

**华夏移动互联灵活配置混合型
证券投资基金（QDII）
2019 年第 4 季度报告
2019 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：二〇二〇年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏移动互联混合（QDII）
基金主代码	002891
交易代码	002891
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月14日
报告期末基金份额总额	89,582,516.63份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的跨境投资，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将依据对全球宏观经济发展走向、区域经济发展态势、经济政策、法律法规等可能影响证券市场的重要因素的分析和预测，并结合股票、债券等不同金融工具的风险收益特征，确定资产配置比例并不时进行调整，以保持基金资产配置的有效性。
业绩比较基准	中证信息指数收益率*30%+中证海外中国互联网指数收益率*30%+上证国债指数收益率*40%。
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。
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
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行（香港）有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2019年10月1日-2019年12月31日)
1.本期已实现收益	7,029,349.82
2.本期利润	11,354,926.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.1307
4.期末基金资产净值	123,082,170.17
5.期末基金份额净值	1.374

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

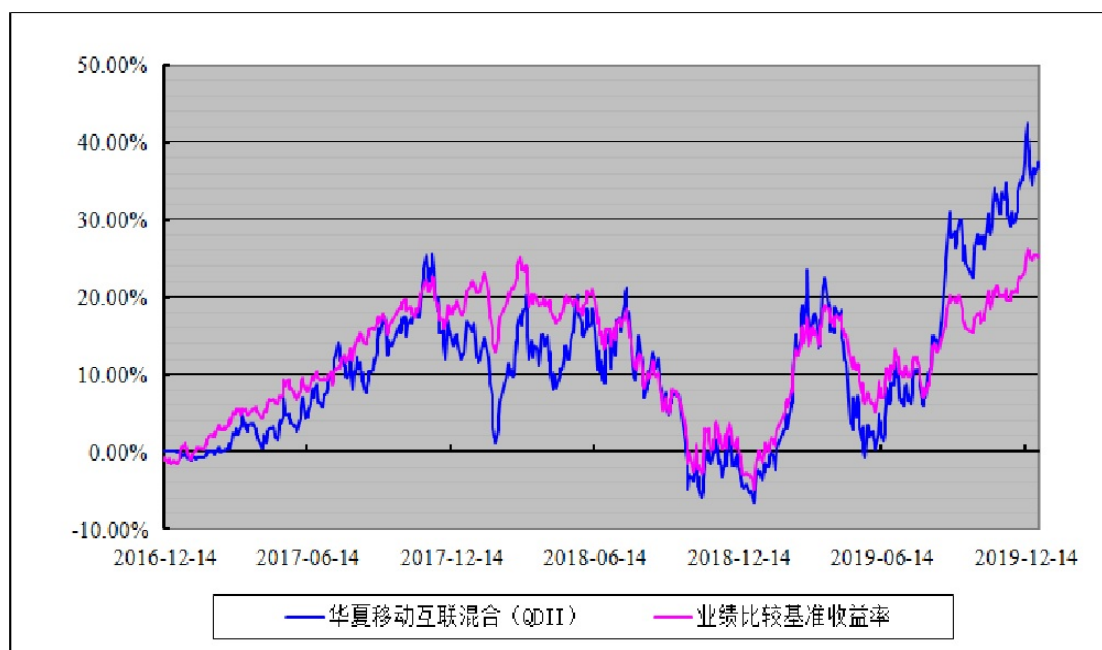
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.54%	1.14%	7.97%	0.59%	2.57%	0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华夏移动互联灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2016年12月14日至2019年12月31日）



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘平	本基金的基金经理、股票投资部总监	2016-12-14	-	12年	金融学硕士。2007年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、投资经理、机构投资部总监等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度全球经济增长动能继续放缓，美国和欧元区 PMI 有所反弹，但仍在荣枯线以下，没有形成持续回升的趋势。美国增长动能继续减退，美联储 10 月降息 25 基点。边际上看到改善的是 12 月中下旬中美贸易摩擦得到阶段性缓和，中美就第一阶段经贸协议文本达成一致，美方将履行分阶段取消对华产品加征关税的相关承诺，有助于市场对全球经济审慎态度的改观。国内经济仍处于弱势震荡区间，中央经济工作会议于 12 月初召开，定位明年经济工作“十分重要”，明年是全面建成小康社会和“十三五”规划收官之年，宏观政策以稳为主，财政政策定位于大力增质提效，货币政策定位于灵活适度，降低融资成本、增加制造业中长期融资，货币政策边际上改善。

4 季度 A 股继续上涨，各行业表现继续严重分化，电子、传媒涨幅居前，食品饮料、农业等前期强势的行业小幅回调，整体来看成长股风格继续占优。美股的纳斯达克指数在高位震荡后于 4 季度创出新高，恒生指数在弱势调整后开始逐步缓慢的企稳反弹。本基金在 4 季度维持高仓位运作，精选个股表现优异，净值创出新高。组合的核心持仓继续向细分行业龙头个股集中，并从布局明年的角度对基金的持仓结构进行了优化调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.374 元，本报告期份额净值增长率为 10.54%，同期业绩比较基准增长率为 7.97%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	108,582,554.65	87.59
	其中：普通股	107,263,355.23	86.53
	存托凭证	1,319,199.42	1.06
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,645,160.46	10.20
8	其他各项资产	2,738,393.57	2.21
9	合计	123,966,108.68	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 10,211,847.39 元，占基金资产净值比例为 8.30%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
中国内地	81,397,689.63	66.13
中国香港	25,865,665.60	21.01
美国	1,319,199.42	1.07
合计	108,582,554.65	88.22

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	64,981,785.17	52.80
非必需消费品	15,372,997.16	12.49
通信服务	12,537,558.75	10.19
保健	6,438,313.80	5.23
材料	5,780,859.00	4.70
工业	1,554,400.00	1.26
金融	1,301,025.00	1.06
必需消费品	569,400.00	0.46
公用事业	-	-
能源	-	-
房地产	-	-
合计	108,536,338.88	88.18

注：①以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

②本报告期末本基金持有“科安达”（A股代码：002972）、“侨银环保”（A股代码：002973）、“神驰机电”（A股代码：603109），公允价值合计为46,215.77元，占基金资产净值比例合计为0.04%。上述股票尚无GICS分类，因此上表未包含上述股票数据。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在 证 券市 场	所属国 家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净 值比例（%）
1	LUXSHAR E PRECISIO N INDUSTRY CO LTD	立讯精密	00247 5	深圳	中国内 地	294,2 10.00	10,738,665. 00	8.72

2	MAXSCEN D MICROELE CTRONICS CO LTD	卓胜微	30078 2	深圳	中国内地	23,96 9.00	9,836,158.5 3	7.99
3	MEITUAN DIANPING	美团点评	03690	香港	中国香港	100,3 00.00	9,155,382.2 0	7.44
4	GLODON CO LTD	广联达	00241 0	深圳	中国内地	142,7 34.00	4,850,101.3 2	3.94
5	KINGSOFT CORP LTD	金山软件有 限公司	03888	香港	中国香港	210,0 00.00	3,799,898.7 6	3.09
6	B-SOFT CO LTD	创业慧康	30045 1	深圳	中国内地	206,4 00.00	3,702,816.0 0	3.01
7	NINESTAR CORP	纳思达	00218 0	深圳	中国内地	106,8 40.00	3,517,172.8 0	2.86
8	IFLYTEK CO LTD	科大讯飞	00223 0	深圳	中国内地	93,25 7.00	3,215,501.3 6	2.61
9	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有 限公司	00700	香港	中国香港	9,500. 00	3,196,322.2 0	2.60
10	KINGDEE INTERNAT IONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	金蝶国际软 件集团有限 公司	00268	香港	中国香港	439,3 80.00	3,066,049.0 9	2.49

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	137,978.46
2	应收证券清算款	311,006.36
3	应收股利	-
4	应收利息	1,536.03
5	应收申购款	2,287,872.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,738,393.57

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	87,256,056.67
报告期基金总申购份额	18,295,404.52
减：报告期基金总赎回份额	15,968,944.56
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	89,582,516.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内披露的主要事项

2019 年 10 月 21 日发布华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下基金基金合同的公告。

2、其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 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、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕

期货 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、信用债指数、商品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，2019 年在基金分类排名中（截至 2019 年 12 月 31 日数据），华夏鼎沛债券在“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 3/224；华夏聚利债券在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中排序 5/165；华夏可转债增强债券(A 类)在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 9/28；华夏债券(C 类)及华夏双债债券(C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（非 A 类）”分别排序 5/105 和 3/105；华夏鼎利债券 (C 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（非 A 类）”中排序 8/160；华夏收益债券（QDII）(A 类)在“QDII 基金-QDII 债券基金-QDII 债券型基金（非 A 类）”中排序 6/21；华夏医疗健康混合(C 类)在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（非 A 类）”中排序 4/18；华夏移动互联混合(QDII)及华夏全球科技先锋混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 2/33 和 6/33；华夏上证 50AH 优选指数（LOF）(C 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（非 A 类）”中排序 4/11；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/60；华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”排序 5/31；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”排序 6/31；华夏创业板 ETF 联接 (A 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中排序 5/46。

在客户服务方面，4 季度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家 APP 启动智能定投功能，为广大投资者提供省心、便捷的理财方式；（2）华夏基金账单服务升级，上线微信账单服务，方便客户详细、准确查询账户持有及交易明细情况；（3）与英大证券、云南红塔银行、弘业期货等代销机构合作，提供更多便捷的理财渠道；（4）开展“低温指数”、“悬赏 ETF 大神”、“找 LOGO-我存在你深深的脑海里”、“他们为什么能？”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；
- 9.1.2 《华夏移动互联灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 9.1.3 《华夏移动互联灵活配置混合型证券投资基金（QDII）托管协议》；

9.1.4 法律意见书；

9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二〇年一月二十一日