

**华夏新时代灵活配置混合型
证券投资基金（QDII）
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	30
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	30
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	31
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	35
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	41
7.7 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.....	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 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.....	42
7.10 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.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
基金简称	华夏新时代混合（QDII）
基金主代码	005534
交易代码	005534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年5月30日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	237,778,194.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极资产配置和组合管理，追求在严格控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金将根据全球宏观经济发展走向、区域经济发展态势、中国大国战略部署、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，分析和比较股票、债券等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，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	30%*富时中国 A 股全股指数收益率+30%*富时中国（不含 B 股）全盘指数收益率+40%*上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合基金，0%-95%的基金资产投资于股票，其预期风险和预期收益低于股票基金，高于货币市场基金和普通债券基金，属于中等风险品种。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。

注：根据本基金管理人于2019年2月22日发布的公告，自2019年3月1日起，本基金的业绩比较基准调整为“30%*富时中国 A 股全股指数收益率+30%*富时中国（不含 B 股）全盘指数收益率+40%*上证国债指数收益率。”

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区	北京市西城区复兴门内大街55号

	A区	
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	杨明辉	陈四清

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		-

2.5 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

2.6 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）
本期已实现收益	10,450,463.94
本期利润	26,322,079.97
加权平均基金份额本期利润	0.0871
本期加权平均净值利润率	9.14%
本期基金份额净值增长率	5.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-17,906,166.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0753
期末基金资产净值	226,182,465.55
期末基金份额净值	0.9512
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.88%

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。

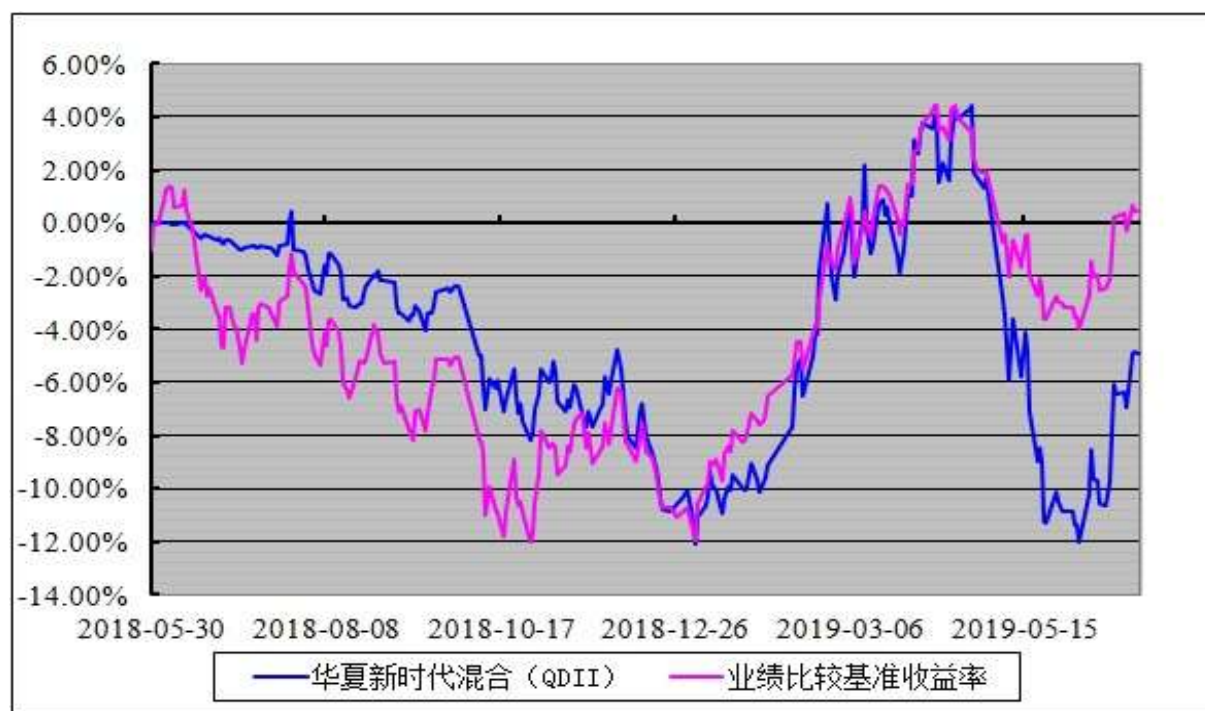
3.2 基金净值表现

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

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	6.73%	1.05%	3.71%	0.65%	3.02%	0.40%
过去三个月	-5.87%	1.33%	-1.01%	0.78%	-4.86%	0.55%
过去六个月	5.72%	1.23%	12.51%	0.78%	-6.79%	0.45%
过去一年	-4.25%	0.98%	3.72%	0.83%	-7.97%	0.15%
自基金合同生效起至今	-4.88%	0.93%	0.43%	0.83%	-5.31%	0.10%

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

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）
 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5月30日至2019年6月30日)



注：根据华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）的基金合同规定，本基金自基金合

同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

§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		
常亚桥	本基金的基金经理、国际投资部高级副总裁	2018-05-30	-	5 年	约翰霍普金斯大学金融学硕士。2014 年 2 月加入华夏基金管理有限公司，曾任国际投资部研究员、投资经理等。
阳琨	本基金的基金经理、公司副总经理、投资总	2018-05-30	-	24 年	北京大学 MBA。曾任宝盈基金基金经理助理，益民基金投资部部门

	监			经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理等。2006年8月加入华夏基金管理有限公司，曾任策略研究员、股票投资部副总经理，兴和证券投资基金基金经理（2009年1月1日至2012年1月12日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007年6月12日至2013年4月11日期间）、华夏盛世精选混合型证券投资基金基金经理（2009年12月18日至2015年9月1日期间）、华夏大盘精选证券投资基金基金经理（2015年9月1日至2017年5月2日期间）、华夏大中华企业精选灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理（2016年1月20日至2018年10月11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。

③根据本基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金经理的公告》，自2019年7月15日起，阳琨先生不再担任本基金基金经理。

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 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,市场在不断降准以及中美贸易战有所缓解的背景下，AH 市场在开年 1 至 2 月迅速反弹，并且在社融创出新高的背景下，市场达到高点。随着贸易战迅速恶化以及边际利好出尽，市场急转直下。

报告期内，本基金进行了均衡配置，30%在 A 股，40%H 股以及 20%在美股。核心配置方向还是以科技、5G、保险以及消费行业为主。在 4 月这一波下跌过程中，科技股受损于对华为的定点封锁，本基金基金净值也有一定回撤，但我们对于 5G 产业趋势依然看好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9512 元，本报告期份额净值增长率为 5.72%，同期业绩比较基准增长率为 12.51%。

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，中美贸易战持续时长不可确定。市场经历了前期巨幅震荡之后，恒生指数 YTD 已经接近 1%，恒生国企指数已经转负。但同时市场已对香港局势恶化、贸易战加剧、汇率贬值都预期较为充分，在基金投资方面，我们将会转向积极，方向上仍以我们擅长的 5G 产业链消费以及保险行业为主，同时密切关注对地产行业的政策变化带来的影响。

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

回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、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

本报告期内，本基金托管人在对华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）未进行利润分配。

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

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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	30,120,577.75	165,147,716.46
结算备付金		3,341,700.83	515,954.04
存出保证金		580,593.23	4,480,318.08
交易性金融资产	6.4.7.2	202,296,145.57	174,482,289.98
其中：股票投资		202,296,145.57	169,793,449.84
基金投资		-	4,688,840.14
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,703.84	18,158.29
应收股利		401,580.52	7,244.60
应收申购款		27,251.20	10,333.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		236,771,552.94	344,662,014.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,762,372.24	14.09
应付赎回款		889,183.63	935,562.81
应付管理人报酬		321,957.08	537,313.61
应付托管费		53,659.52	89,552.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	470,147.13	267,597.20
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,767.79	73,525.70
负债合计		10,589,087.39	1,903,565.67
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	237,778,194.58	380,958,100.18
未分配利润	6.4.7.10	-11,595,729.03	-38,199,650.86
所有者权益合计		226,182,465.55	342,758,449.32
负债和所有者权益总计		236,771,552.94	344,662,014.99

注：①报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9512 元，基金份额总额 237,778,194.58 份。

②本基金合同于 2018 年 5 月 30 日生效，上年度可比期间自 2018 年 5 月 30 日至 2018 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年5月30日（基 金合同生效日）至2018 年6月30日
一、收入		34,240,912.94	-2,115,453.56
1.利息收入		288,217.87	302,307.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	288,217.87	302,307.55
债券利息收入		-	-
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）		19,352,837.62	-1,318,382.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,891,588.79	-1,318,382.28
基金投资收益	6.4.7.13	168,925.05	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,292,323.78	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,871,616.03	-1,099,378.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,472,151.95	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	200,393.37	-
减：二、费用		7,918,832.97	975,922.23
1.管理人报酬		2,567,268.97	718,839.29
2.托管费		427,878.13	119,806.55
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	4,824,198.91	118,438.67
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		506.78	-
7.其他费用	6.4.7.21	98,980.18	18,837.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,322,079.97	-3,091,375.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,322,079.97	-3,091,375.79

注：本基金合同于2018年5月30日生效，上年度可比期间自2018年5月30日至2018年6月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）

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）	380,958,100.18	-38,199,650.86	342,758,449.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,322,079.97	26,322,079.97
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）	-143,179,905.60	281,841.86	-142,898,063.74
其中：1.基金申购款	14,521,919.92	342,120.34	14,864,040.26
2.基金赎回款	-157,701,825.52	-60,278.48	-157,762,104.00
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）	237,778,194.58	-11,595,729.03	226,182,465.55
项目	上年度可比期间 2018年5月30日（基金合同生效日）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）	471,400,177.64	-	471,400,177.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,091,375.79	-3,091,375.79
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）	471,400,177.64	-3,091,375.79	468,308,801.85

注：本基金合同于 2018 年 5 月 30 日生效，上年度可比期间自 2018 年 5 月 30 日至 2018 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 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

华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）（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]2287 号《关于准予华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）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 2018 年 5 月 7 日至 2018 年 5 月 25 日共募集 471,224,195.89 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（2018）验字第 60739337_A13 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》于 2018 年 5 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 471,400,177.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 175,981.75 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

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，本基金可投资于境内市场和境外市场依法发行的金融工具。境内市场投资工具包括依法发行上市的股票（包括创业板、

中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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。境外市场投资工具包括银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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[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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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、对基金在境内取得的股票的股息、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。基金在境内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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息

红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

8、基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

9、基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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	30,120,577.75
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	30,120,577.75

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	191,308,299.21	202,296,145.57	10,987,846.36
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	OTC 市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	191,308,299.21	202,296,145.57	10,987,846.36

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	2,858.52
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	751.82
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	93.50
合计	3,703.84

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	470,147.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	470,147.13

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	241.67
预提费用	91,526.12
合计	91,767.79

6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	380,958,100.18	380,958,100.18
本期申购	14,521,919.92	14,521,919.92
本期赎回（以“-”号填列）	-157,701,825.52	-157,701,825.52
本期末	237,778,194.58	237,778,194.58

6.4.7.10 未分配利润

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	-33,761,611.75	-4,438,039.11	-38,199,650.86
本期利润	10,450,463.94	15,871,616.03	26,322,079.97
本期基金份额交易产生的变动数	5,404,981.45	-5,123,139.59	281,841.86
其中：基金申购款	-279,904.28	622,024.62	342,120.34
基金赎回款	5,684,885.73	-5,745,164.21	-60,278.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,906,166.36	6,310,437.33	-11,595,729.03

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
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	27,429.39
其他	6,544.28
合计	288,217.87

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
减：卖出股票成本总额	1,603,442,799.56
买卖股票差价收入	17,891,588.79

6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	8,255,336.89
减：卖出/赎回基金成本总额	8,086,411.84
基金投资收益	168,925.05

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

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	1,292,323.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,292,323.78

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	15,871,616.03
——股票投资	15,702,298.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	169,317.96
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
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	15,871,616.03

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	200,393.37
合计	200,393.37

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	4,824,198.91
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,824,198.91

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	34,712.18
信息披露费	56,813.94
银行费用	4,262.74
其他	3,191.32
合计	98,980.18

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
纽约梅隆银行股份有限公司	基金境外资产托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月30日（基金合同生效日） 至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	2,183,146,920.16	67.36%	72,469,209.91	100.00%

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 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	1,658,771.04	72.12%	429,377.90	91.33%
关联方名称	上年度可比期间 2018年5月30日（基金合同生效日）至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	56,395.51	100.00%	56,395.51	100.00%

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

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

6.4.10.2 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5月30日（基金合同生 效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,567,268.97	718,839.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,402,042.15	414,773.80

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 1.8%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×1.8%/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5月30日（基金合同生 效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	427,878.13	119,806.55

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 0.30%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×0.30%/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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月30日（基金合同生效日）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
中国工商银行 活期存款	15,885,892.41	144,180.55	445,252,816.35	301,274.67
纽约梅隆银行 股份有限公司 活期存款	14,234,685.34	110,063.65	-	-

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国工商银行和基金境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

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全球证券市场中具有良好流动性的金融工具。本基金投资海外国家/地区的资本市场规模较大、金融市场发展程度高，投资的证券品种成交活跃。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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	11,767,803.75	21,857.96	2,445,554.63	14,235,216.34
交易性金融资产	32,973,431.95	87,336,483.64	7,967,200.87	128,277,116.46
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	66,291.18	165,449.42	231,740.60
应收申购款	-	-	-	-
应收在途资金	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	44,741,235.70	87,424,632.78	10,578,204.92	142,744,073.40
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,762,097.81	6,016,500.47	-	7,778,598.28
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
应付在途资金	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	1,762,097.81	6,016,500.47	-	7,778,598.28
项目	上年度末			
	2018年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	46,175,186.34	31,456,481.93	17,961,096.16	95,592,764.43
交易性金融资产	59,868,699.06	90,986,430.51	2,773,211.21	153,628,340.78
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	6,087.32	1,157.28	-	7,244.60
应收申购款	-	-	-	-
应收在途资金	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	106,049,972.72	122,444,069.72	20,734,307.37	249,228,349.81
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付赎回费	-	-	-	-
应付在途资金	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有外币相对人民币升值 5%	6,748,273.76	12,461,417.49
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,748,273.76	-12,461,417.49

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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

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	202,296,145.57	89.44	169,793,449.84	49.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	4,688,840.14	1.37
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	202,296,145.57	89.44	174,482,289.98	50.91

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	除富时中国（不含 B 股）全盘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%	10,660,858.99	8,262,998.24
	-5%	-10,660,858.99	-8,262,998.24

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 202,296,145.57 元，第二层次的余额为 0 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 174,482,289.98 元，第二层次的余额为 0 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	202,296,145.57	85.44
	其中：普通股	173,542,222.99	73.30
	存托凭证	28,753,922.58	12.14
	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	33,462,278.58	14.13
8	其他各项资产	1,013,128.79	0.43
9	合计	236,771,552.94	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 40,931,973.18 元，占基金资产净值比例为 18.10%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国内地	87,336,483.64	38.61
中国香港	74,019,029.11	32.73
美国	32,973,431.95	14.58
中国台湾	7,967,200.87	3.52
合计	202,296,145.57	89.44

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	55,696,209.13	24.62
金融	51,341,914.17	22.70
信息技术	32,437,816.68	14.34
必需消费品	16,489,858.24	7.29
通信服务	14,078,320.27	6.22
保健	10,086,218.47	4.46
工业	9,060,077.94	4.01
公用事业	6,259,630.00	2.77
材料	3,660,229.93	1.62
房地产	3,175,220.74	1.40
能源	10,650.00	0.00
合计	202,296,145.57	89.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例(%)
1	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318	香港	中国香港	211,000.00	17,410,054.79	7.70
			601318	上海	中国内地	36,400.00	3,225,404.00	1.43
2	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	中国建设银行股份有限公司	00939	香港	中国香港	2,948,000.00	17,452,489.58	7.72
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	-	BABA	纽约	美国	14,265.00	16,617,554.06	7.35
4	WULIANGYE YIBIN CO LTD	五粮液	000858	深圳	中国内地	100,600.00	11,865,770.00	5.25
5	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	00700	香港	中国香港	30,900.00	9,584,194.78	4.24
6	ZTE CORP	中兴通讯	000063	深圳	中国内地	269,900.00	8,779,847.00	3.88
7	TAL EDUCATION GROUP	-	TAL	纽约	美国	25,500.00	6,679,114.79	2.95
8	CHINA YANGTZE POWER CO LTD	长江电力	600900	上海	中国内地	349,700.00	6,259,630.00	2.77
9	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	台湾积体电路制造股份有限公司	2330	台湾	中国台湾	118,000.00	6,256,710.82	2.77
10	LI NING CO LTD	李宁有限公司	02331	香港	中国香港	356,500.00	5,776,489.71	2.55
11	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	沪电股份	002463	深圳	中国内地	370,700.00	5,048,934.00	2.23
12	MIDEA GROUP CO LTD	美的集团	000333	深圳	中国内地	92,700.00	4,807,422.00	2.13
13	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	中国国际金融股份有	03908	香港	中国香港	330,400.00	4,580,481.10	2.03

		限公司						
14	AIA GROUP LTD	友邦保险控股有限公司	01299	香港	中国香港	59,600.00	4,417,036.76	1.95
15	BILIBILI INC	-	BILI	纳斯达克	美国	38,900.00	4,351,018.25	1.92
16	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用品有限公司	02020	香港	中国香港	92,000.00	4,341,825.83	1.92
17	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	申洲国际集团控股有限公司	02313	香港	中国香港	45,100.00	4,260,844.33	1.88
18	XILINX INC	-	XLNX	纳斯达克	美国	5,205.00	4,219,509.37	1.87
19	PING AN BANK CO LTD	平安银行	000001	深圳	中国内地	297,000.00	4,092,660.00	1.81
20	YICHANG HEC CHANGJIANG PHARMACEUTICAL CO LTD	宜昌东阳光长江药业股份有限公司	01558	香港	中国香港	109,800.00	3,771,709.39	1.67
21	TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	通化东宝	600867	上海	中国内地	233,100.00	3,589,740.00	1.59
22	WEICHAI POWER CO LTD	潍柴动力	000338	深圳	中国内地	284,300.00	3,494,047.00	1.54
23	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	希望教育集团有限公司	01765	香港	中国香港	3,502,000.00	3,419,431.95	1.51
24	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	贵州茅台	600519	上海	中国内地	3,300.00	3,247,200.00	1.44
25	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	格力电器	000651	深圳	中国内地	58,100.00	3,195,500.00	1.41
26	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国控股有限公司	01918	香港	中国香港	94,000.00	3,175,220.74	1.40
27	SUZHOU DONGSHAN	东山精	002384	深圳	中国内	209,700.00	3,055,329.00	1.35

	PRECISION MANUFACTURING CO LTD	密			地			
28	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	丘钛科 技(集团) 有限公 司	01478	香港	中国香 港	566,000.00	2,962,430.98	1.31
29	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	中升集 团控股 有限公 司	00881	香港	中国香 港	130,000.00	2,487,238.65	1.10
30	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	宁德时 代	300750	深圳	中国内 地	33,200.00	2,286,816.00	1.01
31	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	山东黄 金	600547	上海	中国内 地	50,200.00	2,066,734.00	0.91
32	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	沃森生 物	300142	深圳	中国内 地	69,100.00	1,959,676.00	0.87
33	LARGAN PRECISION CO LTD	联德电 子股份 有限公 司	3008	台湾	中国台 湾	2,000.00	1,710,490.05	0.76
34	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	永升生 活服务 集团有 限公司	01995	香港	中国香 港	520,000.00	1,568,961.58	0.69
35	BEIJING CAREER INTERNATIONAL CO LTD	科锐国 际	300662	深圳	中国内 地	44,200.00	1,565,564.00	0.69
36	AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	鹏鼎控 股	002938	深圳	中国内 地	49,700.00	1,459,192.00	0.65
37	YINTAI RESOURCES CO LTD	银泰资 源	000975	深圳	中国内 地	103,400.00	1,363,846.00	0.60
38	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	舜宇光 学科技 (集团)有 限公司	02382	香港	中国香 港	19,200.00	1,362,980.39	0.60
39	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	温氏股 份	300498	深圳	中国内 地	35,600.00	1,276,616.00	0.56
40	PINDUODUO INC	-	PDD	纳斯达 克	美国	7,800.00	1,106,235.48	0.49
41	CSTONE	基石药	02616	香港	中国香	75,500.00	765,093.08	0.34

	PHARMACEUTICALS	业			港			
42	QINGDAO RURAL COMMERCIAL BANK CORP	青农商行	002958	深圳	中国内地	17,700.00	129,918.00	0.06
43	GUANGDONG SOUTH NEW MEDIA CO LTD	新媒股份	300770	深圳	中国内地	1,271.00	109,941.50	0.05
44	BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	鸿远电子	603267	上海	中国内地	1,651.00	81,130.14	0.04
45	MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	卓胜微	300782	深圳	中国内地	743.00	80,927.56	0.04
46	ZHEJIANG SANMEI CHEMICAL INDUSTRY CO LTD	三美股份	603379	上海	中国内地	2,052.00	76,621.68	0.03
47	JUSHRI TECHNOLOGIES INC	上海瀚讯	300762	深圳	中国内地	1,233.00	71,514.00	0.03
48	HITEVISION CO LTD	鸿合科技	002955	深圳	中国内地	1,108.00	65,194.72	0.03
49	LAKALA PAYMENT CO LTD	拉卡拉	300773	深圳	中国内地	1,250.00	64,725.00	0.03
50	SHENZHEN ZHILAI SCI AND TECH CO LTD	智莱科技	300771	深圳	中国内地	1,126.00	62,887.10	0.03
51	JIANGSU GUOMAO REDUCER CO LTD	国茂股份	603915	上海	中国内地	2,523.00	58,710.21	0.03
52	CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	新诺威	300765	深圳	中国内地	1,412.00	51,778.04	0.02
53	SICHUAN TEWAY FOOD GROUP CO LTD	天味食品	603317	上海	中国内地	1,156.00	48,494.20	0.02
54	ZHEJIANG MERIT INTERACTIVE NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	每日互动	300766	深圳	中国内地	1,193.00	48,304.57	0.02
55	SINOFIBERS TECHNOLOGY CO LTD	中简科技	300777	深圳	中国内地	1,156.00	42,540.80	0.02
56	HANGZHOU DPTECH	迪普科	300768	深圳	中国内地	1,128.00	42,446.64	0.02

	TECHNOLOGIES CO LTD	技			地			
57	NANJING CHERVON AUTO PRECISION TECHNOLOGY CO LTD	泉峰汽车	603982	上海	中国内地	1,845.00	42,121.35	0.02
58	SHANDONG YUANLI SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	元利科技	603217	上海	中国内地	584.00	39,268.16	0.02
59	GUANGDONG SONGYANG RECYCLE RESOURCES CO LTD	松炆资源	603863	上海	中国内地	1,612.00	37,204.96	0.02
60	SICHUAN FURONG TECHNOLOGY CO LTD	福蓉科技	603327	上海	中国内地	1,323.00	34,014.33	0.02
61	HONGTA SECURITIES CO LTD	红塔证券	601236	上海	中国内地	9,789.00	33,869.94	0.01
62	GUANGDONG INSIGHT BRAND MARKETING GROUP CO LTD	因赛集团	300781	深圳	中国内地	727.00	33,165.74	0.01
63	SHANDONG LONGERTEK TECHNOLOGY CO LTD	朗进科技	300594	深圳	中国内地	721.00	31,803.31	0.01
64	YES OPTOELECTRONICS CO LTD	亚世光电	002952	深圳	中国内地	771.00	27,694.32	0.01
65	SICHUAN DAWN PRECISION TECHNOLOGY CO LTD	德恩精工	300780	深圳	中国内地	935.00	27,676.00	0.01
66	GUANGDONG RIFENG ELECTRIC CABLE CO LTD	日丰股份	002953	深圳	中国内地	1,072.00	26,499.84	0.01
67	CNOOC ENERGY TECHNOLOGY & SERVICES LTD	海油发展	600968	上海	中国内地	3,000.00	10,650.00	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	52,721,778.93	15.38
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	47,087,119.81	13.74
3	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	02318	27,228,985.56	7.94
		601318	18,153,726.00	5.30
4	WH GROUP LTD	00288	43,798,041.70	12.78
5	AIR CHINA LTD	00753	21,176,733.97	6.18
		601111	21,622,296.15	6.31
6	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	002384	34,756,203.64	10.14
7	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	00939	30,767,842.28	8.98
8	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	03908	29,443,416.34	8.59
9	ZTE CORP	000063	18,167,837.80	5.30
		00763	11,135,233.12	3.25
10	HUATAI SECURITIES CO LTD	06886	23,165,463.48	6.76
		601688	5,130,770.00	1.50
11	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	2330	26,075,855.08	7.61
12	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	06098	25,896,378.08	7.56
13	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	600029	21,354,454.99	6.23
		01055	4,302,290.16	1.26
14	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	22,676,928.23	6.62
15	LARGAN PRECISION CO LTD	3008	22,485,636.36	6.56
16	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	300498	22,120,075.00	6.45

17	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	02628	19,069,493.34	5.56
		601628	1,624,862.12	0.47
18	OFILM GROUP CO LTD	002456	20,609,400.83	6.01
19	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	01336	11,838,425.65	3.45
		601336	8,106,823.26	2.37
20	PUYANG HUICHENG ELECTRONIC MATERIAL CO LTD	300481	18,809,538.10	5.49
21	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	00175	18,699,595.02	5.46
22	BILIBILI INC	BILI	18,347,165.12	5.35
23	CSC FINANCIAL CO LTD	601066	11,375,066.00	3.32
		06066	6,908,077.27	2.02
24	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	18,130,183.37	5.29
25	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	00762	17,857,320.65	5.21
26	APPLE INC	AAPL	16,471,219.34	4.81
27	XILINX INC	XLNX	16,362,172.18	4.77
28	UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	601231	16,014,244.00	4.67
29	TAL EDUCATION GROUP	TAL	15,949,505.81	4.65
30	PINDUODUO INC	PDD	15,080,536.07	4.40
31	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	600547	13,922,933.75	4.06
32	SHANGHAI RUNDA MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	603108	13,471,954.64	3.93
33	SHENZHEN SUNLORD ELECTRONICS CO LTD	002138	13,258,403.56	3.87
34	CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	600050	13,044,135.00	3.81
35	BAODING LUCKY INNOVATIVE MATERIALS CO LTD	300446	13,003,112.09	3.79
36	BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	00285	12,672,878.19	3.70
37	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	002463	12,646,545.95	3.69
38	CHINA JINMAO	00817	12,443,329.50	3.63

	HOLDINGS GROUP LTD			
39	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	01610	12,431,236.13	3.63
40	JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	002157	12,082,292.86	3.53
41	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	01765	11,699,907.72	3.41
42	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	01717	11,398,312.74	3.33
43	MAN WAH HOLDINGS LTD	01999	10,838,583.60	3.16
44	YICHANG HEC CHANGJIANG PHARMACEUTICAL CO LTD	01558	10,652,443.41	3.11
45	TECH-BANK FOOD CO LTD	002124	10,260,742.62	2.99
46	TANGRENSHEN GROUP CO LTD	002567	10,175,620.56	2.97
47	AIA GROUP LTD	01299	9,657,220.29	2.82
48	CHINA MINMETALS RARE EARTH CO LTD	000831	9,388,537.78	2.74
49	KINGBOARD LAMINATES HOLDINGS LTD	01888	9,140,938.62	2.67
50	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	02899	8,708,566.74	2.54
51	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	01478	8,564,754.84	2.50
52	XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	000425	8,418,018.00	2.46
53	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	02018	8,336,587.33	2.43
54	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	02313	8,201,335.60	2.39
55	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	603160	8,054,392.46	2.35
56	CHINA GAS HOLDINGS LTD	00384	7,835,306.41	2.29
57	MICROSOFT CORP	MSFT	7,791,406.48	2.27
58	BEIJING CAREER INTERNATIONAL CO LTD	300662	7,771,220.00	2.27

59	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	600519	7,686,750.00	2.24
60	STMICROELECTRONICS NV	STM	7,628,272.60	2.23
61	PING AN BANK CO LTD	000001	7,618,224.00	2.22
62	ELION CLEAN ENERGY CO LTD	600277	7,525,740.96	2.20
63	JOYVIO AGRICULTURE DEVELOPMENT CO LTD	300268	7,360,503.80	2.15
64	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	002281	7,332,521.34	2.14
65	HSBC HOLDINGS PLC	00005	7,287,858.22	2.13
66	CLP HOLDINGS LTD	00002	7,281,709.99	2.12
67	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	000725	6,987,006.00	2.04

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	00700	60,909,545.20	17.77
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BABA	54,813,047.88	15.99
3	WH GROUP LTD	00288	43,295,632.01	12.63
4	AIR CHINA LTD	00753	21,881,177.55	6.38
		601111	21,380,378.00	6.24
5	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	002384	36,846,000.08	10.75
6	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	03908	31,390,566.51	9.16
7	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	06098	29,954,549.37	8.74
8	HUATAI SECURITIES CO LTD	06886	22,910,104.48	6.68
		601688	5,202,463.43	1.52
9	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	02318	10,838,682.95	3.16
		601318	16,022,898.00	4.67
10	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	01055	4,235,291.95	1.24
		600029	22,470,624.42	6.56
11	OFILM GROUP CO LTD	002456	24,534,850.57	7.16
12	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	300498	22,318,108.82	6.51
13	PUYANG HUICHENG ELECTRONIC MATERIAL CO LTD	300481	22,135,602.39	6.46

14	BILIBILI INC	BILI	20,597,055.32	6.01
15	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	00939	20,372,638.56	5.94
16	ZTE CORP	000063	9,880,791.60	2.88
		00763	10,390,397.98	3.03
17	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	01336	11,596,434.82	3.38
		601336	8,532,047.00	2.49
18	LARGAN PRECISION CO LTD	3008	20,061,863.47	5.85
19	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	2330	19,891,397.93	5.80
20	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	02628	18,159,962.04	5.30
		601628	1,649,026.00	0.48
21	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	02382	19,448,460.90	5.67
22	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	00175	18,470,058.44	5.39
23	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	00762	18,397,184.49	5.37
24	AUSNUTRIA DAIRY CORP LTD	01717	17,598,954.90	5.13
25	PINDUODUO INC	PDD	17,533,381.62	5.12
26	UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	601231	17,451,612.88	5.09
27	CSC FINANCIAL CO LTD	06066	6,350,217.68	1.85
		601066	11,082,544.00	3.23
28	AIA GROUP LTD	01299	17,052,883.46	4.98
29	APPLE INC	AAPL	16,817,546.16	4.91
30	BAODING LUCKY INNOVATIVE MATERIALS CO LTD	300446	14,634,676.66	4.27
31	SHENZHEN SUNLORD ELECTRONICS CO LTD	002138	14,138,121.74	4.12
32	SHANGHAI RUNDA MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	603108	13,652,466.07	3.98
33	JIANGXI ZHENGBO TECHNOLOGY CO LTD	002157	13,387,825.32	3.91
34	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	00817	13,126,276.61	3.83
35	CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	600050	12,819,152.00	3.74
36	BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	00285	12,722,007.50	3.71
37	TANGRENSHEN GROUP CO LTD	002567	12,437,890.00	3.63
38	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	600547	12,023,080.40	3.51
39	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	03968	11,814,139.52	3.45
40	MICROSOFT CORP	MSFT	11,781,618.04	3.44
41	COFCO MEAT HOLDINGS LTD	01610	11,631,552.34	3.39
42	MAN WAH HOLDINGS LTD	01999	11,539,095.51	3.37
43	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	02313	11,408,821.21	3.33
44	XILINX INC	XLNX	11,292,203.86	3.29
45	TECH-BANK FOOD CO LTD	002124	11,135,989.61	3.25

46	TAL EDUCATION GROUP	TAL	10,516,828.31	3.07
47	CHINA MINMETALS RARE EARTH CO LTD	000831	10,167,312.70	2.97
48	WULIANGYE YIBIN CO LTD	000858	9,829,461.33	2.87
49	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	02020	9,734,599.08	2.84
50	KINGBOARD LAMINATES HOLDINGS LTD	01888	9,476,850.54	2.76
51	BEIJING CAREER INTERNATIONAL CO LTD	300662	9,434,052.10	2.75
52	XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	000425	8,878,237.00	2.59
53	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	02899	8,805,572.10	2.57
54	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	002463	8,653,891.00	2.52
55	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	603160	8,589,711.02	2.51
56	FIBROGEN INC	FGEN	8,501,686.38	2.48
57	HOPE EDUCATION GROUP CO LTD	01765	8,464,201.56	2.47
58	CHINA MOBILE LTD	00941	8,369,786.16	2.44
59	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	002281	8,359,603.15	2.44
60	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	02018	8,313,836.18	2.43
61	CHINA GAS HOLDINGS LTD	00384	8,176,123.30	2.39
62	STMICROELECTRONICS NV	STM	7,998,994.63	2.33
63	JOYVIO AGRICULTURE DEVELOPMENT CO LTD	300268	7,550,016.92	2.20
64	YICHANG HEC CHANGJIANG PHARMACEUTICAL CO LTD	01558	7,479,258.49	2.18
65	VISA INC	V	7,460,760.95	2.18
66	HISENSE HOME APPLIANCES GROUP CO LTD	00921	7,419,503.51	2.16
67	HSBC HOLDINGS PLC	00005	7,245,424.08	2.11
68	THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	300496	7,190,637.00	2.10
69	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	000725	7,185,679.00	2.10
70	CLP HOLDINGS LTD	00002	7,110,004.34	2.07
71	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	01288	7,028,350.57	2.05
72	TAIMIDE TECH INC	3645	7,012,212.05	2.05
73	SHENZHEN SUNNYPOL OPTOELECTRONICS CO LTD	002876	6,964,151.19	2.03

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,620,243,197.22
卖出收入（成交）总额	1,621,334,388.35

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	580,593.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	401,580.52
4	应收利息	3,703.84
5	应收申购款	27,251.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,013,128.79

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

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
17,128	13,882.43	49,419.33	0.02%	237,728,775.25	99.98%

8.2 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	51,504.83	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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 5 月 30 日）基金份额总额	471,400,177.64
本报告期期初基金份额总额	380,958,100.18
本报告期基金总申购份额	14,521,919.92
减：本报告期基金总赎回份额	157,701,825.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	237,778,194.58

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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	
BOCI SECURITIES	-	25,721,185.46	0.79%	38,581.78	1.68%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES	-	33,669,909.26	1.04%	33,669.90	1.46%	-
CICC	-	48,033,389.61	1.48%	60,041.74	2.61%	-
CREDIT SUISSE	-	146,775,988.15	4.53%	44,032.89	1.91%	-
GOLDMAN SACHS	-	334,459,800.18	10.32%	101,317.65	4.41%	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	-	32,660,445.86	1.01%	32,660.45	1.42%	-
J.P.MORGAN	-	134,991,189.23	4.17%	41,060.36	1.79%	-
KGI	-	53,071,842.97	1.64%	72,568.54	3.16%	-
MIZUHO	-	53,957,930.40	1.66%	43,166.34	1.88%	-
SINOPAC SECURITIES	-	55,766,968.65	1.72%	69,569.89	3.02%	-
国金证券	1	2,382,616.00	0.07%	146.26	0.01%	-
中泰证券	1	12,117,765.00	0.37%	8,861.98	0.39%	-
新时代证券	1	68,591,580.74	2.12%	54,873.25	2.39%	-
中金公司	1	55,547,421.99	1.71%	40,622.97	1.77%	-
中信证券	2	2,183,146,920.16	67.36%	1,658,771.04	72.12%	-

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，本基金还选择了东北证券、东方证券、方正证券、国泰君安、联讯证券、上海证券、天风证券、信达证券、兴业证券、银河证券、长江证券、长城证券、招商证券、中投证券、中信建投、中银国际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，东方证券、联讯证券、长城证券和中金公司的部分交易单元为本基金本期新增的券商交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

⑤此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BOCI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-
HAITONG INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-

SECURITIES						
J.P.MORGAN	-	-	-	-	1,876,475.28	16.33%
KGI	-	-	-	-	7,403,290.41	64.44%
MIZUHO	-	-	-	-	-	-
SINOPAC SECURITIES	-	-	-	-	2,208,892.67	19.23%
国金证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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关于华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）在境外主要投资场所 2019 年节假日暂停申购、赎回、定期定额申购业务的	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-07
2	华夏基金管理有限公司关于调整旗下华夏大中华混合（QDII）、华夏新时代混合（QDII）业绩比较基准并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-22
3	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
4	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
5	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
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在嘉实财富管理有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-13
7	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 《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）基金合同》；

12.1.3 《华夏新时代灵活配置混合型证券投资基金（QDII）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