

华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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）.....	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.....	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.....	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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
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.....	37
§10 重大事件揭示.....	37
§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	华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华夏磐泰定开混合（LOF）
场内简称	华夏磐泰
基金主代码	160323
交易代码	160323
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016年12月26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	235,425,983.46份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年3月15日

2.2 基金产品说明

投资目标	把握市场发展趋势，在控制风险的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*30%+上证国债指数收益率*70%。
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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
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	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	1,836,191.15
本期利润	1,526,646.53
加权平均基金份额本期利润	0.0065
本期加权平均净值利润率	0.65%
本期基金份额净值增长率	0.65%
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	1,668,060.60
期末可供分配基金份额利润	0.0071
期末基金资产净值	237,094,044.06
期末基金份额净值	1.0071
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	0.71%

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	1.13%	0.13%	1.60%	0.20%	-0.47%	-0.07%

过去三个月	-0.03%	0.15%	1.92%	0.19%	-1.95%	-0.04%
过去六个月	0.65%	0.12%	3.44%	0.17%	-2.79%	-0.05%
自基金合同生效起至今	0.71%	0.12%	3.47%	0.17%	-2.76%	-0.05%

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

华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2016 年 12 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日）



注：①本基金合同于 2016 年 12 月 26 日生效。

②根据华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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		
张城源	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2016-12-26	-	8 年	中国人民大学法学硕士。2009 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理、投资研究部总经理助理等。
韩会永	本基金的基金经理、董事总经理	2016-12-26	-	17 年	经济学硕士。曾任职于招商银行北京分行。2000 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任

					研究发展部副总经理、基金经理助理、固定收益副总监、固定收益部总经理、华夏现金增利证券投资基金基金经理（2005 年 4 月 12 日至 2006 年 1 月 24 日期间，2007 年 1 月 6 日至 2008 年 2 月 4 日期间），华夏债券投资基金基金经理（2004 年 2 月 27 日至 2012 年 4 月 5 日期间）、华夏保证金理财货币市场基金基金经理（2013 年 2 月 4 日至 2015 年 4 月 2 日期间）等。
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2017-01-18	-	15 年	北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员等。2003 年 8 月加入原中信基金，曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，美国经济仍处于复苏趋势中，欧日经济数据亦有所改善，欧美股市反弹，石油价格出现明显调整。国内方面，经济继续复苏，但地产调控、金融去杠杆等政策大背景也对经济增长趋势造成一定影响。

股市方面，1 季度，A 股市场春季躁动如约而至，大盘蓝筹、消费、周期均有所表现，部分确定性较好的成长股也逐渐显现出投资价值。但我们也看到，金融去杠杆等政策对投资者风险偏好造成了一定影响，2 季度市场出现一定程度的波动，结构性行情明显，部分估值合理、稳健成长的标的表现较好，而估值相对较高的中小盘股票则持续调整。

定增市场方面，发行较为稳定，受资金面等因素影响，发行折扣率仍保持在较低水平。此外，监管机构先后发布了针对再融资、完善减持制度的新规，新规对上市公司定增发行以及投资者的减持行为进行了规范，对定增市场发行项目质量、发行折价率、投资者结构等方面均有积极的影响，定增市场将由过去一个阶段呈现的卖方市场特征向买方市场转变，具备扎实投研实力的投资者有望在定增市场中获取更好的回报。

报告期内，定增方面，本基金在一年期定向增发项目的申购报价方面采取了较为谨慎的态度；二级市场方面，本基金在市场波动中对仓位及行业配置进行了积极调整，重点配置了部分业绩增长确定性强、估值合理或者低估的上市公司股票。

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 1.0071 元，本报告期份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准增长率为 3.44%。

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，全球经济仍将处于复苏趋势中，国内经济增长惯性仍在。市场在经历了 2 季度的调整后，更多公司估值处于较为合理的位置。随着上市公司中报、3 季报的逐步披露，投资者对上市公司 2017 年的业绩以及 2018 年的业务发展都将有更为明确的预期，对成长性较好、估值合理的公司，也会给予更多关注。

定增策略方面，受再融资新规、完善减持制度新规的影响，部分质地较差的项目将主动退出定增市场，定增项目整体质量将有所提高，同时定增投资者将对发行折扣有更高要求，在此基础上，定增事件驱动策略将迎来较好机会。

下半年，本基金将在控制风险的基础上，依托定增策略，继续挖掘业绩增长确定性强、估值合理或者低估的上市公司进行配置。

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磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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，华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）的管理人——华夏基金管理有限公司在华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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，华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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：华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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	11,975,568.50	64,976,598.67
结算备付金		2,987,107.93	-
存出保证金		25,462.61	-
交易性金融资产	6.4.7.2	208,781,984.27	41,970,199.87
其中：股票投资		39,045,514.94	10,219,898.50
基金投资		-	-
债券投资		140,961,057.00	11,984,400.00
资产支持证券投资		28,775,412.33	19,765,901.37
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	32,600,000.00	136,000,000.00
应收证券清算款		4,055,050.59	7,300,000.00
应收利息	6.4.7.5	2,065,346.76	390,326.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	50,411.24	1,309.62
资产总计		262,540,931.90	250,638,434.41
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		21,000,000.00	7,300,000.00
应付证券清算款		4,093,991.64	7,728,948.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		193,767.87	32,168.54
应付托管费		38,753.57	6,433.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	36,889.63	3,306.86
应交税费		-	-
应付利息		4,141.97	179.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,343.16	-
负债合计		25,446,887.84	15,071,036.88
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	235,425,983.46	235,425,983.46
未分配利润	6.4.7.10	1,668,060.60	141,414.07
所有者权益合计		237,094,044.06	235,567,397.53
负债和所有者权益总计		262,540,931.90	250,638,434.41

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0071 元，基金份额总额 235,425,983.46 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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		3,396,868.93
1.利息收入		3,576,068.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	905,072.45
债券利息收入		1,729,830.83
资产支持证券利息收入		390,113.36
买入返售金融资产收入		551,051.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		129,863.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-408,185.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	384,233.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	21,796.69
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	132,019.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.18	-309,544.62

号填列)		
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	481.25
减：二、费用		1,870,222.40
1.管理人报酬		1,170,961.32
2.托管费		234,192.32
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.4.7.20	71,528.13
5.利息支出		275,980.04
其中：卖出回购金融资产支出		275,980.04
6.其他费用	6.4.7.21	117,560.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,526,646.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,526,646.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

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）	235,425,983.46	141,414.07	235,567,397.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,526,646.53	1,526,646.53
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	235,425,983.46	1,668,060.60	237,094,044.06

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

华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）（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]2290 号《关于准予华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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》、《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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 11 月 23 日至 2016 年 12 月 20 日共募集 235,352,608.04 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2016）验字第 60739337_A05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2016 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 235,425,983.46 份基金份额，其中认购资金利息折合 73,375.42 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《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为

投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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《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》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 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。

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	11,975,568.50
定期存款	-
其他存款	-
合计	11,975,568.50

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	39,510,105.71	39,045,514.94	-464,590.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	75,819,216.89	75,828,557.00
	银行间市场	64,943,516.65	65,132,500.00
	合计	140,762,733.54	140,961,057.00
资产支持证券	28,775,412.33	28,775,412.33	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	209,048,251.58	208,781,984.27	-266,267.31

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	32,600,000.00	-
合计	32,600,000.00	-

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	3,935.16
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	1,344.20
应收债券利息	1,623,760.11
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	436,307.29
合计	2,065,346.76

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	50,411.24
合计	50,411.24

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	34,992.13
银行间市场应付交易费用	1,897.50
合计	36,889.63

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	-
预提费用	79,343.16
合计	79,343.16

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	235,425,983.46	235,425,983.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	235,425,983.46	235,425,983.46

注：本基金自 2016 年 11 月 23 日至 2016 年 12 月 20 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 235,352,608.04 元。根据《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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 73,375.42 元在本基金合同生效后，折算为 73,375.42 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

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	98,136.76	43,277.31	141,414.07
本期利润	1,836,191.15	-309,544.62	1,526,646.53
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,934,327.91	-266,267.31	1,668,060.60

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
定期存款利息收入	776,780.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,292.80
其他	104.33
合计	905,072.45

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	26,581,832.24
减：卖出股票成本总额	26,990,017.90
买卖股票差价收入	-408,185.66

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	102,009,416.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,512,062.82
减：应收利息总额	1,113,120.34
买卖债券差价收入	384,233.20

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	5,036,485.47
减：卖出资产支持证券成本总额	5,001,028.31
减：应收利息总额	13,660.47
资产支持证券投资收益	21,796.69

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	132,019.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	132,019.75

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	-309,544.62
——股票投资	-494,968.08
——债券投资	185,423.46
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-309,544.62

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	-
其他	481.25
合计	481.25

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	69,203.13
银行间市场交易费用	2,325.00

合计	71,528.13
----	-----------

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	3,628.67
银行间账户维护费	4,500.00
上市费	29,588.76
其他	500.00
合计	117,560.59

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

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

无。

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

无。

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	1,170,961.32
其中：支付销售机构的客户维护费	324,053.83

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 1.00%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×1.00%/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	234,192.32

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 0.20%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×0.20%/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	11,975,568.50	109,894.76

注：本基金的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。

6.4.11 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：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
139391	17 观投债	2017-06-23	2017-07-28	新发流通受限	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	-

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
002547	春兴精工	2017-02-20	重大事项	10.89	2017-08-18	9.80	37,500.00	352,508.50	408,375.00	-

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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 21,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	11,975,568.50	-	-	11,975,568.50
结算备付金	2,987,107.93	-	-	2,987,107.93
结算保证金	25,462.61	-	-	25,462.61
债券投资	91,864,057.00	44,097,000.00	5,000,000.00	140,961,057.00
资产支持证券	24,775,412.33	4,000,000.00	-	28,775,412.33
买入返售金融资产	32,600,000.00	-	-	32,600,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	21,000,000.00	-	-	21,000,000.00
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	64,976,598.67	-	-	64,976,598.67
结算备付金	-	-	-	-
结算保证金	-	-	-	-
债券投资	11,984,400.00	-	-	11,984,400.00
资产支持证券	19,765,901.37	-	-	19,765,901.37
买入返售金融资产	136,000,000.00	-	-	136,000,000.00
应收直销申购款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,300,000.00	-	-	7,300,000.00

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	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
利率下降 25 个基点	647,644.99	47,053.24
利率上升 25 个基点	-642,182.44	-46,895.90

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	39,045,514.94	16.47	10,219,898.50	4.34
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	39,045,514.94	16.47	10,219,898.50	4.34

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%	2,269,911.01	629,443.55	
	-5%	-2,269,911.01	-629,443.55	

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 73,770,458.87 元，第二层次的余额为 135,011,525.40 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 29,985,799.87 元，第二层次的余额为 11,984,400.00 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。

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	39,045,514.94	14.87
	其中：股票	39,045,514.94	14.87
2	固定收益投资	169,736,469.33	64.65
	其中：债券	140,961,057.00	53.69
	资产支持证券	28,775,412.33	10.96
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	32,600,000.00	12.42
	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	14,962,676.43	5.70
7	其他各项资产	6,196,271.20	2.36
8	合计	262,540,931.90	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	3,577,404.00	1.51
C	制造业	21,080,524.32	8.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,128,536.00	0.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,510,125.10	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	919,118.52	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	986,302.00	0.42
J	金融业	5,709,739.60	2.41
K	房地产业	1,393,279.00	0.59
L	租赁和商务服务业	1,399,746.40	0.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

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	340,740.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	39,045,514.94	16.47

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	000968	蓝焰控股	247,400	3,577,404.00	1.51
2	002241	歌尔股份	173,773	3,350,343.44	1.41
3	601601	中国太保	44,600	1,510,602.00	0.64
4	000060	中金岭南	128,100	1,434,720.00	0.61
5	603883	老百姓	28,500	1,386,525.00	0.58
6	002223	鱼跃医疗	58,300	1,380,544.00	0.58
7	000066	中国长城	153,100	1,379,431.00	0.58
8	002019	亿帆医药	81,966	1,367,192.88	0.58
9	601688	华泰证券	76,364	1,366,915.60	0.58
10	601166	兴业银行	80,600	1,358,916.00	0.57
11	600109	国金证券	81,800	958,696.00	0.40
12	002678	珠江钢琴	57,400	727,832.00	0.31
13	002345	潮宏基	65,100	707,637.00	0.30
14	600273	嘉化能源	75,100	704,438.00	0.30
15	002261	拓维信息	58,600	686,206.00	0.29
16	603901	永创智能	54,500	645,825.00	0.27
17	601021	春秋航空	19,200	645,696.00	0.27
18	002665	首航节能	87,600	630,720.00	0.27
19	600617	国新能源	60,800	579,424.00	0.24
20	002751	易尚展示	15,000	555,750.00	0.23
21	002284	亚太股份	50,000	555,000.00	0.23
22	002712	思美传媒	25,300	545,974.00	0.23
23	600061	国投安信	32,000	497,600.00	0.21
24	600297	广汇汽车	61,620	463,998.60	0.20
25	002547	春兴精工	37,500	408,375.00	0.17
26	600572	康恩贝	57,700	399,284.00	0.17
27	002532	新界泵业	47,360	385,984.00	0.16
28	000540	中天金融	54,500	378,775.00	0.16
29	002020	京新药业	31,800	376,830.00	0.16
30	000046	泛海控股	41,800	364,914.00	0.15
31	300219	鸿利智汇	26,800	355,368.00	0.15
32	002190	成飞集成	13,200	353,760.00	0.15

33	000669	金鸿能源	19,500	353,535.00	0.15
34	002097	山河智能	39,100	347,599.00	0.15
35	002433	太安堂	37,400	345,950.00	0.15
36	603599	广信股份	22,600	341,938.00	0.14
37	002343	慈文传媒	9,000	340,740.00	0.14
38	000732	泰禾集团	20,400	340,272.00	0.14
39	002024	苏宁云商	30,100	338,625.00	0.14
40	000988	华工科技	23,100	337,029.00	0.14
41	002721	金一文化	22,500	335,925.00	0.14
42	600478	科力远	38,300	329,763.00	0.14
43	600337	美克家居	56,810	320,976.50	0.14
44	002397	梦洁股份	48,000	320,640.00	0.14
45	002005	德豪润达	67,100	320,067.00	0.13
46	002057	中钢天源	24,800	317,192.00	0.13
47	002100	天康生物	39,500	317,185.00	0.13
48	600380	健康元	34,900	316,892.00	0.13
49	000042	中洲控股	18,600	309,318.00	0.13
50	000599	青岛双星	45,600	306,888.00	0.13
51	002363	隆基机械	32,200	304,290.00	0.13
52	002769	普路通	19,800	300,960.00	0.13
53	002063	远光软件	28,800	300,096.00	0.13
54	000796	凯撒旅游	23,370	283,244.40	0.12
55	002741	光华科技	18,100	283,084.00	0.12
56	002161	远望谷	34,500	279,450.00	0.12
57	002488	金固股份	23,900	276,523.00	0.12
58	002627	宜昌交运	14,868	273,422.52	0.12
59	002344	海宁皮城	32,400	269,568.00	0.11
60	002533	金杯电工	35,500	268,380.00	0.11
61	600509	天富能源	25,700	195,577.00	0.08
62	601878	浙商证券	1,000	17,010.00	0.01
63	002886	沃特股份	500	12,695.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔股份	3,385,098.04	1.44
2	000968	蓝焰控股	2,879,719.00	1.22
3	600617	国新能源	1,439,181.00	0.61
4	002568	百润股份	1,438,234.96	0.61
5	600109	国金证券	1,390,057.58	0.59
6	000066	中国长城	1,365,652.00	0.58

7	603883	老百姓	1,365,520.00	0.58
8	002019	亿帆医药	1,364,042.67	0.58
9	002223	鱼跃医疗	1,363,934.00	0.58
10	000060	中金岭南	1,350,536.00	0.57
11	601166	兴业银行	1,343,602.00	0.57
12	601688	华泰证券	1,342,963.12	0.57
13	601601	中国太保	1,342,010.91	0.57
14	600297	广汇汽车	1,048,931.00	0.45
15	600273	嘉化能源	1,047,229.00	0.44
16	002261	拓维信息	1,042,999.00	0.44
17	000958	东方能源	723,047.00	0.31
18	600480	凌云股份	722,652.20	0.31
19	600637	东方明珠	720,080.61	0.31
20	600433	冠豪高新	719,585.83	0.31

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	601111	中国国航	1,408,889.00	0.60
2	002568	百润股份	1,222,506.26	0.52
3	002174	游族网络	1,107,837.20	0.47
4	601000	唐山港	921,190.00	0.39
5	000778	新兴铸管	902,381.09	0.38
6	000931	中关村	833,005.00	0.35
7	600863	内蒙华电	787,873.00	0.33
8	002042	华孚色纺	710,254.00	0.30
9	600617	国新能源	699,405.00	0.30
10	300349	金卡智能	671,135.28	0.28
11	601866	中远海发	668,610.00	0.28
12	600637	东方明珠	666,603.98	0.28
13	000958	东方能源	657,173.00	0.28
14	600297	广汇汽车	649,751.00	0.28
15	000665	湖北广电	634,265.91	0.27
16	002093	国脉科技	612,782.00	0.26
17	600433	冠豪高新	607,782.00	0.26
18	002073	软控股份	606,137.00	0.26
19	600480	凌云股份	577,444.86	0.25
20	000543	皖能电力	575,513.00	0.24

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	56,310,602.42
卖出股票的收入（成交）总额	26,581,832.24

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	69,879,025.40	29.47
5	企业短期融资券	65,132,500.00	27.47
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,949,531.60	2.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	140,961,057.00	59.45

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	011751027	17 兖州煤业 SCP001	100,000	10,022,000.00	4.23
2	041764005	17 徐工 CP001	100,000	10,018,000.00	4.23
3	011760038	17 晋能 SCP002	100,000	9,999,000.00	4.22
4	136090	15 绿地 02	100,000	9,767,000.00	4.12
5	136320	16 宇通 01	100,000	9,721,000.00	4.10

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	142007	花呗 03A1	100,000.00	9,898,031.50	4.17
2	142421	花呗 13A1	100,000.00	9,867,869.87	4.16

3	119238	南方 A2	50,000.00	5,009,510.96	2.11
4	142958	17 康富 A3	40,000.00	4,000,000.00	1.69

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	25,462.61
2	应收证券清算款	4,055,050.59
3	应收股利	-
4	应收利息	2,065,346.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.24

8	其他	-
9	合计	6,196,271.20

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	113009	广汽转债	5,420,816.00	2.29
2	110033	国贸转债	444,075.00	0.19

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
2,515	93,608.74	70,706,412.57	30.03%	164,719,570.89	69.97%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	永赢资产—光大银行—永赢资产—禾丰小满一期专项资产管理计划	8,273,542.00	12.20%
2	华宝证券有限责任公司	8,000,233.00	11.80%
3	西南证券股份有限公司	8,000,155.00	11.80%
3	招商证券股份有限公司	8,000,155.00	11.80%
3	中国国际金融股份有限公司	8,000,155.00	11.80%
6	光大证券股份有限公司	7,500,218.00	11.06%

7	深圳市前海禾丰正则资产管理有限公司一禾丰致远三期私募基金	4,122,062.00	6.08%
8	天安人寿保险股份有限公司一万能产品	2,794,910.00	4.12%
9	杨璐璐	1,495,163.00	2.20%
10	楼朝晖	800,031.00	1.18%

8.3 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	21,001.56	0.01%

8.4 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
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（2016年12月26日）基金份额总额	235,425,983.46
本报告期期初基金份额总额	235,425,983.46
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	235,425,983.46

§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	
国金证券	3	48,798,144.59	61.39%	6,407.12	18.31%	-
中国银河证券	2	30,694,122.03	38.61%	28,585.01	81.69%	-

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，本基金还选择了国泰君安证券、中银国际证券、信达证券、中信建投、中泰证券、新时代证券、东北证券、长江证券、上海证券、中金公司、中信证券、天风证券、中投证券

和兴业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、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
国金证券	25,043,712.67	28.20%	9,036,000.00	0.33%
中国银河证券	63,752,600.80	71.80%	2,722,200,000.00	99.67%

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增聘华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-20
3	华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-10
4	华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-15
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

§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 《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

12.1.3 《华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）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