

华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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。

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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 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.....	43
7.7 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.....	44
7.8 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.....	44
7.9 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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金	
基金简称	华夏睿磐泰茂混合	
基金主代码	004720	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	121,108,820.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
下属分级基金的交易代码	004720	004721
报告期末下属分级基金的份额总额	119,008,193.13 份	2,100,626.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，争取实现基金资产长期持续增值。
投资策略	本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例，为更好地适应不断变化的市场环境，本基金还将动态调整各类资产的配置比例。 在基于风险均衡资产配置策略应用过程中，本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露，以达到长期稳定、相对积极的波动水平，获得良好的风险调整后的收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%。
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	贺倩
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯

	泰大厦B座8层	晨世贸中心东座F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	周慕冰

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	报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
本期已实现收益	1,050,834.27	9,348.02
本期利润	11,458,789.66	80,813.06
加权平均基金份额本期利润	0.0706	0.0647
本期加权平均净值利润率	7.05%	6.49%
本期基金份额净值增长率	5.75%	5.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
期末可供分配利润	-93,121.89	-11,419.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0008	-0.0054
期末基金资产净值	121,397,363.82	2,132,677.95
期末基金份额净值	1.0201	1.0153
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
基金份额累计净值增长率	2.01%	1.53%

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。

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

华夏睿磐泰茂混合 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	1.10%	0.23%	1.02%	0.20%	0.08%	0.03%
过去三个月	-0.30%	0.32%	0.18%	0.24%	-0.48%	0.08%
过去六个月	5.75%	0.35%	5.38%	0.24%	0.37%	0.11%
过去一年	5.90%	0.33%	5.24%	0.23%	0.66%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.01%	0.33%	5.57%	0.21%	-3.56%	0.12%

华夏睿磐泰茂混合 C

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	1.08%	0.23%	1.02%	0.20%	0.06%	0.03%
过去三个月	-0.37%	0.32%	0.18%	0.24%	-0.55%	0.08%
过去六个月	5.60%	0.35%	5.38%	0.24%	0.22%	0.11%
过去一年	5.58%	0.33%	5.24%	0.23%	0.34%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.53%	0.33%	5.57%	0.21%	-4.04%	0.12%

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

华夏睿磐泰茂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

(2017 年 12 月 6 日至 2019 年 6 月 30 日)

华夏睿磐泰茂混合 A



华夏睿磐泰茂混合 C



§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、境内首批中日互通 ETF 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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

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 2019 年 6 月 30 日数据),华夏移动互联混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中排序 9/34;华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A 类)”中排序 8/27;华夏回报混合(H 类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非 A 类)”中排序 8/89;华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 1/228;华夏理财 30 天债券(A 类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A 类)”中排序 10/40;华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 7/19;华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(A 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A 类)”中排序 8/29;华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(C 类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非 A 类)”中排序 4/11;华夏上证 50ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/61;华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中排序 3/31;华夏沪深 300ETF 联接(C 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF

联接基金（非 A 类）”中排序 9/34。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上，华夏安康债券、华夏收益债券（QDII）和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏鼎茂债券（004042）荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖，华夏中小板 ETF（159902）荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019 年上半年度，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）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币 A 的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商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“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2017-12-06	-	19 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

					<p>基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）等。</p>
魏镇江	本基金的基金经理、固定收益部总监	2018-01-08	-	16 年	<p>北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任债券研究员，华夏理财 30 天债券型证券投资基金基金经理（2013 年 4 月 26 日至 2015 年 4 月 2 日期间）、华夏理财 21 天债券型证券投资基金基金经理（2013 年 4 月 26 日至 2015 年 4 月 2 日期间）、华夏鼎诚债券型证券投资基金基金经理（2016 年 12 月 13 日至 2017 年 8 月 30 日期间）、华夏鼎新债券型证券投资基金基金经理（2016 年 3 月 22 日至 2017 年 11 月 15 日期间）、华夏债券投资基金基金经理（2010 年 2 月 4 日至 2017 年 12 月 19 日期间）、华夏聚利债券型证券投资基金基金经理（2014 年 10 月 17 日至 2018 年 1 月 8 日期间）、华夏可转债增强债券型</p>

					证券投资基金基金经理（2016 年 9 月 27 日至 2018 年 1 月 8 日期间）、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 8 日至 2018 年 3 月 14 日期间）、华夏新锦顺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 12 月 17 日期间）、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间）、华夏新起点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 12 月 17 日期间）、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理（2017 年 9 月 8 日至 2018 年 12 月 17 日期间）等。
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2018-04-10	-	9 年	中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员，华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 24 日至 2018 年 9 月 10 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》等法律法规和基金合同，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，国内宏观经济增速先有所回升，但之后又回落。年初，随着稳增长措施的出台，经济企稳，但整体经济的杠杆水平上升。进入 4 月后，政策进行微调，重心转向促进经济转型。5 月，中美贸易摩擦纷争又起，引发全球经济动荡。上半年经济各分项表现中，内需有所走弱，汽车家电等大件消费较低，民间制造业投资信心仍有待恢复，基建投资略有上升，但仍处于低位，倒是房地产表现较好，销售和投资均增长。受贸易摩擦和全球经济走弱影响，外需也表现不佳。上半年货币政策整体保持宽松，债券收益率震荡下行，但信用风险事件频出。经济下行周期中，中小企业的资金压力较大。权益市场今年以来明显回暖，上证综指一季度持续上涨，领涨全球股市。二季度权益市场表现与一季度呈现较大反差，市场整体出现较大幅度回调，其中以一季度涨幅较大的创业板回调幅度最大，主板相对抗压。

本基金报告期内，股票端投资方面以量化策略进行投资管理；债券端拉长了久期，以持有高等级信用债为主，适当增加波段操作，同时维持一定的杠杆。同时，对可转债进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值为 1.0201 元，本报告期份额净值增长率为 5.75%；华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值为 1.0153 元，本报告期份额净值增长率为 5.60%，同期业绩比较基准增长率为 5.38%。

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，宏观经济难以迅速复苏。上半年经济增速的回落，有长期经济增长率下降的因素，也反映了短期内外部仍有一些不利条件，形势仍然复杂严峻。下半年贸易战的影响仍会存在，同时包商银行事件可能对部分企业信用会产生收缩的效果，如何解决实体经济信心仍将是政策重点考量

所在。在这种背景下，预计宽松政策仍将继续支持经济，短期难出现大的转向。总体来说，我们认为下半年债市仍存在一定机会，收益率有小幅下降空间，可积极关注高等级债券。可转债方面难见趋势性机会，预计仍是分化行情，更看好正股基本面良好的品种。在股票端，本基金将采用股票量化投资策略作为主投资策略，尽可能控制回撤，争取相对于市场的超额收益，挖掘景气向上的板块及其内部的绩优个股作为辅助策略。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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

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 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额

申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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

本托管人认为,华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,875,225.68	2,366,826.41
结算备付金		1,103,548.43	2,188,355.28
存出保证金		25,786.38	18,033.93
交易性金融资产	6.4.7.2	154,302,675.62	261,228,985.64
其中：股票投资		22,546,421.55	34,411,103.12
基金投资		-	-
债券投资		121,756,254.07	201,817,882.52
资产支持证券投资		10,000,000.00	25,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	290,715.05
应收利息	6.4.7.5	2,876,101.85	4,907,419.22
应收股利		-	-
应收申购款		571,493.42	1,394.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		160,754,831.38	271,001,730.35
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		35,900,000.00	58,677,000.00
应付证券清算款		500,221.80	71,945.27
应付赎回款		529,235.71	976,396.28
应付管理人报酬		81,869.60	146,569.98
应付托管费		20,467.40	36,642.50
应付销售服务费		275.91	408.58
应付交易费用	6.4.7.7	76,746.13	55,429.04
应交税费		12,949.29	19,232.13
应付利息		21,481.76	9,059.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,542.01	50,000.00
负债合计		37,224,789.61	60,042,683.30
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	121,108,820.11	218,700,653.89
未分配利润	6.4.7.10	2,421,221.66	-7,741,606.84
所有者权益合计		123,530,041.77	210,959,047.05
负债和所有者权益总计		160,754,831.38	271,001,730.35

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日华夏睿磐泰茂混合 A 基金份额净值 1.0201 元，华夏睿磐泰茂混合 C 基金份额净值 1.0153 元；华夏睿磐泰茂混合基金份额总额 121,108,820.11 份（其中 A 类 119,008,193.13 份，C 类 2,100,626.98 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		13,295,944.86	-6,945,585.50
1.利息收入		3,994,466.75	5,069,913.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,512.42	248,268.92
债券利息收入		3,361,300.34	3,575,369.75
资产支持证券利息收入		596,495.89	525,965.33
买入返售金融资产收入		158.10	720,309.20
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,181,016.21	-1,860,661.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,498,648.70	-1,728,104.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,055,014.60	-696,864.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	262,617.89	564,308.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,479,420.43	-12,356,595.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,073.89	2,201,758.05
减：二、费用		1,756,342.14	3,235,924.18
1.管理人报酬		652,408.62	1,385,145.91
2.托管费		163,102.17	346,286.53
3.销售服务费		1,867.18	3,482.35
4.交易费用	6.4.7.20	144,603.83	314,553.80
5.利息支出		674,152.94	1,078,184.89
其中：卖出回购金融资产支出		674,152.94	1,078,184.89
6.税金及附加		10,835.01	10,965.09
7.其他费用	6.4.7.21	109,372.39	97,305.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,539,602.72	-10,181,509.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,539,602.72	-10,181,509.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	218,700,653.89	-7,741,606.84	210,959,047.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,539,602.72	11,539,602.72
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）	-97,591,833.78	-1,376,774.22	-98,968,608.00
其中：1.基金申购款	2,372,592.48	34,701.69	2,407,294.17

2.基金赎回款	-99,964,426.26	-1,411,475.91	-101,375,902.17
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）	121,108,820.11	2,421,221.66	123,530,041.77
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 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）	873,970,404.35	2,141,413.85	876,111,818.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,181,509.68	-10,181,509.68
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）	-611,909,082.95	-1,589,763.33	-613,498,846.28
其中：1.基金申购款	2,821,940.57	-1,371.58	2,820,568.99
2.基金赎回款	-614,731,023.52	-1,588,391.75	-616,319,415.27
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）	262,061,321.40	-9,629,859.16	252,431,462.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏睿磐泰茂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[2017]720号《关于准予华夏睿磐泰茂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》、《华夏睿磐泰茂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 2017 年 11 月 6 日至 2017 年 12 月 1 日共募集 873,549,671.95 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2017）验字第 60739337_A33 号验资报告予以验证。经向中国证监会

备案,《华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 873,970,404.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 420,732.40 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交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、银行存款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(但须符合中国证监会相关规定)。

6.4.2 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 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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。
- 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、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。
- 7、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。
- 8、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。
- 9、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。
- 10、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,875,225.68
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	1,875,225.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,630,531.58	22,546,421.55	-84,110.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	109,625,185.46	111,436,254.07
	银行间市场	10,000,523.56	10,320,000.00
	合计	119,625,709.02	121,756,254.07
资产支持证券	10,000,000.00	10,000,000.00	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	152,256,240.60	154,302,675.62	2,046,435.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	357.45
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	496.60
应收债券利息	2,136,036.20
应收资产支持证券利息	739,200.00
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	11.60
合计	2,876,101.85

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	76,416.13
银行间市场应付交易费用	330.00
合计	76,746.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.67
预提费用	81,538.34
合计	81,542.01

6.4.7.9 实收基金

华夏睿磐泰茂混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	217,054,202.57	217,054,202.57
本期申购	1,027,833.09	1,027,833.09
本期赎回（以“-”号填列）	-99,073,842.53	-99,073,842.53
本期末	119,008,193.13	119,008,193.13

华夏睿磐泰茂混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,646,451.32	1,646,451.32
本期申购	1,344,759.39	1,344,759.39
本期赎回（以“-”号填列）	-890,583.73	-890,583.73
本期末	2,100,626.98	2,100,626.98

6.4.7.10 未分配利润

华夏睿磐泰茂混合 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	-1,762,231.77	-5,916,026.08	-7,678,257.85
本期利润	1,050,834.27	10,407,955.39	11,458,789.66
本期基金份额交易产生的变动数	618,275.61	-2,009,636.73	-1,391,361.12
其中：基金申购款	-7,730.46	22,615.15	14,884.69
基金赎回款	626,006.07	-2,032,251.88	-1,406,245.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-93,121.89	2,482,292.58	2,389,170.69

华夏睿磐泰茂混合 C

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	-18,498.50	-44,850.49	-63,348.99
本期利润	9,348.02	71,465.04	80,813.06
本期基金份额交易产生的变动数	-2,269.16	16,856.06	14,586.90
其中：基金申购款	-7,374.06	27,191.06	19,817.00
基金赎回款	5,104.90	-10,335.00	-5,230.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,419.64	43,470.61	32,050.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	活期存款利息收入	17,145.12
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	19,162.74	
其他	204.56	
合计	36,512.42	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	53,667,209.25
减：卖出股票成本总额	57,165,857.95
买卖股票差价收入	-3,498,648.70

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	250,084,604.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	241,845,360.38
减：应收利息总额	6,184,229.80
买卖债券差价收入	2,055,014.60

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	262,617.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	262,617.89

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	10,479,420.43
——股票投资	10,709,932.56
——债券投资	-230,512.13
——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	10,479,420.43

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	3,073.89
合计	3,073.89

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	142,731.33
银行间市场交易费用	1,872.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	144,603.83
----	------------

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	56,743.15
银行费用	9,234.05
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	109,372.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	652,408.62	1,385,145.91
其中：支付销售机构的客户维护费	244,529.37	654,738.17

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	163,102.17	346,286.53

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C	合计
华夏基金管理有限 公司	-	1,244.34	1,244.34

华夏财富	-	300.40	300.40
合计	-	1,544.74	1,544.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏睿磐泰茂混合A	华夏睿磐泰茂混合C	合计
华夏基金管理有限 公司	-	1,994.64	1,994.64
华夏财富	-	1,015.93	1,015.93
合计	-	3,010.57	3,010.57

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
中国农业银行活期存款	1,875,225.68	17,145.12	4,734,941.61	192,756.98

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113027	华钰转债	2019-06-14	2019-07-10	新发流通受限	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.00	-

6.4.12.2 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600510	黑牡丹	2019-06-19	重大事项	6.32	2019-07-03	6.95	200	1,206.59	1,264.00	-

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 35,900,000.00 元，分别于 2019 年 7 月 1 日、2019 年 7 月 2 日和 2019 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的

债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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之内。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。除在“6.4.12 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，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	1,875,225.68	-	-	1,875,225.68
结算备付金	1,103,548.43	-	-	1,103,548.43
结算保证金	25,786.38	-	-	25,786.38
债券投资	14,292,760.00	107,463,494.07	-	121,756,254.07
资产支持证券	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	35,900,000.00	-	-	35,900,000.00
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
银行存款	2,366,826.41	-	-	2,366,826.41
结算备付金	2,188,355.28	-	-	2,188,355.28
结算保证金	18,033.93	-	-	18,033.93
债券投资	72,078,350.32	110,308,439.40	19,431,092.80	201,817,882.52
资产支持证券	25,000,000.00	-	-	25,000,000.00
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	100.00	-	-	100.00

卖出回购金融资产款	58,677,000.00	-	-	58,677,000.00
-----------	---------------	---	---	---------------

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	利率下降 25 个基点	792,713.18	1,834,708.40
利率上升 25 个基点	-788,133.64	-1,807,723.69	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,546,421.55	18.25	34,411,103.12	16.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,546,421.55	18.25	34,411,103.12	16.31

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。		
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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	+5%	1,204,606.72	1,862,636.88
	-5%	-1,204,606.72	-1,862,636.88

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2019 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 89,680,141.26 元，第二层次的余额为 217,352,054.12 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止，第一层次的余额为 76,333,459.35 元，第二层次的余额为 184,895,526.29 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

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。

6.4.14.4 第三层次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 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	22,546,421.55	14.03
	其中：股票	22,546,421.55	14.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,756,254.07	81.96
	其中：债券	121,756,254.07	75.74
	资产支持证券	10,000,000.00	6.22
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	2,978,774.11	1.85
8	其他各项资产	3,473,381.65	2.16
9	合计	160,754,831.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	45,623.00	0.04
B	采矿业	588,184.45	0.48
C	制造业	11,651,762.94	9.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	714,291.00	0.58
E	建筑业	480,329.00	0.39
F	批发和零售业	651,039.60	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	607,918.00	0.49
H	住宿和餐饮业	13,423.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,435,094.56	1.16
J	金融业	3,856,297.94	3.12
K	房地产业	1,117,081.46	0.90
L	租赁和商务服务业	529,105.30	0.43
M	科学研究和技术服务业	53,932.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	14,640.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	173,122.30	0.14
R	文化、体育和娱乐业	596,073.00	0.48

S	综合	18,504.00	0.01
	合计	22,546,421.55	18.25

7.3 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	000651	格力电器	17,600	968,000.00	0.78
2	601318	中国平安	8,200	726,602.00	0.59
3	000333	美的集团	10,700	554,902.00	0.45
4	000858	五粮液	3,500	412,825.00	0.33
5	600519	贵州茅台	400	393,600.00	0.32
6	000002	万科 A	12,400	344,844.00	0.28
7	000960	锡业股份	30,200	337,334.00	0.27
8	600276	恒瑞医药	4,700	310,200.00	0.25
9	002415	海康威视	10,000	275,800.00	0.22
10	002353	杰瑞股份	11,300	261,030.00	0.21
11	601166	兴业银行	13,700	250,573.00	0.20
12	000001	平安银行	18,100	249,418.00	0.20
13	600036	招商银行	6,900	248,262.00	0.20
14	002195	二三四五	60,320	234,644.80	0.19
15	000999	华润三九	7,900	231,786.00	0.19
16	000623	吉林敖东	14,100	231,099.00	0.19
17	000600	建投能源	34,300	229,810.00	0.19
18	002056	横店东磁	30,200	229,520.00	0.19
19	600031	三一重工	17,200	224,976.00	0.18
20	601328	交通银行	35,900	219,708.00	0.18
21	601688	华泰证券	9,300	207,576.00	0.17
22	002038	双鹭药业	8,800	207,328.00	0.17
23	601211	国泰君安	11,100	203,685.00	0.16
24	600016	民生银行	28,380	180,213.00	0.15
25	601928	凤凰传媒	21,800	175,926.00	0.14
26	600143	金发科技	35,800	175,420.00	0.14
27	300015	爱尔眼科	5,590	173,122.30	0.14
28	600585	海螺水泥	4,100	170,150.00	0.14
29	600161	天坛生物	6,720	169,680.00	0.14
30	002064	华峰氨纶	33,600	168,672.00	0.14
31	000656	金科股份	27,900	168,237.00	0.14
32	002465	海格通信	17,600	167,904.00	0.14
33	603198	迎驾贡酒	9,000	161,190.00	0.13
34	300383	光环新网	9,100	152,607.00	0.12
35	601601	中国太保	4,100	149,691.00	0.12
36	601988	中国银行	39,800	148,852.00	0.12

37	600373	中文传媒	11,700	146,952.00	0.12
38	601877	正泰电器	6,333	146,228.97	0.12
39	601009	南京银行	17,700	146,202.00	0.12
40	600837	海通证券	10,100	143,319.00	0.12
41	000778	新兴铸管	31,700	140,748.00	0.11
42	603885	吉祥航空	10,700	140,170.00	0.11
43	300033	同花顺	1,400	137,704.00	0.11
44	600970	中材国际	21,000	135,030.00	0.11
45	002221	东华能源	15,600	134,316.00	0.11
46	002191	劲嘉股份	10,700	132,787.00	0.11
47	600885	宏发股份	5,400	131,220.00	0.11
48	600195	中牧股份	9,440	130,744.00	0.11
49	002146	荣盛发展	13,900	130,521.00	0.11
50	603866	桃李面包	3,100	129,115.00	0.10
51	300088	长信科技	25,300	128,018.00	0.10
52	601668	中国建筑	21,420	123,165.00	0.10
53	601818	光大银行	31,900	121,539.00	0.10
54	000544	中原环保	15,600	118,092.00	0.10
55	600104	上汽集团	4,600	117,300.00	0.09
56	600522	中天科技	12,700	116,459.00	0.09
57	600050	中国联通	18,900	116,424.00	0.09
58	600511	国药股份	5,000	114,850.00	0.09
59	600048	保利地产	8,900	113,564.00	0.09
60	600056	中国医药	8,400	113,316.00	0.09
61	000338	潍柴动力	9,100	111,839.00	0.09
62	000895	双汇发展	4,400	109,516.00	0.09
63	000997	新大陆	6,400	108,096.00	0.09
64	002818	富森美	8,410	107,900.30	0.09
65	600383	金地集团	9,000	107,370.00	0.09
66	601888	中国国旅	1,200	106,380.00	0.09
67	000709	河钢股份	35,500	106,145.00	0.09
68	600017	日照港	33,000	103,950.00	0.08
69	002372	伟星新材	5,880	102,312.00	0.08
70	000776	广发证券	7,400	101,676.00	0.08
71	002475	立讯精密	4,100	101,639.00	0.08
72	601066	中信建投	4,800	101,184.00	0.08
73	002419	天虹股份	7,700	100,562.00	0.08
74	000685	中山公用	11,700	99,918.00	0.08
75	601939	建设银行	13,300	98,952.00	0.08
76	600563	法拉电子	2,400	98,808.00	0.08
77	000581	威孚高科	5,300	98,368.00	0.08
78	601678	滨化股份	14,500	98,020.00	0.08
79	600887	伊利股份	2,900	96,889.00	0.08

80	600388	龙净环保	7,800	96,642.00	0.08
81	601225	陕西煤业	10,400	96,096.00	0.08
82	002373	千方科技	5,600	95,760.00	0.08
83	000425	徐工机械	21,400	95,444.00	0.08
84	002507	涪陵榨菜	3,100	94,550.00	0.08
85	603766	隆鑫通用	22,300	93,437.00	0.08
86	601169	北京银行	15,800	93,378.00	0.08
87	600881	亚泰集团	28,400	92,300.00	0.07
88	600694	大商股份	3,300	92,103.00	0.07
89	002171	楚江新材	14,400	91,584.00	0.07
90	002013	中航机电	13,300	91,504.00	0.07
91	000828	东莞控股	9,900	90,783.00	0.07
92	300365	恒华科技	5,600	90,776.00	0.07
93	002444	巨星科技	9,000	89,820.00	0.07
94	300295	三六五网	7,100	89,815.00	0.07
95	002317	众生药业	10,500	89,355.00	0.07
96	601006	大秦铁路	11,000	88,990.00	0.07
97	600597	光明乳业	8,200	88,150.00	0.07
98	600160	巨化股份	12,300	87,453.00	0.07
99	600968	海油发展	23,979	85,125.45	0.07
100	002304	洋河股份	700	85,092.00	0.07
101	300316	晶盛机电	6,500	82,485.00	0.07
102	002183	怡亚通	17,200	82,044.00	0.07
103	600886	国投电力	10,500	81,585.00	0.07
104	300687	赛意信息	5,100	80,988.00	0.07
105	002179	中航光电	2,380	79,634.80	0.06
106	601628	中国人寿	2,800	79,296.00	0.06
107	600606	绿地控股	11,500	78,545.00	0.06
108	000049	德赛电池	3,000	78,090.00	0.06
109	601607	上海医药	4,300	78,045.00	0.06
110	600170	上海建工	20,600	77,456.00	0.06
111	601020	华钰矿业	6,600	77,352.00	0.06
112	600028	中国石化	13,600	74,392.00	0.06
113	000061	农产品	13,500	73,170.00	0.06
114	600765	中航重机	7,900	72,917.00	0.06
115	600622	光大嘉宝	14,898	72,553.26	0.06
116	603328	依顿电子	7,000	71,890.00	0.06
117	600741	华域汽车	3,300	71,280.00	0.06
118	600000	浦发银行	6,100	71,248.00	0.06
119	600757	长江传媒	10,300	70,143.00	0.06
120	300182	捷成股份	15,800	69,678.00	0.06
121	600312	平高电气	9,000	69,210.00	0.06
122	601899	紫金矿业	18,000	67,860.00	0.05

123	300120	经纬辉开	10,700	67,838.00	0.05
124	002127	南极电商	6,000	67,440.00	0.05
125	601088	中国神华	3,300	67,254.00	0.05
126	600750	江中药业	5,125	66,676.25	0.05
127	000719	中原传媒	9,000	63,900.00	0.05
128	600256	广汇能源	17,900	63,724.00	0.05
129	601788	光大证券	5,500	62,810.00	0.05
130	601186	中国铁建	6,300	62,685.00	0.05
131	600690	青岛海尔	3,600	62,244.00	0.05
132	600884	杉杉股份	5,800	61,770.00	0.05
133	300166	东方国信	5,000	61,450.00	0.05
134	603806	福斯特	1,600	58,768.00	0.05
135	002563	森马服饰	5,300	58,618.00	0.05
136	002024	苏宁易购	5,100	58,548.00	0.05
137	300058	蓝色光标	13,400	57,218.00	0.05
138	002092	中泰化学	6,700	53,332.00	0.04
139	600309	万华化学	1,200	51,348.00	0.04
140	601800	中国交建	4,500	50,940.00	0.04
141	300150	世纪瑞尔	10,800	49,248.00	0.04
142	601996	丰林集团	15,600	48,048.00	0.04
143	002491	通鼎互联	5,900	47,731.00	0.04
144	600219	南山铝业	20,900	47,234.00	0.04
145	000898	鞍钢股份	12,350	46,806.50	0.04
146	600418	江淮汽车	9,000	46,440.00	0.04
147	000686	东北证券	5,100	44,931.00	0.04
148	600201	生物股份	2,800	43,932.00	0.04
149	600657	信达地产	10,200	42,024.00	0.03
150	000725	京东方 A	12,200	41,968.00	0.03
151	600019	宝钢股份	6,400	41,600.00	0.03
152	002028	思源电气	4,100	40,836.00	0.03
153	002120	韵达股份	1,300	40,066.00	0.03
154	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.03
155	002555	三七互娱	2,900	39,295.00	0.03
156	002128	露天煤业	4,500	38,925.00	0.03
157	000543	皖能电力	8,100	38,151.00	0.03
158	300498	温氏股份	1,000	35,860.00	0.03
159	600282	南钢股份	10,200	35,700.00	0.03
160	600406	国电南瑞	1,900	35,416.00	0.03
161	600018	上港集团	5,100	34,782.00	0.03
162	600027	华电国际	9,200	34,684.00	0.03
163	603259	药明康德	400	34,672.00	0.03
164	300019	硅宝科技	5,100	34,272.00	0.03
165	000157	中联重科	5,700	34,257.00	0.03

166	601003	柳钢股份	5,900	34,161.00	0.03
167	600900	长江电力	1,900	34,010.00	0.03
168	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
169	600325	华发股份	4,300	33,583.00	0.03
170	600009	上海机场	400	33,512.00	0.03
171	600567	山鹰纸业	9,800	33,026.00	0.03
172	601336	新华保险	600	33,018.00	0.03
173	600176	中国巨石	3,400	32,402.00	0.03
174	300144	宋城演艺	1,400	32,396.00	0.03
175	600835	上海机电	1,900	31,540.00	0.03
176	002311	海大集团	1,000	30,900.00	0.03
177	600779	水井坊	600	30,492.00	0.02
178	300100	双林股份	4,000	30,400.00	0.02
179	300061	康旗股份	4,300	29,541.00	0.02
180	600703	三安光电	2,600	29,328.00	0.02
181	000541	佛山照明	5,200	27,248.00	0.02
182	600346	恒力石化	2,240	27,238.40	0.02
183	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.02
184	601989	中国重工	4,700	26,132.00	0.02
185	300122	智飞生物	600	25,860.00	0.02
186	600398	海澜之家	2,700	24,489.00	0.02
187	603863	松炆资源	1,048	24,187.84	0.02
188	600483	福能股份	2,800	23,968.00	0.02
189	300130	新国都	1,500	23,850.00	0.02
190	000063	中兴通讯	700	22,771.00	0.02
191	002332	仙琚制药	3,300	22,308.00	0.02
192	300366	创意信息	2,200	22,242.00	0.02
193	600271	航天信息	900	20,745.00	0.02
194	600705	中航资本	3,800	20,596.00	0.02
195	600038	中直股份	500	20,510.00	0.02
196	600390	五矿资本	2,100	19,803.00	0.02
197	002273	水晶光电	1,700	19,686.00	0.02
198	001872	招商港口	1,200	19,572.00	0.02
199	603369	今世缘	700	19,523.00	0.02
200	002051	中工国际	1,700	19,499.00	0.02
201	002398	建研集团	3,000	19,260.00	0.02
202	600879	航天电子	3,100	19,096.00	0.02
203	002242	九阳股份	900	18,729.00	0.02
204	600138	中青旅	1,400	17,766.00	0.01
205	000848	承德露露	2,100	17,493.00	0.01
206	000021	深科技	2,100	17,073.00	0.01
207	600673	东阳光	2,100	16,485.00	0.01
208	600426	华鲁恒升	1,100	16,346.00	0.01

209	002478	常宝股份	2,700	16,335.00	0.01
210	600643	爱建集团	1,700	16,286.00	0.01
211	002583	海能达	1,900	15,941.00	0.01
212	000900	现代投资	3,300	15,378.00	0.01
213	000563	陕国投 A	3,300	14,652.00	0.01
214	601811	新华文轩	1,200	14,652.00	0.01
215	002027	分众传媒	2,700	14,283.00	0.01
216	601137	博威合金	1,400	13,762.00	0.01
217	300146	汤臣倍健	700	13,580.00	0.01
218	600901	江苏租赁	2,200	13,398.00	0.01
219	601801	皖新传媒	2,200	13,222.00	0.01
220	000758	中色股份	2,400	13,176.00	0.01
221	002110	三钢闽光	1,400	13,020.00	0.01
222	002572	索菲亚	700	12,992.00	0.01
223	002624	完美世界	500	12,905.00	0.01
224	601158	重庆水务	2,300	12,880.00	0.01
225	600258	首旅酒店	700	12,586.00	0.01
226	601677	明泰铝业	1,200	12,372.00	0.01
227	600826	兰生股份	1,100	12,298.00	0.01
228	600332	白云山	300	12,291.00	0.01
229	600475	华光股份	1,100	11,968.00	0.01
230	600999	招商证券	700	11,963.00	0.01
231	000596	古井贡酒	100	11,851.00	0.01
232	600482	中国动力	500	11,810.00	0.01
233	002649	博彦科技	1,300	11,583.00	0.01
234	600710	苏美达	2,000	11,500.00	0.01
235	601139	深圳燃气	2,000	11,380.00	0.01
236	300388	国祯环保	1,200	11,316.00	0.01
237	300339	润和软件	800	11,280.00	0.01
238	600035	楚天高速	3,300	11,154.00	0.01
239	600308	华泰股份	2,500	11,150.00	0.01
240	600704	物产中大	2,000	10,840.00	0.01
241	002065	东华软件	1,500	10,485.00	0.01
242	600572	康恩贝	1,600	10,240.00	0.01
243	000100	TCL 集团	3,000	9,990.00	0.01
244	600600	青岛啤酒	200	9,986.00	0.01
245	603609	禾丰牧业	800	9,472.00	0.01
246	000963	华东医药	360	9,345.60	0.01
247	000036	华联控股	1,820	9,300.20	0.01
248	600816	安信信托	1,800	9,090.00	0.01
249	000525	红太阳	700	9,037.00	0.01
250	000069	华侨城 A	1,300	9,035.00	0.01
251	600566	济川药业	300	9,033.00	0.01

252	600655	豫园股份	1,100	9,009.00	0.01
253	600668	尖峰集团	700	8,960.00	0.01
254	600820	隧道股份	1,400	8,834.00	0.01
255	603612	索通发展	800	8,568.00	0.01
256	600850	华东电脑	400	8,516.00	0.01
257	600389	江山股份	400	8,440.00	0.01
258	601138	工业富联	700	8,435.00	0.01
259	600487	亨通光电	500	8,380.00	0.01
260	000538	云南白药	100	8,342.00	0.01
261	601016	节能风电	3,100	8,246.00	0.01
262	601933	永辉超市	800	8,168.00	0.01
263	002541	鸿路钢构	1,000	7,910.00	0.01
264	000627	天茂集团	1,200	7,788.00	0.01
265	002391	长青股份	1,000	7,690.00	0.01
266	002299	圣农发展	300	7,596.00	0.01
267	002048	宁波华翔	700	7,574.00	0.01
268	002468	申通快递	300	7,482.00	0.01
269	600845	宝信软件	260	7,404.80	0.01
270	002100	天康生物	900	7,290.00	0.01
271	600053	九鼎投资	300	6,990.00	0.01
272	600737	中粮糖业	800	6,944.00	0.01
273	000825	太钢不锈	1,700	6,919.00	0.01
274	002039	黔源电力	500	6,850.00	0.01
275	601369	陕鼓动力	1,000	6,630.00	0.01
276	600352	浙江龙盛	400	6,308.00	0.01
277	600062	华润双鹤	500	6,305.00	0.01
278	601100	恒立液压	200	6,276.00	0.01
279	600859	王府井	400	6,076.00	0.00
280	000860	顺鑫农业	130	6,064.50	0.00
281	601231	环旭电子	500	6,025.00	0.00
282	601199	江南水务	1,500	5,895.00	0.00
283	601398	工商银行	1,000	5,890.00	0.00
284	600919	江苏银行	800	5,808.00	0.00
285	603228	景旺电子	140	5,601.40	0.00
286	600481	双良节能	1,500	5,550.00	0.00
287	600516	方大炭素	447	5,493.63	0.00
288	601126	四方股份	900	5,382.00	0.00
289	300082	奥克股份	800	5,272.00	0.00
290	600897	厦门空港	200	4,822.00	0.00
291	000951	中国重汽	300	4,815.00	0.00
292	002152	广电运通	700	4,795.00	0.00
293	603968	醋化股份	300	4,791.00	0.00
294	300098	高新兴	600	4,788.00	0.00

295	600787	中储股份	800	4,584.00	0.00
296	002083	孚日股份	800	4,520.00	0.00
297	000987	越秀金控	500	4,510.00	0.00
298	002396	星网锐捷	200	4,488.00	0.00
299	600612	老凤祥	100	4,470.00	0.00
300	600664	哈药股份	1,000	4,140.00	0.00
301	603306	华懋科技	300	3,963.00	0.00
302	002001	新和成	200	3,858.00	0.00
303	601111	中国国航	400	3,828.00	0.00
304	601992	金隅集团	1,000	3,760.00	0.00
305	600548	深高速	400	3,756.00	0.00
306	600551	时代出版	400	3,628.00	0.00
307	600089	特变电工	500	3,625.00	0.00
308	600959	江苏有线	800	3,560.00	0.00
309	000750	国海证券	700	3,521.00	0.00
310	603898	好莱客	200	3,308.00	0.00
311	600742	一汽富维	300	3,201.00	0.00
312	600894	广日股份	400	3,132.00	0.00
313	601019	山东出版	400	3,112.00	0.00
314	000539	粤电力 A	700	3,010.00	0.00
315	600183	生益科技	200	3,010.00	0.00
316	600790	轻纺城	800	2,904.00	0.00
317	300378	鼎捷软件	200	2,698.00	0.00
318	600569	安阳钢铁	900	2,628.00	0.00
319	000789	万年青	260	2,605.20	0.00
320	600782	新钢股份	500	2,500.00	0.00
321	601999	出版传媒	400	2,464.00	0.00
322	000598	兴蓉环境	500	2,275.00	0.00
323	002271	东方雨虹	100	2,266.00	0.00
324	600188	兖州煤业	200	2,174.00	0.00
325	600596	新安股份	200	2,152.00	0.00
326	600377	宁沪高速	200	2,148.00	0.00
327	002254	泰和新材	200	2,116.00	0.00
328	600971	恒源煤电	360	2,106.00	0.00
329	002595	豪迈科技	100	2,101.00	0.00
330	600797	浙大网新	200	2,038.00	0.00
331	000551	创元科技	300	2,019.00	0.00
332	000528	柳工	300	1,998.00	0.00
333	300335	迪森股份	300	1,959.00	0.00
334	600507	方大特钢	200	1,956.00	0.00
335	600761	安徽合力	200	1,920.00	0.00
336	600067	冠城大通	400	1,884.00	0.00
337	600862	中航高科	200	1,798.00	0.00

338	600376	首开股份	200	1,786.00	0.00
339	600808	马钢股份	500	1,705.00	0.00
340	600323	瀚蓝环境	100	1,688.00	0.00
341	600580	卧龙电驱	200	1,682.00	0.00
342	002159	三特索道	100	1,636.00	0.00
343	300468	四方精创	100	1,629.00	0.00
344	000899	赣能股份	300	1,578.00	0.00
345	603877	太平鸟	100	1,552.00	0.00
346	002182	云海金属	200	1,522.00	0.00
347	600500	中化国际	200	1,494.00	0.00
348	600469	风神股份	300	1,470.00	0.00
349	002482	广田集团	300	1,458.00	0.00
350	600723	首商股份	200	1,372.00	0.00
351	002635	安洁科技	100	1,349.00	0.00
352	300047	天源迪科	160	1,339.20	0.00
353	002697	红旗连锁	200	1,294.00	0.00
354	600510	黑牡丹	200	1,264.00	0.00
355	600133	东湖高新	200	1,262.00	0.00
356	600775	南京熊猫	100	1,236.00	0.00
357	600650	锦江投资	100	1,205.00	0.00
358	600081	东风科技	100	1,190.00	0.00
359	002233	塔牌集团	100	1,168.00	0.00
360	000877	天山股份	100	1,162.00	0.00
361	002091	江苏国泰	200	1,142.00	0.00
362	600371	万向德农	100	1,134.00	0.00
363	600064	南京高科	100	1,071.00	0.00
364	300229	拓尔思	100	1,054.00	0.00
365	600097	开创国际	100	1,033.00	0.00
366	600033	福建高速	300	981.00	0.00
367	600231	凌钢股份	300	966.00	0.00
368	000631	顺发恒业	300	900.00	0.00
369	002232	启明信息	100	882.00	0.00
370	002238	天威视讯	100	863.00	0.00
371	000524	岭南控股	100	837.00	0.00
372	600210	紫江企业	200	810.00	0.00
373	002441	众业达	100	794.00	0.00
374	300296	利亚德	100	783.00	0.00
375	000026	飞亚达 A	100	777.00	0.00
376	000519	中兵红箭	100	773.00	0.00
377	000429	粤高速 A	100	755.00	0.00
378	601700	风范股份	100	604.00	0.00
379	002314	南山控股	200	600.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	784,434.00	0.37
2	000651	格力电器	557,570.00	0.26
3	000333	美的集团	485,101.00	0.23
4	600519	贵州茅台	449,972.00	0.21
5	600276	恒瑞医药	418,380.00	0.20
6	601166	兴业银行	404,992.00	0.19
7	000002	万科 A	369,570.00	0.18
8	002353	杰瑞股份	361,737.00	0.17
9	000858	五粮液	354,168.00	0.17
10	601328	交通银行	348,879.00	0.17
11	601988	中国银行	337,457.00	0.16
12	600036	招商银行	326,739.00	0.15
13	600694	大商股份	314,289.00	0.15
14	601818	光大银行	301,618.00	0.14
15	000778	新兴铸管	298,907.00	0.14
16	601211	国泰君安	297,500.00	0.14
17	000581	威孚高科	295,551.00	0.14
18	600886	国投电力	294,460.00	0.14
19	000997	新大陆	289,537.00	0.14
20	000656	金科股份	289,215.00	0.14

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。

7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	5,229,511.51	2.48
2	601398	工商银行	5,125,437.00	2.43
3	601899	紫金矿业	4,153,851.00	1.97
4	600195	中牧股份	2,678,511.00	1.27
5	601601	中国太保	2,666,843.00	1.26
6	000776	广发证券	2,048,318.00	0.97
7	600622	光大嘉宝	2,041,752.00	0.97
8	000960	锡业股份	1,872,694.00	0.89
9	601318	中国平安	981,607.00	0.47
10	601166	兴业银行	626,494.00	0.30

11	601988	中国银行	467,947.00	0.22
12	600036	招商银行	411,764.00	0.20
13	601328	交通银行	394,020.00	0.19
14	600886	国投电力	391,551.00	0.19
15	600741	华域汽车	383,333.00	0.18
16	600837	海通证券	370,093.00	0.18
17	601211	国泰君安	349,438.00	0.17
18	600519	贵州茅台	346,739.00	0.16
19	000858	五粮液	321,660.00	0.15
20	601006	大秦铁路	319,538.00	0.15

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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	34,591,243.82
卖出股票的收入（成交）总额	53,667,209.25

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,294,160.00	5.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	102,156,094.07	82.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,320,000.00	8.35
7	可转债（可交换债）	1,986,000.00	1.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,756,254.07	98.56

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112292	16 冀中 01	104,667	10,698,014.07	8.66
2	124252	13 邯交通	100,000	10,387,000.00	8.41

3	143505	18 舟交 01	100,000	10,371,000.00	8.40
4	143361	17 中冶 01	100,000	10,325,000.00	8.36
5	143563	18 张江 01	100,000	10,309,000.00	8.35

7.7 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

金额单位：人民币元

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	116823	逸锆优 2	100,000.00	10,000,000.00	8.10

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	25,786.38

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,876,101.85
5	应收申购款	571,493.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,473,381.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	1,978,000.00	1.60

7.12.5 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。

7.12.6 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 期末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
华夏睿磐泰茂混合 A	3,074	38,714.44	733,518.93	0.62%	118,274,674.20	99.38%
华夏睿磐泰茂混合 C	2,749	764.14	-	-	2,100,626.98	100.00%
合计	5,823	20,798.35	733,518.93	0.61%	120,375,301.18	99.39%

8.2 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	华夏睿磐泰茂混合 A	15,672.17	0.01%
	华夏睿磐泰茂混合 C	10,044.60	0.48%
	合计	25,716.77	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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 研究部门负责人持有本开放式基金	华夏睿磐泰茂混合 A	0
	华夏睿磐泰茂混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	华夏睿磐泰茂混合 A	0~10
	华夏睿磐泰茂混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏睿磐泰茂混合 A	华夏睿磐泰茂混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	869,223,480.85	4,746,923.50
本报告期期初基金份额总额	217,054,202.57	1,646,451.32
本报告期基金总申购份额	1,027,833.09	1,344,759.39
减：本报告期基金总赎回份额	99,073,842.53	890,583.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	119,008,193.13	2,100,626.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周璇女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

本基金本报告期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无受稽查或处罚等情况。

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

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	
申万宏源证券	1	60,123,167.58	68.28%	55,991.40	73.27%	-
广发证券	1	27,928,530.59	31.72%	20,424.73	26.73%	-

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除本表列示外，本基金还选择了安信证券、东吴证券、高华证券、光大证券、国海证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华泰证券、华西证券、联讯证券、西部证券、新时代证券、银河证券、长江证券、中投证券、中信建投、中银国际证券和华创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在上述租用的券商交易单元中，长城证券、海通证券和华创证券的部分交易单元为本基金本

期新增的交易单元，本期没有剔除的券商交易单元。

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

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
申万宏源证券	185,773,435.41	61.11%	1,870,100,000.00	93.01%
广发证券	118,215,342.47	38.89%	140,495,000.00	6.99%

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	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华融湘江银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-04
3	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场内外账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
5	华夏基金管理有限公司关于华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-31
6	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04

§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

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金合同》;

12.1.3 《华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金托管协议》;

12.1.4 法律意见书;

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照;

12.1.6 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

二〇一九年八月二十九日