

(上接 B67 版)
(8) 实时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。
如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,且适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
2. 投资限制
本基金在投资策略上兼顾投资回报以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:
(1) 本基金的股票投资比例为基金资产的 60%—95%,其中投资于新兴产业相关股票的比例不低于资产净值的 80%;投资于权证投资范围为基金资产的 0—3%;现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—40%(其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%);
(2) 持有同一家公司发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的 10%;
(3) 本基金由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;
(4) 本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
(6) 本基金管理人管理的全部基金持有一项权证的比例不得超过该权证的 10%;
(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(11) 相关法律法规及监管部门规定的其它投资限制。
如法律法规或监管部门取消上述限制,且适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

本基金管理人按照国家有关规定代表基金持有人行使股东权利和债权人权利,保护基金份额持有人的利益。
(六) 基金的融资融券
本基金管理人按照国家有关规定进行融资融券。
3. 基金的投资组合
本基金投资组合符合基金合同的有关规定。
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	597,343,555.36	77.62
	其中:股票	597,343,555.36	77.62
2	固定收益投资	-	-
3	期货投资	-	-
	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:买入返售金融资产的买入金额	-	-
	金融债券	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	171,778,806.02	22.32
8	其他资产	48,353.31	0.06
9	合计	769,600,714.69	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合
(1) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	11,623,631.06	1.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	394,218,498.00	51.07
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	15,357,038.00	2.01
E	建筑业	26,193,384.58	3.43
F	批发零售业	47,057,348.00	6.16
G	交通运输、仓储和邮政业	11,579,840.60	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	61,081,604.64	7.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,325,146.00	1.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,151,988.48	0.15
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	18,755,076.00	2.45
S	综合	-	-
	合计	597,343,555.36	78.14

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票投资组合。
(3) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	632,729	44,164,484.20	5.78
2	300145	中钢国际	1,044,138	27,702,307.64	3.62
3	002462	嘉事东	878,960	24,622,743.50	3.22
4	002236	大港股份	1,483,900	23,015,280.00	3.01
5	300296	利源股份	723,918	22,151,890.80	2.90
6	002235	继峰股份	1,805,308	16,590,780.52	2.17
7	600112	赛轮轮胎	1,220,450	16,476,075.00	2.16
8	002665	首航节能	1,725,879	16,447,626.87	2.15
9	600056	中国医药	811,608	15,785,775.60	2.06
10	002957	金采实业	1,044,026	15,232,339.34	1.99

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券投资。
5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金未投资股指期货。
(2) 本基金投资股指期货的投资政策
本基金未投资股指期货。
10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(1) 本期国债期货投资政策
本基金未投资国债期货。
(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金未投资国债期货。
(3) 本期国债期货投资评价
本基金未投资国债期货。
11. 投资组合报告附注
(1) 截至 2016 年 9 月 30 日持有前十名证券中的首航节能(002665)于 2016 年 1 月 5 日收到北京证监局《关于北京首航节能集团股份有限公司采取监管谈话行政监管谈话的决定》,因公司在财务核算、信息披露、内部控制等方面存在问题,予以监管谈话。此后于 2016 年 2 月 25 日收到深圳证券交易所中小板管理出具的监管关注函(中小板关注函[2016]第 34 号),因公司在利润分配政策的具體理

由、合理性、利润分配方案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全,给予关注。
截至 2016 年 9 月 30 日持有前十名证券中的金采实业(002957)于 2016 年 8 月 25 日收到证监会天津监管局下发的《关于下发安察省环境厅对金采实业股份有限公司违法违规行为的行政处罚决定书》,因金采实业违反《上市公司信息披露管理办法》进行环境保护工作专项检查,发现部分环境违法问题,对公司相关环境违法案件立案挂牌督办,要求安察省环保局根据文件通知并配合公司对照检查的情况,制定相关整改措施,并报送安察省环保局,后续待依法对公司进行行政处罚。
本基金管理人通过对上述上市公司进一步分析,认为上述处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资决策未发生改变,报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票范围。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	380,065.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,659.02
5	应收申购款	56,629.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	478,353.31

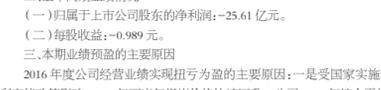
(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况说明
1	002462	嘉事东	3.22 重大资产重组
2	002665	首航节能	2.15 重大资产重组

八、基金业绩
本基金报告期内为 2016 年 9 月 30 日,基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。
1. 净值增长率与同期比较基准收益率对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010/12/31-2011/12/31	-0.47%	0.41%	-0.07%	1.40%	-0.40%	-0.99%
2011/01/01-2011/12/31	-23.67%	1.17%	-26.46%	1.15%	2.79%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	20.09%	1.43%	0.27%	1.11%	19.82%	0.28%
2013/01/01-2013/12/31	60.53%	1.68%	18.99%	1.69%	41.44%	0.52%
2014/01/01-2014/12/31	61.73%	1.38%	23.25%	0.91%	38.48%	0.47%
2015/01/01-2015/12/31	10.76%	2.20%	29.29%	2.14%	30.98%	0.56%
2016/01/01-2016/09/30	-18.09%	1.95%	-14.49%	1.46%	-6.69%	0.49%
2010/12/31-2016/09/30	115.37%	1.98%	24.23%	1.38%	91.14%	0.40%

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
华夏新兴产业灵活配置证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010 年 12 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的 6 个月内达到约定的资产配置比例。
九、基金份额的申购和赎回

由、合理性、利润分配方案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全,给予关注。
截至 2016 年 9 月 30 日持有前十名证券中的金采实业(002957)于 2016 年 8 月 25 日收到证监会天津监管局下发的《关于下发安察省环境厅对金采实业股份有限公司违法违规行为的行政处罚决定书》,因金采实业违反《上市公司信息披露管理办法》进行环境保护工作专项检查,发现部分环境违法问题,对公司相关环境违法案件立案挂牌督办,要求安察省环保局根据文件通知并配合公司对照检查的情况,制定相关整改措施,并报送安察省环保局,后续待依法对公司进行行政处罚。
本基金管理人通过对上述上市公司进一步分析,认为上述处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资决策未发生改变,报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票范围。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	380,065.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,659.02
5	应收申购款	56,629.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	478,353.31

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况说明
1	002462	嘉事东	3.22 重大资产重组
2	002665	首航节能	2.15 重大资产重组

八、基金业绩
本基金报告期内为 2016 年 9 月 30 日,基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。
1. 净值增长率与同期比较基准收益率对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010/12/31-2011/12/31	-0.47%	0.41%	-0.07%	1.40%	-0.40%	-0.99%
2011/01/01-2011/12/31	-23.67%	1.17%	-26.46%	1.15%	2.79%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	20.09%	1.43%	0.27%	1.11%	19.82%	0.28%
2013/01/01-2013/12/31	60.53%	1.68%	18.99%	1.69%	41.44%	0.52%
2014/01/01-2014/12/31	61.73%	1.38%	23.25%	0.91%	38.48%	0.47%
2015/01/01-2015/12/31	10.76%	2.20%	29.29%	2.14%	30.98%	0.56%
2016/01/01-2016/09/30	-18.09%	1.95%	-14.49%	1.46%	-6.69%	0.49%
2010/12/31-2016/09/30	115.37%	1.98%	24.23%	1.38%	91.14%	0.40%

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
华夏新兴产业灵活配置证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010 年 12 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的 6 个月内达到约定的资产配置比例。
九、基金份额的申购和赎回

由、合理性、利润分配方案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全,给予关注。
截至 2016 年 9 月 30 日持有前十名证券中的金采实业(002957)于 2016 年 8 月 25 日收到证监会天津监管局下发的《关于下发安察省环境厅对金采实业股份有限公司违法违规行为的行政处罚决定书》,因金采实业违反《上市公司信息披露管理办法》进行环境保护工作专项检查,发现部分环境违法问题,对公司相关环境违法案件立案挂牌督办,要求安察省环保局根据文件通知并配合公司对照检查的情况,制定相关整改措施,并报送安察省环保局,后续待依法对公司进行行政处罚。
本基金管理人通过对上述上市公司进一步分析,认为上述处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资决策未发生改变,报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票范围。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	380,065.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,659.02
5	应收申购款	56,629.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	478,353.31

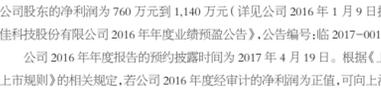
(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况说明
1	002462	嘉事东	3.22 重大资产重组
2	002665	首航节能	2.15 重大资产重组

八、基金业绩
本基金报告期内为 2016 年 9 月 30 日,基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。
1. 净值增长率与同期比较基准收益率对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010/12/31-2011/12/31	-0.47%	0.41%	-0.07%	1.40%	-0.40%	-0.99%
2011/01/01-2011/12/31	-23.67%	1.17%	-26.46%	1.15%	2.79%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	20.09%	1.43%	0.27%	1.11%	19.82%	0.28%
2013/01/01-2013/12/31	60.53%	1.68%	18.99%	1.69%	41.44%	0.52%
2014/01/01-2014/12/31	61.73%	1.38%	23.25%	0.91%	38.48%	0.47%
2015/01/01-2015/12/31	10.76%	2.20%	29.29%	2.14%	30.98%	0.56%
2016/01/01-2016/09/30	-18.09%	1.95%	-14.49%	1.46%	-6.69%	0.49%
2010/12/31-2016/09/30	115.37%	1.98%	24.23%	1.38%	91.14%	0.40%

2. 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率对比图
华夏新兴产业灵活配置证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010 年 12 月 7 日至 2016 年 9 月 30 日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日起的 6 个月内达到约定的资产配置比例。
九、基金份额的申购和赎回

由、合理性、利润分配方案与公司业绩匹配的具体理由等方面披露不全,给予关注。
截至 2016 年 9 月 30 日持有前十名证券中的金采实业(002957)于 2016 年 8 月 25 日收到证监会天津监管局下发的《关于下发安察省环境厅对金采实业股份有限公司违法违规行为的行政处罚决定书》,因金采实业违反《上市公司信息披露管理办法》进行环境保护工作专项检查,发现部分环境违法问题,对公司相关环境违法案件立案挂牌督办,要求安察省环保局根据文件通知并配合公司对照检查的情况,制定相关整改措施,并报送安察省环保局,后续待依法对公司进行行政处罚。
本基金管理人通过对上述上市公司进一步分析,认为上述处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资决策未发生改变,报告期内,本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票范围。
(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	380,065.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,659.02
5	应收申购款	56,629.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	478,353.31

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限情况说明
1	002462	嘉事东	3.22 重大资产重组
2	002665	首航节能	2.15 重大资产重组

八、基金业绩
本基金报告期内为 2016 年 9 月 30 日,基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。
1. 净值增长率与同期比较基准收益率对比

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2010/12/31-2011/12/31	-0.47%	0.41%	-0.07%	1.40%	-0.40%	-0.99%
2011/01/01-2011/12/31	-23.67%	1.17%	-26.46%	1.15%	2.79%	0.02%
2012/01/01-2012/12/31	20.09%	1.43%	0.27%	1.11%	19.82%	0.28%
2013/01/01-2013/12/31	60.53%	1.68%	18.99%	1.69%	41.44%	0.52%
2014/01/01-2014/12/31	61.73%	1.38%	23.25%	0.91%	38.48%	0.47%
2015/01/01-2015/12/31	10.76%	2.20%	29.29%	2.14%	30.98%	0.56%
2016/01/01-2016/09/30	-18.09%	1.95%	-14.49%	1.46%	-6.69%	0.49%
2010/12/31-2016/09/30	115.37%	1.98%	24.23%			