

# 华夏优势增长混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

### 2018 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 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）.....	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.....	13
§7 投资组合报告.....	27
7.1 期末基金资产组合情况.....	27
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	27
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.....	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	34
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.....	34
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.....	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34
7.12 投资组合报告附注.....	34
§8 基金份额持有人信息.....	35
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	36
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§12 备查文件目录.....	39

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏优势增长混合型证券投资基金
基金简称	华夏优势增长混合
基金主代码	000021
交易代码	000021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 24 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,435,069,287.43 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，以 GARP 模型为基础，结合严谨、深入的基本面分析和全面、细致的估值分析和市场面分析，精选出具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估、价格处于合理区间的股票进行投资。同时，考虑到我国股票市场的波动性，基金将主动进行资产配置，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，调整基金在股票、债券等资产类别上的投资比例，以降低投资风险，提高累积收益。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国 A600 指数，债券投资的业绩比较基准为中债综合指数（财富）。基准收益率=富时中国 A600 指数收益率×80%+中债综合指数（财富）收益率×20%。
风险收益特征	本基金风险高于货币市场基金、债券基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033

法定代表人	杨明辉	田国立
-------	-----	-----

## 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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	13,826,701.70
本期利润	-679,361,386.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1940
本期加权平均净值利润率	-11.33%
本期基金份额净值增长率	-10.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	2,042,848,681.04
期末可供分配基金份额利润	0.5947
期末基金资产净值	5,477,917,968.47
期末基金份额净值	1.595
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	228.13%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	-4.20%	1.84%	-6.38%	1.08%	2.18%	0.76%
过去三个月	-7.75%	1.41%	-8.26%	0.92%	0.51%	0.49%
过去六个月	-10.94%	1.39%	-10.68%	0.94%	-0.26%	0.45%
过去一年	-7.48%	1.18%	-4.63%	0.77%	-2.85%	0.41%
过去三年	-24.37%	1.75%	-21.86%	1.21%	-2.51%	0.54%
自基金合同生效起至今	228.13%	1.65%	105.06%	1.44%	123.07%	0.21%

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

华夏优势增长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

(2006 年 11 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、

境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人，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 2018 年 6 月 30 日数据），华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 3/154；华夏医疗健康混合（A 类）在“混合基金-偏股型基金-普通偏股型基金（A 类）”中排序 2/152；华夏医药 ETF、华夏消费 ETF、华夏沪港通恒生 ETF 在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 基金”中分别排序 2/115、8/115、9/115。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“中国基金业 20 周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（一年期）、华夏上证 50ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018 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）华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动的情况；华夏基金网上交易平台上线手机号码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；（3）与中原银行、长城华西银行、西安银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年司庆感恩二十年”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑晓辉	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2013-05-10	-	15年	北京大学金融学博士。曾任长盛基金研究员、基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理（2006年11月29日至2008年4月26日期间）等。2008年5月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资经理、机构投资部总经理助理、机构投资部副总经理、股票投资部副总经理，华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2015年6月16日至2016年9月14日期间）等。
孙轶佳	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2015-11-19	-	10年	上海交通大学金融学硕士。曾任中国国际金融有限公司研究部高级经理等。2011年8月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理等。
刘平	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-11-30	-	11年	金融学硕士。2007年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、投资经理、机构投资部总监等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，美国经济呈现强劲复苏态势。3 月份、6 月份美联储各加息 25 个 BP，并上调了 2018 年加息次数至 4 次。特朗普启动对中国的“301 调查”，公开表示希望大幅缩减对中国的贸易逆差。经过 3 轮的谈判，中美贸易战似乎有所缓和，但是在最后时刻，美国总统特朗普又重新启动了对 500 亿美元中国出口商品加征 25% 关税，并在中国政府做出对等反击之后，又宣布了对另外 2000 亿美元中国出口商品加征 10% 关税的计划，中美贸易战态势日趋严峻。与此同时，欧洲、日本等国家纷纷提出反击，世界经济走势日益不明朗，美元指数大幅升值，避险情绪浓厚，人民币快速贬值。国内方面，虽然新增贷款大幅增长，但是资管新规作用下新增社融增速不断创新低，消费、工业增加值以及基建投资增速都持续下滑。央行分别于 4 月 17 日和 6 月 24 日定向降准 1 个百分点和 0.5 个百分点，货币政策边际上有所转向，地产销售和新开工增速超预期。金融去杠杆叠加贸易战的担忧使得大批高质押比例个股出现闪崩，恐慌情绪蔓延。

A 股市场上半年冲高回落，年初地产、银行等行业带领大盘快速拉升，随后在美国 10 年期国债突破新高之后跟随美股快速下跌。随着监管部门鼓励“独角兽”回归 A 股等引领创新政策的不断渲染下，计算机、医药生物等行业带领创业板震荡走高。2 季度在贸易战恶化以及“资管新规”影响下，市场整体不断下跌，因贸易战恶化导致新增订单、关键零部件采购或是关键设备采购可能受到负面影响的电子、通信以及计算机等科技股板块大幅下跌，而跟内需相关度较大、现金流状况较好的食品饮料、医药等板块表现出了较好的防御性。

报告期内，本基金适度降低了仓位，并进一步优化了组合结构，主要增持了部分业绩增长较快、估值相对较低的云计算、新能源车等板块股票，减持了部分增长不确定性加大的电子、通信等股票，并对周期股进行了波段操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.595 元，本报告期份额净值增长率为-10.94%，同期业绩比较基准增长率为-10.68%。

#### 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，在美国频频向世界各国发起贸易战的背景下，世界经济金融形势不确定性日趋严峻。国内经济已开始显露出下滑态势，在“一行两会”“资管新规”执行细则以及国务院常务会议关于

“积极财政政策更加积极”的表态之后，市场信心有所恢复。但是整体来看，这一轮货币政策和财政政策的变化应该更大程度上是为了应对未来经济可能继续恶化所做出的预调、微调，并不是方向性的根本变化，经济下滑的态势难以根本性扭转。但是考虑到上半年市场整体跌幅较大，相当部分的股票估值在历史上来看已经足够便宜，所以预计下半年市场整体上将维持震荡态势。那些具有国际竞争力、国际范围内估值相对合理、增长较为确定的行业和个股将有持续表现。长期来看，受益于经济转型、治理结构良好、具有持续创新能力的企业有望逐步胜出。

本基金将秉承“以业绩增长”为核心的成长型投资理念，重点研究并跟踪业绩增长较为确定、行业成长空间较大、估值相对较为合理的个股。同时注重自上而下的大类资产配置，密切关注宏观刺激政策、行业景气演变催生的投资机会，在控制整体风险的基础上，不断优化投资组合。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，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，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

# §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：华夏优势增长混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	164,748,116.93	182,330,035.10
结算备付金		13,325,149.33	18,886,548.42
存出保证金		1,800,613.93	1,201,851.13
交易性金融资产	6.4.7.2	5,094,806,161.29	6,334,385,898.92
其中：股票投资		4,854,491,161.29	5,988,205,898.92
基金投资		-	-
债券投资		240,315,000.00	346,180,000.00
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	250,000,245.00	109,948,224.92
应收证券清算款		8,346,172.90	42,340,519.36
应收利息	6.4.7.5	6,672,891.65	3,957,468.54
应收股利		-	-
应收申购款		2,378,889.54	2,139,429.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		5,542,078,240.57	6,695,189,975.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债:</b>		-	-
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		-	100,000,000.00
应付证券清算款		8,663,118.25	31,833,449.86
应付赎回款		4,146,065.48	7,529,011.05
应付管理人报酬		6,860,363.47	8,333,369.96
应付托管费		1,143,393.91	1,388,895.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	43,237,980.50	38,905,736.77
应交税费		-	-
应付利息		-	123,287.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,350.49	138,375.18
负债合计		64,160,272.10	188,252,125.60
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	3,435,069,287.43	3,632,747,463.02
未分配利润	6.4.7.10	2,042,848,681.04	2,874,190,387.00
所有者权益合计		5,477,917,968.47	6,506,937,850.02
负债和所有者权益总计		5,542,078,240.57	6,695,189,975.62

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.595 元，基金份额总额 3,435,069,287.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏优势增长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年6月30日
<b>一、收入</b>		-601,953,714.62	659,819,707.49
1.利息收入		8,685,578.22	2,320,497.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,650,086.80	1,987,871.79
债券利息收入		6,213,665.28	89,406.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		821,826.14	243,219.47
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		81,783,293.14	17,829,175.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	50,743,118.84	-22,846,137.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	149,238.36	-72,008.63
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	30,890,935.94	40,747,322.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-693,188,088.25	638,942,820.95
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	765,502.27	727,212.88
<b>减：二、费用</b>		77,407,671.93	76,874,558.74
1.管理人报酬		44,529,866.29	48,625,711.96
2.托管费		7,421,644.37	8,104,285.34
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	24,953,475.65	20,006,842.77
5.利息支出		368,630.36	-
其中：卖出回购金融资产支出		368,630.36	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	6.4.7.21	134,055.26	137,718.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-679,361,386.55	582,945,148.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-679,361,386.55	582,945,148.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏优势增长混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,632,747,463.02	2,874,190,387.00	6,506,937,850.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-679,361,386.55	-679,361,386.55
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）	-197,678,175.59	-151,980,319.41	-349,658,495.00
其中：1.基金申购款	148,329,637.35	104,380,909.32	252,710,546.67

2.基金赎回款	-346,007,812.94	-256,361,228.73	-602,369,041.67
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）	3,435,069,287.43	2,042,848,681.04	5,477,917,968.47
项目	上年度可比期间 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）	4,094,214,512.35	2,369,259,837.23	6,463,474,349.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	582,945,148.75	582,945,148.75
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）	-186,993,021.39	-122,972,425.13	-309,965,446.52
其中：1.基金申购款	167,066,180.93	104,706,532.00	271,772,712.93
2.基金赎回款	-354,059,202.32	-227,678,957.13	-581,738,159.45
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）	3,907,221,490.96	2,829,232,560.85	6,736,454,051.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：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

华夏优势增长股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]233号《关于同意华夏优势增长股票型证券投资基金募集的批复》核准，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》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏优势增长股票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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 14,101,845,040.96 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（06）第 020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏优势增长股票型证券投资基金基金合同》于 2006

年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,102,025,101.39 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据基金管理人 2015 年 7 月 3 日刊登的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》，华夏优势增长股票型证券投资基金自 2015 年 7 月 15 日起更名为华夏优势增长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券、资产支持证券及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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。
- 5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。
- 7、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。
- 8、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 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。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。
- 9、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。
- 10、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。
- 11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明



6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	活期存款	164,748,116.93
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	164,748,116.93	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,929,577,959.38	4,854,491,161.29	-75,086,798.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	239,914,224.93	240,315,000.00	400,775.07
	合计	239,914,224.93	240,315,000.00	400,775.07
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,169,492,184.31	5,094,806,161.29	-74,686,023.02	

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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	250,000,245.00	-
合计	250,000,245.00	-

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	69,322.36
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	5,996.30
应收债券利息	6,564,049.31
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	32,713.38
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	810.30
合计	6,672,891.65

#### 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	43,231,436.51
银行间市场应付交易费用	6,543.99
合计	43,237,980.50

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,130.94
预提费用	94,219.55
合计	109,350.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,632,747,463.02	3,632,747,463.02
本期申购	148,329,637.35	148,329,637.35
本期赎回（以“-”号填列）	-346,007,812.94	-346,007,812.94
本期末	3,435,069,287.43	3,435,069,287.43

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	2,944,646,275.27	-70,455,888.27	2,874,190,387.00
本期利润	13,826,701.70	-693,188,088.25	-679,361,386.55
本期基金份额交易产生的变动数	-160,235,272.04	8,254,952.63	-151,980,319.41
其中：基金申购款	120,493,456.39	-16,112,547.07	104,380,909.32
基金赎回款	-280,728,728.43	24,367,499.70	-256,361,228.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,798,237,704.93	-755,389,023.89	2,042,848,681.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	1,460,263.15
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	177,688.51
其他	12,135.14
合计	1,650,086.80

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	9,084,441,952.88
减：卖出股票成本总额	9,033,698,834.04
买卖股票差价收入	50,743,118.84

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	201,573,094.52

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	197,198,561.64
减：应收利息总额	4,225,294.52
买卖债券差价收入	149,238.36

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	30,890,935.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,890,935.94

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-693,188,088.25
——股票投资	-694,269,359.89
——债券投资	1,081,271.64

——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-693,188,088.25

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	765,502.27
合计	765,502.27

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	24,952,675.65
银行间市场交易费用	800.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	24,953,475.65

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	39,671.58
银行费用	21,235.71
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	134,055.26

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	5,566,625,883.99	31.49%	4,753,115,106.49	31.92%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	4,688,049.01	32.78%	2,686,524.23	6.21%
关联方名称	上年度可比期间			

	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	3,925,668.00	35.13%	2,969,060.68	6.76%

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 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	44,529,866.29	48,625,711.96
其中：支付销售机构的客户维护费	7,433,323.96	8,064,981.05

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 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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 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	7,421,644.37	8,104,285.34

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	164,748,116.93	1,460,263.15	150,123,657.71	1,754,001.44

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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（2018 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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
------	------	------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----



300740	御家汇	2018-06-15	重大事项	28.76	-	-	270,060	8,691,332.06	7,766,925.60	-
002665	首航节能	2018-05-28	重大事项	5.80	-	-	1,181,450	8,369,692.11	6,852,410.00	-

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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。截至本期末，本基金持有极少量利率敏感性固定收益类资产，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、债券和基金等各类资产损失的可能性。

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证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	4,854,491,161.29	88.62	5,988,205,898.92	92.03
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	4,854,491,161.29	88.62	5,988,205,898.92	92.03

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。		
	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	+5%	289,393,694.29	428,336,367.95
	-5%	-289,393,694.29	-428,336,367.95

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 2018 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 4,846,724,235.69 元，第二层次的余额为 248,081,925.60 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2017 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 5,675,034,584.09 元，第二层次的余额为 659,351,314.83 元，第三层次的余额为 0 元。）

#### 6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

#### 6.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,854,491,161.29	87.59
	其中：股票	4,854,491,161.29	87.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	240,315,000.00	4.34
	其中：债券	240,315,000.00	4.34
	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	250,000,245.00	4.51
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	178,073,266.26	3.21
8	其他各项资产	19,198,568.02	0.35
9	合计	5,542,078,240.57	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	22,256,676.00	0.41
B	采矿业	119,906,288.15	2.19
C	制造业	2,836,593,360.93	51.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,456.00	0.00
E	建筑业	2,477,520.00	0.05
F	批发和零售业	255,404,584.58	4.66
G	交通运输、仓储和邮政业	81,512,597.00	1.49
H	住宿和餐饮业	3,599,904.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,041,079,506.27	19.01
J	金融业	324,512,392.00	5.92
K	房地产业	88,715,720.00	1.62
L	租赁和商务服务业	48,158,853.83	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,795,000.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,964,552.53	0.31
R	文化、体育和娱乐业	9,465,750.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	4,854,491,161.29	88.62

## 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	600519	贵州茅台	200,337	146,538,502.02	2.68
2	603039	泛微网络	1,657,214	145,635,966.32	2.66
3	002410	广联达	5,087,160	141,066,946.80	2.58
4	300166	东方国信	9,534,880	140,448,782.40	2.56
5	600703	三安光电	7,291,682	140,146,128.04	2.56
6	000963	华东医药	2,801,711	135,182,555.75	2.47
7	000977	浪潮信息	5,532,070	131,939,869.50	2.41
8	603799	华友钴业	1,260,659	122,876,432.73	2.24
9	600690	青岛海尔	5,973,500	115,049,610.00	2.10
10	300188	美亚柏科	5,932,020	108,555,966.00	1.98
11	002415	海康威视	2,878,704	106,886,279.52	1.95
12	300145	中金环境	12,074,200	94,540,986.00	1.73
13	002373	千方科技	7,170,054	93,569,204.70	1.71
14	300003	乐普医疗	2,534,997	92,983,689.96	1.70
15	300308	中际旭创	1,490,500	89,489,620.00	1.63
16	002376	新北洋	5,178,587	85,653,828.98	1.56

17	603659	璞泰来	1,322,000	84,462,580.00	1.54
18	002456	欧菲科技	4,988,530	80,464,988.90	1.47
19	300078	思创医惠	8,101,497	76,802,191.56	1.40
20	601601	中国太保	2,402,800	76,529,180.00	1.40
21	600036	招商银行	2,331,500	61,644,860.00	1.13
22	600276	恒瑞医药	780,111	59,101,209.36	1.08
23	603986	兆易创新	531,900	57,721,788.00	1.05
24	601336	新华保险	1,301,000	55,786,880.00	1.02
25	300136	信维通信	1,799,060	55,285,113.80	1.01
26	300036	超图软件	2,623,700	53,497,243.00	0.98
27	300124	汇川技术	1,580,647	51,876,834.54	0.95
28	600809	山西汾酒	800,008	50,312,503.12	0.92
29	002180	纳思达	1,799,722	49,420,366.12	0.90
30	600048	保利地产	4,000,000	48,800,000.00	0.89
31	300170	汉得信息	2,953,800	47,969,712.00	0.88
32	601233	桐昆股份	2,635,420	45,381,932.40	0.83
33	600563	法拉电子	911,700	45,120,033.00	0.82
34	002475	立讯精密	1,979,548	44,619,011.92	0.81
35	600845	宝信软件	1,688,419	44,489,840.65	0.81
36	600115	东方航空	6,632,400	43,906,488.00	0.80
37	600600	青岛啤酒	1,000,000	43,830,000.00	0.80
38	600426	华鲁恒升	2,478,673	43,599,858.07	0.80
39	601398	工商银行	8,000,000	42,560,000.00	0.78
40	600885	宏发股份	1,365,084	40,843,313.28	0.75
41	300047	天源迪科	2,616,419	40,816,136.40	0.75
42	600138	中青旅	2,000,000	39,860,000.00	0.73
43	002024	苏宁易购	2,810,379	39,570,136.32	0.72
44	300037	新宙邦	1,469,200	39,359,868.00	0.72
45	300413	快乐购	1,021,800	38,767,092.00	0.71
46	601699	潞安环能	4,000,061	37,040,564.86	0.68
47	600867	通化东宝	1,524,904	36,551,948.88	0.67
48	300073	当升科技	1,066,400	36,321,584.00	0.66
49	601899	紫金矿业	10,000,000	36,100,000.00	0.66
50	601318	中国平安	599,100	35,095,278.00	0.64
51	601288	农业银行	10,000,000	34,400,000.00	0.63
52	600029	南方航空	4,036,700	34,110,115.00	0.62
53	300424	航新科技	1,734,086	33,675,950.12	0.61
54	002230	科大讯飞	1,014,450	32,533,411.50	0.59
55	002832	比音勒芬	876,425	32,427,725.00	0.59
56	002466	天齐锂业	648,100	32,139,279.00	0.59
57	600570	恒生电子	600,000	31,770,000.00	0.58
58	002384	东山精密	1,287,740	30,905,760.00	0.56
59	002507	涪陵榨菜	1,072,500	27,541,800.00	0.50

60	600779	水井坊	495,042	27,341,169.66	0.50
61	600585	海螺水泥	800,023	26,784,770.04	0.49
62	002405	四维图新	1,265,200	25,620,300.00	0.47
63	002008	大族激光	472,244	25,118,658.36	0.46
64	300097	智云股份	1,377,562	24,410,398.64	0.45
65	600884	杉杉股份	1,103,800	24,393,980.00	0.45
66	300373	扬杰科技	848,500	24,267,100.00	0.44
67	002153	石基信息	818,012	23,722,348.00	0.43
68	300523	辰安科技	376,897	23,473,145.16	0.43
69	002714	牧原股份	500,600	22,256,676.00	0.41
70	300433	蓝思科技	1,060,800	22,255,584.00	0.41
71	603019	中科曙光	465,100	21,334,137.00	0.39
72	600019	宝钢股份	2,709,736	21,108,843.44	0.39
73	600498	烽火通信	846,300	21,030,555.00	0.38
74	000002	万科 A	848,200	20,865,720.00	0.38
75	603345	安井食品	558,800	19,558,000.00	0.36
76	000968	蓝焰控股	1,881,911	19,553,055.29	0.36
77	001979	招商蛇口	1,000,000	19,050,000.00	0.35
78	601688	华泰证券	1,235,200	18,490,944.00	0.34
79	600760	中航沈飞	500,000	18,020,000.00	0.33
80	601607	上海医药	739,600	17,676,440.00	0.32
81	600201	生物股份	1,009,190	17,247,057.10	0.31
82	603369	今世缘	702,000	16,026,660.00	0.29
83	603589	口子窖	256,800	15,780,360.00	0.29
84	300383	光环新网	1,151,300	15,438,933.00	0.28
85	300010	立思辰	1,226,500	15,012,360.00	0.27
86	300577	开润股份	355,644	14,659,645.68	0.27
87	600547	山东黄金	593,800	14,203,696.00	0.26
88	600872	中炬高新	500,000	14,000,000.00	0.26
89	002747	埃斯顿	977,600	13,666,848.00	0.25
90	002912	中新赛克	144,882	13,618,908.00	0.25
91	300377	赢时胜	1,000,000	13,590,000.00	0.25
92	002727	一心堂	418,700	13,586,815.00	0.25
93	600584	长电科技	800,031	13,552,525.14	0.25
94	600782	新钢股份	2,391,900	13,346,802.00	0.24
95	000063	中兴通讯	1,000,000	13,030,000.00	0.24
96	601225	陕西煤业	1,582,600	13,008,972.00	0.24
97	002179	中航光电	300,000	11,700,000.00	0.21
98	600195	中牧股份	586,000	11,397,700.00	0.21
99	002157	正邦科技	2,724,800	11,089,936.00	0.20
100	000333	美的集团	209,775	10,954,450.50	0.20
101	002202	金风科技	848,976	10,731,056.64	0.20
102	002867	周大生	337,299	10,621,545.51	0.19

103	002268	卫士通	485,100	10,589,733.00	0.19
104	002050	三花智控	520,200	9,805,770.00	0.18
105	300750	宁德时代	135,561	9,754,969.56	0.18
106	603466	风语筑	360,600	9,465,750.00	0.17
107	002444	巨星科技	848,400	9,340,884.00	0.17
108	300009	安科生物	500,700	9,232,908.00	0.17
109	000661	长春高新	40,400	9,199,080.00	0.17
110	300568	星源材质	240,155	9,176,322.55	0.17
111	000768	中航飞机	583,400	9,124,376.00	0.17
112	002594	比亚迪	183,467	8,747,706.56	0.16
113	600518	康美药业	379,200	8,676,096.00	0.16
114	300015	爱尔眼科	268,221	8,660,856.09	0.16
115	300347	泰格医药	134,212	8,303,696.44	0.15
116	002127	南极电商	883,797	8,298,853.83	0.15
117	300740	御家汇	270,060	7,766,925.60	0.14
118	300174	元力股份	341,500	7,232,970.00	0.13
119	000960	锡业股份	598,400	7,186,784.00	0.13
120	002665	首航节能	1,181,450	6,852,410.00	0.13
121	300365	恒华科技	224,800	4,637,624.00	0.08
122	002332	仙琚制药	514,200	4,499,250.00	0.08
123	300454	深信服	40,704	4,475,811.84	0.08
124	300687	赛意信息	149,040	4,255,092.00	0.08
125	000538	云南白药	36,900	3,946,824.00	0.07
126	000596	古井贡酒	44,400	3,941,832.00	0.07
127	603568	伟明环保	150,000	3,795,000.00	0.07
128	600754	锦江股份	97,400	3,599,904.00	0.07
129	603678	火炬电子	140,720	3,506,742.40	0.06
130	601021	春秋航空	99,800	3,495,994.00	0.06
131	000889	茂业通信	257,300	3,283,148.00	0.06
132	300199	翰宇药业	221,800	3,167,304.00	0.06
133	300467	迅游科技	93,735	3,008,893.50	0.05
134	002701	奥瑞金	547,000	2,986,620.00	0.05
135	601996	丰林集团	771,300	2,846,097.00	0.05
136	002529	海源机械	248,600	2,737,086.00	0.05
137	002387	维信诺	250,300	2,690,725.00	0.05
138	603203	快克股份	115,830	2,588,800.50	0.05
139	600416	湘电股份	358,400	2,576,896.00	0.05
140	603929	亚翔集成	124,000	2,477,520.00	0.05
141	000915	山大华特	106,400	2,139,704.00	0.04
142	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
143	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
144	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
145	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00



146	601838	成都银行	600	5,250.00	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	603799	华友钴业	181,692,877.67	2.79
2	600048	保利地产	154,273,720.27	2.37
3	300166	东方国信	149,410,392.76	2.30
4	001979	招商蛇口	145,683,947.17	2.24
5	600519	贵州茅台	142,483,568.07	2.19
6	002410	广联达	137,005,724.98	2.11
7	601288	农业银行	135,730,460.00	2.09
8	601398	工商银行	133,725,298.10	2.06
9	000977	浪潮信息	126,202,702.43	1.94
10	601601	中国太保	118,280,147.10	1.82
11	601336	新华保险	116,300,193.76	1.79
12	300003	乐普医疗	101,141,419.82	1.55
13	002373	千方科技	100,348,845.59	1.54
14	603039	泛微网络	98,776,648.88	1.52
15	000651	格力电器	97,434,122.25	1.50
16	300188	美亚柏科	96,522,119.36	1.48
17	300078	思创医惠	94,699,937.45	1.46
18	600340	华夏幸福	92,866,296.24	1.43
19	002376	新北洋	89,304,994.93	1.37
20	002456	欧菲科技	88,605,783.16	1.36

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	600703	三安光电	206,634,493.16	3.18
2	002456	欧菲科技	203,028,664.61	3.12
3	000858	五粮液	170,077,628.29	2.61
4	000001	平安银行	167,931,376.96	2.58
5	601318	中国平安	153,655,398.98	2.36
6	603799	华友钴业	153,086,509.67	2.35
7	000002	万科 A	141,866,932.96	2.18
8	601336	新华保险	138,768,842.93	2.13
9	600048	保利地产	116,921,622.87	1.80

10	600585	海螺水泥	116,368,001.65	1.79
11	600887	伊利股份	110,308,764.97	1.70
12	300156	神雾环保	109,045,050.00	1.68
13	001979	招商蛇口	108,497,901.13	1.67
14	002304	洋河股份	107,089,259.02	1.65
15	601398	工商银行	103,482,552.97	1.59
16	000063	中兴通讯	100,211,698.63	1.54
17	000651	格力电器	96,760,575.97	1.49
18	600741	华域汽车	91,749,976.80	1.41
19	002153	石基信息	91,344,415.25	1.40
20	600196	复星医药	89,472,349.63	1.38

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	8,594,253,456.30
卖出股票的收入（成交）总额	9,084,441,952.88

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,315,000.00	4.39
	其中：政策性金融债	240,315,000.00	4.39
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	240,315,000.00	4.39

#### 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

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	170410	17 农发 10	1,500,000	150,045,000.00	2.74

2	180201	18 国开 01	900,000	90,270,000.00	1.65
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 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	1,800,613.93
2	应收证券清算款	8,346,172.90
3	应收股利	-

4	应收利息	6,672,891.65
5	应收申购款	2,378,889.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,198,568.02

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
239,558	14,339.20	9,372,612.73	0.27%	3,425,696,674.70	99.73%

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	36,212.07	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 11 月 24 日）基金份额总额	14,102,025,101.39
本报告期期初基金份额总额	3,632,747,463.02
本报告期基金总申购份额	148,329,637.35
减：本报告期基金总赎回份额	346,007,812.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,435,069,287.43

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 4 月 28 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 5 月 19 日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	5,566,625,883.99	31.49%	4,688,049.01	32.78%	-

申万宏源证券	2	2,550,391,294.13	14.43%	2,375,170.29	16.61%	-
方正证券	1	2,046,504,907.88	11.58%	882,658.52	6.17%	-
广发证券	1	1,423,640,784.70	8.05%	1,325,836.03	9.27%	-
兴业证券	1	1,151,067,141.14	6.51%	841,777.09	5.89%	-
安信证券	1	943,149,721.18	5.34%	878,351.69	6.14%	-
天风证券	2	844,567,754.22	4.78%	617,635.11	4.32%	-
国联证券	2	773,316,957.79	4.37%	720,189.70	5.04%	-
华鑫证券	1	738,087,589.96	4.18%	687,380.27	4.81%	-
华福证券	1	632,229,290.41	3.58%	462,348.35	3.23%	-
爱建证券	1	499,424,467.69	2.83%	365,229.41	2.55%	-
太平洋证券	1	331,501,362.26	1.88%	308,727.33	2.16%	-
西南证券	2	89,777,996.84	0.51%	83,609.97	0.58%	-
上海证券	1	86,373,648.89	0.49%	63,164.89	0.44%	-

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，本基金还选择了国信证券、中信建投证券、广州证券、财富里昂证券、高华证券、西部证券、信达证券、华融证券、国泰君安证券、中投证券、中国银河证券、中金公司、华宝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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 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	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	200,000,000.00	100.00%
方正证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-

#### 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杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-31
2	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-01
3	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增天津万家财富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	2018-03-13
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原银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-19
5	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23

	修订旗下开放式基金基金合同的公告		
6	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中民财富基金销售（上海）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-23
8	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-28
9	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-09
10	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-19
11	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增西安银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-05
12	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在国金证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-07
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增凤凰金信（银川）基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-29

## §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 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《华夏优势增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏优势增长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

二〇一八年八月二十五日