

**华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）**  
**（原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）转型）**  
**2018 年第 3 季度报告**  
**2018 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十六日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24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。

根据基金管理人发布的《关于华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）触发转型条款并确定转型的公告》，华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）自2018年7月17日正式转型为华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）。

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。

华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）报告期自2018年7月17日起至2018年9月30日止，原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）报告期自2018年7月1日起至2018年7月16日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）及原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）。

## §2 基金产品概况

### 2.1 华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

基金简称	华夏磐泰混合（LOF）
场内简称	华夏磐泰
基金主代码	160323
交易代码	160323
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月17日
报告期末基金份额总额	40,687,473.41 份
投资目标	把握市场发展趋势，在控制风险的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。
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	本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*30%+上证国债指数收益率*70%。
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	中国工商银行股份有限公司

### 2.2 原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

基金简称	华夏磐泰定开混合（LOF）
场内简称	华夏磐泰
基金主代码	160323

交易代码	160323
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016年12月26日
报告期末基金份额总额	55,738,201.48份
投资目标	把握市场发展趋势，在控制风险的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。
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	本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*30%+上证国债指数收益率*70%。
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	中国工商银行股份有限公司

### §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	转型后	转型前
	报告期(2018年7月17日至2018年9月30日)	报告期(2018年7月1日至2018年7月16日)
1.本期已实现收益	-1,647,527.94	-3,614,022.86
2.本期利润	-826,698.62	-543,568.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0188	-0.0054
4.期末基金资产净值	39,936,172.30	55,698,456.34
5.期末基金份额净值	0.9815	0.9993

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自2018年7月17日起，由《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》修订而成的《华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

#### 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

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
自基金转型起至今	-1.78%	0.47%	0.19%	0.39%	-1.97%	0.08%

#### 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

华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

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7月17日至2018年9月30日)



注：①自 2018 年 7 月 17 日起，原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）。

②根据华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）的基金合同规定，基金管理人应当自转型为华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）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二十部分“四、基金转型后的投资”的有关约定。

### 3.2.2 原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

#### 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

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
2018 年 7 月 1 日-2018 年 7 月 16 日	0.06%	0.63%	-0.07%	0.49%	0.13%	0.14%

#### 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

华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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 12 月 26 日至 2018 年 7 月 16 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

#### 4.1.1 华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

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		
张城源	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2018-07-17	-	9年	中国人民大学法学硕士。2009年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理、投资研究部总经理助理等。
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2018-07-17	-	16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，华夏新锦略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年9月8日至2018年5月22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。

#### 4.1.2原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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		
张城源	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2016-12-26	2018-07-16	9年	中国人民大学法学硕士。2009年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理、投资研究部总经理助理等。
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2017-01-18	2018-07-16	16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。

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，全球经济仍处于复苏通道中，通胀提升，全球央行货币政策转向，多个区域进入加息周期；美元持续走强，对新兴市场货币造成较大冲击，新兴市场汇率和资本市场波动明显增加。面对外部的不确定性，国内货币市场流动性较为充裕，国家鼓励打通融资通道，改善信用环境。

3季度A股市场仍较为低迷，伴随资管新规的细则落地，市场有逐步企稳迹象。但由于贸易摩擦尚未最终解决，市场对于不确定性仍有所担忧，投资者对于相关方表态及政策发展变化仍较为敏感，在这一背景下，周期及大盘蓝筹股表现相对较好。

定增市场方面，3季度定增在获批项目数量、发行项目数量、募集资金规模、发行折扣率等方面仍处于较低水平。

报告期内，本基金在市场逐步企稳的过程中，保持了较高的仓位水平，重点配置了部分业绩改善且估值合理、受益于定增市场活跃的上市公司股票以及部分基本面扎实且估值合理的大盘蓝筹标的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至2018年7月16日，华夏磐泰定开混合（LOF）份额净值为0.9993元，2018年7月1日至7月16日期间份额净值增长率为0.06%，同期业绩比较基准收益率为-0.07%；转型后，截至2018年9月30日，华夏磐泰混合（LOF）份额净值为0.9815元，2018年7月17日至9月30日期间份额净值增长率为-1.78%，同期业绩比较基准收益率为0.19%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

转型前，华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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。转型后，华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）自2018年7月18日至2018年9月30日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

（报告期末为2018年9月30日，报告期间为2018年7月17日至2018年9月30日）

#### 5.1.1 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	10,487,950.39	25.11
	其中：股票	10,487,950.39	25.11
2	固定收益投资	24,910,297.00	59.63
	其中：债券	24,185,897.00	57.89
	资产支持证券	724,400.00	1.73
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,200,000.00	2.87
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,707,648.27	11.27
7	其他各项资产	469,574.62	1.12
8	合计	41,775,470.28	100.00

#### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,022,118.43	2.56
C	制造业	5,310,923.33	13.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	448,058.52	1.12
E	建筑业	296,234.91	0.74

华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）  
（原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年第3季度报告

F	批发和零售业	393,049.84	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	262,364.80	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,318,056.79	3.30
J	金融业	483,678.50	1.21
K	房地产业	322,825.50	0.81
L	租赁和商务服务业	630,639.77	1.58
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,487,950.39	26.26

5.1.3 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	000968	蓝焰控股	50,148	698,060.16	1.75
2	002557	洽洽食品	32,897	567,802.22	1.42
3	601318	中国平安	7,061	483,678.50	1.21
4	601727	上海电气	88,899	468,497.73	1.17
5	600900	长江电力	27,354	448,058.52	1.12
6	600519	贵州茅台	598	436,540.00	1.09
7	600104	上汽集团	12,524	416,798.72	1.04
8	002024	苏宁易购	29,158	393,049.84	0.98
9	002027	分众传媒	45,459	386,856.09	0.97
10	600398	海澜之家	36,828	378,960.12	0.95

5.1.4 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	4,100,800.00	10.27
2	央行票据	-	-

3	金融债券	18,488,600.00	46.30
	其中：政策性金融债	18,488,600.00	46.30
4	企业债券	50,330.00	0.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,546,167.00	3.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,185,897.00	60.56

5.1.5 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	180205	18 国开 05	100,000	10,459,000.00	26.19
2	010107	21 国债(7)	40,000	4,100,800.00	10.27
3	108602	国开 1704	40,000	4,026,000.00	10.08
4	018007	国开 1801	40,000	4,003,600.00	10.02
5	132014	18 中化 EB	14,910	1,546,167.00	3.87

5.1.6 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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142958	PR 康富 A3	40,000	724,400.00	1.81
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.1.7 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。

#### 5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.1.9.1 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。

##### 5.1.9.2 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。

#### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.1.10.1 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。

##### 5.1.10.2 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。

##### 5.1.10.3 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。

#### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

##### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,223.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	443,352.30
5	应收申购款	999.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	469,574.62
---	----	------------

#### 5.1.11.4 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。

#### 5.1.11.5 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。

#### 5.1.11.6 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。

### 5.2 原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

（报告期末为2018年7月16日，报告期间为2018年7月1日至2018年7月16日）

#### 5.2.1 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	18,990,659.07	25.38
	其中：股票	18,990,659.07	25.38
2	固定收益投资	41,571,900.80	55.57
	其中：债券	40,471,500.80	54.09
	资产支持证券	1,100,400.00	1.47
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	11,473,520.53	15.34
7	其他各项资产	2,780,571.56	3.72
8	合计	74,816,651.96	100.00

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.2.1 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 （%）

华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）  
（原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年第3季度报告

A	农、林、牧、渔业	311,893.86	0.56
B	采矿业	1,755,803.00	3.15
C	制造业	10,431,826.55	18.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	595,328.94	1.07
E	建筑业	464,620.29	0.83
F	批发和零售业	581,108.58	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	408,630.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,850,199.24	3.32
J	金融业	809,068.14	1.45
K	房地产业	547,613.25	0.98
L	租赁和商务服务业	1,234,567.22	2.22
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,990,659.07	34.10

5.2.3 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	601727	上海电气	209,100	1,131,231.00	2.03
2	000968	蓝焰控股	92,376	1,026,297.36	1.84
3	600276	恒瑞医药	11,459	856,101.89	1.54
4	002557	洽洽食品	47,849	756,014.20	1.36
5	600519	贵州茅台	935	705,625.80	1.27
6	600104	上汽集团	18,662	654,103.10	1.17
7	601318	中国平安	11,061	638,440.92	1.15
8	002027	分众传媒	62,359	631,696.67	1.13
9	600282	南钢股份	132,446	615,873.90	1.11
10	601888	中国国旅	8,335	602,870.55	1.08

#### 5.2.4 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	35,640,000.80	63.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,831,500.00	8.67
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,471,500.80	72.66

#### 5.2.5 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	122437	15 远洋 01	49,990	4,995,000.80	8.97
2	143203	17 电控 01	50,000	4,972,500.00	8.93
3	143165	17 世茂 G1	50,000	4,966,500.00	8.92
4	139391	17 观投债	50,000	4,954,500.00	8.90
5	136587	16 水务 01	50,000	4,937,000.00	8.86

#### 5.2.6 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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142958	PR 康富 A3	40,000	1,100,400.00	1.98
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-

8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

#### 5.2.7 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。

#### 5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.2.9.1 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。

##### 5.2.9.2 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。

#### 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.2.10.1 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。

##### 5.2.10.2 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。

##### 5.2.10.3 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。

#### 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

##### 5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,891.68
2	应收证券清算款	1,984,708.47
3	应收股利	-
4	应收利息	763,971.41

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,780,571.56

#### 5.2.11.4 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。

#### 5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	601727	上海电气	1,131,231.00	2.03	重大事项

#### 5.2.11.6 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

### 6.1 华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	55,738,201.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	74,316.72
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	15,125,044.79
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	40,687,473.41

注：自 2018 年 7 月 17 日起，由《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》修订而成的《华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

### 6.2 原华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	138,576,038.24
报告期基金总申购份额	1.00

减：报告期基金总赎回份额	82,837,837.76
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	55,738,201.48

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

2018年7月17日发布华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回、定期定额申购业务的公告。

2018年7月17日发布关于华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）触发转型条款并确定转型的公告。

2018年7月26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晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告。

2018年8月20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中国国际金融股份有限公司开通定期定额申购业务的公告。

2018年8月29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上海万得基金销售有限公司为代销机构的公告。

#### 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、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人，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 9 月 28 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 1/153；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 8/151；华夏沪港通恒生 ETF、华夏医药 ETF 在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 基金”中分别排序 2/113、8/113；华夏沪深 300 指数增强(C 类)在“股票基金-指数股票型基金-增强指数股票型基金（非 A 类）”中排序 7/18，华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)、华夏上证 50ETF 联接(A 类)在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/75 和 9/75。

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）华夏基金网上交易平台上线闪购业务，为客户提供了更便捷的基金交易方式；（2）对在线智能服务进行全新升级，将机器人小夏全面升级为理财小助手，帮助投资人一搜即达，让投资理财更加便捷、高效；（3）与开源证券、鼎信汇金、北京晟视天下等代销机构合作，为客户提供了更多理财渠道；（4）开展“世界那么大，定投华夏基金再出发”、“揭秘‘团长与团员默契度’”等活动，为客户提供了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 中国证监会准予华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）注册的文件；

9.1.2 《华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

9.1.3 《华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

9.1.4 《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

9.1.5 《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

9.1.6 法律意见书；

9.1.7 基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.8 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  
二〇一八年十月二十六日