

华夏网购精选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：中国工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。

基金托管人中国工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.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	9
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.....	30
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.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	44
§12 备查文件目录.....	44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏网购精选混合
基金主代码	002837
交易代码	002837
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 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	160,567,849.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以网购消费大数据为基础构建量化投资策略，网购消费大数据指的是由蚂蚁金服提供的网上消费行业统计型趋势大数据，包括销售额存量长期增长、销售额长期增长、成交笔数长期增长、订单量存量长期增长、销售额存量同比、价格同比等数据。 本基金是灵活配置混合型基金，在资产配置策略和股票投资策略上均应用网购消费大数据，充分利用公司大数据研究平台的优势，分析研究网购消费大数据，力求为投资者把握网购消费大数据中的投资机会。
业绩比较基准	中证主要消费指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国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A区	北京市西城区复兴门内大街55号
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	易会满

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）
本期已实现收益	2,111,966.95
本期利润	8,010,837.74
加权平均基金份额本期利润	0.0360
本期加权平均净值利润率	3.59%
本期基金份额净值增长率	3.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,611,090.55
期末可供分配基金份额利润	0.0100
期末基金资产净值	165,322,220.48
期末基金份额净值	1.030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.00%

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	3.83%	0.47%	4.14%	0.53%	-0.31%	-0.06%
过去三个月	1.48%	0.45%	4.98%	0.52%	-3.50%	-0.07%
过去六个月	3.73%	0.46%	10.10%	0.46%	-6.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.40%	9.01%	0.46%	-6.01%	-0.06%

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

华夏网购精选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 11 月 2 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：①本基金合同于 2016 年 11 月 2 日生效。

②根据华夏网购精选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。

§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		
郑煜	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-02	-	19 年	中国科技大学管理科学与工程学硕士。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理。2004 年 8 月加入原中信基金，曾任股权投资部总监、华夏基金股票投资部副总经理，华夏红利混合型证券投资基金基金经理（2010

					年 1 月 16 日至 2011 年 3 月 17 日期间)、华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理 (2006 年 8 月 11 日至 2011 年 3 月 17 日期间) 等。
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2016-11-02	-	17 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司, 曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理, 上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间) 等。

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、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, 国际方面, 美国经济数据持续改善, 美联储两次加息并公布了年内缩表的计划; 欧元区经济恢复好于预期。国内方面, 我国经济延续了稳中向好的发展态势, 投资、出口、消费均超出市场预期, 与此同时, 经济增长新动能发挥了积极作用, 经济增长质量不断提高。在经济取得良好

开局的同时，政府也高度重视房地产领域与金融领域的潜在风险，出台了较为严格的监管政策。报告期内，货币政策维持中性，汇率相对稳定。

市场方面，1 季度在国内外基本面企稳确认、工业品价格持续上涨、企业盈利恢复、居民消费升级等因素带动下，市场走出了一波震荡上涨行情。2 季度期初，工业品价格环比回落、金融领域加强监管等因素对风险偏好形成一定压制，市场有所调整，但在雄安新区、监管节奏调整、A 股纳入 MSCI 等因素影响下，市场走出了一波以蓝筹龙头股板块为代表的震荡上涨行情。

基金投资运作方面，作为灵活配置型基金，我们依据量化择时模型在报告期内进行了股票仓位调整，达到了一定规避风险的作用。同时，我们辅助网购大数据以及量化模型对 A 股行业和个股股票进行选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.030 元，本报告期份额净值增长率为 3.73%，同期业绩比较基准增长率为 10.10%。

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，国际方面，在经济保持平稳增长的前提下，美国预期还会加息并将启动缩表程序。国内方面，我国经济稳中向好的发展态势有望进一步巩固，改革也将深入推进；货币政策仍会维持上半年的中性偏紧的态势。如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，市场或将有相对较好的表现。

投资策略方面，我们认为下半年市场仍然是存量博弈的市场，可能仍以价值风格为主，我们会根据量化模型的结果有针对性地进行组合构建，争取为投资者获得更多的收益。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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网购精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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，华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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，华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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网购精选灵活配置混合型证券投资基金 2017 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：华夏网购精选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	4,358,653.12	110,052,725.72
结算备付金		32,645,558.67	3,544,850.14
存出保证金		72,346.68	9,277.59
交易性金融资产	6.4.7.2	104,931,949.03	117,879,047.43
其中：股票投资		94,970,835.22	117,879,047.43
基金投资		-	-
债券投资		9,961,113.81	-
资产支持证券投资		-	-
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	20,000,000.00	80,000,000.00
应收证券清算款		6,411,702.27	18,840,185.76
应收利息	6.4.7.5	127,458.99	89,471.26
应收股利		-	-
应收申购款		20,763.13	8,887.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		168,568,431.89	330,424,445.60
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		-	16,202,916.92
应付赎回款		2,483,933.28	3,080,119.46
应付管理人报酬		215,622.79	460,557.63
应付托管费		35,937.14	76,759.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	422,170.06	91,607.21
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	88,548.14	3,852.80
负债合计		3,246,211.41	19,915,813.61
所有者权益：		-	-

实收基金	6.4.7.9	160,567,849.97	312,559,452.88
未分配利润	6.4.7.10	4,754,370.51	-2,050,820.89
所有者权益合计		165,322,220.48	310,508,631.99
负债和所有者权益总计		168,568,431.89	330,424,445.60

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 160,567,849.97 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏网购精选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			11,050,329.48
1.利息收入			902,013.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11		437,443.96
债券利息收入			209,928.52
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			254,641.21
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			3,829,254.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12		1,554,473.98
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.13		-21,855.33
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		1,371,384.00
股利收益	6.4.7.17		925,252.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18		5,898,870.79
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		420,190.11
减：二、费用			3,039,491.74
1.管理人报酬			1,672,484.24
2.托管费			278,747.39
3.销售服务费			-
4.交易费用	6.4.7.20		1,000,874.34
5.利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6.其他费用	6.4.7.21		87,385.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			8,010,837.74
减：所得税费用			-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,010,837.74
-------------------	--	--------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏网购精选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）	312,559,452.88	-2,050,820.89	310,508,631.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,010,837.74	8,010,837.74
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）	-151,991,602.91	-1,205,646.34	-153,197,249.25
其中：1.基金申购款	10,639,671.19	45,298.52	10,684,969.71
2.基金赎回款	-162,631,274.10	-1,250,944.86	-163,882,218.96
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）	160,567,849.97	4,754,370.51	165,322,220.48

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

华夏网购精选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]1078 号《关于准予华夏网购精选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》、《华夏网购精选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 9 月 26 日至 2016 年 10 月 28 日共募集 466,130,728.47 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（16）第 0942 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11

月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 466,250,712.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 119,983.90 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏网购精选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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券、可转换债券）、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、期权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（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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。

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	4,358,653.12
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,358,653.12

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	90,558,029.53	94,970,835.22	4,412,805.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100.00	113.81
	银行间市场	9,996,260.00	9,961,000.00
	合计	9,996,360.00	9,961,113.81
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	100,554,389.53	104,931,949.03	4,377,559.50

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场买入返售金融资产	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

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	897.13
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	18,375.92
应收债券利息	108,153.44
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	32.50
合计	127,458.99

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	422,170.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	422,170.06

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	9,204.98
预提费用	79,343.16
合计	88,548.14

6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	312,559,452.88	312,559,452.88
本期申购	10,639,671.19	10,639,671.19
本期赎回（以“-”号填列）	-162,631,274.10	-162,631,274.10
本期末	160,567,849.97	160,567,849.97

注：本基金自 2016 年 9 月 26 日至 2016 年 10 月 28 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 466,130,728.47 元。根据《华夏网购精选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 119,983.90 元在本基金合同生效后，折算为 119,983.90 份基金份额

额，计入基金份额持有者账户。

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	-629,720.91	-1,421,099.98	-2,050,820.89
本期利润	2,111,966.95	5,898,870.79	8,010,837.74
本期基金份额交易产生的变动数	128,844.51	-1,334,490.85	-1,205,646.34
其中：基金申购款	1,442.99	43,855.53	45,298.52
基金赎回款	127,401.52	-1,378,346.38	-1,250,944.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,611,090.55	3,143,279.96	4,754,370.51

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	148,901.02
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	288,115.58
其他	427.36
合计	437,443.96

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	389,385,546.52
减：卖出股票成本总额	387,831,072.54
买卖股票差价收入	1,554,473.98

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	19,276,152.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,125,830.00
减：应收利息总额	172,178.23

买卖债券差价收入	-21,855.33
----------	------------

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	1,371,384.00
合计	1,371,384.00

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	925,252.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	925,252.24

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	5,898,870.79
——股票投资	5,934,116.98

——债券投资	-35,246.19
——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	-
——期货投资	-
4.其他	-
合计	5,898,870.79

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	420,190.11
合计	420,190.11

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	1,000,174.34
银行间市场交易费用	700.00
合计	1,000,874.34

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	5,042.61
银行间账户维护费	3,000.00
合计	87,385.77

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
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司

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	388,818,826.22	52.07%

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

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	348,000,000.00	55.41%

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	284,343.22	52.47%	263,722.06	62.47%

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	1,672,484.24
其中：支付销售机构的客户维护费	188,691.03

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 1.5%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×1.5%/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	278,747.39

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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
中国工商银行活期存款	4,358,653.12	148,901.02

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 61,930,540.00 元，支付给中信期货的佣金为 1517.29 元。

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

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
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

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
000007	全新好	2017-01-16	重大事项	15.87	2017-07-17	14.28	53,100	889,601.00	842,697.00	-
002418	康盛股份	2017-03-20	重大事项	9.31	2017-07-10	9.30	73,700	766,931.95	686,147.00	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	51,800	569,287.11	566,692.00	-
300271	华宇	2017-06-22	重大事	16.59	2017-07-04	16.80	26,400	427,251.00	437,976.00	-

300201	软件 海伦哲	2017-02-06	重大事项	8.69	2017-08-21	8.99	22,700	186,569.00	197,263.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	26,400	194,041.43	163,944.00	-
601872	招商轮船	2017-05-02	重大事项	5.16	-	-	28,400	157,749.00	146,544.00	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项	7.57	2017-07-03	7.54	19,200	149,187.00	145,344.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	6,400	112,642.60	142,656.00	-
002586	围海股份	2017-04-18	重大事项	9.87	-	-	13,500	139,749.00	133,245.00	-
000716	黑芝麻	2017-01-03	重大事项	8.06	2017-08-15	7.25	14,900	119,796.00	120,094.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	28,800	95,787.00	103,680.00	-
002098	浔兴股份	2017-04-24	重大事项	14.09	2017-07-24	14.48	6,835	111,754.38	96,305.15	-
600559	老白干酒	2017-01-23	重大事项	22.69	-	-	3,800	89,126.00	86,222.00	-
002076	雪莱特	2017-03-20	重大事项	7.07	-	-	11,600	80,538.51	82,012.00	-
002447	壹桥股份	2017-05-02	重大事项	9.00	-	-	8,701	82,359.24	78,309.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	6.85	2017-08-21	8.22	11,300	73,332.35	77,405.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	6,450	64,967.00	66,628.50	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	3,300	46,130.78	46,596.00	-
002312	*ST 三泰	2017-03-31	重大事项	6.82	2017-07-24	7.16	5,416	46,924.85	36,937.12	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	16.31	2017-08-02	16.48	2,100	30,290.00	34,251.00	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大事项	5.76	2017-08-10	6.19	4,800	28,036.00	27,648.00	-
600577	精达股份	2017-06-26	重大事项	4.80	2017-07-10	4.50	2,000	10,030.00	9,600.00	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	2,200	6,017.00	5,368.00	-
002256	兆新股份	2017-06-05	重大事项	4.39	-	-	174	1,097.54	763.86	-

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。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。截至本期末，本基金持有极少量债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.2 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	94,970,835.22	57.45	117,879,047.43	37.96
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	94,970,835.22	57.45	117,879,047.43	37.96

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 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	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%	5,574,313.17	6,379,024.65

	-5%	-5,574,313.17	-6,379,024.65
--	-----	---------------	---------------

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 94,859,293.03 元，第二层次的余额为 10,072,656.00 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 117,879,047.43 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	94,970,835.22	56.34
	其中：股票	94,970,835.22	56.34
2	固定收益投资	9,961,113.81	5.91
	其中：债券	9,961,113.81	5.91
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	20,000,000.00	11.86
	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	37,004,211.79	21.95
7	其他各项资产	6,632,271.07	3.93
8	合计	168,568,431.89	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	246,981.00	0.15
B	采矿业	6,514,767.00	3.94
C	制造业	36,922,032.60	22.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,102,676.00	0.67
E	建筑业	2,604,926.12	1.58
F	批发和零售业	11,684,658.00	7.07

G	交通运输、仓储和邮政业	1,254,870.00	0.76
H	住宿和餐饮业	842,697.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,978,507.18	3.62
J	金融业	14,968,273.30	9.05
K	房地产业	6,719,979.12	4.06
L	租赁和商务服务业	1,229,530.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,581,600.45	0.96
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	3,319,337.45	2.01
S	综合	-	-
	合计	94,970,835.22	57.45

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	34,800	1,726,428.00	1.04
2	000651	格力电器	41,074	1,691,016.58	1.02
3	600837	海通证券	101,100	1,501,335.00	0.91
4	600036	招商银行	57,100	1,365,261.00	0.83
5	601166	兴业银行	76,400	1,288,104.00	0.78
6	600016	民生银行	151,400	1,244,508.00	0.75
7	000002	万科 A	47,613	1,188,896.61	0.72
8	601328	交通银行	158,300	975,128.00	0.59
9	000333	美的集团	22,606	972,962.24	0.59
10	601668	中国建筑	100,200	969,936.00	0.59
11	600519	贵州茅台	1,900	896,515.00	0.54
12	600028	中国石化	151,000	895,430.00	0.54
13	000007	全新好	53,100	842,697.00	0.51
14	601225	陕西煤业	119,000	841,330.00	0.51
15	000983	西山煤电	95,200	834,904.00	0.51
16	600019	宝钢股份	115,900	777,689.00	0.47
17	600000	浦发银行	59,910	757,861.50	0.46
18	601699	潞安环能	96,300	753,066.00	0.46
19	600348	阳泉煤业	107,300	727,494.00	0.44
20	601857	中国石油	90,100	692,869.00	0.42
21	000776	广发证券	39,800	686,550.00	0.42
22	002418	康盛股份	73,700	686,147.00	0.42
23	601233	桐昆股份	49,000	679,140.00	0.41
24	000725	京东方 A	162,970	677,955.20	0.41

25	000703	恒逸石化	47,600	677,824.00	0.41
26	601688	华泰证券	37,600	673,040.00	0.41
27	600157	永泰能源	186,400	665,448.00	0.40
28	600104	上汽集团	21,300	661,365.00	0.40
29	600808	马钢股份	186,500	660,210.00	0.40
30	600048	保利地产	65,400	652,038.00	0.39
31	002024	苏宁云商	57,600	648,000.00	0.39
32	601601	中国太保	19,000	643,530.00	0.39
33	600010	包钢股份	282,660	619,025.40	0.37
34	601607	上海医药	21,200	612,256.00	0.37
35	000698	沈阳化工	91,300	596,189.00	0.36
36	600291	西水股份	26,700	587,400.00	0.36
37	600282	南钢股份	158,000	586,180.00	0.35
38	601988	中国银行	157,500	582,750.00	0.35
39	600309	万华化学	20,020	573,372.80	0.35
40	601098	中南传媒	30,700	572,248.00	0.35
41	600256	广汇能源	137,700	570,078.00	0.34
42	600289	亿阳信通	51,800	566,692.00	0.34
43	002221	东华能源	51,600	562,956.00	0.34
44	000554	泰山石油	68,300	553,230.00	0.33
45	600900	长江电力	35,300	542,914.00	0.33
46	000963	华东医药	10,700	531,790.00	0.32
47	600569	安阳钢铁	186,900	528,927.00	0.32
48	000959	首钢股份	75,100	524,949.00	0.32
49	600999	招商证券	30,200	520,044.00	0.31
50	000709	河钢股份	123,654	518,110.26	0.31
51	300418	昆仑万维	21,600	493,992.00	0.30
52	600739	辽宁成大	27,200	490,416.00	0.30
53	000778	新兴铸管	71,400	478,380.00	0.29
54	600060	海信电器	31,500	477,855.00	0.29
55	600887	伊利股份	21,500	464,185.00	0.28
56	603969	银龙股份	23,400	461,448.00	0.28
57	600271	航天信息	22,200	458,208.00	0.28
58	002092	中泰化学	35,900	455,930.00	0.28
59	300271	华宇软件	26,400	437,976.00	0.26
60	600757	长江传媒	58,600	437,742.00	0.26
61	601933	永辉超市	61,700	436,836.00	0.26
62	300115	长盈精密	14,903	434,869.54	0.26
63	600415	小商品城	59,500	430,780.00	0.26
64	600486	扬农化工	10,100	426,321.00	0.26
65	600845	宝信软件	24,700	416,195.00	0.25
66	600219	南山铝业	121,600	412,224.00	0.25
67	600160	巨化股份	34,000	409,020.00	0.25

68	000156	华数传媒	27,400	408,534.00	0.25
69	300144	宋城演艺	19,566	408,342.42	0.25
70	600816	安信信托	30,000	407,700.00	0.25
71	601231	环旭电子	25,900	406,889.00	0.25
72	000822	山东海化	49,900	405,188.00	0.25
73	002736	国信证券	30,500	404,125.00	0.24
74	600409	三友化工	40,100	403,807.00	0.24
75	002068	黑猫股份	47,517	399,617.97	0.24
76	002055	得润电子	17,500	397,775.00	0.24
77	603589	口子窖	10,200	395,658.00	0.24
78	300083	劲胜精密	42,625	393,855.00	0.24
79	002597	金禾实业	17,927	391,884.22	0.24
80	600383	金地集团	34,100	391,127.00	0.24
81	300136	信维通信	9,700	388,194.00	0.23
82	603939	益丰药房	11,500	387,550.00	0.23
83	000921	海信科龙	22,500	387,225.00	0.23
84	300182	捷成股份	40,500	387,180.00	0.23
85	300232	洲明科技	24,000	384,000.00	0.23
86	002179	中航光电	12,280	383,013.20	0.23
87	002354	天神娱乐	17,780	382,270.00	0.23
88	600998	九州通	17,700	381,612.00	0.23
89	601766	中国中车	37,600	380,512.00	0.23
90	300494	盛天网络	16,400	380,316.00	0.23
91	000028	国药一致	4,700	380,230.00	0.23
92	002139	拓邦股份	35,285	380,019.45	0.23
93	600037	歌华有线	26,100	380,016.00	0.23
94	000501	鄂武商 A	20,400	376,584.00	0.23
95	600628	新世界	32,500	375,375.00	0.23
96	603199	九华旅游	9,620	375,180.00	0.23
97	000888	峨眉山 A	29,200	370,840.00	0.22
98	600729	重庆百货	13,800	370,392.00	0.22
99	600426	华鲁恒升	31,480	369,575.20	0.22
100	600511	国药股份	10,100	366,024.00	0.22
101	002635	安洁科技	10,100	365,822.00	0.22
102	603368	柳州医药	6,360	364,110.00	0.22
103	002035	华帝股份	15,040	363,968.00	0.22
104	300251	光线传媒	44,437	363,939.03	0.22
105	000587	金洲慈航	24,400	363,560.00	0.22
106	002727	一心堂	19,700	362,480.00	0.22
107	002475	立讯精密	12,367	361,611.08	0.22
108	002705	新宝股份	24,050	361,471.50	0.22
109	002462	嘉事堂	9,200	361,468.00	0.22
110	002400	省广股份	45,000	361,350.00	0.22

111	002032	苏泊尔	8,800	361,240.00	0.22
112	000719	大地传媒	34,600	360,878.00	0.22
113	600056	中国医药	13,900	360,705.00	0.22
114	002241	歌尔股份	18,700	360,536.00	0.22
115	000417	合肥百货	43,600	359,700.00	0.22
116	000404	华意压缩	45,700	359,659.00	0.22
117	300253	卫宁健康	46,000	359,260.00	0.22
118	600713	南京医药	51,100	359,233.00	0.22
119	600833	第一医药	21,000	358,680.00	0.22
120	600694	大商股份	9,200	358,524.00	0.22
121	000978	桂林旅游	38,700	358,362.00	0.22
122	600690	青岛海尔	23,800	358,190.00	0.22
123	000949	新乡化纤	77,200	356,664.00	0.22
124	300207	欣旺达	30,200	356,058.00	0.22
125	600829	人民同泰	28,800	355,392.00	0.21
126	000705	浙江震元	34,500	355,350.00	0.21
127	300170	汉得信息	34,391	354,571.21	0.21
128	600682	南京新百	9,600	354,240.00	0.21
129	002415	海康威视	10,919	352,683.70	0.21
130	600272	开开实业	25,800	352,428.00	0.21
131	002242	九阳股份	17,900	352,093.00	0.21
132	600593	大连圣亚	13,200	351,648.00	0.21
133	002555	三七互娱	13,700	350,309.00	0.21
134	000902	新洋丰	38,900	350,100.00	0.21
135	002065	东华软件	16,043	349,576.97	0.21
136	002589	瑞康医药	22,450	345,730.00	0.21
137	000863	三湘印象	47,106	344,815.92	0.21
138	300279	和晶科技	24,714	344,018.88	0.21
139	000540	中天金融	49,395	343,295.25	0.21
140	300033	同花顺	5,500	342,155.00	0.21
141	002758	华通医药	24,300	341,172.00	0.21
142	300058	蓝色光标	43,600	340,952.00	0.21
143	600015	华夏银行	36,840	339,664.80	0.21
144	300133	华策影视	30,200	338,240.00	0.20
145	002788	鹭燕医药	10,100	336,330.00	0.20
146	300433	蓝思科技	11,500	334,535.00	0.20
147	000049	德赛电池	6,419	332,568.39	0.20
148	000418	小天鹅 A	7,100	332,209.00	0.20
149	601006	大秦铁路	39,500	331,405.00	0.20
150	002071	长城影视	33,200	330,672.00	0.20
151	000063	中兴通讯	13,800	327,612.00	0.20
152	000858	五粮液	5,411	301,176.26	0.18
153	600340	华夏幸福	8,900	298,862.00	0.18

154	000402	金融街	24,293	284,713.96	0.17
155	603778	乾景园林	23,400	281,736.00	0.17
156	601899	紫金矿业	80,400	275,772.00	0.17
157	000686	东北证券	27,100	272,355.00	0.16
158	601390	中国中铁	30,000	260,100.00	0.16
159	600703	三安光电	13,100	258,070.00	0.16
160	600276	恒瑞医药	4,800	242,832.00	0.15
161	000338	潍柴动力	17,915	236,478.00	0.14
162	600068	葛洲坝	20,600	231,544.00	0.14
163	000625	长安汽车	15,906	229,364.52	0.14
164	600518	康美药业	10,500	228,270.00	0.14
165	601186	中国铁建	18,800	226,164.00	0.14
166	600741	华域汽车	8,700	210,888.00	0.13
167	002450	康得新	9,281	209,008.12	0.13
168	000732	泰禾集团	12,300	205,164.00	0.12
169	600585	海螺水泥	9,000	204,570.00	0.12
170	600649	城投控股	19,200	201,792.00	0.12
171	600639	浦东金桥	11,100	201,132.00	0.12
172	600064	南京高科	13,300	200,830.00	0.12
173	603369	今世缘	15,200	200,640.00	0.12
174	600736	苏州高新	28,300	200,081.00	0.12
175	600053	九鼎投资	5,700	199,272.00	0.12
176	300201	海伦哲	22,700	197,263.00	0.12
177	002146	荣盛发展	19,654	193,984.98	0.12
178	000514	渝开发	25,000	188,250.00	0.11
179	002001	新和成	9,628	186,879.48	0.11
180	600376	首开股份	16,100	184,184.00	0.11
181	600266	北京城建	12,400	180,296.00	0.11
182	601800	中国交建	11,300	179,557.00	0.11
183	600089	特变电工	17,328	178,998.24	0.11
184	600322	天房发展	35,300	178,265.00	0.11
185	600246	万通地产	35,600	176,220.00	0.11
186	600325	华发股份	21,100	176,185.00	0.11
187	600611	大众交通	31,800	175,536.00	0.11
188	600637	东方明珠	8,000	173,360.00	0.10
189	600804	鹏博士	9,648	171,252.00	0.10
190	000897	津滨发展	36,000	169,200.00	0.10
191	000711	京蓝科技	11,200	168,672.00	0.10
192	000965	天保基建	19,120	165,579.20	0.10
193	601989	中国重工	26,400	163,944.00	0.10
194	600023	浙能电力	29,400	160,524.00	0.10
195	600674	川投能源	16,100	158,102.00	0.10
196	000623	吉林敖东	6,869	157,231.41	0.10

197	600270	外运发展	8,100	153,333.00	0.09
198	600062	华润双鹤	5,500	150,865.00	0.09
199	000157	中联重科	33,000	148,170.00	0.09
200	001979	招商蛇口	6,900	147,384.00	0.09
201	601872	招商轮船	28,400	146,544.00	0.09
202	601727	上海电气	19,200	145,344.00	0.09
203	600572	康恩贝	20,700	143,244.00	0.09
204	600867	通化东宝	7,840	143,001.60	0.09
205	002142	宁波银行	7,400	142,820.00	0.09
206	601088	中国神华	6,400	142,656.00	0.09
207	000581	威孚高科	5,500	142,450.00	0.09
208	002500	山西证券	14,800	141,784.00	0.09
209	601009	南京银行	12,400	139,004.00	0.08
210	000895	双汇发展	5,800	137,750.00	0.08
211	601985	中国核电	17,600	137,456.00	0.08
212	600153	建发股份	10,600	137,058.00	0.08
213	600893	航发动力	5,000	136,500.00	0.08
214	600029	南方航空	15,600	135,720.00	0.08
215	600919	江苏银行	14,500	134,705.00	0.08
216	601997	贵阳银行	8,500	134,385.00	0.08
217	601211	国泰君安	6,500	133,315.00	0.08
218	002586	围海股份	13,500	133,245.00	0.08
219	601939	建设银行	21,500	132,225.00	0.08
220	600879	航天电子	15,000	131,850.00	0.08
221	600352	浙江龙盛	13,800	131,514.00	0.08
222	600366	宁波韵升	7,400	130,536.00	0.08
223	601929	吉视传媒	37,100	128,366.00	0.08
224	300070	碧水源	6,733	125,570.45	0.08
225	600166	福田汽车	43,600	123,824.00	0.07
226	002624	完美世界	3,600	123,480.00	0.07
227	000768	中航飞机	6,600	121,704.00	0.07
228	000876	新希望	14,733	121,105.26	0.07
229	000716	黑芝麻	14,900	120,094.00	0.07
230	002437	誉衡药业	16,400	119,392.00	0.07
231	600177	雅戈尔	11,460	115,975.20	0.07
232	600547	山东黄金	4,000	115,720.00	0.07
233	000547	航天发展	11,000	114,950.00	0.07
234	002050	三花智控	7,000	114,240.00	0.07
235	300296	利亚德	6,000	112,800.00	0.07
236	002202	金风科技	7,200	111,384.00	0.07
237	300072	三聚环保	3,000	111,150.00	0.07
238	600180	瑞茂通	7,800	109,512.00	0.07
239	601618	中国中冶	21,700	108,717.00	0.07

240	002466	天齐锂业	2,000	108,700.00	0.07
241	600018	上港集团	17,100	108,414.00	0.07
242	000090	天健集团	9,700	107,670.00	0.07
243	601600	中国铝业	23,700	107,124.00	0.06
244	600170	上海建工	27,816	106,257.12	0.06
245	600216	浙江医药	10,700	106,037.00	0.06
246	600606	绿地控股	13,400	104,788.00	0.06
247	600009	上海机场	2,800	104,468.00	0.06
248	002317	众生药业	8,400	104,328.00	0.06
249	600406	国电南瑞	5,900	104,135.00	0.06
250	600795	国电电力	28,800	103,680.00	0.06
251	002595	豪迈科技	4,600	102,258.00	0.06
252	000869	张裕 A	2,700	100,440.00	0.06
253	601111	中国国航	10,200	99,450.00	0.06
254	600373	中文传媒	4,200	98,742.00	0.06
255	002376	新北洋	7,177	98,468.44	0.06
256	601888	中国国旅	3,200	96,448.00	0.06
257	002098	浔兴股份	6,835	96,305.15	0.06
258	000039	中集集团	5,180	93,395.40	0.06
259	600559	老白干酒	3,800	86,222.00	0.05
260	002076	雪莱特	11,600	82,012.00	0.05
261	002447	壹桥股份	8,701	78,309.00	0.05
262	600050	中国联通	11,300	77,405.00	0.05
263	002013	中航机电	6,450	66,628.50	0.04
264	600100	同方股份	3,300	46,596.00	0.03
265	002312	*ST 三泰	5,416	36,937.12	0.02
266	600643	爱建集团	2,100	34,251.00	0.02
267	600657	信达地产	4,800	27,648.00	0.02
268	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
269	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
270	600577	精达股份	2,000	9,600.00	0.01
271	002610	爱康科技	2,200	5,368.00	0.00
272	002256	兆新股份	174	763.86	0.00

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	000651	格力电器	3,315,142.00	1.07
2	600060	海信电器	2,579,807.00	0.83
3	600651	飞乐音响	2,473,733.40	0.80
4	600036	招商银行	2,302,901.18	0.74

5	002567	唐人神	2,255,738.85	0.73
6	600837	海通证券	2,127,384.00	0.69
7	600016	民生银行	2,116,383.75	0.68
8	601318	中国平安	1,811,664.32	0.58
9	600000	浦发银行	1,783,795.54	0.57
10	000048	康达尔	1,776,312.16	0.57
11	600506	香梨股份	1,734,909.03	0.56
12	601166	兴业银行	1,706,311.00	0.55
13	000895	双汇发展	1,695,575.78	0.55
14	002024	苏宁云商	1,650,317.00	0.53
15	002668	奥马电器	1,523,890.00	0.49
16	601328	交通银行	1,519,772.00	0.49
17	600073	上海梅林	1,479,898.00	0.48
18	002068	黑猫股份	1,400,588.23	0.45
19	600519	贵州茅台	1,373,534.61	0.44
20	600887	伊利股份	1,340,694.00	0.43

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	3,181,333.62	1.02
2	600598	北大荒	2,899,283.98	0.93
3	002696	百洋股份	2,731,571.00	0.88
4	002567	唐人神	2,688,531.43	0.87
5	000798	中水渔业	2,584,325.23	0.83
6	002447	壹桥股份	2,576,750.62	0.83
7	002311	海大集团	2,539,439.77	0.82
8	002100	天康生物	2,426,261.17	0.78
9	000876	新希望	2,422,651.64	0.78
10	600651	飞乐音响	2,371,769.00	0.76
11	000702	正虹科技	2,366,710.25	0.76
12	002548	金新农	2,365,671.80	0.76
13	300094	国联水产	2,356,964.35	0.76
14	600438	通威股份	2,332,516.92	0.75
15	002385	大北农	2,283,958.53	0.74
16	600060	海信电器	2,265,318.88	0.73
17	002086	东方海洋	2,201,688.26	0.71
18	002157	正邦科技	2,196,230.02	0.71
19	600467	好当家	2,195,300.00	0.71
20	002124	天邦股份	2,166,327.25	0.70

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	358,988,743.35
卖出股票的收入（成交）总额	389,385,546.52

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	9,961,000.00	6.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	113.81	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,961,113.81	6.03

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	170003	17 付息国债 03	100,000	9,961,000.00	6.03
2	128015	久其转债	1	113.81	0.00
3	-	-	-	-	-
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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 2017 年 5 月 23 日海通证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。2016 年 11 月 28 日海通证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

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	72,346.68
2	应收证券清算款	6,411,702.27
3	应收股利	-
4	应收利息	127,458.99
5	应收申购款	20,763.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,632,271.07

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

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
19,575	8,202.70	-	-	160,567,849.97	100.00%

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	117,522.62	0.07%

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年11月2日）基金份额总额	466,250,712.37
本报告期期初基金份额总额	312,559,452.88
本报告期基金总申购份额	10,639,671.19
减：本报告期基金总赎回份额	162,631,274.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,567,849.97

§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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	388,818,826.22	52.07%	284,343.22	52.47%	-
中国银河证券	2	158,917,627.53	21.28%	147,998.28	27.31%	-
新时代证券	1	135,604,111.84	18.16%	99,170.16	18.30%	-
国金证券	3	59,786,485.46	8.01%	7,850.68	1.45%	-
中泰证券	2	3,553,849.41	0.48%	2,599.04	0.48%	-

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，本基金还选择国泰君安证券、中银国际证券、中信建投证券、东北证券、上海证券、中金公司、中投证券、长江证券、天风证券、兴业证券和信达证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④ 在上述租用的券商交易单元中，中金公司、中信证券、和天风证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，本期没有剔除的券商交易单元。

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	-	-	348,000,000.00	55.41%
中国银河证券	84,216.10	100.00%	280,000,000.00	44.59%
新时代证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-

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在直销机构及华夏财富调整旗下部分开放式基金申购、赎回等业务数量限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-16
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海联泰资产管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	2017-02-16
3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京君德汇富投资咨询有限公司为	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-07

	代销机构的公告		
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中银国际证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-07
5	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
6	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富投资管理有限公司网上交易平台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	2017-06-16
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江金观诚财富管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	2017-06-29

§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 《华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏网购精选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