

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型
证券投资基金（LOF）转型）

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十六日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

根据基金管理人于 2018 年 12 月 14 日发布的《关于华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）触发转型条款并确定转型的公告》，华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）自 2018 年 12 月 14 日正式转型为华夏磐晟灵活配置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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自 2018 年 12 月 14 日起至 2018 年 12 月 31 日止，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 13 日止。如无特殊说明，本报告中“本基金”指华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）及原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金名称	华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏磐晟混合（LOF）
场内简称	华夏磐晟
基金主代码	160324
交易代码	160324
基金运作方式	契约型开放式
基金转型日	2018年12月14日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,559,472.71份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年8月8日

注：原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）于2018年12月14日转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

2.1.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金名称	华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏磐晟定开混合（LOF）
场内简称	华夏磐晟
基金主代码	160324
交易代码	160324
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017年5月31日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	256,358,338.46份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年8月8日

2.2 基金产品说明

2.2.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	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,低于股票基金,属于较高风险、较高收益的品种。

2.2.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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	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,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	95566
传真	010-63136700	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年 5 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12
	转型后	转型前	

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

	报告期 (2018 年 12 月 14 日起至 2018 年 12 月 31 日)	报告期 (2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 13 日)	月 31 日
本期已实现收益	1,914,215.38	-52,972,087.13	-14,012,818.05
本期利润	-7,703,375.76	-47,532,436.35	-17,905,076.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0310	-0.1310	-0.0490
本期加权平均净值利润率	-3.92%	-14.62%	-4.92%
本期基金份额净值增长率	-3.72%	-13.71%	-4.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2018 年 12 月 31 日)	报告期末 (2018 年 12 月 13 日)	2017 年末
期末可供分配利润	-51,135,084.17	-47,387,079.16	-17,905,076.05
期末可供分配基金份额利润	-0.2099	-0.1848	-0.0490
期末基金资产净值	192,424,388.54	210,361,243.55	347,850,976.15
期末基金份额净值	0.7901	0.8206	0.9510
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2018 年 12 月 31 日)	报告期末 (2018 年 12 月 13 日)	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-3.72%	-17.94%	-4.90%

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 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)。

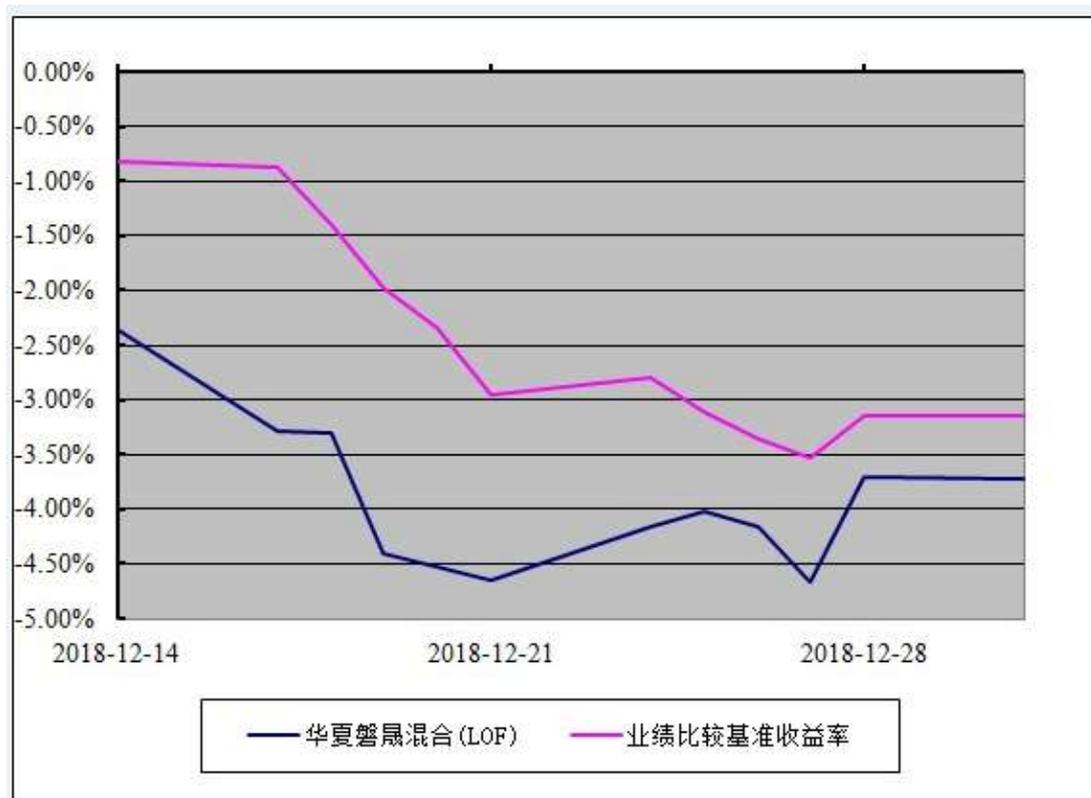
3.2 基金净值表现

3.2.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

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
自基金转型起至今	-3.72%	0.86%	-3.15%	0.35%	-0.57%	0.51%

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

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
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 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日）

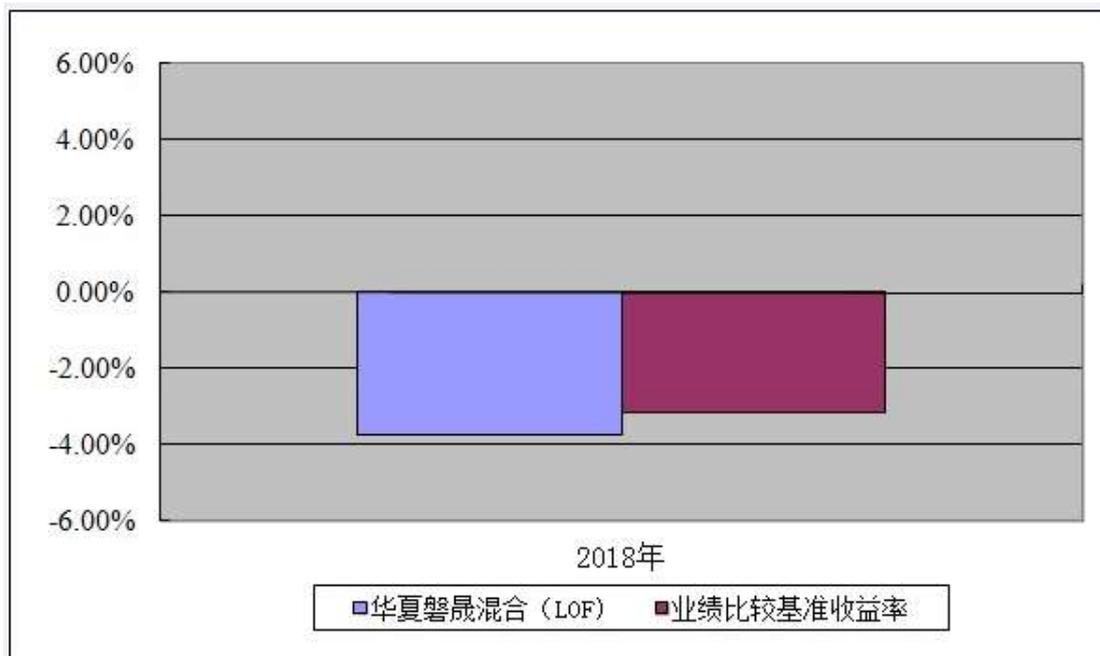


注：①自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

②根据华夏磐晟灵活配置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晟灵活配置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。

3.2.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比如图



注：自2018年12月14日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF），转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置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	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
过去三个月	-0.05%	1.79%	1.35%	0.85%	-1.40%	0.94%
过去六个月	-15.24%	1.65%	-6.63%	0.77%	-8.61%	0.88%
过去一年	-12.79%	1.48%	-7.61%	0.67%	-5.18%	0.81%
自基金合同生效起至转型前	-17.94%	1.22%	-0.37%	0.57%	-17.57%	0.65%

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

原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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

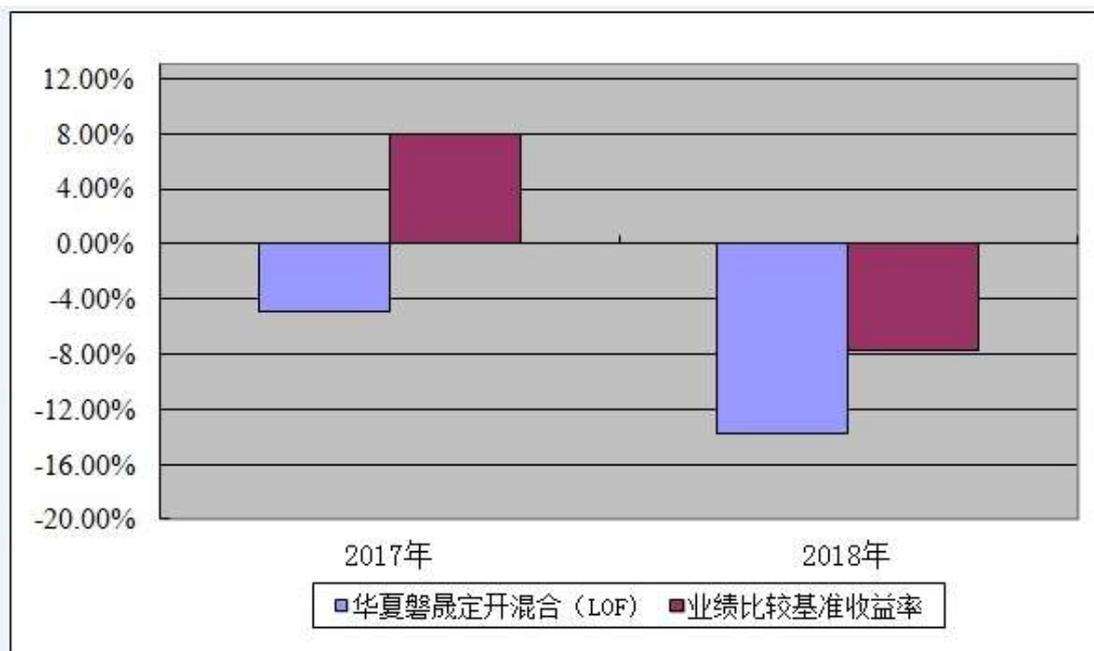
（2017年5月31日至2018年12月13日）



3.2.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本基金自基金转型以来以来无利润分配事项。

3.3.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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、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 12 月 31 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）”中排名 2/152；华夏圆和混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+ 基准股票比例 60%-100%）”中排名 9/346；华夏沪港通恒生 ETF、华夏金融 ETF 在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 基金”中分别排名 1/109 和 9/109；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）”中分别排名 2/73 和 10/73。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“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，公司荣获公募基金 20

周年“金基金”TOP 基金公司大奖，旗下华夏沪深 300ETF 荣获第十五届“金基金”指数基金奖（一年期），华夏上证 50ETF 荣获第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。

在客户服务方面，2018 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）华夏基金网上交易平台上线闪购业务，为客户提供更便捷的基金交易方式；（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情况，进一步提升客户体验；（3）对在线智能服务机器人小夏进行全新升级，帮助投资人一搜即达，让投资理财更加便捷、高效；（4）与中原银行、西安银行、长沙银行、开源证券等基金销售机构合作，为客户提供更多理财渠道；（5）开展“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”、“揭秘‘团长与团员默契度’”、“大胆预测退休金”等活动，为客户提供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 华夏磐晟灵活配置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		
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2018-12-14	-	10 年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009 年 8 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、投资经理，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2013 年 3 月 11 日至 2017 年 2 月 24 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。

4.1.2.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置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	2017-05-31	2018-07-24	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。

	级副总裁				
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2018-01-17	2018-12-13	10 年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009 年 8 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、投资经理，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2013 年 3 月 11 日至 2017 年 2 月 24 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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

2018年以来，金融去杠杆的影响蔓延到实体，导致信用收缩成为影响2018年国内宏观经济的主要逻辑，社融在2018年初走弱，社融存量增速从2017年底的13.4%回落至2018年底的9.8%。实际GDP增速从2017年底的6.8%回落至2018年4季度的6.4%，投资和消费增速也明显下滑。国内经济下行压力逐步体现的同时，外围环境的不确定性也在持续上升，中美贸易战持续升级给未来国内经济增长的预期蒙上阴霾。下半年，国内宏观政策逐渐转向“稳增长”与“调结构”之间的再平衡，货币政策较为宽松，金融市场间流动性十分充裕，但由于非标等信用投放通道收紧，流动性并没有显著传导到实体经济。

海外方面，2018年，美国经济表现相对非美经济体更强，支持美元指数大幅上涨。但是，与过往周期不同，本轮美国通过贸易保护及输出能源等大幅降低需求外溢，使得贸易逆差占GDP比重持续收窄。在逆全球化盛行背景下，全球产业资本也开始从新兴经济体大规模回流美国。

金融市场方面，2018全年沪深300下跌25.31%，弱于美股、港股、伦敦市场等其他几个全球主要股票市场，仅休闲服务、银行、食品饮料、农林牧渔和计算机5个行业跑赢沪深300。跌幅最小的休闲服务全年收跌10.6%，跌幅最大的电子全年收跌42.4%。整体看，板块效应较弱，且行业轮动转换的速度较快。1月金融地产的躁动拉动全面的大盘风格，2月中美贸易摩擦升温后，市场风格迅速转向小盘成长。而伴随5月信用风险暴露，大盘风格再度领先，11月政策密集出台，风格再度转向小盘股。

报告期内，本基金增加了对计算机、通信和食品板块的配置，减持了白酒和医药，取得了较好收益。但由于对全年宏观经济的判断不够准确，未能大幅配置全年跌幅较小的银行板块，拖累了组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至2018年12月13日，华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额净值为0.8206元，2018年1月1日至12月13日期间份额净值增长率为-13.71%，同期业绩比较基准收益率为-7.78%；转型后，截至2018年12月31日，华夏磐晟灵活配置混合型证券投资

资基金（LOF）份额净值为0.7901元，2018年12月14日至12月31日期间份额净值增长率为-3.72%，同期业绩比较基准收益率为-3.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，经济下行压力或将继续释放，GDP 增速或将继续回落。从宏观经济的领先指标来看，经济的触底企稳至少需要等到 19 年 3 季度末之后。全年主要宏观分项普遍存在下行压力，其中，地产和制造业的投资增速都会有所回落，考虑基建的对冲，投资增速依然呈回落的态势。作为后周期概念的消费增速，受外部环境影响的出口增速，2019 年都将面临一定的下行压力。伴随近期政策维稳的持续加码，信用环境已经处于筑底过程，社融存量增速或在 1 季度前后企稳，对应实体经济的底，或需要等到 3 季度末之后才能出现。

2019 年，全球进入比差阶段，新兴尾部风险累积，市场或全面开启 Risk-off 模式。伴随企业端景气见顶回落、加速下滑，美国即将迎来景气拐点：预计 2019 年消费贡献仍然稳定，但私人投资和政府购买的贡献将下降，从而拖累经济增速。预计经济增速将从 2018 年的 2.8%-3% 下降至 2019 年的 2%-2.5%。受特朗普贸易保护和中国经济承压等影响，欧洲等非美经济体景气或趋于加速下滑。

展望 2019 年的股票市场，市场正在经历政策底-市场底-盈利底的磨底过程，在目前宽货币紧信用的前提下，与宏观相关性较强的行业和板块 EPS 继续下修的概率较大，因此我们更看好和宏观经济周期相关性较弱的板块，特别是能代表未来产业发展方向的“硬科技”类公司，此外在资产荒的背景下，股息率较高且稳定的品种也值得持有。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司认真落实资管新规及其配套规则、债券交易合规管理、货币市场基金互联网销售等行业新规，紧密跟踪监管要求，促进公司业务合法合规；公司不断完善内部制度建设，制定了非居民金融账户涉税信息尽职调查管理制度、案件管理制度、合同管理制度、知识产权管理制度等多项制度，修订了投资者适当性管理制度，编制了合规管理白皮书；公司以投资研究和销售业务条线为重点，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和新颁布的法律法规，开展合规培训，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范

各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理、投资组合强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.8 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。会计师事务所对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。

4.9 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。

4.10 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金

份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

普华永道中天审字（2019）第 22376 号

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：

6.1.1 审计意见

（1）我们审计的内容

我们审计了华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金(LOF)，以下简称“华夏磐晟混合（LOF）基金”）的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 12 月 14 日（基金转型日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（2）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏磐晟混合（LOF）基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 12 月 14 日（基金转型日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.1.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏磐晟混合（LOF）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏磐晟混合(LOF)基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)

管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏磐晟混合（LOF）基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏磐晟混合（LOF）基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏磐晟混合（LOF）基金的财务报告过程。

6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏磐晟混合（LOF）基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致华夏磐晟混合（LOF）基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反

映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

单峰 赵雪

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

2019 年 3 月 22 日

6.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

普华永道中天审字（2019）第 22426 号

华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：

6.2.1 审计意见

（1）我们审计的内容

我们审计了华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“华夏磐晟定开混合（LOF）基金”）的财务报表，包括 2018 年 12 月 13 日（基金转型前日）的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日（基金转型前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

（2）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏磐晟定开混合（LOF）基金 2018 年 12 月 13 日（基金转型前日）的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日（基金转型前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏磐晟定开混合（LOF）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏磐晟定开混合（LOF）基金的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏磐晟定开混合（LOF）基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏磐晟定开混合（LOF）基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏磐晟定开混合（LOF）基金的财务报告过程。

6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华夏磐晟定开混合（LOF）基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年年度报告（摘要）

应收申购款		11,995.61
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		197,578,812.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,134,206.38
应付赎回款		534,511.44
应付管理人报酬		275,067.87
应付托管费		45,844.62
应付销售服务费		-
应付交易费用		2,114,766.11
应交税费		27.62
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		50,000.00
负债合计		5,154,424.04
所有者权益：		
实收基金		243,559,472.71
未分配利润		-51,135,084.17
所有者权益合计		192,424,388.54
负债和所有者权益总计		197,578,812.58

注：①自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF），本报告期自 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日。

②报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7901 元；基金份额总额 243,559,472.71 份。

7.1.2 利润表

会计主体：华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 12 月 14 日 (基金转型日) 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-7,393,625.01
1.利息收入		15,195.92
其中：存款利息收入		14,714.32
债券利息收入		481.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益 (损失以“-”填列)		2,202,579.59
其中：股票投资收益		2,202,579.59
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)		-9,617,591.14
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)		6,190.62
减：二、费用		309,750.75
1.管理人报酬		145,296.64
2.托管费		24,216.10
3.销售服务费		-
4.交易费用		129,840.09
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		1.45
7.其他费用		10,396.47
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-7,703,375.76
减：所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-7,703,375.76

注：自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金(LOF),本报告期自 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日。

7.1.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 12 月 14 日 (基金转型日) 至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 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)	256,358,338.46	-45,997,094.91	210,361,243.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-7,703,375.76	-7,703,375.76
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)	-12,798,865.75	2,565,386.50	-10,233,479.25
其中: 1.基金申购款	180,997.60	-37,417.32	143,580.28
2.基金赎回款	-12,979,863.35	2,602,803.82	-10,377,059.53
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)	243,559,472.71	-51,135,084.17	192,424,388.54

注: 自 2018 年 12 月 14 日起, 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF), 本报告期自 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4 财务报表由下列负责人签署:

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

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 重要会计政策和会计估计

7.1.4.1.1 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 12 月 14 日 (基金转型日) 至 2018 年 12 月 31 日。

7.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.1.4.1.3 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变动计入当期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。

7.1.4.1.4 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。

7.1.4.1.5 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。

7.1.4.1.6 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。

7.1.4.1.7 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。

7.1.4.1.8 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。

7.1.4.1.9 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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

7.1.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.1.4.1.11 基金的收益分配政策

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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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。

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。

7.1.4.1.12 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，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.1.4.2 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。

7.1.4.3 关联方关系

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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。

7.1.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	10,129,890.66	11.88%

7.1.4.4.1.2 权证交易

无。

7.1.4.4.1.3 债券交易

无。

7.1.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.1.4.4.1.5 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 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 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	8,606.92	13.55%	8,606.92	0.41%

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。

7.1.4.4.2 关联方报酬

7.1.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	145,296.64
其中：支付销售机构的客户维护费	32,496.55

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 1.50%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×1.50%/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。

7.1.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	24,216.10	

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 0.25%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×0.25%/当年天数。

7.1.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.1.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.1.4.4.4.2 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。

7.1.4.4.5 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 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	41,309,610.53	13,595.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.1.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.1.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.1.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.1.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.1.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.1.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.1.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.1.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.1.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.1.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.1.4.6.1 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。

7.1.4.6.2 各层级金融工具公允价值

截至2018年12月31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154,867,576.96元，第二层次的余额为0元，第三层次的余额为0元。

7.1.4.6.3 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。

7.1.4.6.4 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。

7.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

7.2.1 资产负债表

会计主体：原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年12月13日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月13 日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		35,827,260.75	74,932,135.29
结算备付金		1,040,994.93	10,596,203.36
存出保证金		336,682.48	193,818.86
交易性金融资产		194,511,175.39	261,284,514.32
其中：股票投资		191,537,713.08	261,284,514.32
基金投资		-	-
债券投资		2,973,462.31	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	2,084,382.78
应收利息		82,942.04	17,266.03
应收股利		-	-
应收申购款		13,483.82	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		2,959.45	-
资产总计		231,815,498.86	349,108,320.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月13 日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018 年年度报告（摘要）

衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,152,093.46	-
应付赎回款		5,975,931.65	-
应付管理人报酬		129,771.23	441,314.36
应付托管费		21,628.52	73,552.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,051,227.87	692,477.75
应交税费		11.59	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		123,590.99	50,000.00
负债合计		21,454,255.31	1,257,344.49
所有者权益：			
实收基金		256,358,338.46	365,756,052.20
未分配利润		-45,997,094.91	-17,905,076.05
所有者权益合计		210,361,243.55	347,850,976.15
负债和所有者权益总计		231,815,498.86	349,108,320.64

注：①自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

②报告截止日 2018 年 12 月 13 日，华夏磐晟定开混合（LOF）基金份额净值 0.8206 元；华夏磐晟定开混合（LOF）基金份额总额 256,358,338.46 份。

③本基金合同于 2017 年 5 月 31 日生效，上年度可比期间自 2017 年 5 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日。

7.2.2 利润表

会计主体：原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日	上年度可比期间 2017 年 5 月 31 日 （基金合同生效 日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-35,378,760.61	-12,953,257.42

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

1.利息收入		369,174.23	4,165,024.46
其中：存款利息收入		368,038.32	1,265,280.51
债券利息收入		1,135.91	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,899,743.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-41,263,890.23	-13,226,023.88
其中：股票投资收益		-43,536,196.05	-13,770,642.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,272,305.82	544,618.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		5,439,650.78	-3,892,258.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		76,304.61	-
减：二、费用		12,153,675.74	4,951,818.63
1.管理人报酬		4,639,241.09	3,203,992.05
2.托管费		773,206.74	533,998.67
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,537,720.88	1,050,650.90
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		3.46	-
7.其他费用		203,503.57	163,177.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,532,436.35	-17,905,076.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,532,436.35	-17,905,076.05

注：①本基金合同于 2017 年 5 月 31 日生效，上年度可比期间自 2017 年 5 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日。

②自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)，本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日。

7.2.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 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)	365,756,052.20	-17,905,076.05	347,850,976.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-47,532,436.35	-47,532,436.35
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)	-109,397,713.74	19,440,417.49	-89,957,296.25
其中: 1.基金申购款	226,738.73	-42,093.30	184,645.43
2.基金赎回款	-109,624,452.47	19,482,510.79	-90,141,941.68
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)	256,358,338.46	-45,997,094.91	210,361,243.55
项目	上年度可比期间 2017 年 5 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 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)	365,756,052.20	-	365,756,052.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-17,905,076.05	-17,905,076.05
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)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	365,756,052.20	-17,905,076.05	347,850,976.15
------------------	----------------	----------------	----------------

注：①本基金合同于 2017 年 5 月 31 日生效，上年度可比期间自 2017 年 5 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日。

②自 2018 年 12 月 14 日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)，本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 13 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4 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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 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。

7.2.4.2 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。

7.2.4.3 关联方关系

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
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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。

7.2.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.4.1.1 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 12 月 13 日	上年度可比期间 2017 年 5 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 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	48,238,409.79	0.99%	13,505,893.38	1.68%

7.2.4.4.1.2 权证交易

无。

7.2.4.4.1.3 债券交易

无。

7.2.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.2.4.4.1.5 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12月13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	35,276.73	0.96%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年5月31日（基金合同生效日）至2017年12月31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	9,876.89	1.38%	9,876.89	1.43%

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。

7.2.4.4.2 关联方报酬

7.2.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月13日	上年度可比期间 2017年5月31日（基金合同生 效日）至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,639,241.09	3,203,992.05
其中：支付销售机构的客户维护费	1,013,694.65	824,974.68

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 1.50% 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×1.50%/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。

7.2.4.4.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月13日	上年度可比期间 2017年5月31日(基金合同生效日)至 2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	773,206.74	533,998.67

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 0.25% 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×0.25%/当年天数。

7.2.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.2.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.2.4.4.4.2 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。

7.2.4.4.5 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12月13日		上年度可比期间 2017年5月31日(基金合同生效日) 至 2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	35,827,260.75	330,489.94	74,932,135.29	452,693.02

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管, 按银行同业利率计息。

7.2.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.2.4.5 期末（2018年12月13日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.2.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.2.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.2.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.2.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.2.4.6.1 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。

7.2.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至2018年12月13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194,511,175.39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261,284,514.32元，第二层次的余额为0元，第三层次的余额为0元。）

7.2.4.6.3 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。

7.2.4.6.4 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。

§8 投资组合报告

8.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

(报告期末为 2018 年 12 月 31 日,报告期间为 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 31 日)

8.1.1 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	151,950,823.48	76.91
	其中:股票	151,950,823.48	76.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,916,753.48	1.48
	其中:债券	2,916,753.48	1.48
	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	42,350,605.46	21.43
8	其他各项资产	360,630.16	0.18
9	合计	197,578,812.58	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 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	-	-
C	制造业	77,491,886.24	40.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,533,975.74	5.99

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年年度报告（摘要）

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,170,530.00	3.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,006,843.50	13.52
J	金融业	11,695,060.00	6.08
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,048,000.00	9.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,528.00	0.00
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	151,950,823.48	78.97

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002127	南极电商	2,400,000	18,048,000.00	9.38
2	300232	洲明科技	1,700,000	16,218,000.00	8.43
3	002643	万润股份	1,222,500	12,371,700.00	6.43
4	300309	吉艾科技	1,451,000	11,695,060.00	6.08
5	300339	润和软件	1,000,000	9,120,000.00	4.74
6	300383	光环新网	634,400	8,037,848.00	4.18
7	000895	双汇发展	323,487	7,631,058.33	3.97
8	600548	深高速	798,500	7,170,530.00	3.73
9	300398	飞凯材料	419,893	6,592,320.10	3.43
10	600011	华能国际	822,600	6,070,788.00	3.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

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	000895	双汇发展	7,610,087.73	3.95
2	600271	航天信息	5,996,744.66	3.12
3	002174	游族网络	5,008,486.70	2.60
4	300383	光环新网	4,133,146.00	2.15
5	601965	中国汽研	2,167,755.00	1.13
6	300450	先导智能	1,434,265.44	0.75
7	002821	凯莱英	157,500.00	0.08
8	-	-	-	-
9	-	-	-	-
10	-	-	-	-
11	-	-	-	-
12	-	-	-	-
13	-	-	-	-
14	-	-	-	-
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

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。

8.1.4.2 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	603660	苏州科达	7,996,714.80	4.16
2	600547	山东黄金	7,582,114.88	3.94
3	600048	保利地产	6,346,388.00	3.30
4	000002	万科 A	5,471,747.69	2.84
5	300633	开立医疗	5,364,081.00	2.79
6	002174	游族网络	5,162,071.00	2.68
7	300450	先导智能	4,738,838.00	2.46
8	600489	中金黄金	4,081,207.00	2.12
9	300659	中孚信息	3,181,022.60	1.65
10	300192	科斯伍德	2,849,199.00	1.48

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

11	000739	普洛药业	2,224,231.00	1.16
12	603018	中设集团	2,220,424.00	1.15
13	002557	洽洽食品	982,528.00	0.51
14	603233	大参林	206,060.00	0.11
15	002677	浙江美大	126,760.97	0.07
16	002941	新疆交建	63,647.44	0.03
17	002943	宇晶股份	48,739.92	0.03
18	002942	新农股份	47,495.36	0.02
19	300753	爱朋医疗	43,301.75	0.02
20	-	-	-	-

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。

8.1.4.3 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	26,507,985.53
卖出股票收入（成交）总额	58,736,572.41

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。

8.1.5 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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,916,753.48	1.52
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,916,753.48	1.52

8.1.6 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

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	123016	洲明转债	14,368	1,464,673.92	0.76
2	128046	利尔转债	10,099	1,001,214.86	0.52
3	113020	桐昆转债	4,510	450,864.70	0.23
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.1.7 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。

8.1.8 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。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 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。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1 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。

8.1.11.2 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。

8.1.11.3 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。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

8.1.12.3 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	336,682.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,952.07
5	应收申购款	11,995.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	360,630.16

8.1.12.4 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。

8.1.12.5 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。

8.1.12.6 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。

8.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

（报告期末为2018年12月13日，报告期间为2018年1月1日至2018年12月13日）

8.2.1 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	191,537,713.08	82.63
	其中：股票	191,537,713.08	82.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,973,462.31	1.28
	其中：债券	2,973,462.31	1.28
	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	-	-

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

7	银行存款和结算备付金合计	36,868,255.68	15.9
8	其他各项资产	436,067.79	0.19
9	合计	231,815,498.86	100.00

8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,885,000.00	5.65
C	制造业	88,069,328.02	41.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,190,496.66	5.32
E	建筑业	65,659.40	0.03
F	批发和零售业	233,750.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	7,090,680.00	3.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,591,049.00	13.12
J	金融业	12,580,170.00	5.98
K	房地产业	12,356,000.00	5.87
L	租赁和商务服务业	18,216,000.00	8.66
M	科学研究和技术服务业	2,254,852.00	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	4,728.00	0.00
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	191,537,713.08	91.05

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

1	002127	南极电商	2,400,000	18,216,000.00	8.66
2	300232	洲明科技	1,700,000	15,657,000.00	7.44
3	300309	吉艾科技	1,451,000	12,580,170.00	5.98
4	002643	万润股份	1,222,500	12,506,175.00	5.95
5	300339	润和软件	1,000,000	10,030,000.00	4.77
6	603660	苏州科达	419,980	8,370,201.40	3.98
7	300659	中孚信息	360,350	8,208,773.00	3.90
8	000739	普洛药业	1,000,000	8,070,000.00	3.84
9	600547	山东黄金	260,000	7,670,000.00	3.65
10	300398	飞凯材料	419,893	7,159,175.65	3.40

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 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

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	601336	新华保险	87,341,553.97	25.11
2	601318	中国平安	54,236,643.42	15.59
3	000858	五粮液	52,204,367.89	15.01
4	601233	桐昆股份	52,064,941.10	14.97
5	000002	万科 A	45,051,552.87	12.95
6	600048	保利地产	43,458,261.40	12.49
7	002236	大华股份	41,341,310.87	11.88
8	002643	万润股份	40,246,320.29	11.57
9	000661	长春高新	37,806,411.75	10.87
10	002195	二三四五	37,475,145.69	10.77
11	300059	东方财富	37,276,373.90	10.72
12	300383	光环新网	32,767,151.89	9.42
13	000568	泸州老窖	30,126,658.58	8.66
14	601688	华泰证券	28,808,550.42	8.28
15	603259	药明康德	28,615,919.64	8.23
16	600519	贵州茅台	28,480,443.50	8.19
17	002142	宁波银行	27,991,434.16	8.05

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
 (原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

18	300309	吉艾科技	27,912,841.80	8.02
19	300750	宁德时代	27,496,285.14	7.90
20	300398	飞凯材料	27,100,979.71	7.79
21	001979	招商蛇口	26,725,403.40	7.68
22	300226	上海钢联	26,126,708.00	7.51
23	002557	洽洽食品	25,653,979.61	7.37
24	002867	周大生	25,167,679.74	7.24
25	600029	南方航空	24,788,016.00	7.13
26	600188	兖州煤业	24,697,562.00	7.10
27	600809	山西汾酒	24,181,973.36	6.95
28	603799	华友钴业	22,808,130.28	6.56
29	002463	沪电股份	22,770,490.46	6.55
30	002202	金风科技	22,141,524.20	6.37
31	300496	中科创达	22,042,783.58	6.34
32	601601	中国太保	21,331,461.20	6.13
33	300404	博济医药	21,171,152.96	6.09
34	600115	东方航空	20,871,364.89	6.00
35	300584	海辰药业	20,733,986.50	5.96
36	000977	浪潮信息	20,237,914.39	5.82
37	002127	南极电商	19,915,511.00	5.73
38	300413	芒果超媒	19,588,671.00	5.63
39	000963	华东医药	19,148,239.35	5.50
40	600779	水井坊	19,015,320.35	5.47
41	002258	利尔化学	18,993,365.17	5.46
42	300232	洲明科技	18,154,868.63	5.22
43	300166	东方国信	18,076,835.82	5.20
44	600702	舍得酒业	17,149,001.00	4.93
45	600271	航天信息	16,429,291.00	4.72
46	603019	中科曙光	16,333,448.00	4.70
47	600176	中国巨石	16,063,224.39	4.62
48	600036	招商银行	15,992,743.97	4.60
49	601398	工商银行	15,981,431.00	4.59
50	600703	三安光电	15,547,034.22	4.47
51	000069	华侨城 A	15,512,949.96	4.46
52	600570	恒生电子	15,371,284.98	4.42
53	601877	正泰电器	15,309,262.95	4.40
54	000538	云南白药	15,092,387.00	4.34
55	300192	科斯伍德	13,793,249.87	3.97
56	300454	深信服	13,736,973.57	3.95
57	600346	恒力股份	13,693,722.95	3.94
58	601111	中国国航	13,646,523.94	3.92
59	002821	凯莱英	13,581,786.11	3.90
60	600372	中航电子	13,499,019.43	3.88

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018 年年度报告（摘要）

61	002146	荣盛发展	13,310,383.00	3.83
62	603659	璞泰来	13,148,847.00	3.78
63	600886	国投电力	12,973,907.00	3.73
64	601155	新城控股	12,374,382.63	3.56
65	002024	苏宁易购	12,271,014.00	3.53
66	603639	海利尔	12,139,180.16	3.49
67	000739	普洛药业	12,127,744.80	3.49
68	600985	淮北矿业	12,044,819.16	3.46
69	000975	银泰资源	12,012,138.00	3.45
70	000768	中航飞机	11,841,752.06	3.40
71	600547	山东黄金	11,794,893.40	3.39
72	000651	格力电器	11,778,860.81	3.39
73	300078	思创医惠	11,661,083.30	3.35
74	603660	苏州科达	11,321,009.40	3.25
75	601595	上海电影	11,254,111.26	3.24
76	600507	方大特钢	11,207,033.00	3.22
77	300740	御家汇	11,161,780.22	3.21
78	300170	汉得信息	11,010,348.00	3.17
79	300121	阳谷华泰	10,971,636.10	3.15
80	300659	中孚信息	10,942,431.32	3.15
81	600887	伊利股份	10,910,081.00	3.14
82	600487	亨通光电	10,847,067.00	3.12
83	300339	润和软件	10,675,644.00	3.07
84	603345	安井食品	10,534,301.44	3.03
85	002511	中顺洁柔	10,413,360.34	2.99
86	000426	兴业矿业	10,224,147.96	2.94
87	000001	平安银行	10,222,536.00	2.94
88	603707	健友股份	10,133,358.00	2.91
89	000717	韶钢松山	9,998,627.00	2.87
90	002078	太阳纸业	9,967,227.69	2.87
91	002677	浙江美大	9,617,738.05	2.76
92	002624	完美世界	9,450,434.55	2.72
93	000063	中兴通讯	9,360,971.00	2.69
94	601225	陕西煤业	9,047,434.00	2.60
95	000401	冀东水泥	8,998,683.00	2.59
96	600027	华电国际	8,932,328.00	2.57
97	000738	航发控制	8,865,481.25	2.55
98	002120	韵达股份	8,779,484.00	2.52
99	600763	通策医疗	8,500,038.40	2.44
100	002013	中航机电	8,388,651.90	2.41
101	300463	迈克生物	8,354,301.49	2.40
102	002035	华帝股份	8,199,953.00	2.36
103	002390	信邦制药	8,191,877.00	2.35

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

104	002916	深南电路	8,067,924.00	2.32
105	300633	开立医疗	8,050,620.74	2.31
106	002384	东山精密	8,014,706.25	2.30
107	300085	银之杰	7,992,076.57	2.30
108	601899	紫金矿业	7,986,112.99	2.30
109	600482	中国动力	7,974,005.00	2.29
110	002185	华天科技	7,936,575.20	2.28
111	601668	中国建筑	7,862,479.00	2.26
112	601000	唐山港	7,800,000.00	2.24
113	600760	中航沈飞	7,792,439.00	2.24
114	000333	美的集团	7,741,305.00	2.23
115	300601	康泰生物	7,657,971.94	2.20
116	600622	光大嘉宝	7,635,974.41	2.20
117	600038	中直股份	7,600,310.46	2.18
118	601390	中国中铁	7,532,003.25	2.17
119	000938	紫光股份	7,238,625.55	2.08
120	600535	天士力	7,216,451.00	2.07
121	603233	大参林	7,121,263.00	2.05
122	300477	合纵科技	7,051,598.16	2.03
123	300409	道氏技术	6,996,425.00	2.01
124	002373	千方科技	6,996,075.00	2.01
125	002829	星网宇达	6,995,578.00	2.01

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。

8.2.4.2 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

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	93,132,085.17	26.77
2	000002	万科 A	58,800,762.82	16.90
3	601233	桐昆股份	57,206,326.31	16.45
4	601318	中国平安	54,773,306.09	15.75
5	600048	保利地产	51,075,815.41	14.68
6	002236	大华股份	49,538,710.23	14.24
7	000858	五粮液	47,503,950.76	13.66
8	000661	长春高新	38,928,961.76	11.19
9	600036	招商银行	37,436,379.97	10.76
10	300059	东方财富	37,320,099.46	10.73
11	002195	二三四五	35,339,493.93	10.16
12	601688	华泰证券	33,328,729.50	9.58
13	002643	万润股份	31,186,639.96	8.97
14	002202	金风科技	30,420,321.13	8.75

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018 年年度报告（摘要）

15	300750	宁德时代	30,398,642.29	8.74
16	603259	药明康德	29,907,972.49	8.60
17	002142	宁波银行	28,737,943.09	8.26
18	603799	华友钴业	27,908,705.83	8.02
19	300413	芒果超媒	27,875,553.25	8.01
20	600519	贵州茅台	26,627,572.35	7.65
21	300383	光环新网	26,264,260.68	7.55
22	000963	华东医药	26,042,319.03	7.49
23	002867	周大生	25,712,937.00	7.39
24	300226	上海钢联	24,868,141.93	7.15
25	001979	招商蛇口	24,788,032.98	7.13
26	600809	山西汾酒	24,532,380.50	7.05
27	000568	泸州老窖	24,495,285.52	7.04
28	600188	兖州煤业	24,393,643.85	7.01
29	002557	洽洽食品	22,703,521.25	6.53
30	002463	沪电股份	22,145,896.54	6.37
31	601601	中国太保	21,758,749.17	6.26
32	600779	水井坊	21,725,099.51	6.25
33	300496	中科创达	21,709,268.43	6.24
34	600115	东方航空	20,575,368.00	5.91
35	300398	飞凯材料	20,501,376.68	5.89
36	300404	博济医药	20,124,414.00	5.79
37	600029	南方航空	20,096,969.87	5.78
38	000977	浪潮信息	18,951,729.10	5.45
39	000651	格力电器	18,855,911.03	5.42
40	300584	海辰药业	17,813,516.34	5.12
41	603019	中科曙光	17,762,059.56	5.11
42	600887	伊利股份	17,096,197.54	4.91
43	600702	舍得酒业	16,968,018.30	4.88
44	601398	工商银行	16,205,723.00	4.66
45	000069	华侨城 A	16,117,713.00	4.63
46	002024	苏宁易购	15,997,064.35	4.60
47	600271	航天信息	15,619,366.40	4.49
48	002146	荣盛发展	15,499,628.17	4.46
49	002258	利尔化学	15,447,700.16	4.44
50	000401	冀东水泥	15,372,481.00	4.42
51	600570	恒生电子	14,861,057.77	4.27
52	002127	南极电商	14,854,853.35	4.27
53	300166	东方国信	14,816,294.61	4.26
54	300309	吉艾科技	14,459,391.00	4.16
55	000333	美的集团	14,418,448.48	4.15
56	000538	云南白药	14,418,316.00	4.14
57	300454	深信服	14,211,364.80	4.09

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
 (原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

58	600346	恒力股份	13,752,733.00	3.95
59	601877	正泰电器	13,722,222.52	3.94
60	000546	金圆股份	13,560,447.84	3.90
61	600703	三安光电	13,494,179.00	3.88
62	600176	中国巨石	13,453,767.84	3.87
63	600886	国投电力	13,096,232.00	3.76
64	600372	中航电子	12,948,567.20	3.72
65	600027	华电国际	12,857,678.68	3.70
66	002821	凯莱英	11,985,912.02	3.45
67	002035	华帝股份	11,851,231.62	3.41
68	000768	中航飞机	11,777,792.49	3.39
69	300740	御家汇	11,717,884.40	3.37
70	600985	淮北矿业	11,702,404.43	3.36
71	601111	中国国航	11,625,478.00	3.34
72	002511	中顺洁柔	11,551,029.90	3.32
73	603639	海利尔	11,480,557.95	3.30
74	300078	思创医惠	11,369,149.40	3.27
75	000975	银泰资源	11,365,525.77	3.27
76	603345	安井食品	11,227,835.63	3.23
77	000001	平安银行	11,198,099.00	3.22
78	603707	健友股份	11,095,543.15	3.19
79	600487	亨通光电	10,950,430.73	3.15
80	600138	中青旅	10,809,320.40	3.11
81	601595	上海电影	10,805,980.72	3.11
82	600522	中天科技	10,738,282.00	3.09
83	601155	新城控股	10,665,937.00	3.07
84	600507	方大特钢	10,600,564.00	3.05
85	000063	中兴通讯	10,515,178.00	3.02
86	000717	韶钢松山	10,286,211.00	2.96
87	300121	阳谷华泰	10,264,989.44	2.95
88	000968	蓝焰控股	9,886,463.40	2.84
89	002078	太阳纸业	9,752,952.55	2.80
90	300601	康泰生物	9,602,208.43	2.76
91	002624	完美世界	9,578,497.31	2.75
92	603659	璞泰来	9,481,839.72	2.73
93	002120	韵达股份	9,321,367.80	2.68
94	300463	迈克生物	8,780,921.36	2.52
95	601225	陕西煤业	8,704,284.91	2.50
96	002415	海康威视	8,664,781.26	2.49
97	002185	华天科技	8,538,989.00	2.45
98	002916	深南电路	8,505,185.49	2.45
99	000426	兴业矿业	8,429,292.05	2.42
100	600763	通策医疗	8,415,603.11	2.42

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
(原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 转型) 2018 年年度报告 (摘要)

101	002013	中航机电	8,272,897.87	2.38
102	600482	中国动力	8,232,959.00	2.37
103	601668	中国建筑	8,097,467.00	2.33
104	002384	东山精密	7,857,264.40	2.26
105	000738	航发控制	7,850,672.00	2.26
106	601000	唐山港	7,832,725.68	2.25
107	300409	道氏技术	7,739,865.00	2.23
108	601390	中国中铁	7,607,497.29	2.19
109	300170	汉得信息	7,586,403.71	2.18
110	601899	紫金矿业	7,564,218.00	2.17
111	002390	信邦制药	7,560,620.79	2.17
112	600622	光大嘉宝	7,542,655.69	2.17
113	600038	中直股份	7,529,371.85	2.16
114	300192	科斯伍德	7,466,562.52	2.15
115	603096	新经典	7,445,894.11	2.14
116	600535	天士力	7,390,138.00	2.12
117	600760	中航沈飞	7,374,023.31	2.12
118	000938	紫光股份	7,153,675.84	2.06

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。

8.2.4.3 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	2,418,442,966.41
卖出股票收入（成交）总额	2,450,017,460.07

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。

8.2.5 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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,973,462.31	1.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,973,462.31	1.41

8.2.6 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

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	123016	洲明转债	14,368	1,480,909.76	0.70
2	128046	利尔转债	10,099	1,032,622.75	0.49
3	113020	桐昆转债	4,510	459,929.80	0.22
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.2.7 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。

8.2.8 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。

8.2.9 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。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.2.10.1 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。

8.2.10.2 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。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.2.11.1 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。

8.2.11.2 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。

8.2.11.3 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。

8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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。

8.2.12.3 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	336,682.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	82,942.04
5	应收申购款	13,483.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	2,959.45
8	其他	-
9	合计	436,067.79

8.2.12.4 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。

8.2.12.5 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。

8.2.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

9.1.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,557	53,447.33	1,501,703.32	0.62%	242,057,769.39	99.38%

9.1.2 期末上市基金前十名持有人

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年年度报告（摘要）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张继荣	1,063,911.00	2.71%
2	赖慧珍	1,010,137.00	2.57%
3	王炜	1,000,068.00	2.54%
4	冯守英	894,300.00	2.27%
5	李冲	850,016.00	2.16%
6	魏成龙	601,017.00	1.53%
7	康桂花	535,057.00	1.36%
8	王庭革	530,409.00	1.35%
9	张国秀	519,057.00	1.32%
10	马健	500,077.00	1.27%

9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	20,495.51	0.01%

9.1.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

9.2.1 基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,738	54,106.87	1,900,237.98	0.74%	254,458,100.48	99.26%

9.2.2 期末上市基金前十名持有人

华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
（原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型）2018年年度报告（摘要）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张继荣	1,063,911.00	2.60%
2	赖慧珍	1,010,137.00	2.47%
3	王炜	1,000,068.00	2.45%
4	冯守英	894,300.00	2.19%
5	李冲	850,016.00	2.08%
6	魏成龙	601,017.00	1.47%
7	康桂花	535,057.00	1.31%
8	王庭革	530,409.00	1.30%
9	张国秀	519,057.00	1.27%
10	北京源沣投资管理有限 公司—源沣长征证券投 资基金	513,600.00	1.26%

9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	20,495.51	0.01%

9.2.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	0

§10 开放式基金份额变动

10.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金转型日（2018年12月14日）基金份额总额	256,358,338.46
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	180,997.60
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份 额	12,979,863.35
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	243,559,472.71

注：自2018年12月14日起，原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

10.2原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金合同生效日（2017年5月31日）基金份额总额	365,756,052.20
本报告期期初基金份额总额	365,756,052.20
报告期基金总申购份额	226,738.73
减：报告期基金总赎回份额	109,624,452.47
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	256,358,338.46

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

11.7.1.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	10,129,890.66	11.88%	8,606.92	13.55%	-
中金公司	2	75,114,667.28	88.12%	54,931.32	86.45%	-

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，本基金还选择了东方证券、银河证券、高华证券、国信证券、国泰君安证券、中信建投证券、申万宏源证券、西部证券、兴业证券、中银国际证券、瑞银证券、海通证券、华泰证券、招商证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、平安证券、方正证券、东北证券、国盛证券、南京证券、西藏东方财富、金通证券、东吴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。

11.7.1.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	
东方证券	2	1,664,978,414.69	34.22%	1,217,599.54	33.30%	-

华泰证券	2	1,026,767,338.68	21.10%	750,871.94	20.54%	-
海通证券	2	654,610,684.56	13.45%	478,716.69	13.09%	-
高华证券	1	260,112,558.36	5.35%	242,242.30	6.63%	-
东北证券	1	246,733,793.10	5.07%	180,436.05	4.94%	-
兴业证券	1	229,809,045.48	4.72%	214,021.38	5.85%	-
西藏东方财富证券	1	161,721,902.33	3.32%	118,265.86	3.23%	-
招商证券	2	148,622,347.05	3.05%	108,686.54	2.97%	-
国盛证券	1	139,175,785.80	2.86%	101,778.46	2.78%	-
申万宏源证券	2	134,469,453.15	2.76%	98,337.71	2.69%	-
中金公司	2	57,861,453.90	1.19%	42,313.30	1.16%	-
万和证券	1	51,871,054.39	1.07%	37,933.09	1.04%	-
中信证券	1	48,238,409.79	0.99%	35,276.73	0.96%	-
平安证券	1	40,453,147.10	0.83%	29,583.24	0.81%	-

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，本基金还选择了国泰君安证券、国信证券、中信建投证券、银河证券、西部证券、中银国际证券、瑞银证券、太平洋证券、天风证券、方正证券、南京证券、金通证券、东吴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，国盛证券、南京证券、西藏东方财富、金通证券、东吴证券的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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

11.7.2.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-

11.7.2.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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
东方证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

12.1.1 华夏磐晟灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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。

12.1.2 原华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日