

华夏成长证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§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.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	29
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.....	34
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.....	34
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.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息.....	36
§9 开放式基金份额变动.....	36
§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	华夏成长证券投资基金	
基金简称	华夏成长混合	
基金主代码	000001	
交易代码	000001(前端)	000002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 12 月 18 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	4,294,754,790.07 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属成长型基金，主要通过投资于具有良好成长性的上市公司的股票，在保持基金资产安全性和流动性的前提下，实现基金的长期资本增值。
投资策略	“追求成长性”和“研究创造价值”。
业绩比较基准	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中高风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和货币市场基金。

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	tianqing1.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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	367,253,746.45
本期利润	804,858,285.24
加权平均基金份额本期利润	0.1838
本期加权平均净值利润率	17.35%
本期基金份额净值增长率	19.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	419,606,225.91
期末可供分配基金份额利润	0.0977
期末基金资产净值	4,714,361,015.98
期末基金份额净值	1.098
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	527.28%

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	2.71%	0.88%	-	-	-	-
过去三个月	-3.17%	1.33%	-	-	-	-
过去六个月	19.61%	1.35%	-	-	-	-
过去一年	5.07%	1.30%	-	-	-	-
过去三年	8.71%	1.00%	-	-	-	-
自基金合同生	527.28%	1.25%	-	-	-	-

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

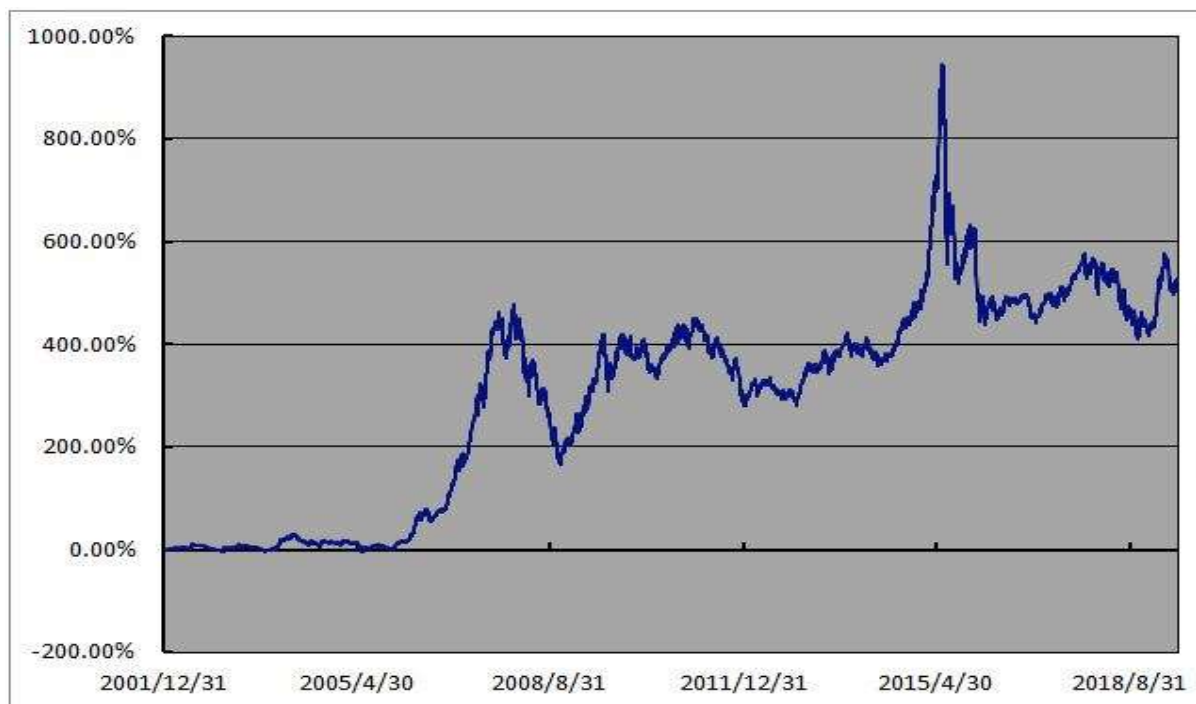
注：本基金未规定业绩比较基准。

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

华夏成长证券投资基金

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

(2001 年 12 月 18 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金未规定业绩比较基准。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中

日互通 ETF 基金管理人, 以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人, 香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一, 在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验, 目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏野村日经 225ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏快线货币 ETF 及华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF, 初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、A 股市场指数、海外市场指数及信用债指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础, 尽力捕捉市场机会, 为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告, 在基金分类排名中(截至 2019 年 6 月 30 日数据), 华夏移动互联混合(QDII)在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金(A 类)”中排序 9/34; 华夏稳增混合在“混合基金-股债平衡型基金-股债平衡型基金(A 类)”中排序 8/27; 华夏回报混合(H 类)在“混合基金-绝对收益目标基金-绝对收益目标基金(非 A 类)”中排序 8/89; 华夏鼎沛债券(A 类)在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 1/228; 华夏理财 30 天债券(A 类)在“债券基金-短期理财债券型基金-短期理财债券型基金(摊余成本法)(A 类)”中排序 10/40; 华夏恒融定开债券在“债券基金-定期开放式普通债券型基金-定期开放式普通债券型基金(二级)(A 类)”中排序 7/19; 华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(A 类)在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(A 类)”中排序 8/29; 华夏上证 50AH 优选指数(LOF)(C 类)在“标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金(非 A 类)”中排序 4/11; 华夏上证 50ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 6/61; 华夏消费 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-行业指数股票 ETF 基金”中排序 3/31; 华夏沪深 300ETF 联接(C 类)在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金(非 A 类)”中排序 9/34。

上半年, 公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在由《证券时报》举办的第十四届中国基金业明星基金奖颁奖典礼上, 华夏安康债券、华夏收益债券(QDII)和华夏鼎茂债券分别荣获五年持续回报积极债券型明星基金、三年持续回报 QDII 明星基金和 2018 年度普通债券型明星基金。在中国证券报举办的第十六届中国基金业金牛奖评选活动中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖, 华夏鼎茂债券(004042)荣获“2018 年度开放式债券型金牛基金”奖, 华夏中小板 ETF(159902)荣获“2018 年度开放式指数型金牛基金”奖。

在客户服务方面，2019 年上半年度，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金客服电话系统上线智能语音功能，客户直接说出需求即可查询账户交易记录和基金信息，同时系统还可以进行身份信息认证，主动告知业务办理进度，为客户提供全面、准确、便捷的服务，提升客户体验；（2）直销电子交易平台开通华夏惠利货币 A 的快速赎回业务，为广大投资者的资金使用提供便利；（3）与微众银行、华融湘江银行、紫金农商银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“你的今年收益知否？知否？”、“你的户口本更新了”、“户龄”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2015-01-07	-	11 年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009 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、投资经理，华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2013 年 3 月 11 日至 2017 年 2 月 24 日期间）、华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2018 年 12 月 13 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》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内宏观方面，整体货币环境较为宽松，小周期内经历了宽-紧-宽的波动；信用环境整体看前高后低，社会融资总量增速企稳回升，但在不大放水的前提下，上行幅度在历史上偏弱，在稳健的货币政策和托底的信用政策共同约束下，宏观经济出现前高后低的态势：今年一季度，去杠杆力度减弱，央行大力度定向降准，地方债专项债发行前置，信贷社融回暖明显，社融、M2 增速企稳；一季度中美经贸摩擦有所缓和，市场对两者达成一致抱有较高期待；在两者的共同作用下，一季度 GDP 略超预期，环比增速上行，资产价格企稳，通胀预期稳定。然而 4 月中旬以来，金融去杠杆边际加码，货币政策表述边际收紧，5 月包商银行被接管更导致对于信用条件收缩的担忧；与此同时，中美贸易摩擦在 5 月迅速恶化，导致二季度以来经济金融数据较一季度有所下滑，货币和信贷增速环比增速放缓，非标整体余额下滑，内需指标走弱明显。针对包商银行事件带来的信用分层情况，货币政策有针对性地进行了一定的宽松加码，目前看中小银行未出现明显信用收缩情况，整体信用条件在包商银行事件出现后保持平稳。

海外宏观方面，上半年全球经济增速放缓，下行风险持续增大，主要由于金融条件紧缩的滞后效果、英国脱欧、逆全球化贸易摩擦引起。在美联储加息周期影响下，2019 年美国也步欧洲后尘，全球同步放缓。居民消费、资本开支增速全面下滑，在这个大背景下，全球央行立场继续向宽松转向，美联储降息概率增加，各新兴、发达经济体开启降息周期，同时，全球负国债利率占比已达 31%，制约货币政策进一步放松。

2019 上半年，市场出现 risk on 后 risk off 的过程，波动较大，结构性机会此起彼伏，年初伊始，由于政策托底经济，货币投放量较大，贸易摩擦预期向好，市场出现了明显的估值修复和流动性推动的行情，5G，养殖，非银等行业和相关主题涨幅较大；4 月份，在估值显著修复、货币政策边际收紧后，市场出现阶段性横盘；5 月份中美贸易摩擦突然升温，包商银行事件出现导致市场偏好明显下行，叠加短期较紧的信用条件，导致一轮 risk off 的行情，具体表现为避险品种银行、黄金等相

对收益明显，中小市值和科技股票面临流动性和估值的双杀，表现逊于市场。上半年，市场对以食品饮料为代表的蓝筹龙头标的抱团现象较为明显，同一行业间优质标的和其他标的的估值差逐渐拉大。

报告期内，本基金加大了金融板块的配置比例，并在季度间对银行、券商和保险进行了轮动。由于对中美贸易争端的不确定，减少了计算机、电子板块的配置比例。此外，本基金在医药、化工、食品饮料、商贸零售等行业“自下而上”精选了一些个股作为重点持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.098 元，本报告期份额净值增长率为 19.61%，同期上证综指上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%。

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，我们认为宏观经济减速的趋势虽然确定，但幅度可控，主要是因为上半年社会融资总量的数据回暖会对下半年的实体经济有一定领先作用，且政府手中仍有较充分的对冲政策可以托底经济。在宏观波动不会太大的判断下，盈利、无风险利率和风险偏好三个影响股价的因素中，盈利因素将占主导，直到政策再次出手刺激经济。我们认为市场在下半年仍具有较强的结构性机会，而分化和“抱团”的格局也较难立即被打破，主要是在经济难有大起落的格局下，各行业中的头部企业将继续获得快于行业的增速。而以外资为代表的增量资金也更青睐于盈利质量高且稳定的行业龙头。随着估值水平的提高，在优质标的中继续获得超额收益取决于：1)业绩的景气度能否继续维持；2)是否能够在细分领域找到新的优质隐形冠军标的。

投资策略上，本基金将继续采取“自上而下”定行业配置，“自下而上”选择优质标的的投资策略，选取真成长股并长期持有。

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，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遵规守信、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：华夏成长证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	190,124,603.16	81,208,843.13
结算备付金		6,216,112.01	6,774,775.39

存出保证金		2,494,521.89	2,633,463.15
交易性金融资产	6.4.7.2	4,398,606,788.75	3,828,999,766.57
其中：股票投资		3,189,468,657.03	2,540,636,464.02
基金投资		-	-
债券投资		1,209,138,131.72	1,288,363,302.55
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	129,965,314.95	199,972,499.96
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	19,067,602.35	26,350,477.53
应收股利		-	-
应收申购款		1,046,886.23	1,303,079.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,747,521,829.34	4,147,242,904.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	30,000,000.00
应付证券清算款		-	31,539,823.00
应付赎回款		5,855,936.19	2,246,557.78
应付管理人报酬		5,692,889.36	5,227,319.83
应付托管费		948,814.89	871,219.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,463,947.18	14,209,554.55
应交税费		2,809,856.91	2,782,663.64
应付利息		-	35,547.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	389,368.83	358,427.71
负债合计		33,160,813.36	87,271,114.44
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	4,294,754,790.07	4,422,779,385.47
未分配利润	6.4.7.10	419,606,225.91	-362,807,594.93
所有者权益合计		4,714,361,015.98	4,059,971,790.54
负债和所有者权益总计		4,747,521,829.34	4,147,242,904.98

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.098 元，基金份额总额 4,294,754,790.07 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		861,618,537.49	-321,298,190.23
1.利息收入		22,001,241.83	25,381,324.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,455,284.87	1,211,860.55
债券利息收入		20,389,095.98	24,020,601.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		156,860.98	148,863.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		401,094,858.58	32,291,617.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	372,848,331.08	17,372,999.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,210,176.00	608,969.03
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	25,036,351.50	14,309,649.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	437,604,538.79	-379,712,181.54
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	917,898.29	741,048.54
减：二、费用		56,760,252.25	59,048,134.47
1.管理人报酬		34,412,033.83	35,750,508.19
2.托管费		5,735,338.95	5,958,418.04
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	16,439,586.29	16,538,722.15
5.利息支出		16,085.94	557,142.23
其中：卖出回购金融资产支出		16,085.94	557,142.23
6.税金及附加		7,552.31	38,595.13
7.其他费用	6.4.7.21	149,654.93	204,748.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		804,858,285.24	-380,346,324.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		804,858,285.24	-380,346,324.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏成长证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,422,779,385.47	-362,807,594.93	4,059,971,790.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	804,858,285.24	804,858,285.24
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）	-128,024,595.40	-22,444,464.40	-150,469,059.80
其中：1.基金申购款	468,204,570.38	35,557,097.57	503,761,667.95
2.基金赎回款	-596,229,165.78	-58,001,561.97	-654,230,727.75
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）	4,294,754,790.07	419,606,225.91	4,714,361,015.98
项目	上年度可比期间 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）	4,398,316,713.21	590,131,614.52	4,988,448,327.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-380,346,324.70	-380,346,324.70
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）	-114,337,416.71	-18,927,168.90	-133,264,585.61
其中：1.基金申购款	378,684,085.76	42,638,861.68	421,322,947.44
2.基金赎回款	-493,021,502.47	-61,566,030.58	-554,587,533.05
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）	4,283,979,296.50	190,858,120.92	4,474,837,417.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏成长证券投资基金（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[2001]49号《关于同意华夏成长证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人华夏基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》（于2004年9月16日废止，由《中华人民共和国证券投资基金法》取代）、《开放式证券投资基金试点办法》（已废止）等有关规定和《华夏成长证券投资基金基金契约》（于2004年10月15日改为《华夏成长证券投资基金基金合同》）发起，于2001年12月18日募集成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,236,830,105.93元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2001）第109号验资报告予以验证。有关基金设立等文件已按规定向中国证监会备案。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《中华人民共和国证券投资基金法》、《华夏成长证券投资基金基金合同》等有关规定，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、债券、权证、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。其中投资的重点是预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司所发行的股票，该部分投资比例不低于本基金股票资产的80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。
- 5、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 6、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 7、对基金取得的股票的股息、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。
- 8、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。
- 9、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。

10、本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	190,124,603.16
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	190,124,603.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,040,589,107.29	3,189,468,657.03	148,879,549.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	62,053,410.40	62,501,131.72
	银行间市场	1,145,290,063.47	1,146,637,000.00
	合计	1,207,343,473.87	1,209,138,131.72
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,247,932,581.16	4,398,606,788.75	150,674,207.59

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
----	-----

	2019 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	129,965,314.95	-
合计	129,965,314.95	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	80,050.02
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	2,797.20
应收债券利息	18,963,651.68
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	19,980.95
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,122.50
合计	19,067,602.35

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	17,461,229.79
银行间市场应付交易费用	2,717.39
合计	17,463,947.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	21,981.60
预提费用	117,387.23

合计	389,368.83
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,422,779,385.47	4,422,779,385.47
本期申购	468,204,570.38	468,204,570.38
本期赎回（以“-”号填列）	-596,229,165.78	-596,229,165.78
本期末	4,294,754,790.07	4,294,754,790.07

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	900,416,823.85	-1,263,224,418.78	-362,807,594.93
本期利润	367,253,746.45	437,604,538.79	804,858,285.24
本期基金份额交易产生的变动数	-34,014,916.52	11,570,452.12	-22,444,464.40
其中：基金申购款	114,930,621.93	-79,373,524.36	35,557,097.57
基金赎回款	-148,945,538.45	90,943,976.48	-58,001,561.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,233,655,653.78	-814,049,427.87	419,606,225.91

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	73,973.92
其他	21,308.48
合计	1,455,284.87

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	5,873,252,704.79
买卖股票差价收入	372,848,331.08

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	383,251,787.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	370,676,637.86
减：应收利息总额	9,364,973.84
买卖债券差价收入	3,210,176.00

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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,036,351.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,036,351.50

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	437,604,538.79
——股票投资	439,682,230.36
——债券投资	-2,077,691.57
——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	437,604,538.79

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	917,886.18
其他	12.11
合计	917,898.29

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	16,437,286.29
银行间市场交易费用	2,300.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	16,439,586.29

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	67,798.66
银行费用	13,667.70
银行间账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	149,654.93

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	4,761,149,896.65	38.62%	1,417,191,334.64	11.63%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

中信证券	9,604,626.84	16.78%	-	-
------	--------------	--------	---	---

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	12,000,000.00	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 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	3,772,434.40	41.47%	3,592,979.64	20.58%
关联方名称	上年度可比期间 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	1,166,299.15	12.48%	957,614.17	3.70%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	34,412,033.83	35,750,508.19
其中：支付销售机构的客户维护费	4,684,321.96	4,646,539.80

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,735,338.95	5,958,418.04

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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	190,124,603.16	1,360,002.47	79,657,293.01	1,069,659.60

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的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。

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 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	190,124,603.16	-	-	190,124,603.16
结算备付金	6,216,112.01	-	-	6,216,112.01
结算保证金	2,494,521.89	-	-	2,494,521.89
债券投资	608,523,284.52	561,610,847.20	39,004,000.00	1,209,138,131.72
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	129,965,314.95	-	-	129,965,314.95
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	81,208,843.13	-	-	81,208,843.13
结算备付金	6,774,775.39	-	-	6,774,775.39
结算保证金	2,633,463.15	-	-	2,633,463.15
债券投资	780,584,302.55	468,931,000.00	38,848,000.00	1,288,363,302.55
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	199,972,499.96	-	-	199,972,499.96
应收直销申购款	24,254.50	-	-	24,254.50
卖出回购金融资产款	30,000,000.00	-	-	30,000,000.00

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-3,880,156.47	-3,925,337.43
	利率下降 25 个基点	3,912,227.86	3,957,571.42

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,189,468,657.03	67.65	2,540,636,464.02	62.58
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,127,284.52	0.15	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,196,595,941.55	67.81	2,540,636,464.02	62.58

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	+5%	178,293,883.55	137,284,307.59
	-5%	-178,293,883.55	-137,284,307.59

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2019 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 3,196,595,941.55 元，第二层次的余额为 1,202,010,847.20 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2018 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 2,557,880,266.57 元，第二层次的余额为 1,271,119,500.00 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	3,189,468,657.03	67.18
	其中：股票	3,189,468,657.03	67.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,209,138,131.72	25.47
	其中：债券	1,209,138,131.72	25.47
	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	129,965,314.95	2.74
	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	196,340,715.17	4.14
8	其他各项资产	22,609,010.47	0.48
9	合计	4,747,521,829.34	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	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.01
C	制造业	1,232,217,939.84	26.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,664,123.48	1.22
E	建筑业	50,632,114.48	1.07
F	批发和零售业	14,099,091.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,751,934.38	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	309,606,415.44	6.57
J	金融业	989,694,634.95	20.99
K	房地产业	232,773,956.52	4.94
L	租赁和商务服务业	206,281,283.68	4.38
M	科学研究和技术服务业	25,725,680.63	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	1,624,429.78	0.03
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	66,033,621.60	1.40
S	综合	-	-
	合计	3,189,468,657.03	67.65

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	3,000,692	265,891,318.12	5.64
2	300232	洲明科技	24,716,360	239,254,364.80	5.08
3	300383	光环新网	10,860,120	182,124,212.40	3.86
4	600867	通化东宝	10,288,765	158,446,981.00	3.36
5	002127	南极电商	13,733,457	154,364,056.68	3.27
6	000002	万科 A	5,100,926	141,856,752.06	3.01
7	601336	新华保险	2,375,289	130,712,153.67	2.77
8	600273	嘉化能源	11,052,700	127,769,212.00	2.71
9	000858	五粮液	990,542	116,834,428.90	2.48
10	601398	工商银行	17,336,300	102,110,807.00	2.17
11	002643	万润股份	9,352,100	94,456,210.00	2.00
12	300226	上海钢联	1,249,971	93,697,826.16	1.99
13	601009	南京银行	11,125,292	91,894,911.92	1.95

14	600048	保利地产	7,000,500	89,326,380.00	1.89
15	601166	兴业银行	4,879,894	89,253,261.26	1.89
16	601688	华泰证券	3,700,000	82,584,000.00	1.75
17	600519	贵州茅台	83,536	82,199,424.00	1.74
18	601601	中国太保	2,242,024	81,856,296.24	1.74
19	300309	吉艾科技	12,343,328	81,465,964.80	1.73
20	603886	元祖股份	2,578,627	68,307,829.23	1.45
21	000568	泸州老窖	633,400	51,197,722.00	1.09
22	600837	海通证券	3,500,000	49,665,000.00	1.05
23	601668	中国建筑	7,263,500	41,765,125.00	0.89
24	000895	双汇发展	1,489,111	37,063,972.79	0.79
25	300099	精准信息	5,000,000	35,900,000.00	0.76
26	600167	联美控股	3,332,644	35,259,373.52	0.75
27	600093	易见股份	2,986,055	34,190,329.75	0.73
28	300144	宋城演艺	1,411,200	32,655,168.00	0.69
29	000651	格力电器	450,000	24,750,000.00	0.52
30	300096	易联众	2,323,500	22,073,250.00	0.47
31	300142	沃森生物	771,864	21,890,063.04	0.46
32	600116	三峡水利	2,700,000	21,546,000.00	0.46
33	300192	科斯伍德	1,801,543	18,141,538.01	0.38
34	601888	中国国旅	199,965	17,726,897.25	0.38
35	603096	新经典	291,080	15,607,709.60	0.33
36	300413	芒果超媒	358,352	14,710,349.60	0.31
37	603659	璞泰来	303,200	14,256,464.00	0.30
38	600885	宏发股份	567,800	13,797,540.00	0.29
39	002867	周大生	400,000	13,676,000.00	0.29
40	002463	沪电股份	1,000,000	13,620,000.00	0.29
41	603018	中设集团	1,057,066	13,160,471.70	0.28
42	600031	三一重工	1,000,000	13,080,000.00	0.28
43	300284	苏交科	1,267,067	11,695,028.41	0.25
44	300124	汇川技术	465,200	10,657,732.00	0.23
45	002384	东山精密	700,000	10,199,000.00	0.22
46	000063	中兴通讯	300,000	9,759,000.00	0.21
47	601128	常熟银行	1,220,500	9,422,260.00	0.20
48	601186	中国铁建	891,100	8,866,445.00	0.19
49	002747	埃斯顿	999,999	8,789,991.21	0.19
50	300496	中科创达	300,000	8,724,000.00	0.19
51	603515	欧普照明	260,000	8,385,000.00	0.18
52	300450	先导智能	180,200	6,054,720.00	0.13
53	603899	晨光文具	118,806	5,223,899.82	0.11
54	601377	兴业证券	710,000	4,785,400.00	0.10
55	600887	伊利股份	142,100	4,747,561.00	0.10
56	603816	顾家家居	140,000	4,468,800.00	0.09

57	002444	巨星科技	418,000	4,171,640.00	0.09
58	300673	佩蒂股份	156,060	4,154,317.20	0.09
59	002138	顺络电子	200,001	3,516,017.58	0.07
60	002206	海利得	848,900	3,505,957.00	0.07
61	300251	光线传媒	450,058	3,060,394.40	0.06
62	300418	昆仑万维	225,776	2,905,737.12	0.06
63	002821	凯莱英	27,600	2,707,008.00	0.06
64	601021	春秋航空	60,000	2,700,000.00	0.06
65	600872	中炬高新	50,005	2,141,714.15	0.05
66	002568	百润股份	111,100	1,986,468.00	0.04
67	600622	光大嘉宝	326,658	1,590,824.46	0.03
68	601233	桐昆股份	100,090	1,552,395.90	0.03
69	002677	浙江美大	100,000	1,316,000.00	0.03
70	002557	洽洽食品	50,000	1,262,500.00	0.03
71	002258	利尔化学	85,142	1,111,103.10	0.02
72	000888	峨眉山 A	180,200	1,084,804.00	0.02
73	300760	迈瑞医疗	6,407	1,045,622.40	0.02
74	603259	药明康德	10,039	870,180.52	0.02
75	600011	华能国际	125,326	780,780.98	0.02
76	002050	三花智控	65,000	685,750.00	0.01
77	002078	太阳纸业	100,000	681,000.00	0.01
78	601799	星宇股份	8,000	631,680.00	0.01
79	002033	丽江旅游	90,139	539,031.22	0.01
80	002185	华天科技	100,000	509,000.00	0.01
81	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
82	300373	扬杰科技	20,000	299,800.00	0.01
83	000786	北新建材	16,240	294,431.20	0.01
84	300633	开立医疗	10,000	285,600.00	0.01
85	601933	永辉超市	25,000	255,250.00	0.01
86	300285	国瓷材料	15,000	255,150.00	0.01
87	300308	中际旭创	7,076	240,513.24	0.01
88	002572	索菲亚	10,000	185,600.00	0.00
89	600729	重庆百货	5,400	163,296.00	0.00
90	002920	德赛西威	4,569	102,345.60	0.00
91	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
92	000899	赣能股份	14,823	77,968.98	0.00
93	300750	宁德时代	1,052	72,461.76	0.00
94	300166	东方国信	3,400	41,786.00	0.00
95	600787	中储股份	7,006	40,144.38	0.00
96	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
97	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
98	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
99	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00

100	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
101	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
102	002142	宁波银行	800	19,392.00	0.00
103	603885	吉祥航空	900	11,790.00	0.00
104	600809	山西汾酒	168	11,600.40	0.00
105	300078	思创医惠	1,000	10,210.00	0.00
106	601965	中国汽研	971	7,214.53	0.00
107	603833	欧派家居	67	7,210.54	0.00
108	603233	大参林	101	4,545.00	0.00
109	600054	黄山旅游	64	594.56	0.00
110	600477	杭萧钢构	166	544.48	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	601336	新华保险	421,467,337.66	10.38
2	601318	中国平安	246,837,562.13	6.08
3	601688	华泰证券	240,540,834.13	5.92
4	601601	中国太保	228,069,055.62	5.62
5	000858	五粮液	220,765,284.70	5.44
6	601009	南京银行	212,599,350.15	5.24
7	000063	中兴通讯	174,559,625.91	4.30
8	000002	万科 A	170,202,725.53	4.19
9	600273	嘉化能源	160,372,729.70	3.95
10	600837	海通证券	155,286,801.91	3.82
11	600048	保利地产	146,862,376.84	3.62
12	300033	同花顺	142,999,316.32	3.52
13	600867	通化东宝	139,871,817.35	3.45
14	601166	兴业银行	139,184,834.51	3.43
15	000568	泸州老窖	131,897,903.18	3.25
16	300339	润和软件	126,106,077.13	3.11
17	300383	光环新网	120,394,937.82	2.97
18	000895	双汇发展	117,229,816.59	2.89
19	601398	工商银行	114,204,413.00	2.81
20	000686	东北证券	109,701,443.95	2.70
21	300059	东方财富	102,577,866.37	2.53
22	600519	贵州茅台	102,527,130.24	2.53
23	600570	恒生电子	100,067,463.91	2.46
24	300226	上海钢联	89,269,662.20	2.20
25	002384	东山精密	88,898,190.71	2.19
26	002463	沪电股份	87,925,035.31	2.17

27	603019	中科曙光	86,764,270.69	2.14
28	601555	东吴证券	85,335,005.06	2.10
29	600958	东方证券	83,604,255.46	2.06

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	002195	二三四五	354,990,486.48	8.74
2	601336	新华保险	302,761,582.54	7.46
3	300226	上海钢联	216,246,384.21	5.33
4	000858	五粮液	189,719,006.08	4.67
5	601688	华泰证券	188,636,242.65	4.65
6	300033	同花顺	187,888,070.23	4.63
7	002127	南极电商	182,723,534.61	4.50
8	300059	东方财富	176,120,828.20	4.34
9	000895	双汇发展	164,446,543.63	4.05
10	601601	中国太保	163,323,800.71	4.02
11	000063	中兴通讯	161,720,507.79	3.98
12	601318	中国平安	155,090,398.22	3.82
13	300339	润和软件	140,577,436.02	3.46
14	300166	东方国信	127,245,738.09	3.13
15	000686	东北证券	121,300,625.08	2.99
16	600570	恒生电子	112,773,604.13	2.78
17	600837	海通证券	109,342,587.92	2.69
18	601009	南京银行	104,496,231.38	2.57
19	603019	中科曙光	102,604,652.76	2.53
20	601555	东吴证券	101,898,266.76	2.51
21	600048	保利地产	101,055,288.61	2.49
22	000568	泸州老窖	92,341,298.41	2.27
23	300309	吉艾科技	91,503,075.32	2.25

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	6,082,402,667.44
卖出股票的收入（成交）总额	6,246,101,035.87

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	55,373,847.20	1.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,045,577,000.00	22.18
	其中：政策性金融债	1,045,577,000.00	22.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	101,060,000.00	2.14
7	可转债（可交换债）	7,127,284.52	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,209,138,131.72	25.65

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	180209	18 国开 09	2,900,000	290,087,000.00	6.15
2	180208	18 国开 08	1,500,000	152,640,000.00	3.24
3	180409	18 农发 09	1,300,000	132,652,000.00	2.81
4	101564021	15 华能集 MTN002	1,000,000	101,060,000.00	2.14
5	190201	19 国开 01	1,000,000	99,960,000.00	2.12

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	2,494,521.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,067,602.35
5	应收申购款	1,046,886.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,609,010.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128046	利尔转债	6,027,920.50	0.13
2	128022	众信转债	624,893.92	0.01
3	128016	雨虹转债	474,470.10	0.01

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
221,989	19,346.70	16,995,587.39	0.40%	4,277,759,202.68	99.60%

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	59,051.60	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（2001年12月18日）基金份额总额	3,236,830,105.93
本报告期期初基金份额总额	4,422,779,385.47
本报告期基金总申购份额	468,204,570.38
减：本报告期基金总赎回份额	596,229,165.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,294,754,790.07

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 3 月 2 日发布公告，李彬女士担任华夏基金管理有限公司督察长，周璇

女士不再担任华夏基金管理有限公司督察长。

本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	3	4,761,149,896.65	38.62%	3,772,434.40	41.47%	-
华创证券	1	1,819,452,837.60	14.76%	784,732.52	8.63%	-
海通证券	1	1,223,633,838.68	9.93%	1,139,567.75	12.53%	-
天风证券	1	1,178,774,346.38	9.56%	862,037.51	9.48%	-
民生证券	1	840,769,463.79	6.82%	614,854.25	6.76%	-
川财证券	1	764,873,730.97	6.20%	559,351.93	6.15%	-
长江证券	1	687,077,523.18	5.57%	502,459.88	5.52%	-
东莞证券	1	464,581,194.24	3.77%	432,664.11	4.76%	-
方正证券	1	448,694,215.35	3.64%	328,126.41	3.61%	-
光大证券	1	138,105,792.23	1.12%	100,993.69	1.11%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③ 除本表列示外，本基金还选择了东方证券、国泰君安证券、国信证券、华泰证券、中信建投证券、平安证券、申万宏源证券、中国银河证券、招商证券、广州证券、中金公司、西部证券、高华证券、万联证券、国海证券、长城证券、信达证券、国盛证券、万和证券、东兴证券、安信证券、东吴证券、汇丰前海证券、财通证券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，中信证券的部分交易单元、东方证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，民族证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元。

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	9,604,626.84	16.78%	12,000,000.00	100.00%
华创证券	2,578,938.40	4.50%	-	-
海通证券	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-
方正证券	45,067,508.60	78.72%	-	-
光大证券	-	-	-	-

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公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-02
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融湘江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	2019-03-04
3	华夏基金管理有限公司关于提示投资者在中国结算办理场外账户对应关系维护业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
4	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
5	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在嘉实财富管理有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-13
6	华夏基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善客户身份信息资料的特别提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；

12.1.2 《华夏成长证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《华夏成长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

二〇一九年八月二十九日