华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 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 9
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 10
6.1 资产负债表 10
6.2 利润表 11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 12
6.4 报表附注 12
§7 投资组合报告 30
7.1 期末基金资产组合情况 30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41
§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 45
§12 备查文件目录 45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华夏新锦图混合	
基金主代码	003906	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	199,612,851.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏新锦图混合 A	华夏新锦图混合 C
下属分级基金的交易代码	003906	003907
报告期末下属分级基金的份额总额	199,612,851.26 份	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，把握市场机会，追求资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用“自上而下”的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：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，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	张燕
	联系电话	400-818-6666	0755-83199084
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95555
传真		010-63136700	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区A区	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码	100033	518040
法定代表人	杨明辉	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	华夏新锦图混合 A	华夏新锦图混合 C
本期已实现收益	3,087,303.48	-
本期利润	6,068,640.26	-
加权平均基金份额本期利润	0.0296	-
本期加权平均净值利润率	2.94%	-
本期基金份额净值增长率	3.01%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏新锦图混合 A	华夏新锦图混合 C
期末可供分配利润	3,077,017.72	-
期末可供分配基金份额利润	0.0154	-
期末基金资产净值	205,623,520.58	-
期末基金份额净值	1.0301	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	华夏新锦图混合 A	华夏新锦图混合 C
基金份额累计净值增长率	3.01%	-

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

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

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏新锦图混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.02%	0.26%	2.56%	0.33%	-0.54%	-0.07%
过去三个月	2.52%	0.16%	3.11%	0.31%	-0.59%	-0.15%
过去六个月	3.01%	0.12%	5.50%	0.29%	-2.49%	-0.17%
自基金合同生效起至今	3.01%	0.11%	5.73%	0.28%	-2.72%	-0.17%

华夏新锦图混合 C

2016 年 12 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日期间， 华夏新锦图混合 C 类基金份额为零。

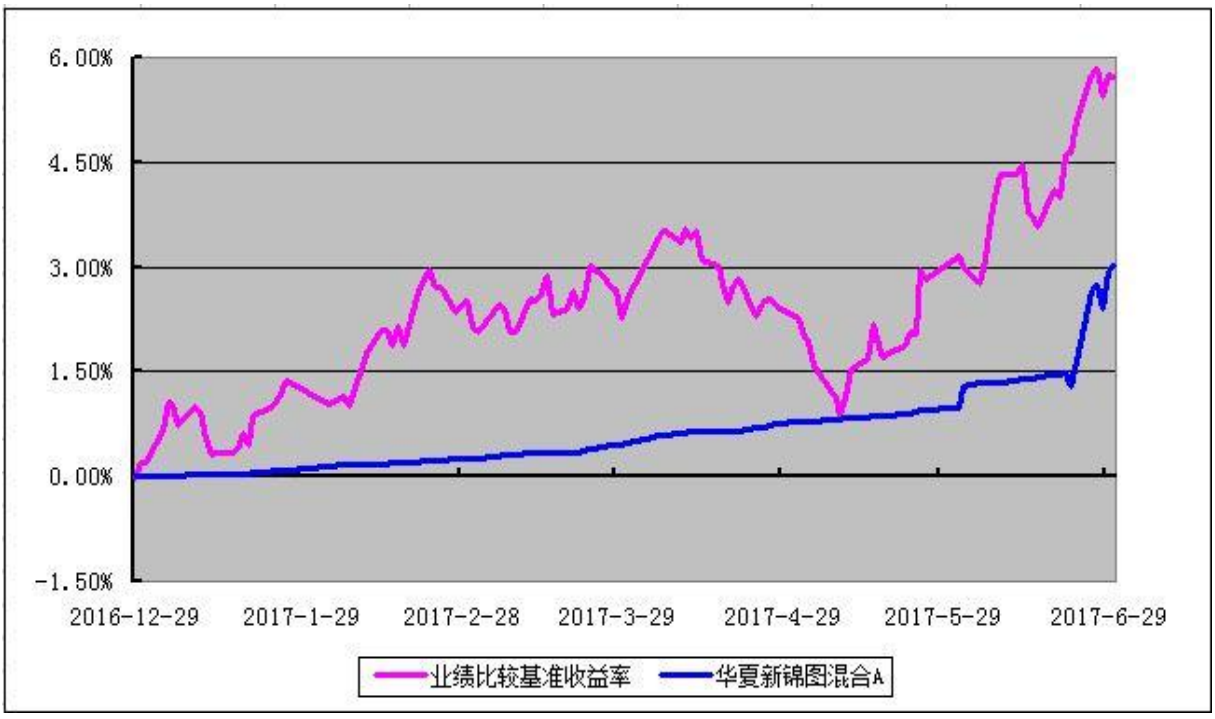
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016 年 12 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日）

华夏新锦图混合 A



注：①本基金合同于 2016 年 12 月 29 日生效。

②根据华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金的基金合同规定，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。

③2016 年 12 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日期间，华夏新锦图混合 C 类基金份额为零。

§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，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 2017 年 6 月 30 日数据），华夏大盘精选混合在 137 只普通偏股型基金（A 类）中排名第 5；华夏消费升级混合 A 在 256 只灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中排名第 2；华夏回报混合 A 和华夏回报二号混合分别在 172 只绝对收益目标基金（A 类）中排名第 2 和第 3；华夏全球股票(QDII)在 56 只 QDII 股票型基金（A 类）中排名第 3；华夏安康债券 C 在 126 只普通债券型基金（二级非 A 类）中排名第 9；华夏可转债增强债券 A 在 17 只可转换债券型基金（A 类）中排名第 3。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，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）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，

拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，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		
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016-12-29	-	17 年	经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部副总经理、基金经理助理、固定收益副总监、固定收益部总经理、华夏现金增利证券投资基金基金经理（2005 年 4 月 12 日至 2006 年 1 月 24 日期间，2007 年 1 月 6 日至 2008 年 2 月 4 日期间），华夏债券投资基金基金经理（2004 年 2 月 27 日至 2012 年 4 月 5 日期间）、华夏保证金理财货币市场基金基金经理（2013 年 2 月 4 日至 2015 年 4 月 2 日期间）等。
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2017-03-24	-	7 年	中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员等。

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》、基金合同和其他有关法律法规，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，美联储继续加息，但特朗普政策低于预期，欧洲经济也开始企稳，美元走弱，美国债利率下行。中国经济增速平稳，1 季度央行提升公开市场操作利率，正式将理财纳入 MPA 考核，2 季度银监会等出台力度较强的金融监管政策，社会融资总量和货币供应量增速均出现下降。

上半年债券市场继续调整，在 2 季度后半段随着央行对资金面态度的缓和，债市有所上涨，但同业存单利率仍然维持相对高位，去杠杆政策使得利率债总体需求不强，高等级信用利差继走阔后重新收窄。股票市场风格分化明显，主板除 2 季度上半段受去杠杆政策等影响调整幅度较大外，总体表现相对平稳，创业板表现较弱。可转债市场总体先抑后扬，因正股不同表现分化。

报告期内，本基金增持了二级市场股票，债券部分以持有短久期品种为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华夏新锦图混合 A 份额净值为 1.0301 元，本报告期份额净值增长率为 3.01%，同期绩比较基准增长率为 5.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，美联储有望开始缩表，全球货币政策进入温和收缩区间。中国经济增速在融资收缩和地方债务监管加强的背景下可能走弱，从而使得货币政策立场逐步转入相对温和。目前债券到期收益率仍然维持相对偏高的位置，具有一定配置价值。股市在去杠杆背景下预计继续保持分化，业绩稳定并有一定成长性的股票有望获得超额收益。

下半年，本基金将择机进行利率债的波段操作，并进行新股申购。

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，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、

准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,053,277.22	200,203,890.22
结算备付金		1,873,698.90	-
存出保证金		3,129.55	-
交易性金融资产	6.4.7.2	197,372,020.39	-
其中：股票投资		140,618,240.39	-
基金投资		-	-
债券投资		21,157,680.00	-
资产支持证券投资		35,596,100.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,904,430.14	-
应收利息	6.4.7.5	749,586.95	12,012.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		205,956,143.15	200,215,902.46
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		10.18	-
应付管理人报酬		106,468.13	6,564.20
应付托管费		17,744.69	1,094.04

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	129,056.37	-
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	79,343.20	-
负债合计		332,622.57	7,658.24
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	199,612,851.26	200,203,890.22
未分配利润	6.4.7.10	6,010,669.32	4,354.00
所有者权益合计		205,623,520.58	200,208,244.22
负债和所有者权益总计		205,956,143.15	200,215,902.46

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，华夏新锦图混合 A 基金份额净值 1.0301 元；华夏新锦图混合基金份额总额 199,612,851.26 份（其中 A 类 199,612,851.26 份，C 类 0.00 份）。

6.2 利润表

会计主体：华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		7,111,142.51
1.利息收入		3,711,424.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	136,655.87
债券利息收入		1,834,705.21
资产支持证券利息收入		670,961.80
买入返售金融资产收入		1,069,101.44
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-86,930.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-220,884.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	133,953.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,981,336.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	505,312.04

减：二、费用		1,042,502.25
1.管理人报酬		621,943.59
2.托管费		103,657.26
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.4.7.20	141,789.39
5.利息支出		89,659.68
其中：卖出回购金融资产支出		89,659.68
6.其他费用	6.4.7.21	85,452.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,068,640.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,068,640.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	200,203,890.22	4,354.00	200,208,244.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,068,640.26	6,068,640.26
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）	-591,038.96	-62,324.94	-653,363.90
其中：1.基金申购款	199,522,780.40	1,878,624.30	201,401,404.70
2.基金赎回款	-200,113,819.36	-1,940,949.24	-202,054,768.60
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）	199,612,851.26	6,010,669.32	205,623,520.58

报表附注为财务报表的组成部分。

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016] 2742 号《关于准予华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2016 年 12 月 13 日至 2016 年 12 月 27 日共募集 200,179,378.30 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（2016）验字第 60739337_A09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,203,890.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,511.92 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券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。

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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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公允价值变动计入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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的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，但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。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。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

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。

6.4.4.12 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[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》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、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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种，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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

4、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)，于 2015 年 3 月 20 日起按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、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。

5、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。

6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。其中对内地投资者取得上述收入按照 20%代扣代缴个人所得税，

应纳税所得额按如下方式确认：基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税；对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10%的税率代扣所得税。

7、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,053,277.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,053,277.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		137,661,943.61	140,618,240.39	2,956,296.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,197,600.00	1,198,680.00	1,080.00
	银行间市场	19,935,040.00	19,959,000.00	23,960.00
	合计	21,132,640.00	21,157,680.00	25,040.00
资产支持证券		35,596,100.00	35,596,100.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		194,390,683.61	197,372,020.39	2,981,336.78

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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,131.75
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	843.20
应收债券利息	257,457.75
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	489,154.25
合计	749,586.95

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 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	128,206.37
银行间市场应付交易费用	850.00
合计	129,056.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.04
预提费用	79,343.16
合计	79,343.20

6.4.7.9 实收基金

华夏新锦图混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	200,203,890.22	200,203,890.22
本期申购	199,522,780.40	199,522,780.40
本期赎回（以“-”号填列）	-200,113,819.36	-200,113,819.36
本期末	199,612,851.26	199,612,851.26

华夏新锦图混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	-	-

注：本基金自 2016 年 12 月 13 日至 2016 年 12 月 27 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 200,179,378.30 元。根据《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金的认购资金在募集期间产生的利息 24,511.92 元在本基金合同生效后，折算为 24,511.92 份基金份额，计入基金份额持有者账户。

6.4.7.10 未分配利润

华夏新锦图混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,354.00	-	4,354.00
本期利润	3,087,303.48	2,981,336.78	6,068,640.26
本期基金份额交易产生的变动数	-14,639.76	-47,685.18	-62,324.94
其中：基金申购款	2,011,916.72	-133,292.42	1,878,624.30
基金赎回款	-2,026,556.48	85,607.24	-1,940,949.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,077,017.72	2,933,651.60	6,010,669.32

华夏新锦图混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	107,004.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,886.31
其他	9,765.04
合计	136,655.87

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	164,850,231.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	162,990,654.40
减：应收利息总额	2,080,461.77
买卖债券差价收入	-220,884.27

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	133,953.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	133,953.64

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	2,981,336.78
——股票投资	2,956,296.78
——债券投资	25,040.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	2,981,336.78

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	505,214.82
其他	97.22

合计	505,312.04

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	140,464.39
银行间市场交易费用	1,325.00
合计	141,789.39

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	39,671.58
银行费用	2,709.17
银行间账户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	85,452.33

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	137,661,943.61	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	44,027,759.60	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	4,429,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	128,206.37	100.00%	128,206.37	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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	621,943.59
其中：支付销售机构的客户维护费	9.05

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.6%/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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	103,657.26

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 0.1%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×0.1%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	1,053,277.22	107,004.52

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 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（2017 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600172	黄河旋风	2017-06-30	重大事项	8.23	2017-07-14	8.00	43,800	356,566.20	360,474.00	-
300145	中金环境	2017-06-28	重大事项	16.92	-	-	9,000	149,978.00	152,280.00	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项	7.57	2017-07-03	7.54	3,000	22,676.00	22,710.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金一贯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。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，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，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,053,277.22	-	-	1,053,277.22
结算备付金	1,873,698.90	-	-	1,873,698.90
结算保证金	3,129.55	-	-	3,129.55
债券投资	21,157,680.00	-	-	21,157,680.00
资产支持证券	24,000,000.00	11,596,100.00	-	35,596,100.00
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产	-	-	-	-

款				
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	200,203,890.22	-	-	200,203,890.22
结算备付金	-	-	-	-
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	81,652.37	-
	利率上升 25 个基点	-81,287.73	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	140,618,240.39	68.39	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
合计	140,618,240.39	68.39	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动		
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	+5%	8,159,373.40	-
	-5%	-8,159,373.40	-

注：本基金上年度主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

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 2017 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 176,214,340.39 元，第二层次的余额为 21,157,680.00 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 0 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。

6.4.14.5 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	140,618,240.39	68.28
	其中：股票	140,618,240.39	68.28
2	固定收益投资	56,753,780.00	27.56
	其中：债券	21,157,680.00	10.27
	资产支持证券	35,596,100.00	17.28
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	2,926,976.12	1.42
7	其他各项资产	5,657,146.64	2.75
8	合计	205,956,143.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	825,894.00	0.40
B	采矿业	5,071,500.00	2.47
C	制造业	69,657,961.79	33.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,311,438.00	2.10
E	建筑业	4,484,778.00	2.18
F	批发和零售业	7,795,815.00	3.79
G	交通运输、仓储和邮政业	3,312,381.00	1.61
H	住宿和餐饮业	178,860.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,610,173.20	2.24
J	金融业	23,508,528.60	11.43
K	房地产业	9,307,888.80	4.53
L	租赁和商务服务业	3,455,034.00	1.68
M	科学研究和技术服务业	415,800.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	973,140.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,108.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,255,970.00	1.10
S	综合	407,970.00	0.20
	合计	140,618,240.39	68.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	68,700	3,408,207.00	1.66
2	601398	工商银行	450,000	2,362,500.00	1.15
3	600000	浦发银行	184,500	2,333,925.00	1.14
4	601288	农业银行	494,700	1,741,344.00	0.85
5	600998	九州通	75,300	1,623,468.00	0.79
6	600015	华夏银行	166,680	1,536,789.60	0.75
7	000651	格力电器	35,100	1,445,067.00	0.70
8	600271	航天信息	67,200	1,387,008.00	0.67

9	600309	万华化学	44,400	1,271,616.00	0.62
10	600522	中天科技	103,500	1,247,175.00	0.61
11	601668	中国建筑	125,700	1,216,776.00	0.59
12	600048	保利地产	120,300	1,199,391.00	0.58
13	000002	万科 A	46,200	1,153,614.00	0.56
14	600016	民生银行	137,100	1,126,962.00	0.55
15	000625	长安汽车	74,700	1,077,174.00	0.52
16	002019	亿帆医药	63,600	1,060,848.00	0.52
17	002001	新和成	53,400	1,036,494.00	0.50
18	601211	国泰君安	48,900	1,002,939.00	0.49
19	000001	平安银行	105,000	985,950.00	0.48
20	600252	中恒集团	242,400	979,296.00	0.48
21	000776	广发证券	56,700	978,075.00	0.48
22	000078	海王生物	159,900	964,197.00	0.47
23	600837	海通证券	64,800	962,280.00	0.47
24	000990	诚志股份	59,100	944,418.00	0.46
25	600031	三一重工	114,600	931,698.00	0.45
26	601766	中国中车	90,600	916,872.00	0.45
27	600183	生益科技	72,900	899,586.00	0.44
28	002217	合力泰	90,900	898,092.00	0.44
29	000989	九芝堂	47,322	897,225.12	0.44
30	600519	贵州茅台	1,800	849,330.00	0.41
31	600887	伊利股份	38,700	835,533.00	0.41
32	000876	新希望	100,500	826,110.00	0.40
33	002152	广电运通	99,000	822,690.00	0.40
34	000686	东北证券	81,000	814,050.00	0.40
35	002440	闰土股份	53,100	810,306.00	0.39
36	002106	莱宝高科	79,500	805,335.00	0.39
37	002463	沪电股份	176,400	802,620.00	0.39
38	000541	佛山照明	87,300	795,303.00	0.39
39	000157	中联重科	175,800	789,342.00	0.38
40	300269	联建光电	39,300	787,179.00	0.38
41	000921	海信科龙	45,600	784,776.00	0.38
42	002308	威创股份	59,400	775,170.00	0.38
43	002027	分众传媒	55,500	763,680.00	0.37
44	000826	启迪桑德	21,600	758,592.00	0.37
45	000960	锡业股份	55,500	755,355.00	0.37
46	000039	中集集团	41,700	751,851.00	0.37
47	000060	中金岭南	65,400	732,480.00	0.36
48	600737	中粮糖业	76,800	724,992.00	0.35
49	000830	鲁西化工	104,400	720,360.00	0.35
50	601607	上海医药	24,600	710,448.00	0.35
51	600498	烽火通信	27,900	707,265.00	0.34

52	002195	二三四五	98,400	703,560.00	0.34
53	600690	青岛海尔	46,500	699,825.00	0.34
54	000581	威孚高科	26,700	691,530.00	0.34
55	601678	滨化股份	99,000	688,050.00	0.33
56	000858	五粮液	12,300	684,618.00	0.33
57	000333	美的集团	15,900	684,336.00	0.33
58	600900	长江电力	44,400	682,872.00	0.33
59	600703	三安光电	34,500	679,650.00	0.33
60	601225	陕西煤业	96,000	678,720.00	0.33
61	601601	中国太保	19,800	670,626.00	0.33
62	601800	中国交建	42,000	667,380.00	0.32
63	601186	中国铁建	55,200	664,056.00	0.32
64	000725	京东方 A	159,600	663,936.00	0.32
65	000547	航天发展	63,300	661,485.00	0.32
66	002421	达实智能	108,000	660,960.00	0.32
67	000012	南玻 A	70,500	657,765.00	0.32
68	000963	华东医药	13,200	656,040.00	0.32
69	600028	中国石化	110,100	652,893.00	0.32
70	601988	中国银行	176,400	652,680.00	0.32
71	600637	东方明珠	30,000	650,100.00	0.32
72	603993	洛阳钼业	128,400	649,704.00	0.32
73	002064	华峰氨纶	134,400	647,808.00	0.32
74	601179	中国西电	115,800	643,848.00	0.31
75	000938	紫光股份	10,500	641,760.00	0.31
76	000732	泰禾集团	38,400	640,512.00	0.31
77	002203	海亮股份	78,600	639,804.00	0.31
78	600338	西藏珠峰	16,800	638,232.00	0.31
79	601555	东吴证券	56,700	636,741.00	0.31
80	600606	绿地控股	81,300	635,766.00	0.31
81	600801	华新水泥	66,000	628,980.00	0.31
82	600109	国金证券	53,400	625,848.00	0.30
83	002147	新光圆成	39,600	615,384.00	0.30
84	002304	洋河股份	6,900	598,989.00	0.29
85	002078	太阳纸业	81,000	595,350.00	0.29
86	601515	东风股份	52,200	589,860.00	0.29
87	002354	天神娱乐	27,300	586,950.00	0.29
88	601877	正泰电器	29,100	584,619.00	0.28
89	002500	山西证券	60,300	577,674.00	0.28
90	600064	南京高科	38,100	575,310.00	0.28
91	600811	东方集团	88,200	575,064.00	0.28
92	000750	国海证券	104,100	572,550.00	0.28
93	600094	大名城	74,100	568,347.00	0.28
94	601801	皖新传媒	41,100	568,002.00	0.28

95	000528	柳工	65,400	565,056.00	0.27
96	600823	世茂股份	115,200	564,480.00	0.27
97	600565	迪马股份	101,100	557,061.00	0.27
98	300251	光线传媒	67,800	555,282.00	0.27
99	600875	东方电气	57,900	554,682.00	0.27
100	600312	平高电气	40,200	552,348.00	0.27
101	600019	宝钢股份	81,900	549,549.00	0.27
102	000030	富奥股份	61,200	547,128.00	0.27
103	600598	北大荒	49,200	546,612.00	0.27
104	600748	上实发展	75,600	544,320.00	0.26
105	300039	上海凯宝	74,400	540,888.00	0.26
106	600567	山鹰纸业	148,800	532,704.00	0.26
107	002344	海宁皮城	63,900	531,648.00	0.26
108	601985	中国核电	67,200	524,832.00	0.26
109	000417	合肥百货	63,600	524,700.00	0.26
110	600566	济川药业	13,789	524,395.67	0.26
111	600060	海信电器	34,500	523,365.00	0.25
112	002024	苏宁云商	46,500	523,125.00	0.25
113	601818	光大银行	129,000	522,450.00	0.25
114	600586	金晶科技	106,200	519,318.00	0.25
115	000761	本钢板材	99,000	517,770.00	0.25
116	600758	红阳能源	57,900	517,626.00	0.25
117	000540	中天金融	74,400	517,080.00	0.25
118	000564	供销大集	78,300	509,733.00	0.25
119	000681	视觉中国	32,400	507,384.00	0.25
120	002249	大洋电机	77,100	507,318.00	0.25
121	000987	越秀金控	43,200	502,416.00	0.24
122	600317	营口港	146,100	501,123.00	0.24
123	600118	中国卫星	18,000	501,120.00	0.24
124	600487	亨通光电	17,700	496,485.00	0.24
125	600663	陆家嘴	20,700	489,348.00	0.24
126	601567	三星医疗	46,200	481,404.00	0.23
127	603806	福斯特	15,000	480,150.00	0.23
128	600862	中航高科	49,200	476,748.00	0.23
129	600642	申能股份	74,700	470,610.00	0.23
130	601238	广汽集团	18,000	469,080.00	0.23
131	300202	聚龙股份	28,200	465,864.00	0.23
132	600585	海螺水泥	20,400	463,692.00	0.23
133	000898	鞍钢股份	81,900	463,554.00	0.23
134	002501	利源精制	40,500	460,485.00	0.22
135	000596	古井贡酒	9,000	458,550.00	0.22
136	002444	巨星科技	29,400	458,052.00	0.22
137	600483	福能股份	44,100	457,317.00	0.22

138	000719	大地传媒	43,200	450,576.00	0.22
139	002589	瑞康医药	29,100	448,140.00	0.22
140	600366	宁波韵升	25,200	444,528.00	0.22
141	002051	中工国际	21,000	435,330.00	0.21
142	601311	骆驼股份	30,300	429,048.00	0.21
143	002601	龙蟒佰利	25,800	422,604.00	0.21
144	603698	航天工程	16,500	415,800.00	0.20
145	601866	中远海发	112,500	405,000.00	0.20
146	000939	凯迪生态	78,300	399,330.00	0.19
147	002315	焦点科技	15,900	396,546.00	0.19
148	000969	安泰科技	45,000	392,850.00	0.19
149	000685	中山公用	35,100	384,345.00	0.19
150	600073	上海梅林	39,600	378,180.00	0.18
151	002092	中泰化学	29,400	373,380.00	0.18
152	000860	顺鑫农业	18,600	372,186.00	0.18
153	002680	长生生物	24,300	371,547.00	0.18
154	600172	黄河旋风	43,800	360,474.00	0.18
155	000550	江铃汽车	17,400	360,180.00	0.18
156	600428	中远海特	57,600	358,272.00	0.17
157	601899	紫金矿业	101,700	348,831.00	0.17
158	002002	鸿达兴业	44,400	347,652.00	0.17
159	600236	桂冠电力	60,600	345,420.00	0.17
160	603369	今世缘	26,100	344,520.00	0.17
161	002400	省广股份	42,900	344,487.00	0.17
162	000729	燕京啤酒	50,400	338,688.00	0.16
163	600770	综艺股份	45,000	337,500.00	0.16
164	600061	国投安信	21,600	335,880.00	0.16
165	000712	锦龙股份	20,400	333,948.00	0.16
166	000046	泛海控股	37,800	329,994.00	0.16
167	601216	君正集团	65,100	318,339.00	0.15
168	600053	九鼎投资	9,000	314,640.00	0.15
169	600409	三友化工	31,200	314,184.00	0.15
170	002437	誉衡药业	42,600	310,128.00	0.15
171	600029	南方航空	34,500	300,150.00	0.15
172	000825	太钢不锈	69,000	300,150.00	0.15
173	600635	大众公用	54,600	297,570.00	0.14
174	600990	四创电子	4,800	297,552.00	0.14
175	002581	未名医药	14,400	294,480.00	0.14
176	600628	新世界	25,200	291,060.00	0.14
177	601888	中国国旅	9,600	289,344.00	0.14
178	603328	依顿电子	20,400	288,660.00	0.14
179	600477	杭萧钢构	18,900	288,414.00	0.14
180	002563	森马服饰	33,900	287,472.00	0.14

181	601628	中国人寿	10,500	283,290.00	0.14
182	000997	新大陆	12,300	279,087.00	0.14
183	601336	新华保险	5,400	277,560.00	0.13
184	001696	宗申动力	36,600	277,062.00	0.13
185	002236	大华股份	12,000	273,720.00	0.13
186	000598	兴蓉环境	48,600	273,132.00	0.13
187	601666	平煤股份	51,600	271,932.00	0.13
188	600291	西水股份	12,000	264,000.00	0.13
189	000738	航发控制	13,200	258,324.00	0.13
190	002653	海思科	19,800	257,598.00	0.13
191	600415	小商品城	35,400	256,296.00	0.12
192	300182	捷成股份	26,700	255,252.00	0.12
193	600971	恒源煤电	31,200	253,656.00	0.12
194	000059	华锦股份	25,200	252,252.00	0.12
195	300010	立思辰	19,200	248,640.00	0.12
196	600741	华域汽车	10,200	247,248.00	0.12
197	600816	安信信托	18,000	244,620.00	0.12
198	002555	三七互娱	9,300	237,801.00	0.12
199	002151	北斗星通	8,400	234,780.00	0.11
200	000415	渤海金控	34,800	234,204.00	0.11
201	000582	北部湾港	20,400	231,540.00	0.11
202	600872	中炬高新	12,600	230,580.00	0.11
203	600839	四川长虹	63,000	228,060.00	0.11
204	002636	金安国纪	13,200	227,964.00	0.11
205	600270	外运发展	12,000	227,160.00	0.11
206	000400	许继电气	12,600	226,296.00	0.11
207	000089	深圳机场	24,000	224,400.00	0.11
208	600009	上海机场	6,000	223,860.00	0.11
209	600079	人福医药	11,400	223,668.00	0.11
210	002479	富春环保	18,600	221,340.00	0.11
211	600614	鹏起科技	19,800	217,800.00	0.11
212	002573	清新环境	11,400	214,548.00	0.10
213	600126	杭钢股份	31,200	214,032.00	0.10
214	002415	海康威视	6,600	213,180.00	0.10
215	000970	中科三环	14,400	212,832.00	0.10
216	600694	大商股份	5,400	210,438.00	0.10
217	600736	苏州高新	29,700	209,979.00	0.10
218	002508	老板电器	4,800	208,704.00	0.10
219	601939	建设银行	33,900	208,485.00	0.10
220	603001	奥康国际	10,800	202,932.00	0.10
221	600687	刚泰控股	15,600	200,928.00	0.10
222	002325	洪涛股份	26,400	192,720.00	0.09
223	601111	中国国航	19,500	190,125.00	0.09

224	600879	航天电子	21,500	188,985.00	0.09
225	002482	广田集团	21,000	188,790.00	0.09
226	601390	中国中铁	21,600	187,272.00	0.09
227	600348	阳泉煤业	27,300	185,094.00	0.09
228	600188	兖州煤业	15,000	183,600.00	0.09
229	000758	中色股份	25,800	180,858.00	0.09
230	002042	华孚色纺	16,800	179,592.00	0.09
231	600754	锦江股份	6,600	178,860.00	0.09
232	600153	建发股份	13,800	178,434.00	0.09
233	603198	迎驾贡酒	9,300	176,979.00	0.09
234	002663	普邦股份	31,800	172,674.00	0.08
235	600640	号百控股	10,200	172,380.00	0.08
236	002081	金螳螂	15,600	171,288.00	0.08
237	603444	吉比特	600	169,998.00	0.08
238	000425	徐工机械	44,400	166,500.00	0.08
239	600893	航发动力	6,000	163,800.00	0.08
240	002048	宁波华翔	7,800	162,708.00	0.08
241	002705	新宝股份	10,500	157,815.00	0.08
242	002714	牧原股份	5,700	155,154.00	0.08
243	600074	保千里	12,000	153,720.00	0.07
244	300145	中金环境	9,000	152,280.00	0.07
245	600018	上港集团	24,000	152,160.00	0.07
246	002093	国脉科技	17,100	150,480.00	0.07
247	601233	桐昆股份	10,800	149,688.00	0.07
248	600023	浙能电力	27,000	147,420.00	0.07
249	300296	利亚德	7,800	146,640.00	0.07
250	002537	海立美达	12,000	146,160.00	0.07
251	600125	铁龙物流	16,200	145,152.00	0.07
252	600059	古越龙山	15,600	144,300.00	0.07
253	601857	中国石油	18,600	143,034.00	0.07
254	002266	浙富控股	28,800	140,544.00	0.07
255	002568	百润股份	8,400	139,608.00	0.07
256	600597	光明乳业	10,800	137,700.00	0.07
257	600160	巨化股份	11,400	137,142.00	0.07
258	002273	水晶光电	6,600	136,158.00	0.07
259	603188	亚邦股份	7,800	136,032.00	0.07
260	603766	隆鑫通用	18,600	135,408.00	0.07
261	300316	晶盛机电	10,800	134,892.00	0.07
262	000813	德展健康	15,600	134,628.00	0.07
263	002466	天齐锂业	2,400	130,440.00	0.06
264	002063	远光软件	12,000	125,040.00	0.06
265	600108	亚盛集团	28,800	124,128.00	0.06
266	600438	通威股份	22,200	123,876.00	0.06

267	600499	科达洁能	15,600	123,864.00	0.06
268	603118	共进股份	9,000	122,670.00	0.06
269	000630	铜陵有色	42,600	120,984.00	0.06
270	601718	际华集团	13,500	118,665.00	0.06
271	002191	劲嘉股份	12,600	117,936.00	0.06
272	002247	帝龙文化	8,400	110,208.00	0.05
273	601158	重庆水务	15,000	107,250.00	0.05
274	002468	申通快递	4,200	106,722.00	0.05
275	603816	顾家家居	1,800	105,804.00	0.05
276	600688	上海石化	15,900	105,099.00	0.05
277	600383	金地集团	9,000	103,230.00	0.05
278	000762	西藏矿业	7,200	102,024.00	0.05
279	300017	网宿科技	8,400	101,388.00	0.05
280	000895	双汇发展	4,200	99,750.00	0.05
281	600708	光明地产	14,820	98,404.80	0.05
282	601006	大秦铁路	11,700	98,163.00	0.05
283	002498	汉缆股份	26,400	96,624.00	0.05
284	600376	首开股份	8,400	96,096.00	0.05
285	600547	山东黄金	3,300	95,469.00	0.05
286	000718	苏宁环球	16,200	94,932.00	0.05
287	600390	五矿资本	7,800	94,458.00	0.05
288	000156	华数传媒	6,000	89,460.00	0.04
289	600611	大众交通	16,200	89,424.00	0.04
290	300055	万邦达	4,800	88,320.00	0.04
291	002241	歌尔股份	4,500	86,760.00	0.04
292	603515	欧普照明	2,400	86,688.00	0.04
293	601886	江河集团	8,400	86,100.00	0.04
294	603866	桃李面包	2,400	85,392.00	0.04
295	600551	时代出版	5,400	85,266.00	0.04
296	002242	九阳股份	4,200	82,614.00	0.04
297	600398	海澜之家	8,700	82,563.00	0.04
298	600115	东方航空	12,000	81,600.00	0.04
299	601020	华钰矿业	3,600	79,308.00	0.04
300	002221	东华能源	7,200	78,552.00	0.04
301	603528	多伦科技	5,400	77,598.00	0.04
302	600138	中青旅	3,600	75,816.00	0.04
303	603868	飞科电器	1,200	74,208.00	0.04
304	600175	美都能源	16,200	70,470.00	0.03
305	002662	京威股份	9,600	69,120.00	0.03
306	000568	泸州老窖	1,200	60,696.00	0.03
307	603077	和邦生物	11,400	58,026.00	0.03
308	002155	湖南黄金	6,000	57,420.00	0.03
309	000683	远兴能源	21,000	56,700.00	0.03

310	002310	东方园林	3,300	55,176.00	0.03
311	600705	中航资本	8,700	49,155.00	0.02
312	600352	浙江龙盛	4,800	45,744.00	0.02
313	603377	东方时尚	1,200	45,108.00	0.02
314	002558	巨人网络	960	44,371.20	0.02
315	600787	中储股份	5,400	42,714.00	0.02
316	000726	鲁泰 A	3,600	42,696.00	0.02
317	600221	海航控股	12,900	41,538.00	0.02
318	002375	亚厦股份	4,200	37,422.00	0.02
319	600489	中金黄金	3,300	33,099.00	0.02
320	002431	棕榈股份	3,000	33,060.00	0.02
321	601727	上海电气	3,000	22,710.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,402,901.72	1.70
2	600000	浦发银行	2,307,902.29	1.15
3	601398	工商银行	2,295,843.00	1.15
4	601288	农业银行	1,732,053.00	0.87
5	600998	九州通	1,519,380.37	0.76
6	600015	华夏银行	1,507,526.00	0.75
7	000651	格力电器	1,370,990.00	0.68
8	600271	航天信息	1,321,242.13	0.66
9	600309	万华化学	1,193,441.00	0.60
10	600522	中天科技	1,191,995.00	0.60
11	601668	中国建筑	1,187,199.00	0.59
12	600048	保利地产	1,184,999.00	0.59
13	600016	民生银行	1,113,372.00	0.56
14	000625	长安汽车	1,063,590.00	0.53
15	000002	万科 A	1,020,921.00	0.51
16	002001	新和成	995,546.00	0.50
17	002019	亿帆医药	991,641.50	0.50
18	600252	中恒集团	986,831.00	0.49
19	601211	国泰君安	971,950.00	0.49
20	600837	海通证券	968,482.00	0.48

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无股票卖出。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	137,661,943.61
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,198,680.00	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,952,000.00	4.84
	其中：政策性金融债	9,952,000.00	4.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,007,000.00	4.87
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,157,680.00	10.29

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	011760026	17 中化工 SCP002	100,000	10,007,000.00	4.87
2	170301	17 进出 01	100,000	9,952,000.00	4.84
3	019546	16 国债 18	12,000	1,198,680.00	0.58
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116515	徐工 2A7	140,000.00	14,000,000.00	6.81
2	142636	汇通 9A5	100,000.00	10,000,000.00	4.86
3	142911	YX 优 A	90,000.00	6,596,100.00	3.21

4	116539	京东 7 优 A	50,000.00	5,000,000.00	2.43

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,129.55
2	应收证券清算款	4,904,430.14
3	应收股利	-
4	应收利息	749,586.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	5,657,146.64

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华夏新锦图混合 A	244	818,085.46	198,136,516.74	99.26%	1,476,334.52	0.74%
华夏新锦图混合 C	-	-	-	-	-	-
合计	244	818,085.46	198,136,516.74	99.26%	1,476,334.52	0.74%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华夏新锦图混合 A	13,569.56	0.01%
	华夏新锦图混合 C	-	-
	合计	13,569.56	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华夏新锦图混合 A	0~10
	华夏新锦图混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华夏新锦图混合 A	0~10
	华夏新锦图混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏新锦图混合 A	华夏新锦图混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 29 日）基金份额总额	200,203,890.22	-
本报告期期初基金份额总额	200,203,890.22	-
本报告期基金总申购份额	199,522,780.40	-
减：本报告期基金总赎回份额	200,113,819.36	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,612,851.26	-

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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未受到任何处分。

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	佣金	占当期	

			股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
中信证券	2	137,661,943.61	100.00%	128,206.37	100.00%	-

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，本基金还选择了光大证券、国泰君安证券、申万宏源证券、招商证券、中金公司、中银国际证券、中信建投证券、华泰证券和中信证券（山东）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，中金公司的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，本期没有剔除的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	44,027,759.60	100.00%	4,429,000,000.00	100.00%

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	华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额开放日常申购、赎回、转换转出业	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-07

	务的公告		
2	关于华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额限制申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-07
3	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-25
4	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-06-01	200,023,444.44	-	200,023,444.44	-	-
	2	2017-05-26 至 2017-06-30	-	198,136,516.74	-	198,136,516.74	99.26%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于5000万元，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§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《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

12.1.3《华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日