快;欧洲央行货币政策仍将保持耐心、持续和谨慎,部分欧元区国家经济形势不容乐观,债务危机存在一定风险但目前看还较为可控。国内方面,在经济增速短期下行压力增大的背景下,货币、金融、财税政策有望向结构性宽松转变,制造业将保持温和复苏,同时结构性分化将加大,高端制造业投资或将提速;在扩大内需政策的带动下,下半年或将释放一定内需空间,消费增长逐步得到修复;受外围形势影响,下半年进出口对经济拉动作用继续有限。综合来看,国内经济需求动力有增有减,但总体保持稳定,预计经济增速下半年保持平稳。

市场方面,A股整体估值水平已接近历史低位,具有较高的安全边际。6月初,A股正式纳入MSCI新兴市场指数,虽然短期难以成为影响A股的主要驱动力,但长远来看,随着纳入比例的提高,A股市场活力和效率也将随之得到提升。

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

本基金本报告期末未进行利润分配,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

转型前, 华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 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。基金管理人于 2018 年 2 月 26 日以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会, 会议审议并通过了《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》, 基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《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表决结果暨决议生效公告》, 自 2018 年 3 月 6 日起, 华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金。

转型后, 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资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 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

托管人声明, 在本报告期内, 基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

##### 6.1.1 资产负债表

会计主体: 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

报告截止日: 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
<b>资产:</b>		
银行存款	6.1.4.7.1	792,276.47
结算备付金		43,736.46
存出保证金		5,386.75
交易性金融资产	6.1.4.7.2	8,359,728.56
其中: 股票投资		8,359,728.56
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收证券清算款		244,890.31
应收利息	6.1.4.7.5	211.13
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	-
资产总计		9,446,229.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		73,702.52
应付赎回款		-
应付管理人报酬		7,931.11
应付托管费		1,586.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.1.4.7.7	24,861.99
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-



华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	59,507.37
负债合计		167,589.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.1.4.7.9	11,112,413.33
未分配利润	6.1.4.7.10	-1,833,772.86
所有者权益合计		9,278,640.47
负债和所有者权益总计		9,446,229.68

注：①自 2018 年 3 月 6 日起，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金，本报告期自 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日。

②报告截止日 2018 年 6 月 30 日，华夏智胜价值成长股票 A 基金份额净值 0.8350 元；华夏智胜价值成长股票基金份额总额 11,112,413.33 份(其中 A 类 11,112,413.33 份,C 类 0.00 份)。

#### 6.1.2 利润表

会计主体：华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-1,314,586.21
1.利息收入		4,261.34
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	3,281.36
债券利息收入		0.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		979.57
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-131,365.26
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	-208,722.83
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	66.19
资产支持证券投资收益	6.1.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.1.4.7.15	-
衍生工具收益	6.1.4.7.16	-

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

股利收益	6.1.4.7.17	77,291.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.1.4.7.18	-1,187,841.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.1.4.7.19	359.46
<b>减: 二、费用</b>		127,973.72
1.管理人报酬		32,610.68
2.托管费		6,522.15
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.1.4.7.20	50,209.80
5.利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		-
7.其他费用	6.1.4.7.21	38,631.09
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-1,442,559.93
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-1,442,559.93

注: 自 2018 年 3 月 6 日起, 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金, 本报告期自 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日。

### 6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

本报告期: 2018 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 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)	10,903,772.92	-376,090.65	10,527,682.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,442,559.93	-1,442,559.93
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)	208,640.41	-15,122.28	193,518.13
其中: 1.基金申购款	269,573.62	-19,380.29	250,193.33
2.基金赎回款	-60,933.21	4,258.01	-56,675.20
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)	11,112,413.33	-1,833,772.86	9,278,640.47
-----------------	---------------	---------------	--------------

注：自 2018 年 3 月 6 日起，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金，本报告期自 2018 年 3 月 6 日至 2018 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：

<u>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

#### 6.1.4 报表附注

##### 6.1.4.1 基金基本情况

根据原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华夏新锦源混合”）基金份额持有人大会审议通过的《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，华夏新锦源混合于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

##### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.1.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

##### 6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 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 2018 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.1.4.4.3 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公允价值变动计入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。

##### 6.1.4.4.4 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。

#### 6.1.4.4.5 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；估值日无交易且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。

#### 6.1.4.4.6 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。

#### 6.1.4.4.7 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份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份

额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、于 2017 年 12 月 28 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》进行估值；自 2017 年 12 月 28 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.1.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

4、存款利息收入不征收增值税。

5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

8、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利



所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

9、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

10、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	792,276.47
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	792,276.47

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,547,570.31	8,359,728.56	-1,187,841.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,547,570.31	8,359,728.56	-1,187,841.75

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	189.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	19.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.40
合计	211.13

6.1.4.7.6 其他资产

无。

6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	24,861.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	24,861.99

6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	59,507.37
合计	59,507.37

6.1.4.7.9 实收基金

华夏智胜价值成长股票A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年3月6日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	10,903,772.92	10,903,772.92
本期申购	269,573.62	269,573.62
本期赎回（以“-”号填列）	-60,933.21	-60,933.21
本期末	11,112,413.33	11,112,413.33

华夏智胜价值成长股票C

无。

6.1.4.7.10 未分配利润

华夏智胜价值成长股票A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	837,362.37	-1,213,453.02	-376,090.65
本期利润	-254,718.18	-1,187,841.75	-1,442,559.93
本期基金份额交易产生的变动数	16,132.58	-31,254.86	-15,122.28
其中：基金申购款	19,895.03	-39,275.32	-19,380.29
基金赎回款	-3,762.45	8,020.46	4,258.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	598,776.77	-2,432,549.63	-1,833,772.86

华夏智胜价值成长股票C

无。

6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,921.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	245.74
其他	113.81
合计	3,281.36

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,245,801.97
减：卖出股票成本总额	13,454,524.80
买卖股票差价收入	-208,722.83

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,066.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应收利息总额	0.41
买卖债券差价收入	66.19

#### 6.1.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.1.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.1.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.1.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.1.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.1.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.1.4.7.16 衍生工具收益

6.1.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.1.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.1.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月6日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	77,291.38
基金投资产生的股利收益	-
合计	77,291.38

6.1.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月6日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-1,187,841.75
——股票投资	-1,187,841.75
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,187,841.75

6.1.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月6日至2018年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	359.46
合计	359.46

#### 6.1.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	50,209.80
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	50,209.80

#### 6.1.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	12,822.03
信息披露费	25,644.06
银行费用	165.00
合计	38,631.09

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月6日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	36,239,272.08	100.00%

##### 6.1.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月6日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	2,066.60	100.00%

##### 6.1.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月6日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	1,000,000.00	100.00%

##### 6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月6日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	33,748.46	100.00%	24,861.99	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

##### 6.1.4.10.2 关联方报酬

#### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的管理费	32,610.68

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

#### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	6,522.15

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.1.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	
	华夏智胜价值成长股票 A	华夏智胜价值成长股票 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 6 日）持有的基金份额	10,608,423.83	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-



期末持有的基金份额占基金总份额比例	95.46%	-
-------------------	--------	---

6.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华夏智胜价值成长股票 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
中信证券	248442.02	2.24%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	792,276.47	2,921.81

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.1.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

000779	三毛派神	2018-03-21	重大事项	13.47	2018-08-21	12.12	3,800.00	47,653.00	51,186.00	
002270	华明装备	2018-05-03	重大事项	5.81	2018-07-03	5.23	8,700.00	54,024.00	50,547.00	
000603	盛达矿业	2018-06-11	重大事项	10.83	2018-08-21	9.75	4,600.00	51,520.00	49,818.00	
002102	冠福股份	2018-06-01	重大事项	4.07	-	-	11,300.00	49,155.00	45,991.00	
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项	32.50	-	-	1,400.00	45,528.00	45,500.00	
600844	丹化科技	2018-06-01	重大事项	5.36	-	-	8,300.00	50,298.00	44,488.00	
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项	21.67	-	-	200.00	4,811.00	4,334.00	

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

#### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

##### 6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的

信用风险。

#### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.1.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

##### 6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。截至本期末，本基金未持有利率敏感性固定收益类资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

##### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	8,359,728.56	90.10
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
合计	8,359,728.56	90.10

##### 6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。	
分析	相关风险变量的 变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 (2018 年 6 月 30 日)
	+5%	438,010.90
	-5%	-438,010.90

#### 6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.1.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的

报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

#### 6.1.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至 2018 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 8,359,728.56 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。

#### 6.1.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

#### 6.1.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## 6.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 3 月 5 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 3 月 5 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.2.4.7.1	584,126.11	432,446.93
结算备付金		4,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.2.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.2.4.7.5	677.12	104.75
应收股利		-	-
应收申购款		10,000,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	-	-
资产总计		10,588,803.23	432,551.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 3 月 5 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		28.97	72.01
应付管理人报酬		43.46	203.79
应付托管费		7.25	33.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	61,041.28	40,000.00
负债合计		61,120.96	40,309.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.2.4.7.9	10,903,772.92	370,852.88
未分配利润	6.2.4.7.10	-376,090.65	21,389.02
所有者权益合计		10,527,682.27	392,241.90
负债和所有者权益总计		10,588,803.23	432,551.68

注：①自 2018 年 3 月 6 日起，原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金。

②报告截止日 2018 年 3 月 5 日，华夏新锦源混合 A 基金份额净值 0.9655 元；华夏新锦

源混合基金份额总额 10,903,772.92 份 (其中 A 类 10,903,772.92 份, C 类 0.00 份)。

## 6.2.2 利润表

会计主体: 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		910.45	14,959,150.25
1.利息收入		910.45	6,761,364.12
其中: 存款利息收入	6.2.4.7.11	572.37	277,381.93
债券利息收入		-	6,241,459.48
资产支持证券利息收入		-	27,397.26
买入返售金融资产收入		338.08	215,125.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)		-	-15,507,859.38
其中: 股票投资收益	6.2.4.7.12	-	2,548,185.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-	-18,026,494.36
资产支持证券投资收益	6.2.4.7.14	-	-29,550.68
贵金属投资收益	6.2.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.16	-	-
股利收益	6.2.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.2.4.7.18	-	17,714,706.89
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	6.2.4.7.19	-	5,990,938.62
<b>减: 二、费用</b>		21,746.46	1,931,210.86
1.管理人报酬		454.46	1,324,301.11
2.托管费		75.72	220,716.88
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.2.4.7.20	-	303,462.63
5.利息支出		-	395.44
其中: 卖出回购金融资产支出		-	395.44
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	6.2.4.7.21	21,216.28	82,334.80

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,836.01	13,027,939.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,836.01	13,027,939.39

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 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）	370,852.88	21,389.02	392,241.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,836.01	-20,836.01
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）	10,532,920.04	-376,643.66	10,156,276.38
其中：1.基金申购款	10,856,865.85	-360,560.43	10,496,305.42
2.基金赎回款	-323,945.81	-16,083.23	-340,029.04
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）	10,903,772.92	-376,090.65	10,527,682.27
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,197,963,035.70	-12,234,627.50	1,185,728,408.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,027,939.39	13,027,939.39
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）	-1,188,957,277.40	720,265.87	-1,188,237,011.53
其中：1.基金申购款	8,548,345.73	1,450,654.27	9,999,000.00
2.基金赎回款	-1,197,505,623.13	-730,388.40	-1,198,236,011.53



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）	9,005,758.30	1,513,577.76	10,519,336.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1121 号《关于准予华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 8 月 2 日至 2016 年 8 月 5 日共募集 600,649,023.47 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 0784 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,757,177.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 108,153.58 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

经中国证监会批准,本基金的基金管理人华夏基金管理有限公司将本基金于 2018 年 3 月 6 日转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金,故本财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 3 月 5 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 3 月 5 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.2.4.6 税项

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关

于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

4、存款利息收入不征收增值税。

5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

8、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

9、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

10、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 3 月 5 日
活期存款	584,126.11
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	584,126.11

6.2.4.7.2 交易性金融资产

无。

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 3 月 5 日
应收活期存款利息	668.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4.08
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.83
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	677.12

6.2.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年3月5日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	61,041.28
合计	61,041.28

#### 6.2.4.7.9 实收基金

华夏新锦源混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月5日	
	基金份额	账面金额
上年度末	370,852.88	370,852.88
本期申购	10,856,865.85	10,856,865.85
本期赎回（以“-”号填列）	-323,945.81	-323,945.81
本期末	10,903,772.92	10,903,772.92

华夏新锦源混合 C

无。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

华夏新锦源混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,651.97	-41,262.95	21,389.02
本期利润	-20,836.01	-	-20,836.01
本期基金份额交易产生的变动数	795,546.41	-1,172,190.07	-376,643.66
其中：基金申购款	847,672.58	-1,208,233.01	-360,560.43
基金赎回款	-52,126.17	36,042.94	-16,083.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	837,362.37	-1,213,453.02	-376,090.65

华夏新锦源混合 C

无。

#### 6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日
活期存款利息收入	563.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4.08
其他	4.83
合计	572.37

#### 6.2.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 6.2.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.2.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.2.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.2.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.2.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.2.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.2.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.2.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.2.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.2.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.2.4.7.17 股利收益

无。

#### 6.2.4.7.18 公允价值变动收益

无。

#### 6.2.4.7.19 其他收入

无。

#### 6.2.4.7.20 交易费用

无。

#### 6.2.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日
审计费用	7,013.76
信息披露费	14,027.52
银行间账户维护费	175.00
银行费用	-
其他	-
合计	21,216.28

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

##### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 20 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于 2018 年 2 月 26 日获得通过，大会决议自同日起生效。自 2018 年 3 月 6 日起，“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”正式转型为“华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金”。

##### 6.2.4.9 关联方关系

###### 6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

###### 6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司 (“中信证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.2.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年3月5日		上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中信证券	-	-	169,744,930.82	100.00%

##### 6.2.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.2.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年3月5日		上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中信证券	-	-	102,466,961.32	100.00%

##### 6.2.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年3月5日		上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交 总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额 的比例
中信证券	1,200,000.00	100.00%	1,120,800,000.0	100.00%

##### 6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年3月5日



	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
中信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
中信证券	158,083.35	100.00%	187.54	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年3月5日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	454.46	1,324,301.11

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

##### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年3月5日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75.72	220,716.88

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.2.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	华夏新锦源混合 A	华夏新锦源混合 C	华夏新锦源混合 A	华夏新锦源混合 C
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	10,608,423.83	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	10,608,423.83	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	97.29%	-	-	-

注：本基金管理人于本报告期申购本基金，申购费用为 1,000.00 元。

6.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华夏新锦源混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 3 月 5 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	248,442.02	2.28%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	584,126.11	563.46	2,628,562.03	266,037.11

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.2.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.2.4.12 期末（2018 年 3 月 5 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出

发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用的金融工具特征, 通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告, 参考压力测试结果, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时对各种风险进行监督、检查和评估, 并制定相应决策, 将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 债券发行人信用评级降低导致债券价格下降, 或基金在交易过程中发生交收违约, 而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库, 对发行人及债券投资进行内部评级, 对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度, 以控制可能出现的信用风险。

#### 6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下, 基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合, 从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易, 除在“6.2.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外, 其余均能及时变现。

##### 6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中, 本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端, 本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标, 并定期开展压力测试, 详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端, 基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据, 审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求, 当市场环境或投资者结构发生变化时, 及时调整组合资产结构及比例, 预留充足现金头寸, 保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形, 基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具, 控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性, 本基金管理人通过监测

组合敏感性指标来衡量市场风险。

#### 6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动,从而影响基金投资收益的风险。截至本期末,本基金未持有利率敏感性固定收益类资产,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。截止本期末,本基金主要持有银行存款,其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.2.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层次:

第一层次:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### 6.2.4.14.2 各层级金融工具公允价值

截至 2018 年 3 月 5 日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 0 元,第二层次的余额为 0 元,第三层次的余额为 0 元。(截至 2017 年 12 月 31 日止:第一层次的余额为 0 元,第二层次的余额为 0 元,第三层次的余额为 0 元。)

##### 6.2.4.14.3 公允价值所属层级间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票,本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起

从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

#### 6.2.4.14.4 第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

(报告期末为 2018 年 6 月 30 日，报告期间为 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 6 月 30 日)

#### 7.1.1 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	8,359,728.56	88.50
	其中：股票	8,359,728.56	88.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	836,012.93	8.85
8	其他各项资产	250,488.19	2.65
9	合计	9,446,229.68	100.00

#### 7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	248,529.00	2.68
C	制造业	3,793,310.62	40.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	318,003.00	3.43

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

E	建筑业	451,751.30	4.87
F	批发和零售业	266,715.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	217,959.00	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	292,747.28	3.16
J	金融业	1,834,546.40	19.77
K	房地产业	389,678.20	4.20
L	租赁和商务服务业	85,680.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	134,931.76	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	148,393.00	1.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,780.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	122,954.00	1.33
S	综合	5,750.00	0.06
	合计	8,359,728.56	90.10

7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	6,800.00	398,344.00	4.29
2	002110	三钢闽光	8,200.00	131,446.00	1.42
3	601166	兴业银行	8,000.00	115,200.00	1.24
4	600016	民生银行	14,900.00	104,300.00	1.12
5	601328	交通银行	17,300.00	99,302.00	1.07
6	601288	农业银行	24,000.00	82,560.00	0.89
7	000002	万科 A	3,100.00	76,260.00	0.82
8	601398	工商银行	13,600.00	72,352.00	0.78
9	600000	浦发银行	7,400.00	70,744.00	0.76
10	600387	海越股份	7,300.00	67,014.00	0.72
11	600153	建发股份	7,100.00	63,829.00	0.69
12	601601	中国太保	2,000.00	63,700.00	0.69
13	601003	柳钢股份	8,000.00	63,360.00	0.68
14	300176	鸿特科技	760.00	63,026.80	0.68
15	600277	亿利洁能	11,400.00	59,736.00	0.64
16	601169	北京银行	9,300.00	56,079.00	0.60
17	600609	金杯汽车	11,100.00	55,167.00	0.59
18	600048	保利地产	4,500.00	54,900.00	0.59

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

19	300532	今天国际	3,100.00	54,157.00	0.58
20	000546	金圆股份	4,000.00	53,480.00	0.58
21	600403	大有能源	12,300.00	53,259.00	0.57
22	603568	伟明环保	2,100.00	53,130.00	0.57
23	000425	徐工机械	12,400.00	52,576.00	0.57
24	601005	重庆钢铁	25,300.00	51,359.00	0.55
25	300400	劲拓股份	3,800.00	51,338.00	0.55
26	000779	三毛派神	3,800.00	51,186.00	0.55
27	002514	宝馨科技	8,800.00	51,040.00	0.55
28	002270	华明装备	8,700.00	50,547.00	0.54
29	600737	中粮糖业	6,700.00	50,518.00	0.54
30	600508	上海能源	4,700.00	50,196.00	0.54
31	000157	中联重科	12,200.00	50,142.00	0.54
32	603018	中设集团	3,164.00	50,117.76	0.54
33	300444	双杰电气	3,300.00	50,094.00	0.54
34	300448	浩云科技	4,361.00	49,933.45	0.54
35	300437	清水源	3,000.00	49,860.00	0.54
36	000603	盛达矿业	4,600.00	49,818.00	0.54
37	601898	中煤能源	10,300.00	49,749.00	0.54
38	300097	智云股份	2,800.00	49,616.00	0.53
39	002203	海亮股份	6,100.00	49,410.00	0.53
40	600648	外高桥	2,700.00	49,356.00	0.53
41	000016	深康佳 A	9,400.00	49,350.00	0.53
42	002001	新和成	2,600.00	49,296.00	0.53
43	600681	百川能源	3,800.00	49,248.00	0.53
44	000001	平安银行	5,400.00	49,086.00	0.53
45	300237	美晨生态	6,800.00	48,824.00	0.53
46	601717	郑煤机	8,400.00	48,804.00	0.53
47	300250	初灵信息	4,000.00	48,800.00	0.53
48	000150	宜华健康	1,800.00	48,780.00	0.53
49	300174	元力股份	2,300.00	48,714.00	0.53
50	002526	山东矿机	14,900.00	48,425.00	0.52
51	600837	海通证券	5,100.00	48,297.00	0.52
52	002619	艾格拉斯	11,500.00	48,185.00	0.52
53	300388	国祯环保	2,500.00	48,175.00	0.52
54	002061	浙江交科	4,600.00	48,162.00	0.52
55	600131	岷江水电	8,300.00	48,057.00	0.52
56	000802	北京文化	4,600.00	48,024.00	0.52
57	600400	红豆股份	12,800.00	48,000.00	0.52
58	600027	华电国际	12,200.00	47,824.00	0.52
59	300150	世纪瑞尔	9,900.00	47,817.00	0.52
60	601988	中国银行	13,200.00	47,652.00	0.51



华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

61	600545	卓郎智能	6,000.00	47,640.00	0.51
62	603855	华荣股份	4,900.00	47,579.00	0.51
63	603030	全筑股份	6,900.00	47,541.00	0.51
64	600741	华域汽车	2,000.00	47,440.00	0.51
65	603601	再升科技	5,400.00	47,304.00	0.51
66	601106	中国一重	15,100.00	47,112.00	0.51
67	002717	岭南股份	4,800.00	47,088.00	0.51
68	000662	天夏智慧	7,281.00	46,816.83	0.50
69	601006	大秦铁路	5,700.00	46,797.00	0.50
70	600854	春兰股份	11,100.00	46,731.00	0.50
71	300249	依米康	7,200.00	46,656.00	0.50
72	600126	杭钢股份	7,800.00	46,566.00	0.50
73	300200	高盟新材	5,600.00	46,480.00	0.50
74	600516	方大炭素	1,900.00	46,322.00	0.50
75	002608	江苏国信	6,700.00	46,230.00	0.50
76	601677	明泰铝业	4,600.00	46,184.00	0.50
77	600963	岳阳林纸	8,900.00	46,102.00	0.50
78	600010	包钢股份	29,700.00	46,035.00	0.50
79	002102	冠福股份	11,300.00	45,991.00	0.50
80	300038	梅泰诺	4,300.00	45,838.00	0.49
81	002360	同德化工	8,400.00	45,780.00	0.49
82	300473	德尔股份	1,200.00	45,540.00	0.49
83	601020	华钰矿业	3,300.00	45,507.00	0.49
84	002602	世纪华通	1,400.00	45,500.00	0.49
85	600491	龙元建设	6,500.00	45,435.00	0.49
86	002757	南兴装备	1,500.00	45,420.00	0.49
87	600836	界龙实业	11,200.00	45,360.00	0.49
88	600629	华建集团	3,800.00	45,334.00	0.49
89	300391	康跃科技	4,400.00	45,320.00	0.49
90	600582	天地科技	12,300.00	45,141.00	0.49
91	000004	国农科技	2,300.00	45,080.00	0.49
92	600863	内蒙华电	19,800.00	44,946.00	0.48
93	603955	大千生态	2,210.00	44,929.30	0.48
94	002599	盛通股份	4,300.00	44,849.00	0.48
95	002712	思美传媒	2,400.00	44,616.00	0.48
96	600844	丹化科技	8,300.00	44,488.00	0.48
97	000786	北新建材	2,400.00	44,472.00	0.48
98	002406	远东传动	8,100.00	44,469.00	0.48
99	000833	贵糖股份	8,500.00	44,455.00	0.48
100	601908	京运通	9,700.00	44,426.00	0.48
101	000850	华茂股份	11,800.00	44,368.00	0.48
102	300227	光韵达	4,100.00	44,362.00	0.48

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

103	601188	龙江交通	13,500.00	44,280.00	0.48
104	600615	丰华股份	5,100.00	44,217.00	0.48
105	000821	京山轻机	4,800.00	44,208.00	0.48
106	603878	武进不锈	3,200.00	44,128.00	0.48
107	002586	围海股份	6,300.00	44,100.00	0.48
108	000980	众泰汽车	6,200.00	44,082.00	0.48
109	603040	新坐标	1,048.00	44,005.52	0.47
110	600167	联美控股	4,400.00	44,000.00	0.47
111	601058	赛轮金宇	18,100.00	43,983.00	0.47
112	603023	威帝股份	7,600.00	43,852.00	0.47
113	000078	海王生物	9,100.00	43,771.00	0.47
114	600590	泰豪科技	6,760.00	43,602.00	0.47
115	600671	天目药业	2,700.00	43,578.00	0.47
116	002283	天润曲轴	11,000.00	43,560.00	0.47
117	002775	文科园林	3,300.00	43,494.00	0.47
118	002478	常宝股份	9,700.00	43,456.00	0.47
119	002335	科华恒盛	2,400.00	43,320.00	0.47
120	601028	玉龙股份	8,600.00	43,172.00	0.47
121	601216	君正集团	12,800.00	43,136.00	0.46
122	000880	潍柴重机	5,600.00	43,064.00	0.46
123	002482	广田集团	7,200.00	42,984.00	0.46
124	603595	东尼电子	600.00	42,900.00	0.46
125	002682	龙洲股份	5,200.00	42,796.00	0.46
126	600626	申达股份	8,300.00	42,745.00	0.46
127	000548	湖南投资	9,700.00	42,486.00	0.46
128	002671	龙泉股份	9,500.00	42,370.00	0.46
129	603818	曲美家居	3,600.00	42,336.00	0.46
130	002164	宁波东力	7,300.00	42,194.00	0.45
131	000900	现代投资	10,000.00	41,600.00	0.45
132	603117	万林股份	5,800.00	41,064.00	0.44
133	000498	山东路桥	9,500.00	40,470.00	0.44
134	601599	鹿港文化	9,800.00	39,886.00	0.43
135	603017	中衡设计	4,200.00	39,480.00	0.43
136	300120	经纬辉开	5,819.00	38,987.30	0.42
137	002755	东方新星	4,000.00	38,240.00	0.41
138	300027	华谊兄弟	6,200.00	38,192.00	0.41
139	600793	宜宾纸业	2,700.00	38,178.00	0.41
140	000591	太阳能	10,300.00	37,698.00	0.41
141	000892	欢瑞世纪	7,800.00	36,738.00	0.40
142	603268	松发股份	2,800.00	36,624.00	0.39
143	601818	光大银行	10,000.00	36,600.00	0.39
144	601211	国泰君安	2,400.00	35,376.00	0.38

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

145	002247	帝龙文化	4,100.00	33,620.00	0.36
146	603111	康尼机电	4,900.00	32,389.00	0.35
147	601688	华泰证券	2,100.00	31,437.00	0.34
148	600015	华夏银行	4,000.00	29,800.00	0.32
149	001979	招商蛇口	1,500.00	28,575.00	0.31
150	600919	江苏银行	4,300.00	27,563.00	0.30
151	601939	建设银行	4,200.00	27,510.00	0.30
152	002142	宁波银行	1,600.00	26,064.00	0.28
153	000776	广发证券	1,900.00	25,213.00	0.27
154	601009	南京银行	3,200.00	24,736.00	0.27
155	601628	中国人寿	1,000.00	22,520.00	0.24
156	601336	新华保险	500.00	21,440.00	0.23
157	600999	招商证券	1,400.00	19,152.00	0.21
158	601155	新城控股	600.00	18,582.00	0.20
159	600340	华夏幸福	700.00	18,025.00	0.19
160	601901	方正证券	2,600.00	17,394.00	0.19
161	600958	东方证券	1,900.00	17,347.00	0.19
162	601377	兴业证券	2,900.00	15,283.00	0.16
163	600606	绿地控股	2,300.00	15,042.00	0.16
164	600383	金地集团	1,400.00	14,266.00	0.15
165	002736	国信证券	1,500.00	13,650.00	0.15
166	601788	光大证券	1,200.00	13,176.00	0.14
167	600705	中航资本	2,800.00	13,076.00	0.14
168	000783	长江证券	2,400.00	13,032.00	0.14
169	000166	申万宏源	2,800.00	12,236.00	0.13
170	601997	贵阳银行	900.00	11,124.00	0.12
171	600208	新湖中宝	2,700.00	10,314.00	0.11
172	601555	东吴证券	1,500.00	10,245.00	0.11
173	601099	太平洋	4,300.00	10,062.00	0.11
174	600816	安信信托	1,340.00	9,701.60	0.10
175	000728	国元证券	1,300.00	9,620.00	0.10
176	002146	荣盛发展	1,100.00	9,603.00	0.10
177	600109	国金证券	1,300.00	9,243.00	0.10
178	601198	东兴证券	700.00	9,128.00	0.10
179	002797	第一创业	1,300.00	8,801.00	0.09
180	600325	华发股份	1,100.00	8,503.00	0.09
181	002673	西部证券	1,100.00	8,305.00	0.09
182	000656	金科股份	1,700.00	8,160.00	0.09
183	600663	陆家嘴	500.00	7,895.00	0.09
184	601229	上海银行	500.00	7,880.00	0.08
185	000961	中南建设	1,200.00	7,572.00	0.08
186	002500	山西证券	1,100.00	7,414.00	0.08

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

187	600643	爱建集团	751.00	7,059.40	0.08
188	600369	西南证券	1,800.00	6,930.00	0.07
189	000750	国海证券	1,900.00	6,783.00	0.07
190	000627	天茂集团	900.00	6,318.00	0.07
191	000671	阳光城	1,000.00	5,970.00	0.06
192	000981	银亿股份	800.00	5,960.00	0.06
193	000732	泰禾集团	300.00	5,835.00	0.06
194	000686	东北证券	900.00	5,769.00	0.06
195	600094	大名城	1,000.00	5,760.00	0.06
196	600895	张江高科	500.00	5,750.00	0.06
197	600266	北京城建	600.00	5,640.00	0.06
198	000402	金融街	700.00	5,635.00	0.06
199	600376	首开股份	800.00	5,624.00	0.06
200	002670	国盛金控	520.00	5,600.40	0.06
201	600291	西水股份	400.00	5,344.00	0.06
202	002244	滨江集团	1,000.00	5,200.00	0.06
203	600240	华业资本	700.00	5,131.00	0.06
204	600649	城投控股	800.00	4,896.00	0.05
205	600061	国投资本	500.00	4,640.00	0.05
206	002285	世联行	700.00	4,389.00	0.05
207	000979	中弘股份	4,300.00	4,343.00	0.05
208	600466	蓝光发展	700.00	4,340.00	0.05
209	600848	上海临港	200.00	4,334.00	0.05
210	600823	世茂股份	1,000.00	4,180.00	0.05
211	000031	中粮地产	700.00	4,046.00	0.04
212	600909	华安证券	700.00	4,004.00	0.04
213	600503	华丽家族	1,000.00	3,910.00	0.04
214	000718	苏宁环球	1,000.00	3,670.00	0.04
215	000667	美好置业	1,700.00	3,621.00	0.04
216	000926	福星股份	500.00	3,595.00	0.04
217	600908	无锡银行	600.00	3,534.00	0.04
218	600064	南京高科	480.00	3,523.20	0.04
219	000006	深振业 A	600.00	3,516.00	0.04
220	000563	陕国投 A	1,000.00	3,400.00	0.04
221	002807	江阴银行	600.00	3,372.00	0.04
222	600926	杭州银行	300.00	3,327.00	0.04
223	601881	中国银河	400.00	3,252.00	0.04
224	000712	锦龙股份	300.00	2,994.00	0.03
225	600565	迪马股份	900.00	2,655.00	0.03
226	600639	浦东金桥	200.00	2,496.00	0.03
227	601375	中原证券	500.00	2,335.00	0.03
228	600155	宝硕股份	300.00	2,157.00	0.02

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

229	600657	信达地产	500.00	2,125.00	0.02
230	600773	西藏城投	300.00	2,076.00	0.02
231	600748	上实发展	400.00	2,016.00	0.02
232	000897	津滨发展	800.00	1,808.00	0.02
233	600053	九鼎投资	100.00	1,717.00	0.02
234	601878	浙商证券	200.00	1,680.00	0.02
235	000987	越秀金控	200.00	1,572.00	0.02
236	600390	五矿资本	200.00	1,550.00	0.02
237	600743	华远地产	600.00	1,542.00	0.02
238	002839	张家港行	100.00	609.00	0.01
239	601128	常熟银行	100.00	572.00	0.01

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	482,049.00	5.20
2	002110	三钢闽光	180,114.00	1.94
3	600153	建发股份	156,465.00	1.69
4	601166	兴业银行	142,838.00	1.54
5	600016	民生银行	127,263.00	1.37
6	002775	文科园林	114,361.00	1.23
7	601328	交通银行	112,876.00	1.22
8	300391	康跃科技	108,280.00	1.17
9	002549	凯美特气	108,058.00	1.16
10	300176	鸿特科技	107,612.00	1.16
11	002215	诺普信	107,557.00	1.16
12	300132	青松股份	107,118.00	1.15
13	002717	岭南股份	106,503.00	1.15
14	002599	盛通股份	106,349.00	1.15
15	603017	中衡设计	105,483.00	1.14
16	300227	光韵达	105,000.00	1.13
17	002482	广田集团	104,999.00	1.13
18	600801	华新水泥	104,872.00	1.13
19	002228	合兴包装	104,214.00	1.12
20	600508	上海能源	103,953.00	1.12
21	002611	东方精工	103,761.00	1.12
22	600963	岳阳林纸	103,744.00	1.12

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300132	青松股份	119,294.00	1.29%
2	002215	诺普信	117,005.00	1.26%
3	600801	华新水泥	108,278.10	1.17%
4	002753	永东股份	108,237.00	1.17%
5	002228	合兴包装	106,932.00	1.15%
6	002549	凯美特气	104,193.00	1.12%
7	002724	海洋王	103,883.50	1.12%
8	002611	东方精工	103,707.00	1.12%
9	002039	黔源电力	102,906.66	1.11%
10	002803	吉宏股份	99,747.78	1.08%
11	300180	华峰超纤	99,492.00	1.07%
12	300307	慈星股份	99,185.00	1.07%
13	600755	厦门国贸	98,020.00	1.06%
14	002717	岭南股份	71,795.00	0.77%
15	000820	神雾节能	70,694.00	0.76%
16	600153	建发股份	68,689.00	0.74%
17	002776	柏堡龙	67,914.00	0.73%
18	600519	贵州茅台	67,171.00	0.72%
19	300259	新天科技	66,140.00	0.71%
20	002775	文科园林	64,583.00	0.70%

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,002,095.11
卖出股票收入（成交）总额	13,245,801.97

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.5 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。

#### 7.1.6 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。

#### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.1.9 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。

#### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.1.10.1 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。

##### 7.1.10.2 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。

#### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.1.11.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.1.11.2 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。

##### 7.1.11.3 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。

#### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	5,386.75
2	应收证券清算款	244,890.31
3	应收股利	-
4	应收利息	211.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	250,488.19

#### 7.1.12.4 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。

#### 7.1.12.5 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。

#### 7.1.12.6 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。

### 7.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

(报告期末为 2018 年 3 月 5 日，报告期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 5 日)

#### 7.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	588,126.11	5.55
8	其他各项资产	10,000,677.12	94.45
9	合计	10,588,803.23	100.00

#### 7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合



#### 7.2.2.1 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。

#### 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

##### 7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

##### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.5 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。

#### 7.2.6 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。

#### 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.2.9 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。

#### 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.2.10.1 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。

##### 7.2.10.2 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。

#### 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.2.11.1 本期国债期货投资策略

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.2.11.2 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。

#### 7.2.11.3 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。

#### 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

#### 7.2.12.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	677.12
5	应收申购款	10,000,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,000,677.12

#### 7.2.12.4 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。

#### 7.2.12.5 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。

#### 7.2.12.6 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

##### 8.1.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金  
(原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型) 2018 年半年度报告

	户数(户)	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏智胜价值股票 A	189	58,795.84	10,856,865.85	98.00%	255,547.48	2.00%
华夏智胜价值股票 C	-	-	-	-	-	-
合计	189	58,795.84	10,856,865.85	98.00%	255,547.48	2.00%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏智胜价值股票 A	113,707.12	1.02%
	华夏智胜价值股票 C	-	-
	合计	113,707.12	1.02%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	华夏智胜价值股票 A	0~10
	华夏智胜价值股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏智胜价值股票 A	0
	华夏智胜价值股票 C	0
	合计	0

8.1.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,608,423.83	95.46%	10,356,255.18	93.20%	不少于三年
基金管理人高级管理人员					
基金经理等人员					
基金管理人股东					
其他					
合计	10,608,423.83	95.46%	10,356,255.18	93.20%	

## 8.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

### 8.2.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏新锦源混合 A	174	62,665.36	10,856,865.85	99.57%	46,907.07	0.43%
华夏新锦源混合 C	-	-	-	-	-	-
合计	174	62,665.36	10,856,865.85	99.57%	46,907.07	0.43%

### 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏新锦源混合 A	38,965.79	0.36%
	华夏新锦源混合 C		
	合计	38,965.79	0.36%

### 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	华夏新锦源混合 A	0~10
	华夏新锦源混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏新锦源混合 A	0
	华夏新锦源混合 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

### 9.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

单位：份

项目	华夏智胜价值股票 A	华夏智胜价值股票 C
基金合同生效日(2018 年 3 月 6 日)基金份额总额	10,903,772.92	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	269,573.62	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	60,933.21	-
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

末基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	11,112,413.33	-

注：自2018年3月6日起，由《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金合同》修订而成的《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》生效。

## 9.2原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

项目	华夏新锦源混合A	华夏新锦源混合C
基金合同生效日（2016年8月9日）基金份额总额	600,757,177.05	-
本报告期期初基金份额总额	370,852.88	-
报告期基金总申购份额	10,856,865.85	-
减：报告期基金总赎回份额	323,945.81	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,903,772.92	-

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金于2018年1月20日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金有关事项的议案》，会议议案于2018年2月26日获得通过，大会决议自同日起生效。自2018年3月6日起，“华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金”正式转型为“华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金”。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2018年4月28日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于2018年5月19日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

自 2018 年 3 月 6 日起, 华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金正式转型为华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金。转型前后的基金适用于不同的投资策略, 且转型前后的基金在各自的报告期内投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

##### 10.7.1.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	36,239,272.08	100.00%	33,748.46	100.00%	

##### 10.7.1.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-

注: ①为了贯彻中国证监会的有关规定, 我公司制定了选择券商的标准, 即:

i 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序:

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③自 2018 年 3 月 6 日起，由《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》生效。除本表列示外，本基金还选择了光大证券、国泰君安证券、华泰证券、申万宏源证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

#### 10.7.2.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	2,066.60	100.00%	1,000,000.00	100.00%

#### 10.7.2.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	-	-	1,200,000.00	100.00%

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于恢复华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-17
2	关于暂停华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-18
3	华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召	中国证监会指定报刊	2018-01-20

	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	及网站	
4	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第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-22
5	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第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-23
6	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表决结果暨决议生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-02-27
7	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-05
8	华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金开放日常转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-04
9	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-28
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-19

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.1 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

##### 11.1.1 华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金

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
机构	1	2018-03-06 至 2018-06-30	10,608,423.83	-	-	10,608,423.83	95.46%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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正常运作水平，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。</p>							



### 11.1.2 原华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金

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
机构	1	2018-01-18 至 2018-03-05	-	10,608,423.83	-	10,608,423.83	97.29%
	2	2018-01-18 至 2018-03-04	-	248,442.02	-	248,442.02	2.28%
个人	1	2018-01-01 至 2018-01-04	301,258.11	-	301,258.11	-	-
	2	2018-01-05 至 2018-01-17	19,979.63	-	19,979.63	-	-
<b>产品特有风险</b>							
<p>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。</p> <p>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正常运作水平，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。</p>							

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会准予华夏新锦源混合注册的文件；
- 12.1.2 中国证监会核准华夏新锦源混合转型的文件；
- 12.1.3 《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 12.1.4 《华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 12.1.5 《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.6 《华夏新锦源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.7 法律意见书；

12.1.8 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.9 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一八年八月二十五日